

# 南方梦元短债债券型证券投资基金（A类份额）

## 基金产品资料概要

更新日期：2019年9月26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	南方梦元短债 A	基金代码	007790
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	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	-	交易币种	人民币
基金类型	债券型	开放频率	每个开放日
运作方式	普通开放式		
基金经理	李慧鹏	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2006年7月1日

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，重点投资短期债券，力争获得长期稳定的投资收益。
投资范围	本基金投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券比例不低于非现金资产的 80%。 本基金所指的短期债券是指剩余期限不超过 397 天（含）的债券资产，主要包括国债、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、政府机构债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分。
主要投资策略	1、信用债投资策略；2、收益率曲线策略；3、放大策略；4、资产支持证券投资策略；5、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合（1 年以下）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

注：详见《南方梦元短债债券型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表 无

(三) 自基金合同生效以来 / 最近十年 (孰短) 基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图 无

### 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	金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式 / 费率	备注
认购费	M < 100 万	0.30%	
	100 万 ≤ M < 500 万	0.15%	
	500 万 ≤ M	每笔 1000 元	
申购费 (前收费)	M < 100 万	0.30%	
	100 万 ≤ M < 500 万	0.15%	
	500 万 ≤ M	每笔 1000 元	
赎回费	N < 7 日	1.50%	
	N ≥ 7 日	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
管理费	0.25%
托管费	0.05%
其他费用	-

注: 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。

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) 本基金除承担由于市场利率波动造成的利率风险外, 还要承担如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险。

##### 2) 投资于资产支持证券的风险

(1) 信用风险: 也称为违约风险, 表现为证券化资产所产生的现金流不能支持本金和利息的及时支付而给投资者带来损失。

(2) 利率风险: 资产支持证券的价格受利率波动发生变动而造成的风险。

(3) 流动性风险: 资产支持证券不能迅速、低成本地变现的风险。

(4) 提前偿付风险: 若合同约定债务人有权在产品到期前偿还, 则存在由于提前偿付而使投资者遭受损失的可能性。

(5) 操作风险: 指相关各方在业务操作过程中, 因操作失误或违反操作规程

而引起的风险。

(6) 法律风险：指因资产支持证券交易结构较为复杂、参与方较多、交易文件较多，而存在的法律风险和履约风险。

### 3) 投资于国债期货的风险

(1) 市场风险：国债价格的波动将可能影响国债期货合约的价格波动；国债期货合约价格的波动将直接影响基金资产净值；国债期货与现货合约以及国债期货不同合约之间价格差的波动可能导致特定策略组合在部分时间点上价值产生不利方向的波动。

(2) 流动性风险：主要包括持仓组合变现的流动性风险和无法缴足保证金的资金流动性风险。

(3) 信用风险：指由于发行人或交易对手违约而产生损失的风险。由于国债期货业务持有的合约均为中金所场内交易的标准品种，因此该业务的信用风险较小。

(4) 合规性风险：国债期货业务开展过程中，存在可能违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等方面的风险。

(5) 国债期货实物交割风险：国债期货到期时采取实物交割方式，因此可能存在因实物交割导致被逼空的风险。

### 4) 基金合同终止的风险

连续60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人民币5000万元情形的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。

2、普通开放式债券型证券投资基金共有的风险，如债券市场风险、管理风险、流动性风险、其他风险等。

## (二) 重要提示

南方梦元短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2019年7月8日证监许可[2019]1265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。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见南方基金官方网站 [www.nffund.com] [客服电话：400-889-8899]

- 《南方梦元短债债券型证券投资基金基金合同》、
- 《南方梦元短债债券型证券投资基金托管协议》、
- 《南方梦元短债债券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