

# 南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）

编制日期：2023 年 4 月 25 日

送出日期：2023 年 5 月 24 日

**本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。**

## 一、产品概况

基金简称	南方中证 1000ETF 发起联接 C	基金代码	011861
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021 年 9 月 27 日		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式		
开放频率	每个开放日		
基金经理	崔蕾	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 9 月 27 日
		证券从业日期	2015 年 2 月 2 日
其他	<p>1. 《基金合同》生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。如本基金在《基金合同》生效 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 30 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 1 亿元情形的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>2. 目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资人合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</p> <p>(1) 目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；</p> <p>(2) 目标 ETF 终止上市；</p> <p>(3) 目标 ETF 基金合同终止；</p> <p>(4) 目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标</p>		

ETF 的基金管理人相同的除外)。

若目标 ETF 变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。但目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决，目标 ETF 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标 ETF 的联接基金。

## 二、基金投资与净值表现

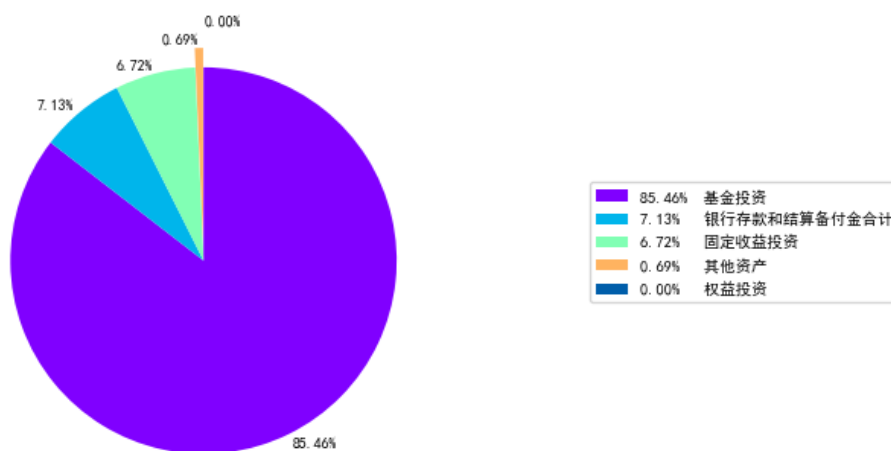
### （一）投资目标与投资策略

注：详见《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

投资目标	<p>本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。</p>
投资范围	<p>本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票以及存托凭证（下同）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金可投资于存托凭证。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>基金管理人根据相关规定可参与融资、转融通证券出借业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
主要投资策略	<p>本基金为完全被动式指数基金，主要投资于目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股投资策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p>
业绩比较基准	<p>中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金的目标 ETF 为股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。</p>

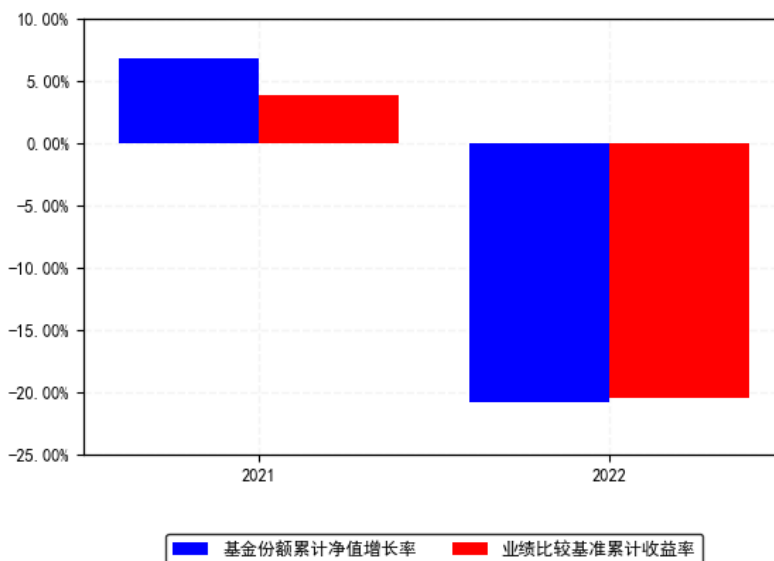
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图（2023年3月31日）



（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

南方中证1000ETF发起联接C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2022年12月31日）



1. 基金合同生效当年按实际期限计算，不按整个自然年度进行折算。  
2. 基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7 天	1.5%	-
	7 天 ≤ N	0%	-

本基金 C 类份额不收取认购费。

本基金 C 类份额不收取申购费。

## （二）基金运作相关费用

费用类别	收费方式	年费率
管理费		- 0.50%
托管费		- 0.10%
销售服务费		- 0.10%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费，基金份额持有人大会费用，基金的证券/期货交易费用，基金的银行汇划费用，基金相关账户的开户及维护费用，因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用，因参与转融通证券出借业务而产生的各项合理费用，按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：本基金管理费和托管费的计费基础为基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）。

本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、本基金特有的风险

（1）标的指数的风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

（2）标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（3）跟踪偏离风险/跟踪误差未达约定目标的风险：即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性，包括但不限于以下因素：

- 1) 标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；
- 2) 标的指数成份股的调整；
- 3) 基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击；
- 4) 申购、赎回因素带来的跟踪误差；
- 5) 新股市值配售、新股认购带来的跟踪误差；
- 6) 基金现金资产的拖累；
- 7) 基金的管理费、托管费和销售服务费等带来的跟踪误差；
- 8) 指数成份股停牌、摘牌，成份股涨、跌停板等因素带来的偏差；
- 9) 基金管理人的买入卖出时机选择；
- 10) 其他因素带来的偏差。

#### （4）标的指数变更的风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合随

之调整，基金收益风险特征可能发生变化，投资人需承担投资组合调整所带来的风险与成本。

（5）投资于目标 ETF 基金带来的风险

由于主要投资于目标 ETF，所以本基金会面临诸如目标 ETF 的管理风险与操作风险、目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 的技术风险等风险。

（6）基金表现与业绩比较基准偏离的风险

本基金业绩比较基准仅为基金业绩提供对比的参考基准，业绩比较基准的表现并不代表基金实际的收益情况，也不作为对基金收益的预测。本基金实际运作中投资的对象及其权重，与业绩比较基准的构成及其权重可能并非完全一致，可能出现投资组合收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险。

（7）基金合同终止的风险

基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

如本基金在基金合同生效 3 年后继续存续的，连续 30 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于人民币 1 亿元情形的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。

（8）投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括中国存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（9）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

（10）成份股停牌、摘牌的风险

标的指数的当前成份股可能会改变、停牌或摘牌，此后也可能会有其它股票加入成为该指数的成份股。本基金投资组合与相关指数成份股之间并非完全相关，在标的指数的成份股调整时，存在由于成份股停牌或流动性差等原因无法及时买卖成份股，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。当标的指数的成份股摘牌时，本基金可能无法及时卖出而导致基金净值下降，跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时

对相关成份股进行调整，但并不保证能因此避免该成份证券对本基金基金财产的影响，当基金管理人对该成份股予以调整时也可能产生跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

2、开放式证券投资基金共有的风险，如市场风险、管理风险、流动性风险、其他风险等。

3、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、暂停基金估值等，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

4、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价、销售机构之间的基金风险评价可能不一致的风险。

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法可能存在不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，但销售机构向投资人推介基金产品时，所依据的基金产品风险等级评价结果不得低于基金管理人作出的风险等级评价结果。投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

## （二）重要提示

南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2021 年 3 月 5 日证监许可〔2021〕732 号文注册募集。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳市。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

投资人知悉并同意基金管理人可为投资人提供营销信息、资讯与增值服务，并可自主选择退订，具体的服务说明详见招募说明书“基金份额持有人服务”章节。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.nffund.com][客服电话：400-889-8899]

- 《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、
- 《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》、
- 《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》

- 定期报告、包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

## 六、其他情况说明

暂无。