

南方创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2022 年 5 月 16 日

送出日期：2022 年 5 月 18 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	创业 LOF	基金代码	160143
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2020 年 9 月 1 日	上市交易所	深圳证券交易所
		上市日期	2021 年 3 月 17 日
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式		
开放频率	每两年开放一次		
基金经理	应帅	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 9 月 1 日
		证券从业日期	2001 年 7 月 8 日
其他	1、场内简称：创业 LOF；创业板定开南方		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

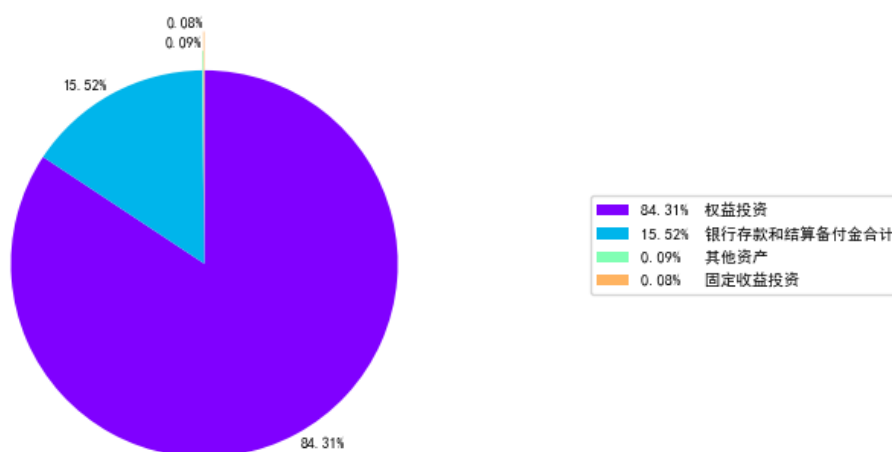
详见《南方创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》第十部分“基金的投资”。

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证（下同）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

	<p>基金的投资组合比例为：封闭期内，本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例范围为 60%-100%（其中港股通股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%），且基金投资于创业板的股票资产占非现金资产的比例不低于 80%。应开放期流动性需要，为保护持有人利益，本基金在开放期、开放期开始前 1 个月以及开放期结束后 1 个月内，本基金的股票资产投资比例可不受上述限制。</p> <p>开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
主要投资策略	<p>本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股票期权投资策略；8、战略配售投资策略；9、开放期投资策略。</p>
业绩比较基准	<p>创业板指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债总指数收益率*30%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金股票资产主要投资于创业板，会面临创业板注册制下因投资标的、市场制度以及交易规则等变化带来的特有风险。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金可选择投资战略配售股票，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。</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（2021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

截至相关披露时点，本基金尚未完成建仓。

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
认购费	M < 100 万元	1.2%	-
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.8%	-
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%	-
	500 万元 ≤ M	每笔 1000 元	-
	申购费（前收费）	M < 100 万元	1.5%
申购费（前收费）	100 万元 ≤ M < 200 万元	1.2%	-
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.8%	-
	500 万元 ≤ M	每笔 1000 元	-
	赎回费	N < 7 天	1.5%
7 天 ≤ N < 30 天		0.75%	-
30 天 ≤ N < 365 天		0.5%	-
1 年 ≤ N < 2 年		0.3%	-
2 年 ≤ N		0%	-

投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

（二）基金运作相关费用

费用类别	收费方式	年费率
管理费	-	1.50%
托管费	-	0.25%
销售服务费	-	-
其他费用	基金上市费用及年费；《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所费、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；因投资港股通股票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。

一）本基金的特定风险

1、本基金为混合型基金，封闭期内，本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-100%（其中港股通股票最高投资比例不得超过股票资产的50%），且基金投资于创业板的股票资产占非现金资产的比例不低于80%。应开放期流动性需要，为保护持有人利益，本基金在开放期、开放期开始前1个月以及开放期结束后1个月内，本基金的股票资产投资比例可不受上述限制。

2、投资港股通股票的风险

本基金投资于法律法规规定范围内的香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特定风险，包括但不限于：

汇率风险、香港市场风险、香港交易市场制度或规则不同带来的风险、港股通制度限制或调整带来的风险、法律和政治风险、会计制度风险、税务风险等。

3、本基金投资股指期货的风险。

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，主要存在以下风险：

（1）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。
（2）流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。
（3）基差风险：是指股指期货合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险。

（4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

（5）杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

（6）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

（7）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

4、本基金投资范围包括国债期货，可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

5、本基金投资范围包括股票期权，股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率水平等因素的影响。

6、本基金投资资产支持证券的风险

本基金可投资于资产支持证券，因此可能面临资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、法律风险和操作风险。本基金管理人将通过内部信用评级、投资授信控制等方法对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制。同时，本基金管理人将对资产支持证券进行全程合规监控，通过事前控制、事中监督和事后报告检查等方式，确保资产支持证券投资的合法合规。

7、二级市场折溢价风险

本基金封闭期间投资者不能申购赎回基金份额。本基金在封闭期间，基金份额可上市交易，投资者可在二级市场买卖基金份额。受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

8、封闭期内无法赎回的风险

本基金封闭期内不开放申购赎回，投资者无法在封闭期内申购赎回，只有在开放期才能提交申购赎回申请。

9、本基金封闭期内基金总资产不超过基金净资产的 200%，可能造成本基金资产净值波动大于普通开放式基金的风险。

10、本基金可选择投资战略配售股票，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。战略配售股票有可能出现股价波动较大的情况，投资者有可能面临战略配售股票价格大幅波动的风险。

11、本基金股票资产主要投资于创业板，会面临创业板注册制下因投资标的、市场制度以及交易规则等变化带来的特有风险，包括退市风险、股价波动风险和投资战略配售股票风险等。一是退市风险。创业板注册制改革后，创业板的退市标准将比 A 股其他板块(除科创板)更加严格，且不设置暂停上市、恢复上市和重新上市等环节，因此上市公司退市风险更大，可能给基金净值带来不利影响。二是股价波动风险。创业板注册制改革后，创业板股票价格涨跌幅限制将调整为 20%，涨跌幅限制大于 A 股其他板块(除科创板)，可能给基金净值带来较大的波动风险。三是投资战略配售股票风险。本基金可选择投资战略配售股票，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。战略配售股票有可能出现股价波动较大的情况，投资者有可能面临战略配售股票价格大幅波动的风险。

12、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的存托凭证(“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。

二) 市场风险。

三) 开放式基金共有的风险如管理风险、流动性风险和其他风险。

四) 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。

五) 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

南方创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2020 年 7 月 7 日证监许可[2020]1370 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。

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]

- 《南方创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金基金合同》、
- 《南方创业板 2 年定期开放混合型证券投资基金托管协议》、
- 《南方创业板 2 年定期开放混合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。