

南方基金关于旗下“南方金选组合” 调整投资组合策略方案说明书的公告

为更好地为投资者提供服务，南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）决定调整旗下“南方金选组合”名称及其《投资组合策略方案说明书》（以下简称“《策略说明书》”）的相关表述，具体调整如下：

一、调整内容

依据相关法律法规、《南方基金管理型基金投资顾问业务规则》规定以及相关协议、《策略说明书》约定，本公司可以依据维护投资者合法权益的原则，对“南方金选组合”投资目标和投资策略进行调整。考虑到海内外宏观经济背景、产业格局越发复杂，为提高策略灵活性和市场适应性，秉着谨慎勤勉原则，经审慎评估，本公司决定调整《策略说明书》第五条“适合投资者范围”和第九条“投资策略”的相关表述。此外，本公司根据业务实际需要，决定将“南方金选组合”名称及其简称中的“金”调整为“鑫”，该名称调整事项对投资者权益无实质性不利影响。具体修订内容详见附件。

本公司将从3月31日开始，根据上述调整后的《策略说明书》等相关法律文件约定及公告规定继续提供投顾服务。投资者可根据自身的投资需求，自主做出投顾组合持有或退出安排。近期市场波动加剧，如果需要退出投顾服务的，请特别注意市场风险。

本公告为《策略说明书》的有效组成部分，公告中有关基金投顾

业务投资范围等未尽事宜，详见《南方基金管理型基金投资顾问业务规则》规定以及相关协议、《策略说明书》约定。

二、投资者可通过以下途径了解或咨询详情

本公司网站：www.nffund.com

本公司客服电话：400-889-8899

三、风险提示

1、本公司承诺以诚实守信、勤勉尽责的原则管理投顾账户的资产，但不保证投顾账户一定盈利，也不保证最低收益。投资者进行投资存在本金亏损的风险。投顾业务的过往业绩并不预示其未来业绩表现。本公司提醒投资者投顾业务及基金投资遵循“买者自负”原则，在决定参与投顾业务并选择投资组合策略后，投顾账户相关损益由投资者自行承担。

2、投资者申请参与投顾业务前，应认真阅读有关投顾业务的协议、业务规则、投资组合策略说明书、风险揭示书等文件，了解投顾业务的业务规则和相关风险，投资者应慎重选择，并在使用时妥善保管好电子交易信息，特别是账号和密码。

特此公告

南方基金管理股份有限公司

2022年3月23日

附：

投资组合策略方案说明书

一、组合名称

南方鑫选组合（简称：司南鑫选组合、南方鑫选升级、南方专家鑫选、南方鑫选梦想佳）

二、策略结构

本投资组合策略权益仓位（股票型基金、偏股混合型基金、股票指数基金等）范围在 60%-100% 区间；固定收益类仓位（货币基金、债券型基金、偏债混合型基金、债券指数基金、对冲策略基金等）范围在 0%-40% 区间。

三、业绩比较基准

业绩比较基准=沪深 300 指数*95%+中证全债指数*5%

四、风险特征

本投资组合策略风险等级为 R3—中风险。

组合风险等级依据投资组合策略整体风险特征评定，组合内可能存在风险评级高于投资组合策略风险等级的基金产品。

五、适合投资者范围

本投资组合策略的风险收益特征适合风险评级为稳健型（C3）、积极型（C4）、进取型（C5）的投资者。

上述对于投资目标的描述，不构成南方基金或基金销售机构对投资者获取投资收益或免受投资损失的承诺、保证或预期。

六、投资范围

本组合策略投资范围为本方案第九条规定的基金产品（法律法规及本说明书禁止投资的产品除外），包括但不限于货币基金、债券型基金、混合型基金、股票型基金、指数型基金、FOF、QDII基金等。

七、备选基金产品评估情况

南方基金专业研究团队对每一只备选基金产品及相关基金管理人实施标准化、流程化的尽职调查，形成评估报告。

同时为了分散投资风险，加强流动性管理，本投资组合策略将遵循法律法规以及监管部门规定的投资集中度、产品结构等投资限制。

八、组合配置策略

本基金权益仓位主要投资于主动管理型基金，偏成长风格，固定收益类仓位主要投资于偏债型基金和债券型基金等产品。南方基金对本投资组合策略的配置将坚持长期资产配置理念，择机进行多风格配置、境内外区域分散，再通过精选优秀基金经理力求获取长期稳健超额收益。

九、投资策略

1、运用量化模型分析各类资产风险收益特征，通过综合各国资产收益，把握宏观周期，同时控制权益仓位在规定范围前提下，计算各类细分资产配置比例，作为配置组合起点；结合团队宏观研究、资产研判以及资产配置委员会季度观点等，对量化配置比例进行对应的高低配调整，以此决定大类资产配置比例。

2、在底层基金方面，对全市场基金进行定量分析和定性跟踪研究，精选全市场权益类、固定收益类、绝对收益策略、QDII 等投资范围内的公募基金构建投资组合。

3、动态跟踪组合表现与资产配置目标偏离情况，以及底层基金表现，对组合进行动态管理，在目标策略下追求择时、风格轮动、优选基金带来的超额收益。

十、风险控制措施

1、本组合策略仅投资于经南方基金投顾业务投资决策委员会审议的基金备选库产品。

2、南方基金将在风控系统中根据系统条件合理设置风控阈值，并安排专人处置投资者账户的异常交易行为。

3、南方基金将每季度对基金投顾业务的风控情况、基金投资组合策略及实施有效性进行核查评估，并将评估情况提交审议。

4、为了分散投资风险，加强流动性管理，本投资组合策略将遵循相关投资限制。如因证券市场波动、基金规模变动等投资策略以外的因素导致使资产配置超过规定投资限制的，将在法律法规及监管部门规定时间内通过调仓进行调整，经监管部门认可的情形除外。