

中海中证高铁产业指数分级证券投资基金  
更新招募说明书  
(2017 年第 2 号)

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

**【重要提示】**

本基金于 2015 年 5 月 18 日经中国证券监督管理委员会证监许可 932 号文准予募集注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险（包括本基金的指数投资风险、上市交易风险、杠杆机制风险、折/溢价风险等金融衍生品投资风险以及份额配对转换及份额折算等业务办理过程中的特定风险）等。

本基金为股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，中海中证高铁A份额具有低风险、收益相对稳定的特征，中海中证高铁B份额具有高风险、高预期收益的特征。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，并自行承担投资风险。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投

资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2017年7月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日(财务数据未经审计)。

## 目 录

一、绪言 .....	4
二、释义 .....	5
三、基金管理人 .....	11
四、基金托管人 .....	22
五、相关服务机构 .....	25
六、基金份额的分类与净值计算规则 .....	48
七、基金的募集 .....	52
八、基金合同的生效 .....	59
九、中海中证高铁份额的申购与赎回 .....	61
十、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的上市交易 .....	73
十一、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管等其他相关业务 .....	75
十二、基金的份额配对转换 .....	77
十三、基金份额折算 .....	80
十四、基金的投资 .....	89
十五、基金的业绩 .....	100
十六、基金的财产 .....	101
十七、基金资产估值 .....	102
十八、基金的收益与分配 .....	107
十九、基金费用与税收 .....	108
二十、基金的会计与审计 .....	111
二十一、基金的信息披露 .....	112
二十二、风险揭示 .....	118
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	125
二十四、基金合同的内容摘要 .....	127
二十五、基金托管协议的内容摘要 .....	143
二十六、对基金份额持有人的服务 .....	156
二十七、其他应披露的事项 .....	159
二十八、招募说明书存放及查阅方式 .....	161
二十九、备查文件 .....	162

## 一、绪言

《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）以及《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

中海中证高铁产业指数分级证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。投资人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，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指中海中证高铁产业指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人：指中海基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指招商证券股份有限公司
- 4、基金合同：指《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义

务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

19、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、运作周年：指自某运作周年开始日起至该运作周年结束日止的运作期间。基金合同生效之日为第一个运作周年的开始日，其他运作周年的开始日为上一个运作周年结束日的次日。运作周年结束日为该运作周年开始日至满一周年的最后一日，若某运作周年结束日为非工作日，则该运作周年的结束日顺延至之后的第一个工作日

22、中海中证高铁份额：指中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之基础份额。投资者在场外认/申购的中海中证高铁份额不进行自动分离和基金份额分拆；投资者在场内认购的中海中证高铁份额将在基金合同生效后进行基金份额自动分离；投资者在场内申购的中海中证高铁份额不会进行自动分离，投资者可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆

23、中海中证高铁 A 份额：指中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额

24、中海中证高铁 B 份额：指中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之积极收益类份额

25、基金份额分级：指本基金的基金份额包括中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之基础份额、中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之积极收益类份额。其中，中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不

变

26、年基准收益率：指本基金为中海中证高铁 A 份额设定每运作周年应得的收益率。中海中证高铁 A 份额的年基准收益率 = 一年期银行定期存款利率（税后） + 3.50%，其中，一年期银行定期存款利率是指每个运作周年开始日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。年基准收益率除以运作周年的实际天数为日基准收益率，其对应的日分配金额称为日基准收益，日基准收益以面值 1.000 元为基准采取单利进行计算

27、上市交易公告书：指《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额上市交易公告书》

28、会员单位：指上海证券交易所会员单位

29、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

30、销售机构：指中海基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，以及可通过上海证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位

31、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人开放式基金账户和/或上海证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

32、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中海基金管理有限公司或接受中海基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

33、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户、用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

34、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资、交易等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

35、上海证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户，基



金投资者通过上海证券交易所办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户

36、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在登记结算系统

37、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在证券登记系统

38、场外份额：指登记在登记结算系统下的基金份额

39、场内份额：指登记在证券登记系统下的基金份额

40、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的行为，包括系统内转托管及跨系统转托管

41、系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构(网点)之间进行转托管的行为

42、跨系统转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转登记的行为

43、自动分离：指基金合同生效后，投资者场内认购并获确认的中海中证高铁份额按照 1:1 的比例自动分离为中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额

44、配对转换：指根据基金合同的约定，本基金中海中证高铁份额与中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面

45、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每两份中海中证高铁份额的场内份额申请分拆成一份中海中证高铁 A 份额与一份中海中证高铁 B 份额的行为

46、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每一份中海中证高铁 A 份额与一份中海中证高铁 B 份额进行配对申请合并成两份中海中证高铁份额的场内份额的行为

47、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

48、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

49、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

50、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

51、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

52、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

53、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

54、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

55、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

56、《业务规则》：指上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人、基金销售机构的相关业务规则

57、场外：指通过上海证券交易所交易系统外的销售机构办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

58、场内：指通过上海证券交易所内具有相应业务资格的会员单位办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

59、上市交易：指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖中海中证高铁A份额、中海中证高铁B份额的行为

60、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

61、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

62、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

63、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

64、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账

户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

65、巨额赎回：指本基金单个开放日，中海中证高铁份额净赎回申请(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)超过上一开放日基金总份额(包括中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额)的 10%

66、元：指人民币元

67、标的指数：指中证高铁产业指数

68、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

69、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

70、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

71、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

72、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

73、虚拟清算：指假定 T 日为本基金在存续期内的提前终止日，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值

74、基金份额参考净值：指在 T 日基金资产净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

75、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

76、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 三、基金管理人

#### 一、基金管理人概况

本基金管理人为中海基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

邮政编码：200120

成立日期：2004 年 3 月 18 日

法定代表人：黄鹏

总经理：黄鹏

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2004]24 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币

存续期间：持续经营

联系人：葛玮赓

联系电话：021-38429808

股东名称及其出资比例：

中海信托股份有限公司 41.591%

国联证券股份有限公司 33.409%

法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司 25.000%

#### 二、主要人员情况

##### 1、董事会成员

黄晓峰先生，董事长。中国人民大学硕士，高级经济师。现任中海信托股份有限公司总裁、党委书记。历任湖北省计划管理干部学院助教，国家海洋局管理司主任科员，中国海洋石油总公司计划项目处、经济评价处干部、保险处保险主

管，中海石油有限公司税收保险岗、代理融资岗位经理、资金部副总监、代理总监、总监，中海石油财务有限责任公司总经理。

庞建先生，董事。中国人民大学本科学历，高级会计师。现任中国海洋石油总公司资金部总经理。历任渤海石油公司对外合作部计划财务部外事会计，渤海13/03合作区联管会财务专业代表，10/15、11/19、06/17合作区联管会财务专业代表，中国海洋石油总公司审计部干部，中海会计审计公司第三业务处干部、审计业务三部经理（副处级），中国海洋石油总公司（有限公司）审计部审计三处处长、项目审计经理、审计监察部投资项目审计调查经理、内审岗经理，中国海洋石油有限公司审计监察部总经理，中国海洋石油总公司（有限公司）审计监察部副总经理兼审计中心主任，中国海洋石油国际有限公司副总经理。

黄鹏先生，董事。复旦大学硕士。现任中海基金管理有限公司总经理兼中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。历任上海市新长宁（集团）有限公司销售经理，上海浦东发展银行股份有限公司大连分行行长秘书，中海信托股份有限公司综合管理部经理助理、投资管理部经理、风控委员会委员，中海基金管理有限公司董事会秘书、总经理助理兼营销中心总经理。

彭焰宝先生，董事。清华大学学士。现任国联证券股份有限公司总裁、董事，兼华英证券有限责任公司董事。历任无锡市证券公司（国联证券前身）交易员，国联证券有限责任公司投资经理，无锡市国联投资管理咨询有限公司投资经理，锡洲国际有限公司投资部经理，中海基金管理有限公司投资管理部总经理兼投资总监（期间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理）、风险管理部总经理兼风控总监，国联证券股份有限公司证券投资部总经理、副总裁。

江志强先生，董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司监事会主席。历任国联证券股份有限公司证券投资部经理、证券营业部总经理、财富管理中心总经理、资产管理部总经理、总裁助理、副总裁。

MOLING CHEN（陈未翎）女士，董事。澳大利亚国籍。澳洲莫纳什大学工商管理硕士。现任爱德蒙罗斯柴尔德中国私募股权基金I期和II期主管合伙人。历任澳大利亚墨尔本药物技术研究所化学分析师，澳大利亚墨尔本凯龙生物区域经理，百奥维达中国基金高级投资总监。

陈道富先生，独立董事。中国人民银行金融研究所博士。现任国务院发展研究中心金融研究所副所长。曾任中关村证券公司总裁助理、国务院发展研究中心

金融研究所综合研究室主任。

WANG WEIDING（王卫东）先生，独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。现任北京市中伦律师事务所合伙人，历任Sidley Austin(盛德律师事务所)芝加哥总部律师，北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授，北京德恒律师事务所合伙人，美国德杰律师事务所合伙人。

张军先生，独立董事。复旦大学博士。现任复旦大学经济学院院长、中国经济研究中心主任、复旦大学“当代中国经济”长江学者特聘教授、复旦发展研究院副院长、博士生导师、教育部重点研究基地中国社会主义市场经济研究中心主任。历任复旦大学经济学院助教、讲师，复旦大学经济学院副教授。

## 2、监事会成员

张悦女士，监事长。硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司总稽核、党办主任、信托事务管理总部总经理。历任北京石油交易所交易部副经理，中国海洋石油东海公司计财部会计、企管部企业管理岗，中海石油总公司平湖生产项目计财部经理，中海石油有限公司上海分公司计财部岗位经理，中海信托股份有限公司计划财务部会计、计划财务部经理、稽核审计部经理、纪委副书记、合规总监。

Pascal CHARLOT（夏乐博）先生，监事。法国国籍。法国埃夫里大学金融系硕士、法国国立电信管理学院金融系硕士。现任爱德蒙得洛希尔资产管理(香港)有限公司董事会成员、执行总监、营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员，爱德蒙得洛希尔集团亚太区财务长。历任法国巴黎银行全球IT部门客户经理、法国巴黎银行新加坡分行项目经理、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司财务总监、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员。

康铁祥先生，职工监事。博士。现任中海基金管理有限公司风控稽核部总经理。历任山东省招远市绣品厂财务科科员，上海浦发银行外汇业务部科员，中海基金管理有限公司风险管理部助理风控经理、风控经理、风险管理部总经理助理、风险管理部总经理兼风控总监。

张奇先生，职工监事。学士。现任中海基金管理有限公司信息技术部总经理。历任沈阳联正科技有限公司技术部经理，北京致达赛都科技有限公司网络部经理，上海致达信息产业股份有限公司技术支持部经理，中海基金管理有限公司信

息技术部工程师、信息技术部总经理助理、信息技术部副总经理。

### 3、高级管理人员

黄鹏先生，总经理。复旦大学金融学专业硕士。历任上海市新长宁（集团）有限公司销售经理，上海浦东发展银行股份有限公司大连分行行长秘书，中海信托股份有限公司综合管理部经理助理、投资管理部经理、风控委员会委员。2007年10月进入本公司工作，曾任董事会秘书、总经理助理兼营销中心总经理，2011年10月至今任本公司总经理，2013年2月至今任本公司董事，2013年7月至今任中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。

宋宇先生，常务副总经理。复旦大学数理统计专业学士，经济师。历任无锡市统计局秘书，国联证券股份有限公司营业部副经理、发行调研部副经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月进入本公司工作，历任本公司督察长、副总经理（期间2011年1月至2011年10月兼任本公司代理总经理，2014年5月至2014年10月兼任本公司代理督察长），2015年4月至今任本公司常务副总经理。

王莉女士，督察长。华东政法学院国际经济法专业学士。历任中银国际证券有限责任公司研究部翻译，上海源泰律师事务所律师助理。2006年9月进入本公司工作，历任监察稽核部监察稽核经理、监察稽核部部门负责人、督察长兼监察稽核部总经理兼信息披露负责人。2015年5月至今任本公司督察长兼信息披露负责人。

### 4、基金经理

彭海平先生，中国科学技术大学概率论与数理统计专业硕士。2009年7月进入本公司工作，历任金融工程助理分析师、金融工程分析师、金融工程分析师兼基金经理助理。2013年1月至今任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理，2015年7月至今任中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理，2016年4月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年12月至今任中海量化策略混合型证券投资基金基金经理，2017年4月至今任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理。

### 5、历任基金经理

本基金基金合同于2015年7月31日生效，历任基金经理如下表：

基金经理姓名	管理本基金时间
--------	---------

彭海平	2015年7月31日-至今
-----	---------------

#### 6、投资决策委员会成员

黄鹏先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司董事、总经理。

许定晴女士，委员。现任中海基金管理有限公司代理投资总监、投资副总监、基金经理。

夏春晖先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、首席策略分析师、基金经理。

江小震先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、基金经理。

蒋佳良先生，委员。现任中海基金管理有限公司研究部总经理、基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2、办理基金备案手续。

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制季度、半年度和年度基金报告。

7、计算并公告基金资产净值，确定中海中证高铁份额的申购、赎回价格。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、按照规定召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

12、中国证监会规定的其他职责。

### 四、基金管理人的承诺



1、基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资。
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产。
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益。
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反《基金合同》或《托管协议》；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- (7) 违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密和尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；

- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

## 五、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人牟取利益。

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 六、基金管理人的风险管理和内部控制制度

### 1、内部控制体系概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。

基金管理人结合自身具体情况，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

### 2、风险管理的理念和文化

- (1) 以最大程度保护基金份额持有人利益为己任。
- (2) 风险管理是业务发展的保障。
- (3) 最高管理层承担最终责任。
- (4) 分工明确、相互制约的组织结构是前提。
- (5) 制度建设是基础。
- (6) 制度执行监督是保障。

### 3、内部控制遵循的原则

(1) 健全性原则。内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金财产、公司自有资产、其他资产的运作分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 4、风险管理和内部控制的组织体系

公司的风险控制组织体系至少应包括以下几个层面：一、董事会负责控制公司整体运营风险；二、公司高级管理层负责公司内部风险控制的领导及政策决定；三、风险管理部负责对业务风险进行日常管理；四、各职能部门负责对各自业务活动中潜在的风险通过执行制度进行控制。

(1) 董事会应充分重视风险控制。通过批准公司的风险控制战略、制度和工作计划，确保公司已具有了管理其面临的所有风险所需的必要系统、运作制度和控制环境，并通过审计与合规委员会和督察长对公司经营管理层的风险控制工作发挥更权威的监督作用。董事会通过控制公司治理结构风险、制定内部管理制度、完善有关议事规则及充分发挥独立董事的作用达到对风险的最终控制。

(2) 风险控制委员会为公司非常设议事机构，负责对公司业务风险控制进行决策和协调，是公司日常风险控制工作的最高决策机构。其具体职责主要有：审议基金财产风险状况评价分析报告，审定公司的业务授权方案的合法性、合规性，负责协调处理突发性重大事件并界定相关人员的责任，审议公司其他各项资产管理业务的风险状况评价分析报告。

(3) 督察长负责对公司和基金的内部控制和管理情况进行全面监督，对公司保持各项管理制度的合法性、合理性、有效性和完备程度进行检查并督促改进，发现重大问题及时向审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告。

(4) 监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）

进行合规控制的职能部门。其职责主要是对公司各职能部门在业务运作中的遵纪守法情况进行监督，保证公司为控制风险所制定的各项管理制度切实得到贯彻和执行。

(5) 公司各职能部门是公司内部风险控制措施的具体执行单位，应在公司各项基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及风险控制规定，并督导部门员工严格执行。

#### 5、监督机构的合规检查作用

公司日常管理中的监督机构由董事会审计与合规委员会、公司督察长和监察稽核部组成，其主要作用是对公司各项经营管理活动进行合规控制。其中，审计与合规委员会通过定期审阅公司督察长工作报告和监察稽核报告，检查公司合规运作情况和督察长、监察稽核部对公司合规运作的监督工作，从而加强董事会对公司运作情况的监督；

督察长是董事会常设的执行监督职能的岗位，负责对公司的内部控制和管理情况进行全面监督，对公司保持各项管理制度的合法性、合理性、有效性和完备程度进行检查并督促改进，发现重大问题及时向审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告；

监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）进行合规性检查的职能部门。其职责主要是对公司各职能部门在业务运作中的遵纪守法情况进行监督，保证公司为控制风险所制定的各项管理制度切实得到贯彻和执行。

#### 6、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

(1) 控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

(2) 公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

(3) 公司健全法人治理结构, 充分发挥独立董事和监事会的监督职能, 严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生, 保护投资者利益和公司合法权益。

(4) 公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则, 各部门有明确的授权分工, 操作相互独立。公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制, 包括民主、透明的决策程序和管理议事规则, 高效、严谨的业务执行系统, 以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(5) 公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线:

1) 各岗位职责明确, 有详细的岗位说明书和业务流程, 各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守, 在授权范围内承担责任;

2) 建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度, 相关部门和岗位之间相互监督制衡;

3) 公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门, 对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈;

(6) 公司建立有效的人力资源管理制度, 健全激励约束机制, 确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力;

(7) 公司建立科学严密的风险评估体系, 对公司内外部风险进行识别、评估和分析, 及时防范和化解风险;

(8) 授权控制贯穿于公司经营活动的始终, 通过完善法人治理结构、明确各部门职能与授权范围来完成;

(9) 公司建立完善的资产分离制度, 基金财产与公司资产、不同基金的财产和其他委托资产要实行独立运作, 分别核算;

(10) 公司建立科学、严格的岗位分离制度, 明确划分各岗位职责, 投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。重要业务部门和岗位进行物理隔离;

(11) 公司制订切实有效的应急应变措施, 建立危机处理机制和程序;

(12) 公司维护信息沟通渠道的畅通, 建立清晰的报告系统;

(13) 公司建立有效的内部监控制度, 设置督察长和独立的监察稽核部门, 对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督, 保证内部控制制度落实。

7、基金管理人关于内部控制的声明

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确。
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座 38-45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座 38-45 层

法定代表人：霍达

成立时间：1993 年 8 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：66.99 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可[2014]78 号

联系人：秦湘

联系电话：0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会评定为 A 类 AA 级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北京、上海、广州、深圳等城市拥有 222 家批准设立的证券营业部和 11 家证券经纪业务管理分公司，同时在香港设有分支机构，全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司，参股博时基金管理公司、招商基金管理公司、广东金融高新区股权交易中心有限公司及证通股份有限公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

#### 2、主要人员情况

招商证券托管部员工多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审

计经验，以及大型IT公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上学历人员占比 100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

### 3、基金托管业务经营情况

招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外，招商证券于 2012 年 10 月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至 2017 年二季度，招商证券共托管 26 只公募基金。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

招商证券作为基金托管人：

(1) 托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

(3) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

(4) 不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

### 2、内部控制组织结构

招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决策机构，风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案，拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核监察部为公司的风险管理职能部门。

资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立



行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

### 2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、场外销售机构

##### (1) 直销机构

##### 1) 中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：黄鹏

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：周颖

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）或 021-38789788

网址：[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)

##### 2) 中海基金管理有限公司北京分公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

负责人：李想

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：邹意

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）

网址：[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)

##### 3) 网上交易系统

网址：[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)

##### (2) 场外代销机构

##### (1) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：秦湘

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

(2) 平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系电话：021-38637673

传真电话：021-50979507

联系人：潘琦

客户服务电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

(3) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

电话：021-61616193

传真：021-63604196

联系人：朱萍

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(4) 宁波银行股份有限公司

注册地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：王海燕

电话：0574-89103171

传真：0574-89103213

客户服务电话：95574

网址：<http://www.nbc.com.cn/>

(5) 国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街8号7-9层

办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号7-9层

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：沈刚

客户服务电话：95570

公司网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(6) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

客户服务电话：4008-888-888

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(7) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

## (8) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：95553

公司网址：www.htsec.com

## (9) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐、许梦园

电话：400-8888-108

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网址：www.csc108.com

## (10) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

## (11) 东吴证券股份有限公司

住所：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务电话：0512-33396288

公司网址：www.dwzq.com.cn

（12）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

客户服务电话：400-888-8666/95521

公司网址：www.gtja.com

（13）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（14）华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784656、4890208

传真：0931-4890628

联系人：李昕田

客户服务电话：400-689-8888

公司网址：www.hlzqgs.com

(15) 中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号 23 层经纪业务总部

法定代表人：李玮

电话：0531-68889115

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(16) 第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：吴军

电话：0755-23838751

传真：0755-82485081

客户服务电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

(17) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(18) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：[www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

(19) 国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号 6、16、17 楼

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客户服务电话：95310

公司网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

(20) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(21) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座



办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客户服务电话：400-889-5548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（22）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号证券大厦 1005 室

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客户服务电话：4006000686

公司网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

（23）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户服务电话：400-888-8993

公司网址：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

（24）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

客户服务电话：010-66045678

公司网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

(25) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(26) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：周志茹

电话：028-86135991

传真：028-86150040

客户服务电话：95584 和 4008-888-818

公司网址：<http://www.hx168.com.cn>

(27) 中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

联系电话：01065051166

客服电话：4009101166

公司网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

(28) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四  
楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四  
楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0752-2119700

传真：0752-2119660

客户服务电话：95564

网址：[www.lxsec.com](http://www.lxsec.com)

(29) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前  
海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A

法定代表人：高锋

联系人：廖苑兰

电话：0755-83655588

传真：0755-83655518

客户服务电话：4008048688

网址：[www.keynesasset.com](http://www.keynesasset.com)

(30) 上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

客户服务电话：021-962518

公司网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(31) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七  
幢23层1号4号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）

第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

联系人：陆锋

客户服务电话：4000279899

公司网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

(32) 北京电盈基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人：程刚

联系人：赵立芳

客户服务电话：400-100-3391

公司网址：<http://www.dianyingfund.com/>

(33) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(34) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(35) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

业务联系人：郑茵华

联系电话：021-20691831

客服电话：400-089-1289

公司网址：www.erichfund.com

（36）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 层

法定代表人：汪静波

联系人：徐诚

联系电话：021-38509639

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（37）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

联系电话：021-20835787

客服电话：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：licaike.hexun.com

（38）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

联系人：朱玉

联系电话：021-54509977

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

## (39) 众升财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招娣

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

客服电话：400-876-9988

公司网址：www.wy-fund.com

## (40) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

## (41) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 10 楼

法定代表人：李兴春

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533

传真：021-50583535

客服电话：400-921-7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

## (42) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 号

法定代表人：罗细安

联系人：史丽丽

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

公司网址：www.zcvc.com.cn

(43) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

联系人：周斌

联系电话：010-57756019

客服电话：400-786-8868-5

公司网址：www.chtfund.com

(44) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼 7 层  
727 室

法定代表人：杨懿

联系人：刘宝文

联系电话：010-63130889-8369

客服电话：400-166-1188

公司网址：8.jrj.com.cn

(45) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(46) 中期资产管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号中期大厦 8 层

法定代表人：姜新

联系人：方艳美

联系电话：010-65807865

客服电话：010-65807865

公司网址：www.cifcofund.com

（47）浙江金观诚财富管理有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

联系人：孙成岩

联系电话：0571-88337717

客服电话：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

（48）上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

联系人：陈云卉

联系电话：18616024775

客服电话：400-820-2819

公司网址：fund.bundtrade.com

（49）上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031



公司网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(50) 大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：孟召社

联系电话：021-20324176

传真：021-20324199

客服电话：400-928-2266

公司网址：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(51) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：王哲宇

联系电话：021-63333389-611

传真：021-63333390

客服电话：4006-433-389

公司网址：[www.vstonewealth.com](http://www.vstonewealth.com)

(52) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(53) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

（54）奕丰金融服务（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

联系电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

公司网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

（55）北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

（56）北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366

传真：010-62020355

联系人：翟文

客户服务电话：4008188000

公司网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

（57）北京广源达信投资管理有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

电话：4006236060

传真：010-82055860

联系人：王英俊

客户服务电话：400-623-6060

公司网址：[www.niuniufund.com](http://www.niuniufund.com)

（58）深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人：赖任军

电话：0755-66892301

传真：0755-66892399

联系人：张烨

客户服务电话：4009500888

公司网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

（59）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077-220

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(60) 懒猫金融信息服务有限公司

住所：北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号

法定代表人：许现良

电话：010-57649619

传真：010-57649620

联系人：朱翔宇

客户服务电话：010-57649619

公司网址：[www.lanmao.com](http://www.lanmao.com)

(61) 一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：+86(10)88312877

传真：+86(10)88312877

联系人：徐越

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com/>

(62) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：吴季林

客户服务电话：4000618518

公司网址：<https://danjuanapp.com>

(63) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室  
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室  
法定代表人：王伟刚  
电话：010-62680827  
传真：010-62680827  
联系人：丁向坤  
客户服务电话：400-619-9059  
公司网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(64) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼  
办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼  
法定代表人：陈洪生  
电话：0592-3122672  
传真：0592-3122701  
联系人：梁云波  
客户服务电话：400-9180808  
公司网址：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

(65) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室  
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室  
法定代表人：李昭琛  
电话：010-62676405  
传真：8610-62675979  
联系人：付文红  
客户服务电话：010-62675369  
公司网址：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(66) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

电话：010-58160168

传真：010-58160173

联系人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

(67)上海云湾投资管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼

法定代表人：戴新装

电话：021-20538888

传真：021-20538999

联系人：江辉

客户服务电话：400-820-1515

公司网址：[www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

(68)杭州科地瑞富基金销售有限公司

住所：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法定代表人：陈刚

联系人：胡璇

联系电话：0571-85267500

传真：0571-85269200

客服电话：0571-86655920

公司网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

(69)北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座

法定代表人：江卉

联系人：赵德赛

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

客服电话：95118

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## 2、场内代销机构

本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

电话：010-50938888

传真：010-66210938

联系人：朱立元

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

法定代表人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：黎明、孙睿

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-58153000

联系人：汤骏

经办会计师：汤骏、朱昀



## 六、基金份额的分类与净值计算规则

### 一、基金份额结构

本基金的基金份额包括中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之基础份额(简称“中海中证高铁份额”)、中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“中海中证高铁 A 份额”)与中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之积极收益类份额(简称“中海中证高铁 B 份额”)。其中,中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

### 二、基金份额的自动分离与分拆规则

基金发售结束后,本基金将投资者在场内认购的全部中海中证高铁份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别,即中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额。

根据中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额比例,中海中证高铁 A 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%,中海中证高铁 B 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%,且两类基金份额的基金资产合并运作。

基金合同生效后,中海中证高铁份额设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额交易代码不同,只可在上海证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。

投资者可在场内申购和赎回中海中证高铁份额,投资者可选择将其场内申购的中海中证高铁份额按 1:1 的比例分拆成中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额申请合并为中海中证高铁份额后赎回。

投资者可在场外申购和赎回中海中证高铁份额。场外申购的中海中证高铁份额不进行分拆,但基金合同另有规定的除外。投资者可将其持有的场外中海中证高铁份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额后上市交易。投资者可按 1:1 的配比将其持有的中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额合并为中海中证高铁份额后赎回。

无论是定期份额折算,还是不定期份额折算(有关本基金的份额折算详见基

金合同“第二十一部分 基金份额折算”)，其所产生的中海中证高铁份额不进行自动分离。投资者可选择将上述折算产生的场内中海中证高铁份额按 1:1 的比例分拆为中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额。

### 三、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值计算规则

根据中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的预期风险和预期收益特性不同，中海中证高铁份额所自动分离或分拆的两类基金份额中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额具有不同的净值计算规则。

在本基金的存续期内，本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额分别进行基金份额参考净值计算，中海中证高铁 A 份额为低预期风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金资产净值优先确保中海中证高铁 A 份额的本金及中海中证高铁 A 份额累计约定应得收益；中海中证高铁 B 份额为高预期风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金在优先确保中海中证高铁 A 份额的本金及累计约定应得收益后，将剩余基金资产净值计为中海中证高铁 B 份额的净资产。

在本基金存续期内，中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值计算规则如下：

1、在每个运作周年，中海中证高铁 A 份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+3.5%”，同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）以该运作周年首日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。中海中证高铁 A 份额约定年基准收益均以 1.000 元为基准进行计算；

2、本基金每个工作日对中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额进行基金份额参考净值计算。在进行中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额各自的基金份额参考净值计算时，本基金资产净值优先确保中海中证高铁 A 份额的本金及中海中证高铁 A 份额累计约定应得收益，之后的剩余基金资产净值计为中海中证高铁 B 份额的净资产。中海中证高铁 A 份额累计约定应得收益按依据中海中证高铁 A 份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日中海中证高铁 A 份额应计收益的天数确定；

3、每 2 份中海中证高铁份额所代表的基金资产净值等于 1 份中海中证高铁 A 份额和 1 份中海中证高铁 B 份额的基金资产净值之和；

4、在每个运作周年，自该运作周年首日至基金份额参考净值计算日，若未发生基金合同规定的定期份额折算或不定期份额折算，则中海中证高铁 A 份额在基金份额参考净值计算日应计收益的天数按自该运作周年首日至计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的定期份额折算或不定期份额折算，则中海中证高铁 A 份额在基金份额参考净值计算日应计收益的天数应按照最近一次基金份额折算基准日次日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证中海中证高铁 A 份额的基金份额持有人的本金及约定应得收益，如在基金存续期内本基金资产出现极端损失情况下，中海中证高铁 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

四、中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值的计算

本基金作为分级基金，按照中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值：

1、中海中证高铁份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。设  $NAV_{\text{基础}}$  为 T 日中海中证高铁份额的基金份额净值，计算方式为：

$$NAV_{\text{基础}} = \text{T 日闭市后的基金资产净值} / \text{T 日本基金基金份额的总数}$$

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额和中海中证高铁份额的份额数之和。

2、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值计算

设 T 日为基金份额参考净值计算日；N 为该运作周年实际天数； $t = \min\{\text{自该运作周年首日至 T 日之间的自然日, 自最近一次基金份额折算基准日次日至 T 日之间的自然日}\}$ ； $NAV_A$  为 T 日中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值； $NAV_B$

为 T 日中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值； $NAV_{\text{基础}}$  为 T 日中海中证高铁份额的基金份额净值；R 为中海中证高铁 A 份额的约定年基准收益率，则中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值计算方式为：

$$NAV_A = 1 + R \times \frac{t}{N}$$

$$NAV_B = 2 \times NAV_{\text{基础}} - NAV_A$$

3、中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

4、T 日的中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 七、基金的募集

### 一、募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关法律法规，并经中国证监会 2015年 5月 18日证监许可（2015）932号文注册。

### 二、基金类型

股票型证券投资基金

### 三、基金运作方式

契约型、开放式

### 四、基金存续期限

不定期

### 五、募集方式和募集场所

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。在基金募集阶段，本基金以同一个基金份额认购代码在场内和场外同时募集。

场外将通过基金管理人的直销机构及基金代销机构的代销网点（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）或按基金管理人直销机构、代销机构提供的其他方式办理公开发售。场内将通过上海证券交易所内具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。尚未取得基金销售业务资格，但属于上海证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过上海证券交易所交易系统参与本基金份额的上市交易。

通过场外认购的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下。

## 六、募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

## 七、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

## 八、基金的最低募集份额总额和金额

基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元。

## 九、基金份额发售面值、认购费用和认购份额的计算

1、基金份额面值：本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，按发售面值发售。

### 2、认购费用：

本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。

本基金认购采用金额认购方式，本基金对通过直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的认购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

本基金非养老金客户的场外认购费率如下表：

单笔认购金额 (M)	费率
M<50万元	0.40%
50万元≤M<100万元	0.20%
M≥100万元	300元/笔

养老金客户通过基金管理人的直销中心认购本基金的场外认购费率见下表：

单笔认购金额（M）	费率
M<50万元	0.24%
50万元≤M<100万元	0.12%
M≥100万元	300元/笔

本基金场内认购也采取金额认购方式，认购费率如下表：

单笔认购金额（M）	费率
M<50万元	0.40%
50万元≤M<100万元	0.20%
M≥100万元	300元/笔

认购规则按销售机构及届时上海证券交易所公布的规则执行。

### 3、认购份额的计算

#### （1）中海中证高铁份额认购份额和利息折算份额的计算

本基金采用“金额认购”的申报方式，即投资人在认购基金时缴纳认购费。登记机构根据单次认购的实际确认金额确定每次认购所适用的费率并分别计算。

当认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=净认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额初始面值

认购份额总额=认购份额+利息折算的份额

当认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用=固定金额认购费

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=净认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额初始面值

认购份额总额=认购份额+利息折算的份额

场外认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；场内认购份额计算结果先按四舍五入原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的金额退

还投资者。

场内认购利息折算的基金份额按截位法保留到整数位，小数部分舍去归基金资产；场外认购利息折算的基金份额按截位法保留到小数点后两位，小数点第三位以后部分舍去归基金资产。

举例说明：

假设某投资人（非养老金客户）通过场外认购本基金，认购金额 10,000 元，认购费率为 0.40%，假定募集期间认购资金所得利息为 35.5 元，则其可得到的中海中证高铁份额计算如下：

$$\text{净认购金额} = 10,000 / (1 + 0.40\%) = 9,960.16 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 10,000 - 9,960.16 = 39.84 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = 9,960.16 / 1.00 = 9,960.16 \text{ 份}$$

$$\text{利息转份额} = 35.5 / 1.00 = 35.50 \text{ 份}$$

$$\text{认购总份额} = 9,960.16 + 35.50 = 9,995.66 \text{ 份}$$

即：该投资人投资 10,000 元通过场外认购本基金份额，假定募集期间认购资金所得利息为 35.5 元，在基金发售结束后，其所获得的中海中证高铁份额为 9,995.66 份。

举例说明：

某投资人（非养老金客户）在募集期内投资 100,000 元通过场内认购本基金，上海证券交易所会员单位设定其适用的认购费率为 0.40%，如果募集期内认购资金获得的利息为 99 元，则其可得到的场内中海中证高铁份额计算如下：

$$\text{净认购金额} = 100,000 / (1 + 0.40\%) = 99,601.59 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 99,601.59 = 398.41 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = 99,601.59 / 1.00 = 99,601.59 \text{ 份}$$

认购份额按截位法保留到整数位为 99,601 份，小数部分 0.59 份对应的金额退还投资人。

$$\text{利息转份额} = 99 / 1.00 = 99 \text{ 份}$$

$$\text{认购总份额} = 99,601 + 99 = 99,700 \text{ 份}$$

$$\text{退款金额} = 0.59 \times 1.00 = 0.59 \text{ 元}$$

即：该投资人投资 100,000 元从场内认购本基金，如果募集期内认购资金获



得的利息为 99 元，在基金发售结束后，则其可得到的场内中海中证高铁份额 99,700 份，退款 0.59 元。

## (2) 中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的计算

本基金发售结束后，场内认购的全部份额将按 1:1 的比例确认为中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额，两类基金份额的计算公式如下：

认购份额总额 = 认购份额 + 利息转份额

经确认的中海中证高铁 A 份额 = 认购份额总额 × 0.5

经确认的中海中证高铁 B 份额 = 认购份额总额 × 0.5

中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额的计算保留至整数位（最小单位为 1 份）。

举例说明：

某投资人（非养老金客户）在募集期内投资 100,000 元通过场内认购本基金，上海证券交易所会员单位设定其适用的认购费率为 0.40%，如果募集期内认购资金获得的利息为 99 元，则其可得到的场内中海中证高铁份额计算如下：

净认购金额 =  $100,000 / (1 + 0.40\%) = 99,601.59$  元

认购费用 =  $100,000 - 99,601.59 = 398.41$  元

认购份额 =  $99,601.59 / 1.00 = 99,601.59$  份

认购份额按截位法保留到整数位为 99,601 份。

利息转份额 =  $99 / 1.00 = 99$  份

认购总份额 =  $99,601 + 99 = 99,700$  份

经确认的中海中证高铁 A 份额 =  $99,700 \times 0.5 = 49,850$  份

经确认的中海中证高铁 B 份额 =  $99,700 \times 0.5 = 49,850$  份

即投资人在募集期内通过场内认购 100,000 元本基金，如果募集期内认购资金获得的利息为 99 元，上海证券交易所会员单位设定其适用的认购费率为 0.40%，基金募集期结束后，投资人经确认的中海中证高铁 A 份额为 49,850 份、中海中证高铁 B 份额为 49,850 份。

## 十、投资人对基金份额的认购

### 1、认购时间安排

投资人可在募集期内前往本基金销售机构的网点办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各销售机构相关业务办理规则。

## 2、投资人认购应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或各销售机构相关业务办理规则。

## 3、认购的方式及确认

(1) 本基金场外认购采用金额认购方式。场内认购采用金额认购方式，具体以届时上海证券交易所公布的有关规定办理。投资人认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额交付认购款项。

募集期内，投资人可多次认购基金份额，但已受理的认购申请不得撤销。

### (2) 认购确认

对于 T 日（此处，特指发售募集期内的工作日）交易时间内受理的认购申请，在正常情况下，基金登记机构将在 T+1 日（同上）就申请的有效性进行确认。但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资人的认购申请，认购申请的成功确认应以基金登记机构在本基金募集结束后的登记确认结果为准。投资人应在基金合同生效后到各销售网点或以其规定的其他合法方式查询最终确认情况。投资人应主动查询申请的确认结果。投资人开户和认购所需提交的文件和办理的具体程序，请参阅基金份额发售公告。

## 4、认购数量限制

### (1) 场外认购中海中证高铁份额的限额

本基金场外认购采用金额认购的方式。本基金在场外代销机构或基金管理人网上交易系统的首次单笔最低认购金额为人民币 10 元（含认购费），追加认购的单笔最低认购金额为人民币 10 元（含认购费）；基金管理人直销网点的首次单笔最低认购金额为人民币 100,000 元（含认购费），追加认购的单笔最低认购金额为人民币 10,000 元（含认购费）。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

### (2) 场内认购中海中证高铁份额的限额

本基金场内认购采用金额认购的方式，具体以届时上海证券交易所公布的有关规定办理。在具有基金销售资格的上海证券交易所会员单位的单笔最低认购金

额为 50,000 元（含认购费）。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

（3）本基金对单个账户持有的基金份额不进行限制。

#### 十一、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

十二、基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前，任何人不得动用。

## 八、基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
- 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息(税后)。
- 3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《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个工作日出现基金份额持有人数量不满200人的,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。

《基金合同》生效满三年后,本基金连续60个工作日基金资产规模低于5000

万元时，基金合同终止，而无需经基金份额持有人大会审议。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 九、中海中证高铁份额的申购与赎回

本基金不接受投资者单独申购或赎回中海中证高铁 A 份额或中海中证高铁 B 份额。

本基金基金合同生效后,投资者可通过场外或场内两种方式对中海中证高铁份额进行申购与赎回。

### 一、申购和赎回场所

中海中证高铁份额场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构,投资者可使用开放式基金账户,通过基金管理人、场外代销机构办理场外申购、赎回业务;中海中证高铁份额场内申购与赎回的场所为具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位,投资者使用上海证券账户,通过上海证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理中海中证高铁份额的申购与赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理中海中证高铁份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,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。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理中海中证高铁份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其中中海中证高铁份额申购、赎回价格为下一开放日中海中证高铁份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的中海中证高铁份额的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资人通过上海证券交易所交易系统办理中海中证高铁份额的场内申购、赎回业务时，需遵守上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在申购中海中证高铁份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的中海中证高铁份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请不成立。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为

准。

## 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购中海中证高铁份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人提交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

## 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

## 五、申购和赎回的数量限制

### 1、申购中海中证高铁份额的限制

本基金场外申购和场内申购中海中证高铁份额采用金额申购的方式。

本基金在场外代销机构或基金管理人网上交易系统的首次单笔最低申购金额为人民币 10 元(含申购费)，追加申购的单笔最低申购金额为人民币 10 元(含申购费)；基金管理人直销网点的首次单笔最低申购金额为人民币 100,000 元(含申购费)，追加申购的单笔最低申购金额为人民币 10,000 元(含申购费)。

本基金在场内具有基金销售资格的上海证券交易所会员单位的单笔最低申购金额为人民币 50,000 元(含申购费)。具体以届时上海证券交易所公布的有关规定办理。

各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

### 2、赎回中海中证高铁份额的限制



中海中证高铁份额场外赎回和场内赎回采用份额赎回的方式。

中海中证高铁份额持有人可将其全部或部分中海中证高铁份额赎回，在场外代销机构或基金管理人网上交易系统单笔赎回不得少于 1 份中海中证高铁份额，在场内具有基金销售资格的上海证券交易所会员单位单笔赎回不得少于 100 份中海中证高铁份额，且通过场内单笔申请赎回的中海中证高铁份额必须是整数份。具体以届时上海证券交易所公布的有关规定办理。

某笔赎回导致基金份额持有人在某一场外销售机构某一交易账户的中海中证高铁份额余额少于 1 份的，基金管理人有权将在该销售机构托管的该类基金剩余份额一次性全部赎回。

各销售机构对赎回份额限制有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

3、投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

4、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、中海中证高铁份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的中海中证高铁份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、中海中证高铁份额申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

非养老金客户场外申购中海中证高铁份额的申购费率如下表所示：

单笔申购金额（M，元）	费率
M<50万	0.60%
50万≤M<100万	0.30%

M $\geq$ 100万	300元/笔
---------------	--------

养老金客户通过基金管理人的直销中心申购本基金的场外申购费率见下表：

单笔申购金额 (M)	费率
M $<$ 50万	0.36%
50万 $\leq$ M $<$ 100万	0.18%
M $\geq$ 100万	300元/笔

中海中证高铁份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

中海中证高铁份额的场内申购根据基金销售机构及上海证券交易所届时公布的规则执行。投资人在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

中海中证高铁份额的申购费用由投资人承担，不列入基金资产。

3、中海中证高铁份额的场外赎回费率按照持有时间递减，即中海中证高铁份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。本基金的场外赎回费率如下表所示：

持有时间 (Y)	场外赎回费率	赎回费计入基金资产比例
Y $<$ 1年	0.50%	25%
1年 $\leq$ Y $<$ 2年	0.25%	25%
Y $\geq$ 2年	0	25%

注：1年=365日

中海中证高铁份额的场内赎回费率由基金销售机构参照场外赎回费率执行。

中海中证高铁份额的赎回费用由赎回中海中证高铁份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回中海中证高铁份额时收取。赎回费总额的25%应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

从场内转托管至场外的中海中证高铁份额，从场外赎回时，其持有期限从场内持有中海中证高铁份额的第一天开始计算。

从场外转托管至场内的中海中证高铁份额，从场内赎回时，其持有期限从场外持有中海中证高铁份额的第一天开始计算。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动

期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率，并进行公告。

6、办理中海中证高铁份额的场内申购、赎回业务应遵守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业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、中海中证高铁份额的申购份额的计算及余额的处理方式

中海中证高铁份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} \times \text{申购费率} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购份额} = (\text{申购金额} - \text{申购费用}) / (1 + \text{申购费率})$$

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日中海中证高铁份额净值}$$

申购费用以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；通过场内方式进行申购的中海中证高铁份额的份额，申购份额计算结果先按四舍五入保留到小数点后两位，再采取截尾法保留到整数位，小数部分对应的资金返还投资者。

举例说明：

某投资人（非养老金客户）通过场外投资 10,000 元申购中海中证高铁份额，对应费率为 0.60%，假设申购当日中海中证高铁份额的基金份额净值为 1.1210 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 10,000 \times 0.60\% / (1 + 0.60\%) = 59.64 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (10,000 - 59.64) / 1.1210 = 8,867.40 \text{ 份}$$

即：该投资人通过场外投资 10,000 元申购中海中证高铁份额，假设申购当日中海中证高铁份额的基金份额净值为 1.1210 元，则可得到 8,867.40 份中海中证高铁份额。

举例说明：

某投资人（非养老金客户）通过场内投资 100,000 元申购中海中证高铁份额，对应的申购费率为 0.60%，假设申购当日中海中证高铁份额的基金份额净值为 1.1210 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{申购费用} = 100,000 \times 0.60\% / (1 + 0.60\%) = 596.42 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (100,000 - 596.42) / 1.1210 = 88,674.02 \text{ 份}$$

因此，投资人申购所得份额为 88,674 份，小数部分 0.02 份对应的申购资金返还给投资人。

$$\text{退款金额} = 0.02 \times 1.1210 = 0.02 \text{ 元}$$

即：该投资人投资 100,000 元从场内申购中海中证高铁份额，假设申购当日中海中证高铁份额的基金份额净值为 1.1210 元，则其可得到中海中证高铁份额 88,674 份，退款 0.02 元。

## 2、中海中证高铁份额赎回金额的计算及处理方式

投资人在赎回中海中证高铁份额时需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

$$\text{赎回费} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值} - \text{赎回费}$$

赎回金额单位为元，计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

举例说明：

某中海中证高铁份额持有人持有 10,000 份中海中证高铁份额一年后（未满 2 年）决定从场外赎回，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日中海中证高铁份额的基金份额净值是 1.1210 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.1210 \times 0.25\% = 28.03 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,000 \times 1.1210 - 28.03 = 11,181.97 \text{ 元}$$

即：该中海中证高铁份额持有人持有 10,000 份中海中证高铁份额一年后（未

满 2 年) 从场外赎回, 对应的赎回费率为 0.25%, 假设赎回当日中海中证高铁份额的基金份额净值是 1.1210 元, 则可得到的净赎回金额为 11,181.97 元。

举例说明:

某中海中证高铁份额持有人持有 10,000 份中海中证高铁份额一年后(未满 2 年) 决定从场内赎回, 对应的赎回费率为 0.25%, 假设赎回当日中海中证高铁份额的基金份额净值是 1.1210 元, 则可得到的净赎回金额为:

赎回费用=10,000×1.1210×0.25%=28.03 元

净赎回金额=10,000×1.1210-28.03=11,181.97 元

即: 该中海中证高铁份额持有人持有 10,000 份中海中证高铁份额一年后(未满 2 年) 从场内赎回, 对应的赎回费率为 0.25%, 假设赎回当日中海中证高铁份额的基金份额净值是 1.1210 元, 则可得到的净赎回金额为 11,181.97 元。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时, 基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、发生基金合同约定的份额折算等事项, 根据相关业务规则可暂停接受申购申请的情形。
- 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、8 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时, 基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人

的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。
- 6、发生基金合同约定的份额折算等事项，根据相关业务规则可暂停接受赎回申请的情形。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于场外赎回申请，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。对于场内赎回申请，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。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 十、巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的中海中证高铁份额净赎回申请(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)超过前一开放日的基金总份额(包括中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额)的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，对于场外赎回申请，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) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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中海中证高铁份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如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。

对于场内赎回申请，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) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受中海中证高铁份额的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

## 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的中海中证高铁份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次；暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个工作日的中海中证高铁份额的基金份额净值。

## 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十三、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

## 十四、基金的转托管



基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### 十五、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 十六、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十、中海中证高铁A份额与中海中证高铁B份额的上市交易

### 一、上市交易的基金份额

基金合同生效后,在本基金符合法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下,基金管理人将根据有关规定,申请中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额上市交易。

未来,基金管理人可根据基金运作情况,在履行相关程序后申请中海中证高铁份额上市交易,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 二、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为上海证券交易所。

### 三、上市交易的时间

基金合同生效后六个月内,中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额将申请在上海证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登基金份额《上市交易公告书》。

### 四、上市交易的规则

中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的上市交易遵循《上海证券交易所交易规则》及《上海证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定。

### 五、上市交易的费用

中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额上市交易的费用按照上海证券交易所有关规定办理。

### 六、上市交易的停复牌和终止上市

中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的停复牌和终止上市按照《基金法》相关规定和上海证券交易所的相关规定执行。

七、相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

八、若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 十一、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管等其他相关业务

### 一、基金份额的登记

1、本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的中海中证高铁份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购或申购的中海中证高铁份额、或上市交易的中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额登记在证券登记系统基金份额持有人证券账户下。

2、登记在证券登记系统中的中海中证高铁份额可以申请场内赎回；登记在登记结算系统中的中海中证高铁份额可申请场外赎回。

3、登记在证券登记系统中的中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额只能在上海证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按 1：1 的比例申请合并为中海中证高铁份额后再申请场内赎回。

### 二、系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理中海中证高铁份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有中海中证高铁份额的系统内转托管。

3、基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

4、募集期内不得办理系统内转托管。

### 三、跨系统转托管

1、跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的中海中证高铁份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

2、中海中证高铁份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

3、基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

4、本基金上市前、权益分派期间、上海证券交易所规定相应停牌日期、基金份额折算基准日至折算处理日、基金份额处于质押、冻结状态或出现上海证券交易所、登记机构规定的其他情形时，不得办理跨系统转托管。

#### 四、基金份额的非交易过户、质押、冻结与解冻

本基金的非交易过户、质押、冻结与解冻等，按照中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所等相关机构的规定办理。如基金合同的有关约定与上述规定不一致，以该等规定为准。

#### 五、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

六、如遇法律法规及登记机构、证券交易所相关规则等发生变动，上述规则等可相应进行调整。

## 十二、基金的份额配对转换

本基金《基金合同》生效后，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

一、份额配对转换是指本基金的中海中证高铁份额与中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面：

1、分拆。基金份额持有人将其持有的每两份中海中证高铁份额的场内份额申请分拆成一份中海中证高铁 A 份额与一份中海中证高铁 B 份额的行为；

2、合并。基金份额持有人将其持有的每一份中海中证高铁 A 份额与一份中海中证高铁 B 份额进行配对申请合并成两份中海中证高铁份额的场内份额的行为。

### 二、份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。上海证券交易所、基金登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

### 三、份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前 2 日在指定媒介公告。

份额配对转换的业务办理日为上海证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若上海证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

#### 四、份额配对转换的原则

- 1、份额配对转换以份额申请。
- 2、申请进行分拆的中海中证高铁份额的场内份额必须是偶数。
- 3、申请进行合并的中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。
- 4、中海中证高铁份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为中海中证高铁份额的场内份额后方可进行。
- 5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。上海证券交易所、基金登记机构或基金管理人可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 日在指定媒介公告。

#### 五、份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### 六、暂停份额配对转换的情形

- 1、基金管理人认为继续接受份额配对转换可能损害基金份额持有人利益的。
- 2、上海证券交易所、登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。
- 3、基金管理人根据本基金届时投资运作、交易的实际情形决定暂停接受份额配对转换。
- 4、法律法规、上海证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形之一且基金管理人决定暂停份额配对转换的，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人可恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

#### 七、份额配对转换的业务办理费用

份额配对转换业务办理机构可对转换业务的办理酌情收取一定的佣金，具体见相关业务公告。

八、若上海证券交易所、登记机构等相关机构调整上述规则，基金合同将视需要进行相应修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会审议。



## 十三、基金份额折算

### 一、定期份额折算

在存续期内的每个运作周年的结束日，基金份额定期折算基准日登记在册的中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额。本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### 1、基金份额折算基准日

每个运作周年的结束日。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁份额。

#### 3、基金份额折算频率

每个运作周年折算一次。

#### 4、基金份额折算方式

中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额按照基金合同中规定的基金份额参考净值计算规则进行基金份额参考净值计算，对中海中证高铁 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算，每 2 份中海中证高铁份额将按 1 份中海中证高铁 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

对于中海中证高铁 A 份额期末的约定应得收益，即中海中证高铁 A 份额每个运作周年基金份额折算基准日的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内中海中证高铁份额分配给中海中证高铁 A 份额持有人。中海中证高铁份额持有人持有的每 2 份中海中证高铁份额将按 1 份中海中证高铁 A 份额获得新增中海中证高铁份额的分配。持有场外中海中证高铁份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外中海中证高铁份额的分配；持有场内中海中证高铁份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内中海中证高铁份额的分配。经过上述份额折算，中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值和中海中证高铁份额的基金份额净值将相应调整。

每个运作周年的基金份额折算基准日，本基金将对中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁份额进行应得收益的定期份额折算。

中海中证高铁 A 份额本运作周年应得收益的定期份额折算时，有关计算公

式如下：

(1) 中海中证高铁 A 份额

定期份额折算后中海中证高铁 A 份额的份额数=定期份额折算前中海中证高铁 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

中海中证高铁 A 份额持有人新增的场内中海中证高铁份额数量

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 A 份额的份额数

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$  为折算后中海中证高铁份额的基金份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁份额的份额数

(2) 中海中证高铁 B 份额

每个运作周年的定期份额折算不改变中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

(3) 中海中证高铁份额

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

中海中证高铁份额持有人新增的中海中证高铁份额 =

$$\frac{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{(NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后中海中证高铁份额持有人持有的中海中证高铁份额的份额数=定期份额折算前中海中证高铁份额的份额数 + 中海中证高铁份额持有人新增的中海中证高铁份额的份额数

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$  为折算后中海中证高铁份额的基金份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁份额的份额数

中海中证高铁份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；中海中证高铁份额的场内份额经折算后的份额数，以及中海中证高铁 A 份额折算成中海中证高铁份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

在实施基金份额折算时，折算日折算前中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的上市交易和中海中证高铁份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告，并报中国证监会备案。

#### 7、特殊情形的处理

若在定期份额折算日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，将按照不定期份额折算的规则进行份额折算。

## 二、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当中海中证高铁份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元；当中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元。

1、当中海中证高铁份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

### （1）基金份额折算基准日

中海中证高铁份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额和中海中证高铁份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当中海中证高铁份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元后，本基金将分别对中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额和中海中证高铁份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值、中海中证高铁份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

当中海中证高铁份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元后，中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额、中海中证高铁份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

1) 中海中证高铁 A 份额

份额折算原则：

①份额折算前中海中证高铁 A 份额的份额数与份额折算后中海中证高铁 A 份额的份额数相等；

②中海中证高铁 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即参考净值超出 1.000 元以上的部分全部折算为场内中海中证高铁份额。

$$NUM_A^{\text{前}} = NUM_A^{\text{后}}$$

中海中证高铁 A 份额持有人新增的场内中海中证高铁份额数量

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 A 份额的份额数

$NUM_{基础}^{后}$  为折算后中海中证高铁份额的份额数

## 2) 中海中证高铁 B 份额

份额折算原则:

① 份额折算后中海中证高铁 B 份额与中海中证高铁 A 份额的份额数保持 1:1 配比;

② 份额折算前中海中证高铁 B 份额的资产净值与份额折算后中海中证高铁 B 份额的资产净值及新增场内中海中证高铁份额的资产净值之和相等;

③ 份额折算前中海中证高铁 B 份额的持有人在份额折算后将持有中海中证高铁 B 份额与新增场内中海中证高铁份额。

$$NUM_B^{后} = NUM_A^{后}$$

中海中证高铁 B 份额持有人新增的场内中海中证高铁份额数量

$$= \frac{NUM_B^{前} \times (NAV_B^{前} - 1.000)}{1.000}$$

其中:

$NAV_B^{前}$  为折算前中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值

$NUM_B^{前}$  为折算前中海中证高铁 B 份额的份额数

$NUM_B^{后}$  为折算后中海中证高铁 B 份额的份额数

$NUM_A^{后}$  为折算后中海中证高铁 A 份额的份额数

## 3) 中海中证高铁份额

份额折算原则:

场外中海中证高铁份额持有人份额折算后获得新增场外中海中证高铁份额,场内中海中证高铁份额持有人份额折算后获得新增场内中海中证高铁份额。

$$NUM_{基础}^{后} = \frac{NAV_{基础}^{前} \times NUM_{基础}^{前}}{1.000}$$

其中:

$NAV_{基础}^{前}$  为折算前中海中证高铁份额的基金份额净值

$NUM_{基础}^{前}$  为折算前中海中证高铁份额的份额数

$NUM_{基础}^{后}$  为折算后原中海中证高铁份额持有人持有的中海中证高铁份额的份额数

中海中证高铁份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；中海中证高铁份额的场内份额经折算后的份额数，以及中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额折算成中海中证高铁份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

在实施基金份额折算时，折算日折算前中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的上市交易和中海中证高铁份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告，并报中国证监会备案。

2、当中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### （1）基金份额折算基准日

中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

#### （2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额、中海中证高铁份额。

#### （3）基金份额折算频率

不定期。

#### （4）基金份额折算方式

当中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元后，本基金将分别对中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额和中海中证高铁份额进行

份额折算，份额折算后本基金将确保中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

当中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元后，中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额、中海中证高铁份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

#### 1) 中海中证高铁 B 份额

份额折算原则：

份额折算前中海中证高铁 B 份额的资产净值与份额折算后中海中证高铁 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后中海中证高铁 B 份额的份额数

#### 2) 中海中证高铁 A 份额

份额折算原则：

①份额折算前后中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比；

②份额折算前中海中证高铁 A 份额的资产净值与份额折算后中海中证高铁 A 份额的资产净值及新增场内中海中证高铁份额的资产净值之和相等；

③份额折算前中海中证高铁 A 份额的持有人在份额折算后将持有中海中证高铁 A 份额与新增场内中海中证高铁份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

$$NUM_{\text{场内新增}}^{\text{基础}} = \frac{NAV_A^{\text{前}} \times NUM_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{后}}$  为折算后中海中证高铁 A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后中海中证高铁 B 份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{场内新增}}$  为份额折算前中海中证高铁 A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内中海中证高铁份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁 A 份额的份额数

3) 中海中证高铁份额:

份额折算原则:

份额折算前中海中证高铁份额的资产净值与份额折算后中海中证高铁份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中:

$NAV_{\text{基础}}^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁份额的基金份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$  为折算前中海中证高铁份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$  为折算后原中海中证高铁份额持有人持有的中海中证高铁份额的份额数

中海中证高铁份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位; 中海中证高铁份额的场内份额经折算后的份额数, 以及中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额折算成中海中证高铁份额的场内份额数均取整计算 (最小单位为 1 份), 余额计入基金财产。

按照上述折算和计算方法, 可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差, 视为未改变基金份额持有人的资产净值。

在实施基金份额折算时, 折算日折算前中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### (5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作, 基金管理人可根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的上市交易和中海中证高铁份额的申购或赎回等相关



业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告，并报中国证监会备案。

三、基金管理人、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司有权调整上述规则，本基金基金合同将相应予以修改，并在本基金更新的招募说明书中列示，无须召开基金份额持有人大会。

## 十四、基金的投资

### 一、投资目标

本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,实现对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证高铁产业指数的有效跟踪。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证高铁产业指数的成份股、备选成份股、其他股票、债券、债券回购、资产支持证券、衍生工具(权证等)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相关规定)。

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。

待证券投资基金参与融资融券业务的相关规定颁布后,基金管理人在履行适当程序后,可以根据相关法律法规的规定,在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%,且不低于非现金基金资产的80%;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;本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%。

本基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

### 三、投资策略

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证高铁产业指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等），或因基金申购和赎回等对本基金跟踪标的指数效果可能带来影响时，基金管理人将适当调整基金投资组合，力求降低基金的跟踪误差，尽可能贴近标的指数的表现。

#### 1、股票投资策略

本基金股票资产投资通过完全复制标的指数的方法，根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量。

在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：

- （1）标的指数成份股流动性严重不足或停牌；
- （2）本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；
- （3）成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
- （4）法律法规禁止或限制投资等。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：

(1)基本面替代：按照与被替代股票所属行业，基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；

(2)相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。

#### 2、股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据中证高铁产业指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行适时调整。

##### （1）定期调整

本基金所构建的股票投资组合将定期根据中证高铁产业指数的调整规则和备选股票的预期，及时进行跟踪调整。

## （2）不定期调整

1) 若出现标的指数成份股临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略；

2) 若标的指数成份股及其备选成份发生包括股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌以及其他重大信息，本基金管理人将根据上述信息及时制定相应的投资组合调整策略；

3) 根据本基金的申购和赎回情况，结合本基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

本基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

## 3、债券投资策略

本基金债券投资主要根据流动性管理的需要，投资于具有较好流动性的国债、央票、金融债等债券。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

## 4、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证，或者本基金在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合，力求取得最优的风险调整收益。

## 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证

券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 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；

(3) 基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(4) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评

级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(12) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(14) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持

有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

## 五、标的指数与业绩比较基准

### 1、标的指数

本基金的标的指数是中证高铁产业指数。

中证高铁产业指数是中证全指细分行业系列指数旗下一只二级行业指数，是中国多层次证券市场的重要指数。该指数以沪深两市从事高铁相关行业上市公司的股票作为其成份股，用以表征高铁行业的整体股价变化，综合反映沪深两市属于高铁产业的公司股票的整体走势，兼具价值尺度与投资标的的功能。因此，选择中证高铁产业指数作为本基金的标的指数。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略等实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

### 2、业绩比较基准

业绩比较基准： $\text{中证高铁产业指数收益率} \times 95\% + \text{同期银行活期存款利率} (\text{税后}) \times 5\%$

由于本基金投资标的指数为中证高铁产业指数，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，因此，本基金将业绩比较基准定

为：中证高铁产业指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。若业绩比较基准和标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若业绩比较基准、标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名、指数编制方案调整等)，则无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人应与基金托管人协商一致后报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

## 六、风险收益特征

本基金为股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，中海中证高铁A份额具有低风险、收益相对稳定的特征，中海中证高铁B份额具有高风险、高预期收益的特征。

## 七、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 2、有利于基金资产的安全和增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

依照有关规定，基金管理人代表基金出席上市公司的股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

## 八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导



性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据为截至 2017 年 6 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、基金资产组合情况

截至 2017 年 6 月 30 日,中海中证高铁产业指数分级证券投资基金资产净值为 36,673,922.85 元,基金份额净值为 1.004 元,累计基金份额净值为 0.673 元。其资产组合情况如下:

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	33,140,936.55	89.09
	其中:股票	33,140,936.55	89.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备 付金合计	2,774,663.62	7.46
8	其他资产	1,282,020.38	3.45
9	合计	37,197,620.55	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### (1) 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,633,988.46	56.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,286,453.37	33.50
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	220,494.72	0.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,140,936.55	90.37

(2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

(1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601766	中国中车	490,267	4,961,502.04	13.53
2	601186	中国铁建	408,801	4,917,876.03	13.41
3	601390	中国中铁	555,252	4,814,034.84	13.13
4	600820	隧道股份	252,925	2,554,542.50	6.97
5	000008	神州高铁	225,655	1,642,768.40	4.48
6	600967	内蒙一机	91,978	1,253,660.14	3.42
7	002501	利源精制	99,696	1,133,543.52	3.09
8	300001	特锐德	65,612	1,099,657.12	3.00
9	600169	太原重工	245,364	947,105.04	2.58
10	600562	国睿科技	32,500	895,050.00	2.44

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### (1) 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

##### (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

##### (3) 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

#### 11、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库

之外的股票。

(3) 截至 2017 年 6 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	43,125.95
2	应收证券清算款	1,086,016.79
3	应收股利	-
4	应收利息	1,350.78
5	应收申购款	151,526.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,282,020.38

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

(5) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 报告期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(7) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十五、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（截止日期2017年6月30日）：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015.7.30-2015.12.31	-13.90%	2.64%	-5.69%	2.91%	-8.21%	-0.27%
2016.1.1-2016.12.31	-17.91%	1.84%	-17.16%	1.96%	-0.75%	-0.12%
2017.1.1-2017.6.30	-7.12%	0.83%	-7.51%	0.88%	0.39%	-0.05%
自基金成立以来至今	-34.35%	1.87%	-27.74%	2.01%	-6.61%	-0.14%

注：本基金合同生效日为2015年7月30日，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 十六、基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立银行结算账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十七、基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠

计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 四、估值程序

1、中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参



考净值和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值的计算精确到 0.001 元, 小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的, 从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值, 并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后, 将中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人, 经基金托管人复核无误后, 由基金管理人按约定对外公布。

## 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时, 视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中, 如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误, 导致其他当事人遭受损失的, 过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿, 承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于: 资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生, 但尚未给当事人造成损失时, 估值错误责任方应及时协调各方, 及时进行更正, 因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担; 由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误, 给当事人造成损失的, 由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任; 若估值错误责任方已经积极协调, 并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正, 则其应当承担相应赔偿责

任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额（参考）净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额（参考）净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额（参考）净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额（参考）净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值、中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值、中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按约定对基金净值予以公布。

## 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于中证指数公司、证券交易所或登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的或即使发现错误但因前述原因无法纠正的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十八、基金的收益与分配

在存续期内，本基金（包括中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案后，如果终止中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 十九、基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数许可使用费；
- 4、基金上市费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、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。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。通常情况下，指数许可使用费按照前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率进行计提，且收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费每日计算，逐日累计，每季支付一次，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的指数许可使用费。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中予以披露。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 二十、基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。



## 二十一、基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在基金管理人网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

（三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

（四）基金份额上市交易公告书

中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁份额 B 上市交易 3 个工作日前，将上市交易公告书登载在指定媒介上。

（五）中海中证高铁份额开始申购、赎回公告

基金管理人应于中海中证高铁份额申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定媒介上公告。

#### （六）基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额上市交易前或开始办理中海中证高铁份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值。

在中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额上市交易前或开始办理中海中证高铁份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过基金管理人网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的中海中证高铁份额的基金份额净值和基金份额累计净值、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、中海中证高铁份额的基金份额净值和基金份额累计净值、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值登载在指定媒介上。

#### （七）中海中证高铁份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明中海中证高铁份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （八）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于基金管理人网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在基金管理人网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

#### （九）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、中海中证高铁份额、中海中证高铁A份额与中海中证高铁B份额基金份额（参考）净值计价错误达基金份额（参考）净值百分之零点五；

- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金登记机构；
- 21、中海中证高铁份额开始办理申购、赎回；
- 22、中海中证高铁份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、中海中证高铁份额发生巨额赎回并延期办理；
- 24、中海中证高铁份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、中海中证高铁份额暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；
- 27、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- 28、中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额上市交易；
- 29、中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额停复牌或终止上市；
- 30、本基金实施基金份额折算；
- 31、中国证监会规定的和基金合同约定的其他事项。

#### （十）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （十一）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十二）资产支持证券的投资情况

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管

理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值、中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值、中海中证高铁份额的基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 二十二、风险揭示

### 一、市场风险

本基金为股票型证券投资基金，投资组合主要由各种证券组成，证券市场价格因受到各种因素的影响而引起的波动，将使本基金收益水平变化而产生风险。本基金的市场风险主要来源于标的指数成份股和备选成份股股票资产与债券资产市场价格的波动，风险因素主要包括：

1、政策风险。因国家的各项宏观政策，如货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等发生变化，导致证券市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，各行业和证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金主要投资于上市公司的股票与债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。市场利率的波动会导致证券市场的价格和收益率的变动，同时影响上市企业的融资成本和利润水平等，进而对本基金的收益水平产生影响，从而产生风险。

4、通货膨胀风险。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值并产生风险。

5、信用风险。信用风险主要指信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。当证券的信用等级发生变化时，可能会导致证券的价格变动，从而产生风险。

6、再投资风险。再投资获得的收益又被称做利息的利息，这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

7、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术变革、新产品研发、竞争加剧等风险。如果本基金所投资的上市公司基本面或发展前景发生变化，可能导致其股价的下跌，或者可分配利润的降低，使基金预期收益产生波动。虽然基金可以通过分散化投资来减少风险，但不能完全规避。

## 二、管理风险

### (1) 管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，或者由于基金数量模型设计不当或实施差错导致基金收益水平偏离业绩基准的风险。对主要业务人员（如基金经理）的依赖也可能产生管理风险。本基金管理人和基金托管人因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善，也构成了本基金的管理风险。

### (2) 新产品创新带来的风险

随着中国证券市场不断发展，各种投资工具和投资方式也将被逐步引入，这些新的投资工具和投资方式在为基金资产提供保值增值功能的同时，也会产生一些新的风险。同时，基金管理人也可能因为对这些新的投资产品的不熟悉而发生投资错误，产生投资风险。

## 三、流动性风险

本基金面临的流动性风险主要表现在以下几方面：建仓成本控制不力，建仓时效不高；基金资产变现能力差，或变现成本高；在投资人大额赎回时缺乏应对手段；证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

### (1) 市场整体流动性问题

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本基金的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。这种风险在发生大额申购和大量赎回时表现尤为突出。

### (2) 市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本基金在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加基金投资成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。



#### 四、参与融资融券风险

待证券投资基金参与融资融券业务的相关规定颁布后，基金管理人可以根据相关法律法规的规定，在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务。

融资融券交易作为证券市场一项具有重要意义的创新交易机制，蕴含着相比以往普通交易更复杂的风险。除具有普通交易具有的市场风险外，融资融券交易还蕴含其特有的风险。

(1) 杠杆交易风险。融资融券交易在投资规模上对本基金提供了一定比例的交易杠杆，在遭受亏损时，亏损将进一步放大。此外，融资融券交易需要支付利息费用。

(2) 强制平仓风险。融资融券交易中，本基金与证券公司间除了普通交易的委托买卖关系外，还存在着较为复杂的债权债务关系，以及由于债权债务产生的担保关系。证券公司为保护自身债权，对本基金相关账户的资产负债情况实时监控，在一定条件下可能对本基金担保资产执行强制平仓。

(3) 监管风险。监管部门和证券公司在融资融券交易出现异常、或市场出现系统性风险时，都将对融资融券交易采取监管措施，以维护市场平稳运行，甚至可能暂停融资融券交易。这些监管措施将对本基金进行的融资融券交易产生影响。

(4) 其他风险。如果中国人民银行规定的同期金融机构贷款基准利率调高，证券公司将相应调高融资利率或融券费率，本基金将面临融资融券成本增加的风险。

#### 五、权证投资风险

权证投资主要有如下风险：

(1) 杠杆效应风险。权证是一种高杠杆投资工具，其价格只占标的资产价格的较小比例。一旦判断失误，有可能在短时间内蒙受全额或巨额的损失。

(2) 时间风险。与其他的有价证券不同，权证有一定的存续期限，且其时间价值会随着时间消逝而快速递减。到期以后（不含到期日），权证价值将为0。

## 六、本基金的特有风险

### 1、本基金分级结构运作的特有风险

本基金作为分级基金，中海中证高铁A份额与中海中证高铁B份额的运作有别于普通的开放式基金与封闭式基金，所以投资者投资于本基金还将面临以下特有风险：

#### （1）上市交易的风险

本基金在基金合同生效后，中海中证高铁A份额和中海中证高铁B份额在上海证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能发生因中海中证高铁A份额与中海中证高铁B份额的规模可能较小或交易量不足，导致投资者不能迅速、低成本地变现或买入的风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

#### （2）中海中证高铁B份额持有人的特有风险

由于中海中证高铁B份额具有高杠杆特性，呈现出预期风险高、预期收益高的特征。在标的指数持续下跌的市场环境下，中海中证高铁B份额的价格杠杆倍数一般会增加（价格杠杆倍数是指中海中证高铁份额的基金份额净值/中海中证高铁B份额的基金份额参考净值\*初始杠杆）；而在标的指数持续上涨的市场环境下，中海中证高铁B份额的价格杠杆倍数一般会下降。因此，中海中证高铁B份额的持有人会因价格杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

#### （3）份额配对转换业务中存在的风险

本基金基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理中海中证高铁份额与中海中证高铁A份额、中海中证高铁B份额之间的份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变中海中证高铁A份额与中海中证高铁B份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格变化；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### （4）基金份额的折/溢价交易风险

中海中证高铁A份额与中海中证高铁B份额上市交易后，基金份额的交易价格与其基金份额参考净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。对于中

海中证高铁A份额与海中证高铁B份额，尽管在份额配对转换机制下，一份海中证高铁A份额与一份海中证高铁B份额的市价总和将与两份海中证高铁份额的净值之间具有逼近的趋势。但是，海中证高铁A份额与海中证高铁B份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于份额配对转换下套利机制的影响，海中证高铁A份额与海中证高铁B份额的交易价格可能会相互影响。

#### （5）份额折算风险

1) 在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为1份），余额计入基金财产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

2) 份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

新增份额可能面临无法赎回的风险是指从场内购买海中证高铁A份额或海中证高铁B份额的一部分投资者可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而只有具备基金销售资格的证券公司才可以允许投资者赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买海中证高铁A份额或海中证高铁B份额，在其参与份额折算后，则折算新增的中海中证高铁份额并不能被赎回。此风险需要引起投资者注意，投资者可以选择在份额折算前将海中证高铁A份额或海中证高铁B份额卖出，或者将新增的中海中证高铁份额通过转托管业务转入具有基金销售资格的证券公司后赎回基金份额。

#### （6）风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基金份额折算后，海中证高铁A份额持有人或海中证高铁B份额持有人将会获得一定比例的中海中证高铁份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

#### （7）基金的收益分配

在存续期内，本基金（包括海中证高铁份额、海中证高铁A份额、海中证高铁B份额）将不进行收益分配。基金管理人将根据基金合同约定对本基金

的中海中证高铁A份额和中海中证高铁B份额实施份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过分拆卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

## 2、指数投资的特有风险

### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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）标的指数波动的风险

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、投资人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）基金投资组合回报与目标指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离：

1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。

2) 由于目标指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在目标指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。

3) 成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率，产生跟踪误差。

4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪误差。

5) 由于基金应对日常赎回保留的少量现金、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，使基金投资组合与目标指数产生跟踪误差。

6) 其他因素产生的跟踪误差。如未来法律法规允许的情况下的卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪误差；因基金申购与赎回带来的现金变动等。

### （4）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，如出现变更目标指数的情形，本基

金将变更目标指数。基于原目标指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的目标指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

## 七、其他风险

### 1、大额申购/赎回风险

本基金是开放式基金，基金规模将随着投资人对基金单位的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量申购而导致基金管理人在短期内被迫持有大量现金；或由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售所持有的证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

### 2、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资人在赎回基金单位时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

### 3、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

4、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

### 5、其他意外导致的风险。

## 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估值和变现；
  - (4) 制作清算报告；
  - (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
  - (7) 对基金剩余财产进行分配。
- 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额各自的应计分配比例，并据此由中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额各自的基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十四、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利、义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

本基金同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。如果中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的运作出现终止，则在终止中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依照法律法规及基金合同的规定，依法转让其持有的中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额，依法申请赎回其持有的中海中证高铁份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资



价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利、义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定中海中证高铁份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及

报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理中海中证高铁份额的申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能

生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利、义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设银行结算账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，

保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的银行结算账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值与中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值、中海中证高铁份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一份基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》，基金合同另有约定的除外；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人（以基金管

理人收到提议当日的基金份额计算，下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 终止中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；

(13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整中海中证高铁份额的申购费率、调低赎回费率或在现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式；

(4) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(6) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(7) 经中国证监会允许，基金管理人、基金登记机构、销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，

并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、单独或合计代表中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集或在规定时间内未能作出书面回复，单独或合计代表中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、单独或合计代表中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：



- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对, 汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示, 有效的中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的基金份额不少于本基金在权益登记日各类别基金总份额的二分之一 (含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额少于本基金在权益登记日各类别基金份额的二分之一, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内, 就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额应不少于在权益登记日各类别基金份额的三分之一 (含三分之一)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时, 通讯开会的方式视为有效:

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后, 在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人 (如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人) 到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人 (如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人) 和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见; 基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的, 不影响表决效力;

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的, 基金份额持有人所持有的中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的基金份额不小于在权益登记日各自基金份额的二分之一 (含二分之一); 若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额小于在权益登记日各类别基金份额的二分之一, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内, 就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表中海中证高铁份额、中海中证高

铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额各类别基金份额三分之一以上（含三分之一）的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主

持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开

审议、逐项表决。

### （七）计票

#### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

#### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序

#### (一) 《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

#### (二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### 四、争议解决方式

各方当事人同意，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，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十五、 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：中海基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

邮政编码：200120

法定代表人：黄鹏

成立日期：2004 年 3 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2004]24 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.466667 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）

#### （二）基金托管人

名称：招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

邮政编码：518026

法定代表人：宫少林

成立时间：1993 年 8 月

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]78 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 46.61 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财



务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证高铁产业指数的成份股、备选成份股、其他股票、债券、债券回购、资产支持证券、衍生工具（权证等）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相关规定）。

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。

待证券投资基金参与融资融券业务的相关规定颁布后，基金管理人在履行适当程序后，可以根据相关法律法规的规定，在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；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；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。

本基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定, 对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

1. 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%, 投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%, 且不低于非现金资产的 80%;

2. 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;

3. 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;

4. 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;

5. 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

6. 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;

7. 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;

8. 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;

9. 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

10. 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

11. 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

12. 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

13. 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%; 本基金持有的同一流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 2%;

14. 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

15. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督

基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单和结算交易方式进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易结算方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行的股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产

生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的安全责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2.基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3.本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4.基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能

进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5.基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6.相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额（参考）净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(七) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(八) 基金管理人应义务配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

(十) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，

同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额（参考）净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

(三) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 四、基金财产保管

#### (一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5.基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

6.对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7.除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）募集资金的验证

1、基金募集期间募集的资金应划入本基金在中国证券登记结算有限公司开立的备付金账户。该账户由基金管理人或由接受基金管理人委托代为办理登记业务的机构开立并管理。

2.基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的托管资金专门账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3.若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## （三）基金托管资金专门账户的开立和管理

1.基金托管人以基金的名义在具有基金托管资格的商业银行开设托管资金



专门账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2.托管资金专门账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

3.托管资金专门账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

#### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

1.基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2.基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4.基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5.若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

《基金合同》生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开设和管理

1.因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和《基金合同》的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2.法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1.基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。中海中证高铁份额的基金份额净值是按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个交易日计算基金资产净值及中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值，并按规定公告。

2.基金管理人应每个交易日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或

《基金合同》的规定暂停估值时除外。基金管理人每个交易日对基金资产估值后，将中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、基金托管协议的变更、终止

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会

备案。

(二) 基金托管协议终止出现的情形

1. 《基金合同》终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 二十六、对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者，基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、基金份额持有人登记服务

基金管理人委托登记机构为基金份额持有人提供登记服务。基金管理人将敦促基金登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、转托管；基金转换和非交易过户；基金份额持有人名册的管理；基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### 二、交易资料的寄送

1、账户资料：基金投资者开户申请被受理的2个工作日后（T+2日后），可以到销售网点查询和打印基金账户开户确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向定制纸质对账单的投资者寄送包含基金账户信息在内的对账单。

2、基金交易确认查询服务：基金投资者在交易申请被受理的2个工作日后（T+2日后），可以到销售网点查询和打印该项交易的确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向定制纸质对账单的投资者寄送包含基金认购确认信息在内的对账单。

3、每季度结束后20个工作日内，基金管理人将向该季度发生过交易的定制纸质对账单的基金份额持有人邮寄该季度对账单。每年度结束后30个工作日内，向所有定制纸质对账单的基金份额持有人寄送年度对账单。

4、对于未主动定制对账单服务的投资者，基金管理人将统一提供电子对账单（包含电子邮件或短信形式，按账户资料完善程度，优先提供电子邮件对账单）。

### 三、客户服务中心电话服务

客户服务中心提供24小时自动语音查询服务。基金份额持有人可进行基金账户余额、申购与赎回交易情况查询、基金产品与传真服务等信息的查询。

客户服务中心提供每周五天，每天不少于8小时的人工热线咨询服务。持有人可通过客服热线电话：400-888-9788或021-38789788享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单寄送地址资料修改等专项服务。

### 四、网上交易服务

基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网上交易平台可以办理基金认购、申购、赎回方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。个人投资者可以直接登录基金管理人网站www.zhfund.com办理“网上开户”和“网上交易”业务，适用银行卡详见基金管理人网站www.zhfund.com网上交易平台。

在技术条件成熟时，基金管理人还将提供支持其他银行卡种的网上交易业务。

### 五、定期定额投资计划

基金管理人可通过基金管理人网站[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)和销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

### 六、信息定制服务

基金持有人可以登录拨打客服热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按持有人的定制提供信息。可定制的信息包括：每周基金净值、交易确认信息、投资者服务刊物、公司公告等。基金管理人可以根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

## 七、投资者投诉受理服务

投资者可以通过代销机构网点或基金管理人客服热线电话、基金管理人网站留言栏目、信函及电子邮件等形式对基金管理人或销售网点所提供的服务进行投诉。

客服热线电话投诉、电子邮件投诉、信函投诉、网站留言是主要投诉受理渠道，基金管理人客户服务部负责管理投诉电话、投诉邮箱。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各代销机构和基金管理人分别管理。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复；对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在投诉送达基金管理人的2个工作日之内做出回复。对于非工作日提出的投诉，顺延至下一工作日完成回复。

客户服务部邮箱：[service@zhfund.com](mailto:service@zhfund.com)

八、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十七、其他应披露的事项

- 1、2017-03-06 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京电盈基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告
- 2、2017-03-16 中海中证高铁产业指数分级证券投资基金更新招募说明书（2017年第1号）
- 3、2017-03-16 中海中证高铁产业指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2017年第1号）
- 4、2017-03-17 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为销售机构的公告
- 5、2017-03-20 中海基金管理有限公司关于旗下基金参加上海汇付金融服务有限公司费率优惠活动的公告
- 6、2017-03-28 中海基金管理有限公司关于旗下基金参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告
- 7、2017-03-31 中海中证高铁产业指数分级证券投资基金2016年年度报告
- 8、2017-03-31 中海中证高铁产业指数分级证券投资基金2016年年度报告摘要
- 9、2017-04-11 中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告
- 10、2017-04-21 中海中证高铁产业指数分级证券投资基金2017年第1季度报告
- 11、2017-04-26 中海基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告
- 12、2017-04-27 中海基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告
- 13、2017-04-28 中海基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告
- 14、2017-04-29 中海基金管理有限公司关于停止深圳富济财富管理有



## 限公司代销旗下基金业务的公告

- 15、2017-04-29 中海基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告
- 16、2017-05-10 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告
- 17、2017-05-15 中海基金管理有限公司关于参加武汉市伯嘉基金销售有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告
- 18、2017-07-01 中海中证高铁产业指数分级证券投资基金半年度最后一日净值公告
- 19、2017-07-08 中海基金管理有限公司旗下基金更换会计师事务所的公告
- 20、2017-07-13 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天津万家财富资产管理有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告
- 21、2017-07-18 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华西证券股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告
- 22、2017-07-20 中海基金管理有限公司关于《中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天津万家财富资产管理有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告》的更正公告
- 23、2017-07-21 中海中证高铁产业指数分级证券投资基金2017年第2季度报告
- 24、2017-07-27 关于中海中证高铁产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告
- 25、2017-07-27 关于中海中证高铁产业指数分级证券投资基金定期份额折算业务期间暂停申购及赎回业务的公告

## 二十八、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的住所、登记机构、基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得招募说明书的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)）查阅和下载招募说明书。

## 二十九、 备查文件

### 一、 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中海中证高铁产业指数分级证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、注册登记协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、关于申请募集中海中证高铁产业指数分级证券投资基金之法律意见书
- 8、中国证监会要求的其他文件

### 二、 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的住所。

### 三、 查阅方式

投资者可到基金管理人和基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。

中海基金管理有限公司  
二〇一七年九月十三日