

关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额合并及调整最小申购、赎回单位相关业务安排的公告

为更好地服务投资者,南方基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”或“本基金管理人”)旗下南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”;基金简称:1000ETF,中证 1000ETF;基金代码:512100),根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和本基金基金合同、招募说明书等有关规定,拟实施基金份额合并,并调整最小申购、赎回单位。现将有关情况公告如下:

一、基金份额的合并

- 1、权益登记日:2022 年 9 月 1 日。
- 2、份额合并日:2022 年 9 月 2 日。
- 3、合并对象:权益登记日登记在册的本基金基金份额。
- 4、合并方式

(1)基金份额合并后本基金基金份额净值与 2022 年 8 月 22 日中证 1000 指数收盘点位的万分之四基本一致。

(2)合并比例 $=\frac{X+Y}{I \times 4 \div 10000}$

其中,X 为 2022 年 8 月 22 日经本基金管理人计算并经托管人复核的本基金基金资产净值;Y 为 2022 年 8 月 22 日本基金基金份额总数;I 为 2022 年 8 月 22 日中证 1000 指数收盘点位。合并比例以四舍五入的方法保留至小数点后 5 位。

2022 年 8 月 22 日,经本基金管理人计算并经托管人复核的本基金基金资产净值为 11,361,439,164.78 元,该日本基金基金份额总数为 10,660,692,000 份,该日中证 1000 指数收盘点位为 7288.577。根据上述公式,本基金本次基金份额合并比例为 0.36555。

本基金管理人将按照合并比例对权益登记日登记在册的本基金的基金份额实施合并,并由中国证券登记结算有限责任公司于份额合并日进行变更登记。为保护基金份额持有人利益,基金份额持有人持有的合并产生的小数点后基金份额将按照“上进位”的原则进行取整,即小数点后基金份额均进位为 1 份。进位处理所需资金由本基金管理人弥补,并于份额合并日计入基金资产。

(3)合并后的基金份额净值

份额合并日基金份额净值=份额合并日基金资产净值÷合并后的基金份额总数。

合并后的基金份额净值采用四舍五入法保留到小数点后 4 位。

5、合并结果的公告和查询

份额合并日的下一工作日(2022 年 9 月 5 日),本基金管理人将公告基金份额合并结果,敬请基金份额持有人关注并妥善处置自身权益情况,自公告当日起基金份额持有人可通过其所属销售机构和指定交易的券商查询合并后其所持有的本基金基金份额。

6、最小申购、赎回单位

自基金份额合并日(2022 年 9 月 2 日)起,本基金最小申购、赎回单位由 280 万份调整为 100 万份。届时将更新基金招募说明书。

二、本基金交易、申购赎回及其他相关业务安排

鉴于本基金份额在上海证券交易所上市交易,并已开放申购、赎回业务。为顺利实施本次份额合并,本基金将对份额合并期间的基金交易、申购赎回及其他相关业务办理做如下安排:

1、权益登记日(2022 年 9 月 1 日),本基金正常交易、正常办理申购与赎回业务。份额合并日(2022 年 9 月 2 日),本基金停牌及暂停办理申购、赎回和融资融券申报业务。份额合并日后的第一个工作日(2022 年 9 月 5 日)起,本基金复牌且恢复办理申购、赎回和融资融券申报业务。

2、本基金于权益登记日前三个工作日(2022 年 8 月 29 日)至份额合并日(2022 年 9 月 2 日)期间暂停办理以本基金为标的的证券的约定购回业务和股票质押式回购业务,并于份额合并日后的第一个工作日(2022 年 9 月 5 日)起恢复正常办理。

3、本基金于份额合并日(2022 年 9 月 2 日)暂停办理转融通可充抵保证金证券划转业务,并于份额合并日后的第一个工作日(2022 年 9 月 5 日)起恢复正常办理。

三、其他业务提示

1、对于包括但不限于司法冻结、司法轮候冻结、司法冻结质押、证券质押等业务,基金份额持有人及相关业务申请人应注意:

(1)在权益登记日操作上述业务,由于本基金尚未进行份额合并登记处理,所以其当日可用于办理业务的份额为份额合并前持有的可用份额;

(2)在份额合并日操作上述业务,由于该类业务日终根据有效的申报数据进行处理,而业务申报时可用份额为份额合并前持有的可用份额,因此需根据实际情况于份额合并日后再次提交业务申请。

上述可用份额为可以用于清算交收的份额,如有疑问,可咨询办理业务的证券公司或本基金管理人。

2、在权益登记日日终已冻结或质押的基金份额,在份额合并后将执行原有的冻结或质押。

四、风险提示

1、基金份额合并后,基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整,但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额合并对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额合并后,基金份额持有人将按照合并后的基金份额享有权利并承担义务。

2、因基金份额合并导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征。投资者在投资本基金之前,应全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,在了解产品情况、销售机构适当性匹配意见的基础上,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

3、由于本基金在实施份额合并的过程中,本基金将根据相关法律法规和实际情况暂停申购、赎回及交易等相关业务,投资者会在一定期间内无法赎回或卖出持有的本基金基金份额而面临流动性风险,投资者应提前做好交易安排并关注暂停业务期间证券市场、本基金标的指数以及本基金份额净值的波动。

4、本基金若被作为融资融券担保物的,在本次基金份额合并操作过程中,因本基金基金份额净值发生折算等情形的,可能导致其在份额合并后作为担保物的名义价值显著降低,造成担保物价值与其融资融券债务之间的比例低于维持担保比例,融资融券客户将可能被证券公司要求追加担保物,如无法按照融资融券业务约定的时间、数量追加担保物时,将可能面临担保物被证券公司强制平仓的风险,进而可能会给该等投资者造成经济损失。

5、本基金若作为约定购回式证券交易的标的证券,在基金份额合并过程中短期内基金份额净值发生变化可能导致投资者面临被动提前购回的风险。

6、本基金若作为股票质押回购交易业务的补充质押的标的证券,在基金份额合并过程中短期内基金份额净值发生变化可能导致投资者面临补充质押无法成交的风险以及由于本基金作为质押物的名义价值可能降低,导致融入方客户的履约保障比例达不到证券公司补充质押要求的风险。

7、本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于上述基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书和基金产品资料概要及其更新等法律文件。

五、其他事项

1、本公告仅对本基金本次份额合并及调整最小申购、赎回单位的有关事项予以说明。投资者欲了解详细情况,请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书和基金产品资料概要及其更新等法律文件以及相关公告。

2、本基金管理人可综合各种情况对本基金份额合并安排做适当调整。

3、投资人可以登录本公司网站(www.nffund.com)或拨打客户服务电话(400-889-8899)咨询相关信息。

特此公告。

南方基金管理股份有限公司

2022 年 8 月 24 日