

南方昌元可转债债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年9月26日

送出日期：2021年10月25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	南方昌元可转债债券 C	基金代码	006031
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2018年12月25日		
基金类型	债券型	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	刘文良	开始担任本基金基金经理的日期	2020年3月6日
		证券从业日期	2012年7月11日

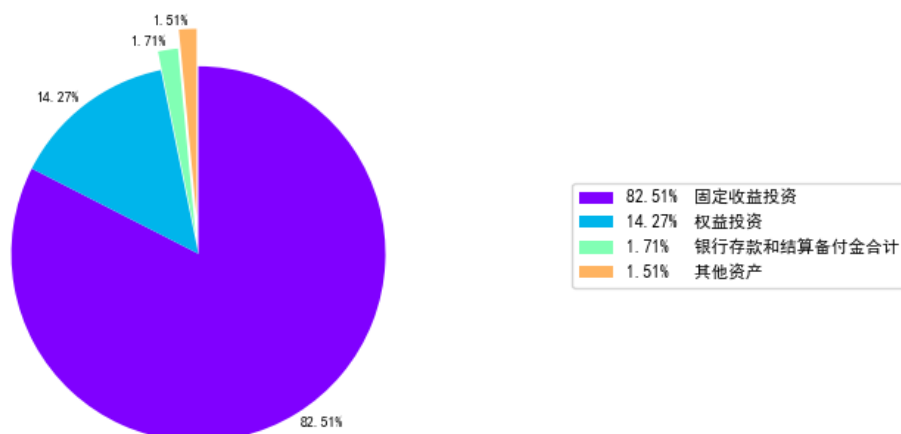
二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

详见《南方昌元可转债债券型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

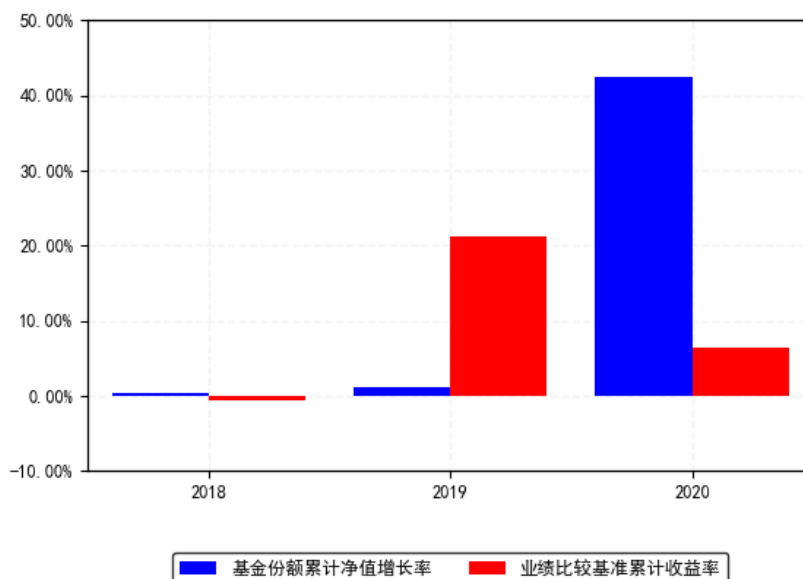
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图（2021年6月30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

南方昌元可转债债券C级每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2020年12月31日）



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 < 30 天	0.5%	-
	30 天 ≤ N	0%	-

（二）基金运作相关费用

费用类别	收费方式	年费率
管理费	-	1.00%
托管费	-	0.20%
销售服务费	-	0.50%

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、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，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。投资者可能损失投资本金。

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。

一、本基金的特有风险

1、本基金为债券型证券投资基金，债券投资占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于可转换债券的比例合计不低于非现金基金资产的 80%。因此，本基金主要投资于固定收益类品种，需要承担债券市场整体下跌的风险。另外，本基金主要投资于可转换债券，需要承担可转换债券市场的流动性风险、债券价格受所对应股票价格波动影响而波动的风险以及在转股期或换股期不能转股或换股的风险等。

2、本基金投资国债期货，国债期货的主要风险如下：（1）市场风险：国债价格的波动将可能影响国债期货合约的价格波动；国债期货合约价格的波动将直接影响基金资产净值；国债期货与现货合约以及国债期货不同合约之间价格差的波动可能导致特定策略组合在部分时间点上价值产生不利方向的波动。（2）流动性风险：国债期货业务的流动性风险主要包括持仓组合变现的流动性风险和无法缴足保证金的资金流动性风险。持仓组合变现的流动性风险是指持仓品种变现时由于市场流动性严重不足、或头寸持有集中度过大导致未在合理价位成交而造成变现损失的风险；无法缴足保证金的资金流动性风险指当国债期货业务支付现金的义务大于组合现金头寸而发生流动性危机的风险。（3）信用风险：信用风险指由于发行人或交易对手违约而产生损失的风险。由于国债期货业务持有的合约均为中金所场内交易的标准品种，因此该业务的信用风险较小。（4）合规性风险：国债期货业务开展过程中，存在可能违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等方面的风险。（5）国债期货实物交割风险：国债期货到期时采取实物交割方式，因此可能存在因实物交割导致被逼空的风险

3、本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

（1）信用风险也称为违约风险，它是指资产支持证券参与主体对它们所承诺的各种合约的违约所造成的可能损失。从简单意义上讲，信用风险表现为证券化资产所产生的现金流不能支持本金和利息的及时支付而给投资者带来损失。

（2）利率风险是指资产支持证券作为固定收益证券的一种，也具有利率风险，即资产支持证券的价格受利率波动发生变动而造成的风险。

（3）流动性风险是指资产支持证券不能迅速、低成本地变现的风险。

（4）提前偿付风险是指若合同约定债务人有权在产品到期前偿还，则存在由于提前偿付而使投资者遭受损失的可能性。

（5）操作风险是指相关各方在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

（6）法律风险是指因资产支持证券交易结构较为复杂、参与方较多、交易文件较多，而存在的法律风险和履约风险。

4、流动性风险评估

（1）本基金的申购、赎回安排

本基金采用开放方式运作，基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购和赎回业务，具体业务办理时间在申购赎回开始公告中规定。

（2）投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金为债券型证券投资基金，债券投资部分以可转换债券为主要投资目标，在保持适当流动性、合理控制风险的基础上，合理配置债券等固定收益类金融工具和权益类资产。本基金债券投资占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于可转换债券的比例合计不低于非现金基金资产的 80%，股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%。根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关要求，本基金审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当单个开放日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，本基金将可能无法及时赎回持有的全部基金份额，即认为是发生了巨额赎回。当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。如基金管理人对其超过基金总份额 20%以上的赎回申请实施延期办理，基金管理人只接受其基金总份额 20%部分作为当日有效赎回申请且基金管理人可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理，对单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请延期赎回。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。基金份额持有人在提交赎回申请时可以事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销，延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（4）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，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价以及中国证监会认定的其他措施。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。

二、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：1、政策风险。2、经济周期风险。3、利率风险。4、上市公司经营风险。5、购买力风险。6、信用风险。7、债券收益率曲线变动风险。8、再投资风险。

三、基金资产的流动性风险

四、管理风险

五、运作风险

六、不可抗力风险

七、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也不同,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,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。

八、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具,是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算,并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付,目的在于有效隔离并化解风险,确保投资者得到公平对待。但基金启用侧袋机制后,侧袋账户份额将停止披露基金份额净值,并不得办理申购、赎回和转换,仅主袋账户份额正常开放赎回,因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额,侧袋账户份额不能赎回,其对应特定资产的变现时间具有不确定性,最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制前特定资产的估值,基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间,因本基金不披露侧袋账户份额的净值,即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的,也不作为特定资产最终变现价格的承诺,因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格,基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策,因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后,基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产,并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理,因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

（二）重要提示

南方昌元可转债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2018年4月16日证监许可[2018]692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。因本基金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中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁,仲裁地点为北京市。

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。

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]

- 《南方昌元可转债债券型证券投资基金基金合同》、
- 《南方昌元可转债债券型证券投资基金托管协议》、
- 《南方昌元可转债债券型证券投资基金招募说明书》
- 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。