

南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金(A类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年06月04日

送出日期：2024年06月22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	南华中证杭州湾区ETF联接	基金代码	007842
基金简称A	南华中证杭州湾区ETF联接A	基金代码A	007842
基金管理人	南华基金管理有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日	2020年04月23日	上市交易所及上市日期	暂未上市
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	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
黄志钢	2022年01月29日		2005年07月15日
康冬	2023年08月30日		2017年07月21日
其他	《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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

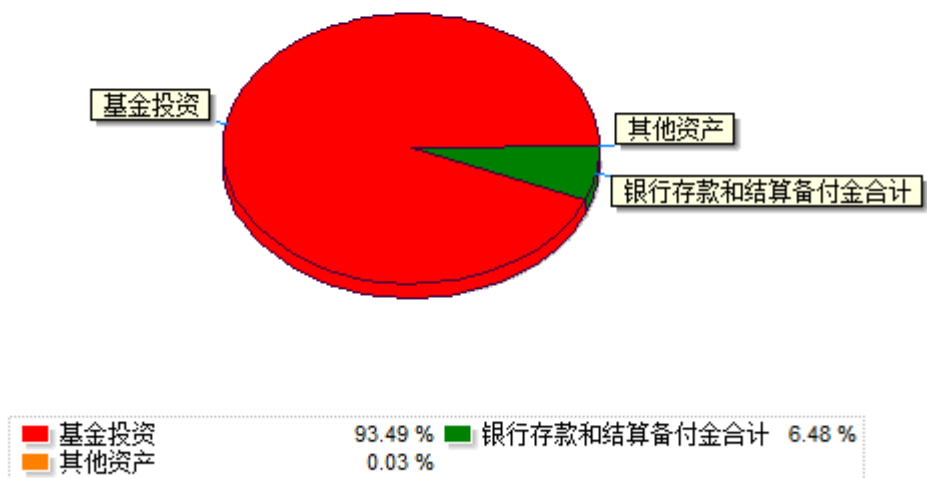
请投资者阅读《招募说明书》第九部分“基金的投资”了解详细情况。

投资目标	通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、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、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期

	<p>融资券、公开发行的次级债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、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）、货币市场工具、同业存单、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货等）以及法律法规或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>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> <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合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不得低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>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的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证杭州湾区指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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证券市场相似的风险收益特征。</p> <p>同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。</p>

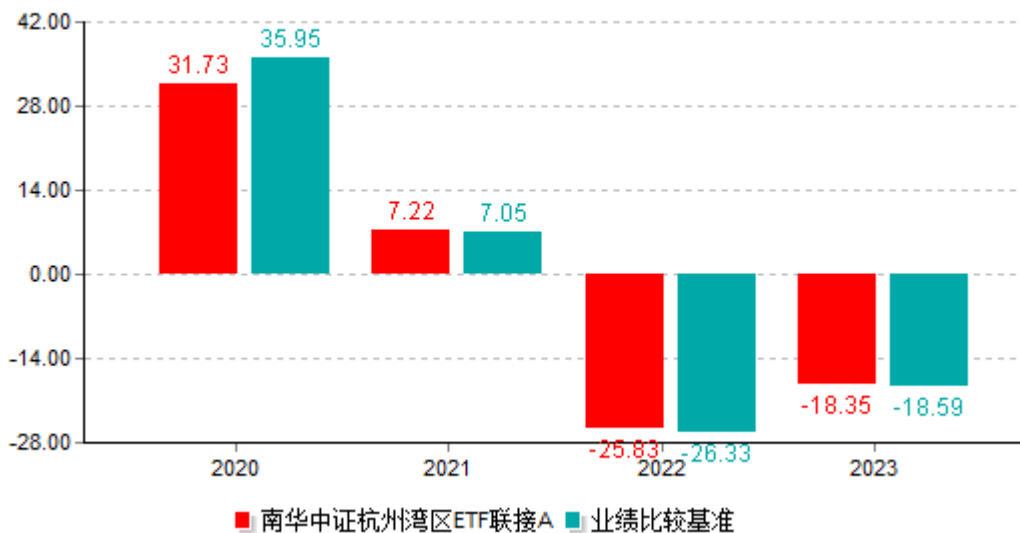
(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年03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

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日
单位%



三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

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	1.20%	
	100万 ≤ M < 300万	1.00%	

	300万≤M<500万	0.80%	
	M≥500万	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<365天	0.50%	
	365天≤N<730天	0.25%	
	N≥730天	0.00%	

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.50%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	50,000.00	会计师事务所
信息披露费	0.00	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、公证费、律师费、诉讼费和仲裁费、基金份额持有人大会费用、基金的相关账户的开户及维护费用、基金的证券、期货交易费用、基金的银行汇划费用、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。	相关服务机构

注：（1）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；

（2）本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费；

（3）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）
持有期	0.84%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率。其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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。

本基金投资运作过程中面临的主要风险包括投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险、特有风险、流动性风险以及其他风险。

本基金特有风险：

(1) ETF联接基金的特有风险

本基金为目标ETF的联接基金，两者在投资方法、交易方式等方面既有联系又有区别。本基金与其目标ETF基金的业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素包括但不限于以下几点：

- 1) 二者的业绩比较基准存在差异。
- 2) 二者的投资组合限制存在差异。
- 3) 联接基金在进行现金与股票转换的过程中的成本与收益受二级市场价格影响。
- 4) 由于联接基金可通过二级市场在证券交易所买入、卖出目标ETF基金份额，因此目标ETF二级市场的折溢价将影响联接基金的收益。
- 5) 联接基金可以直接投资标的指数的成份股及备选成份股，这部分股票投资组合与ETF的投资组合可能存在差异。

(2) 投资于ETF基金的特定风险

1) 目标ETF标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

目标ETF标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2) 目标ETF标的指数波动的风险

目标ETF标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者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) 目标ETF基金投资组合回报与其标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使目标ETF基金投资组合的收益率与其标的指数的收益率发生偏离：

- a. 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使目标ETF基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。
- b. 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使目标ETF基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。
- c. 成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致目标ETF基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。
- d. 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使目标ETF基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。
- e. 由于目标ETF基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使目标ETF基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。
- f. 在目标ETF基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对目标ETF基金的收益产生影响，从而影响目标ETF基金对标的指数的跟踪程度。
- g. 其他因素产生的偏离。

4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

5) 成份股停牌风险

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股，当标的指数成份股停牌时，可能出现导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差扩大的风险。

6) 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向中国证监会报告并提出解决方案，并召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同直接终止。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并实施前，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。

7) 目标ETF基金标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，目标ETF基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，目标ETF基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

8) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管目标ETF基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

9) 参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV计算可能出现错误。

10) 退市风险

因目标ETF基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

11) 投资者申购失败的风险

因目标ETF基金在申购、赎回清单可能不会对所有的成份股允许使用现金替代，而且现金替代比例会设置现金替代上限比例进行控制。所以投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法购入申购所需的足够成份股，导致申购失败的风险。

12) 投资者赎回失败的风险

目标ETF的基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

13) 基金份额赎回对价的变现风险

目标ETF基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

14) 第三方机构服务的风险

目标ETF基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

a. 申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

b. 登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

c. 证券/期货交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

(二) 重要提示

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。

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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，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

以下资料详见南华基金官方网站 [www.nanhuafunds.com] [客服电话：400-810-5599]

1、《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》、《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》

2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料

六、 其他情况说明

无。