**南方基金管理股份有限公司**

**关于调整旗下公募基金风险评级相关事项的公告**

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及其他相关法律法规的有关规定，为进一步提升投资者适当性服务水平，南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）自2025年1月20日起调整公司旗下公募基金风险评级规则，并对旗下基金的风险等级进行了重新评估，调整了部分产品风险评级。现将有关事项公告如下:

1. 本次调整风险评级的基金名单如下，调整事项自2025年1月20日起生效

| **基金代码** | **基金简称** | **调整前风险评级** | **调整后风险评级** |
| --- | --- | --- | --- |
| 001113 | 南方大数据100指数A | R3 | R4 |
| 004344 | 南方大数据100指数C | R3 | R4 |
| 004642 | 南方中证全指房地产ETF联接A | R3 | R4 |
| 004643 | 南方中证全指房地产ETF联接C | R3 | R4 |
| 010989 | 南方中证全指房地产ETF联接E | R3 | R4 |
| 021002 | 南方中证全指房地产ETF联接I | R3 | R4 |
| 020685 | 南方上证科创板新材料ETF发起联接A | R3 | R4 |
| 020686 | 南方上证科创板新材料ETF发起联接C | R3 | R4 |
| 159639 | 南方中证上海环交所碳中和ETF | R3 | R4 |
| 016917 | 南方中证上海环交所碳中和ETF联接A | R3 | R4 |
| 016918 | 南方中证上海环交所碳中和ETF联接C | R3 | R4 |
| 159858 | 南方中证创新药产业ETF | R3 | R4 |
| 021097 | 南方中证创新药产业ETF发起联接A | R3 | R4 |
| 021098 | 南方中证创新药产业ETF发起联接C | R3 | R4 |
| 159877 | 南方中证全指医疗保健设备与服务ETF | R3 | R4 |
| 019452 | 南方中证全指医疗保健设备与服务ETF联接A | R3 | R4 |
| 019453 | 南方中证全指医疗保健设备与服务ETF联接C | R3 | R4 |
| 021006 | 南方中证全指医疗保健设备与服务ETF联接I | R3 | R4 |
| 159896 | 南方中证物联网主题ETF | R3 | R4 |
| 512200 | 南方中证全指房地产ETF | R3 | R4 |
| 517160 | 南方中证长江保护主题ETF | R3 | R4 |
| 016938 | 南方中证长江保护主题ETF联接A | R3 | R4 |
| 016939 | 南方中证长江保护主题ETF联接C | R3 | R4 |
| 588160 | 南方上证科创板新材料ETF | R3 | R4 |
| 588370 | 南方上证科创板50成份增强策略ETF | R3 | R4 |
| 007109 | 南方沪港深核心优势混合 | R3 | R4 |
| 009318 | 南方成长先锋混合A | R3 | R4 |
| 009319 | 南方成长先锋混合C | R3 | R4 |
| 010299 | 南方产业升级混合A | R3 | R4 |
| 010300 | 南方产业升级混合C | R3 | R4 |
| 014189 | 南方专精特新混合A | R3 | R4 |
| 014190 | 南方专精特新混合C | R3 | R4 |
| 010592 | 南方医药创新股票A | R3 | R4 |
| 010593 | 南方医药创新股票C | R3 | R4 |
| 005207 | 南方高端装备混合C | R3 | R4 |
| 202027 | 南方高端装备混合A | R3 | R4 |
| 202028 | 南方高端装备混合A（后端） | R3 | R4 |
| 009152 | 南方瑞盛三年持有期混合A | R3 | R4 |
| 009153 | 南方瑞盛三年持有期混合C | R3 | R4 |
| 010357 | 南方阿尔法混合A | R3 | R4 |
| 010358 | 南方阿尔法混合C | R3 | R4 |
| 011216 | 南方优质企业混合A | R3 | R4 |
| 011217 | 南方优质企业混合C | R3 | R4 |
| 011862 | 南方蓝筹成长混合A | R3 | R4 |
| 011863 | 南方蓝筹成长混合C | R3 | R4 |
| 011903 | 南方领航优选混合A | R3 | R4 |
| 011904 | 南方领航优选混合C | R3 | R4 |
| 012354 | 南方新能源产业趋势混合A | R3 | R4 |
| 012355 | 南方新能源产业趋势混合C | R3 | R4 |
| 012314 | 南方行业领先混合 | R3 | R4 |

二、风险评级规则调整

调整公司旗下所有公募基金的风险评级规则，调整后的《南方基金公募基金风险评级规则》详见本公告附件和公司官网。本次调整事项适用于公司直销渠道以及采用公司产品风险评级方式、标准和结果的销售机构。

三、其他事项

投资人可访问本公司网站(www.nffund.com)或拨打客户服务电话（400－889－8899）咨询相关情况。

**风险提示：**

1、此次公司公募基金风险评级规则调整后，部分基金的风险等级将发生变化，请投资人务必了解调整后的基金风险等级，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否与本人的风险承受能力及投资需求相适应。

2、销售机构根据投资者适当性法律法规对基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法不同，因此不同销售机构对基金的风险等级评价结果可能存在不同。

3、投资者购买基金后，所购买的基金产品风险等级可能因市场或运作情况等影响而发生调整，并可能超出投资者自身风险承受能力，从而可能产生不利后果和损失。投资者应及时关注基金风险等级的变化并谨慎决策，以确保自身的投资决策与风险承受能力相匹配。

4、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。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读各基金的基金合同、招募说明书等法律文件，了解所投资基金的风险收益特征及归属的风险等级，并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。 敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

附件：南方基金公募基金风险评级规则

南方基金管理股份有限公司

2025年1月20日

**南方基金公募基金风险评级规则**

（2025年1月）

**第一条** 南方基金管理股份有限公司（下简称“公司”）在销售基金和相关产品的过程中，需注重投资人的适当性管理，根据投资人的风险承受能力销售不同风险等级的产品，把合适的基金产品卖给合适的投资人。为此，公司需对基金产品的风险等级进行设置并对基金产品进行风险评价，以风险评价结果作为公司向投资人推介基金产品的重要依据。

根据《证券投资基金销售适用性指导意见》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》（以下简称《指引》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和其他法律法规及公司相关制度，公司将基金产品风险等级设置为高风险、中高风险、中风险、中低风险、低风险五个风险等级，并将各类风险等级的基金产品与不同风险承受能力的投资人相对应（其可购买对应风险等级及以下的产品），具体标准如下：

|  |  |
| --- | --- |
| 基金投资者风险承受能力 | 基金产品及服务风险评价 |
| 进取型（高风险承受能力） | R5高风险及以下等级基金产品及服务 |
| 积极型（中高风险承受能力） | R4中高风险及以下等级基金产品及服务 |
| 稳健型（中风险承受能力） | R3中风险及以下等级基金产品及服务 |
| 保守型（中低风险承受能力） | R2中低风险及以下等级基金产品及服务 |
| 安全型（低风险承受能力） | R1低风险等级基金产品及服务 |

**第二条**  本制度适用于公司旗下所有公募产品。

**第三条**  风险评级采用定量与定性相结合的方式，从公司及产品本身角度出发，基于基金产品合同相关要素与基金实际运作状况对产品进行定量打分，之后审慎考虑定性指标，对产品最终的定量得分进行定性调整，完成对基金风险的评级。对于新成立的基金，成立时确定初始风险评级。对于存续期基金，定期评估风险等级并对结果进行更新。

**第四条**  对于创新型产品、产品投资标的发生异常变动的产品以及包含有《指引》第四十一条指出的特殊因素的产品（简称“特别基金”），需审慎评估其风险等级，最终评级结果可根据产品具体情况进行一定程度的修正。

**第五条**  产品的风险等级按照风险由低到高顺序，划分为R1、 R2、R3、R4、R5五个等级。

**第六条**  定性指标包括但不限于基金经理的稳定性，基金经理或产品成立以来有无违规行为发生,同业同类产品的风险评级，以及基金经理管理的其他同类产品的风险评级等其他与产品风险评级相关的因素。

**第七条**  定量指标分为基金产品合同风险评分和存续期风险评分两部分。根据《指引》第四十条、第四十二条内容，结合公司实际对评估因素进行增删调整，评估因素如下：

基金产品合同风险评分主要依据基金合同中的投资品种、投资范围及其他要素，同时结合中国银河证券基金研究中心对基金类型的划分体系进行分类评分。

存续期风险评分参考的投资指标包括：长短期标准差、长短期贝塔值、风险资产净仓位、重仓证券集中度、杠杆比例、运作方式（产品流动性）、投资者盈亏体验（成立以来收益率、滚动收益率、滚动最大回撤）。

**第八条** 对于新成立、设立不满3个月的基金，主要根据基金产品合同风险评分进行风险等级划分；对设立满3个月但不满15个月的基金，根据“40%×基金产品合同风险评分+60%×存续期风险评分”所得总分进行风险等级划分；对设立15个月以上的基金，根据“20%×基金产品合同风险评分+80%×存续期风险评分”所得总分进行风险等级划分，使基金的风险评级结果更贴合实际表现。

**第九条** 基金产品风险评分

按照证监会相关规定对基金分类，参考银河分类对基金产品如下分类评分，参考的指标包括但不限于产品内的投资范围、投资比例、投资策略、投资限制、结构复杂性、风险业绩特征。具体基金产品的风险等级划分则根据实际的风险情况进行确定。对于业绩比较基准指数标准差、贝塔值、最大回撤、投资者盈亏等指标超过产品所属分类初始评级水平的基金，可以适当调整其评分。对于特别基金，可以适当调整其评分。各基金产品类型的风险评价区间如下：

表1：基金产品风险评价区间

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **一级分类** | **二级分类** | **等级区间** |
| 股票基金 | 主动股票型 | 中风险 - 中高风险 |
| 指数股票型 | 中风险 - 中高风险 |
| 混合基金 | 偏股型基金 | 中风险 – 中高风险 |
| 灵活配置型基金 |
| 股债平衡型基金 |
| 偏债型基金 | 中低风险 – 中风险 |
| 绝对收益目标基金 |
| 债券基金 | 可转换债券型基金 | 中风险 |
| 长期纯债债券型基金 | 中低风险 |
| 中短期纯债债券型基金 | 中低风险 |
| 普通债券型基金 | 中低风险 |
| 指数债券型基金 | 中低风险 |
| 摊余成本法债券型基金 | 中低风险 |
| 长期理财债券型基金 | 中低风险 |
| 中短期理财债券型基金 | 中低风险 |
| 货币市场基金 | 货币市场基金 | 低风险 |
| 基金中基金（FOF） | 股票型FOF | 中高风险 |
| 债券型FOF | 中低风险 |
| 混合型FOF | 中低风险 – 中高风险 |
| 目标日期FOF |
| 目标风险FOF |
| QDII基金 | QDII股票基金 | 中高风险 |
| QDII混合基金 | 中高风险 |
| QDII债券基金 | 中风险 |
| QDII其他基金 | 根据实际情况而定 |
| 其他基金 | 商品型基金 | 中风险 – 高风险 |
| REITs | 中风险 – 中高风险 |
| 其他类型 | 根据实际情况而定 |

**第十条** 基金产品的风险评价规则由本公司负责根据相关法律、法规及公司运作的需要进行解释及修订。随着基金产品的不断创新和投资范围的拓展，公司将根据新设基金产品的投资管理特点和风险特征调整风险评价方法。