

# 南方科创板 3 年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要（20240117 更新）

编制日期：2024 年 1 月 17 日

送出日期：2024 年 1 月 17 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	南方科创板 3 年定开混合	基金代码	506000
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	2020 年 7 月 28 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	三年定期开放		
基金经理	王博	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 7 月 28 日
		证券从业日期	2015 年 7 月 6 日
基金经理	郑晓曦	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 1 月 12 日
		证券从业日期	2008 年 7 月 8 日
其他	1、场内简称：科创板基金；科创板基 2、《基金合同》生效后，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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。		

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

详见《南方科创板 3 年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化行业深度研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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、科创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。本基金根据相关规定可参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例不低于60%（其中港股通股票投资占股票资产的比例范围为0-10%），投资于科创板的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%。但在每次开放期的前20个交易日、开放期以及开放期结束后20个交易日的期间内，基金投资不受上述比例限制。

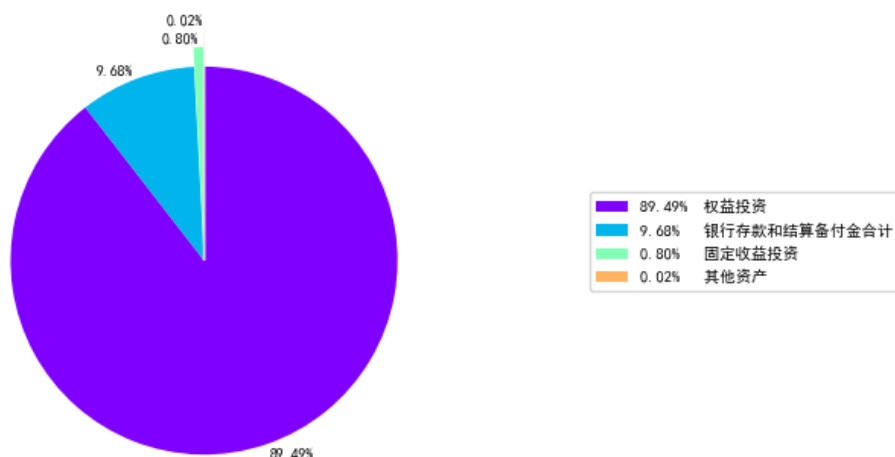
开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

主要投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>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、转融通证券出借业务投资策略；</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	<p>中国战略新兴产业成份指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+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。本基金可投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。</p>

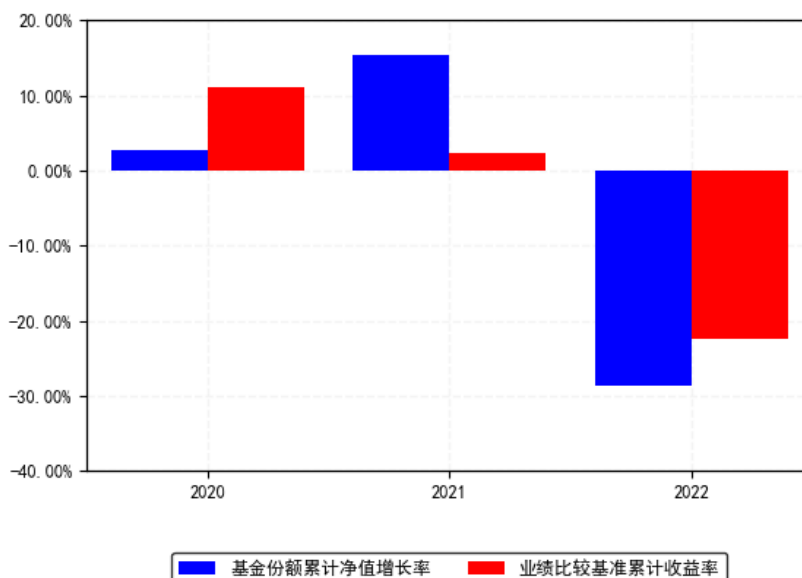
## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

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

南方科创板3年定开混合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
申购费（前收费）	M < 100 万元	1.5%	-
	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%	-

1年按365天计算。

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		- 1.20%
托管费		- 0.20%
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、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；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；因投资港股通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。	

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。

#### 1、本基金的特定风险

（1）本基金为混合型基金，本基金投资于股票的资产占基金资产的比例不低于60%（其中港股通股票投资占股票资产的比例范围为0-10%），本基金投资于科创板的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%。

因此，国内股票市场和债券市场的变化均会影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

#### （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：

1) 汇率风险、2) 香港市场风险、3) 香港交易市场制度或规则不同带来的风险、4) 港股通制度限制或调整带来的风险、5) 法律和政治风险、6) 会计制度风险、7) 税务风险。

#### （3）本基金投资科创板股票的风险

1) 流动性风险：由于科创板股票的投资者门槛较高，股票流动性弱于A股其他板块，投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，因此存在基金持有股票无法正常交易的风险。

2) 退市风险：科创板的退市标准将比A股其他板块更加严格，且不再设置暂停上市、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。

3) 投资集中风险：科创板上市企业主要属于科技创新成长型企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。

(4) 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；2) 流动性风险；3) 基差风险；4) 保证金风险；5) 杠杆风险；6) 信用风险；7) 操作风险。

(5) 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。

(6) 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。因此，投资股票期权主要存在Delta风险、Gamma风险、Vega风险、Theta风险以及Rho风险。同时，进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。

(7) 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。

(8) 二级市场折溢价风险

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。

(9) 封闭期内无法赎回的风险

本基金封闭期内不开放赎回，投资者无法在封闭期内赎回，只能在开放期才能提交赎回。

(10) 本基金封闭期内基金总资产可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。

(11) 参与战略配售股票投资的风险

本基金可参与战略配售股票投资，本基金管理人将根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于战略配置股票，基金资产并非必然投资于战略配置股票，本基金存在可能无法配售股票风险。

本基金可能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。

此外，战略配售股票在发行时明确了一定期限锁定期，该类证券在锁定期内的流动性较差，存在市场或个券出现大幅调整时无法及时卖出的风险，可能给投资者带来损失。

(12) 参与转融通证券出借业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与转融通证券出借业务，可能存在流动性风险、市场风险和信用风险等转融通业务特有风险。

(13) 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。

## 2、流动性风险评估

### （1）本基金的申购、赎回安排

本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作，以三年为一个封闭期。投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为开放期内上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日（若该工作为非港股通交易日，则本基金不开放）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。封闭期内，本基金不办理申购与赎回业务

### （2）投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资标的均在证监会及相关法律法规规定的合法范围之内。本基金的投资范围的设定合理、明确，操作性较强。本基金股票投资占基金资产的比例不低于60%（其中港股通股票投资占股票资产的比例范围为0-10%），投资于科创板的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%。但在每次开放期的前20个交易日、开放期以及开放期结束后20个交易日的期间内，基金投资不受上述比例限制。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；封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但在扣除国债期货、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。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。实际投资过程中，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。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，本基金会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

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一工作日的基金总份额的20%，即认为是发生了巨额赎回。

#### 1) 巨额赎回的场外处理方式

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、延缓支付赎回款项或部分延期赎回。

①全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

②延缓支付赎回款项：当基金管理人认为支付投资人的赎回款项有困难 或认为因支付投资人的赎回款项而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当接受并确认所有的有效赎回申请（基金合同另有约定的除外），当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的百分之二十，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过二十个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

③延期办理赎回申请：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30%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以参照以下规则实施延期办理赎回申请：

对单个基金份额持有人占基金总份额 30%部分的赎回申请：可以接受作为当日有效赎回申请，根据前述“①全额赎回”或“②延缓支付赎回款项”的约定方式对该部分有效赎回申请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 30%以上的赎回申请：可以实施延期赎回，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该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推；但若在开放期最后一日发生上述情形的，超过部分将视为无效赎回申请。

如投资人在提交赎回申请时对延期部分选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如果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。

## 2) 巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回的场内处理按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

3、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。

## 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，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。

## 5、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。

## 6、基金投资组合收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险

## 7、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。

## 8、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

南方科创板 3 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 16 日证监许可[2020]1494 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深圳国际仲裁院仲裁，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]

- 《南方科创板 3 年定期开放混合型证券投资基金基金合同》、
- 《南方科创板 3 年定期开放混合型证券投资基金托管协议》、
- 《南方科创板 3 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。