

# 南方基金管理股份有限公司关于南方中证高铁产业指数分级证券投资基金实施转型的公告

南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）于2020年9月25日至2020年10月28日以通讯方式组织召开了南方中证高铁产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议了《关于南方中证高铁产业指数分级证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。《议案》于2020年10月29日获得表决通过，自该日起基金份额持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。本公司已于2020年10月30日发布了《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议公告》”）。根据《决议公告》，现就转型相关事项公告如下：

## 一、更名

基金名称由“南方中证高铁产业指数分级证券投资基金”变更为“南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）”。

## 二、取消分级运作机制

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金转型为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）后，取消分级运作机制。在基金份额持有人大会审议通过后且前述转型正式实施后，高铁A份额、高铁B份额、南方高铁份额将根据转型方案的约定全部转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额，因而也不再设置基金份额的分级、折算、配对转换等机制。

## 三、高铁A份额、高铁B份额的终止上市

基金管理人已按照深圳证券交易所的业务规则和《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请高铁A份额、高铁B份额的终止上市。具体安排详见基金管理人2020年11月25日发布的《关于南方中证高铁产业指数分级证券投资基金之高铁A份额、高铁B份额终止上市的公告》。

## 四、基金份额的转换

本基金的份额转换基准日为2020年11月30日。南方高铁份额、高铁A份额、高铁B份额将于份额转换基准日进行转换，最终将转换成基金份额净值为1.0000元的南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额。在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

证券登记系统登记在册的南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额将转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）的场内份额，在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登记在册的南方高铁份额将转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）的场外份额。

由南方高铁份额的场内份额或南方高铁份额的场外份额转换的南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额数=南方高铁份额的场内份额或南方高铁份额的场外份额数×份额转换基准日每份南方高铁份额净值÷1.0000

由高铁 A 份额转换的南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额数=高铁 A 份额的场内份额数×份额转换基准日每份高铁 A 份额的基金份额参考净值÷1.0000

由高铁 B 份额转换的南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额数=高铁 B 份额的场内份额数×份额转换基准日每份高铁 B 份额的基金份额参考净值÷1.0000

基金份额转换后，南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）的基金份额净值为 1.0000 元，南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）的场内份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。基金份额转换后，南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）的场外份额数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产。由于上述基金份额数计算方法产生的误差，基金份额持有人可能将面临资产净值减小的风险；对于持有份额数较少的南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额的场内份额持有人，将面临因持有的基金份额转换后份额数不足 1 份而被计入基金财产的风险。

## 五、调整自动清盘条款

《南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金合同》约定，连续 30 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 1 亿元情形的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。

## 六、变更后基金的基本情况

- 1、基金的名称：南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）
- 2、基金类型：股票型
- 3、基金运作方式：上市契约型开放式（LOF）
- 4、基金存续期限：不定期
- 5、基金份额的上市交易

基金合同生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可申请本基金在深圳证券交易所上市交易。

## 6、投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。

## 7、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证（下同））、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：在建仓完成后，本基金 80%以上的基金资产投资于股票（含存托凭证）。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

## 8、投资限制

（1）本基金 80%以上的基金资产投资于股票（含存托凭证）；

（2）本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（3）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(12) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(13) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%。

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(14) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(15) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行；

(16) 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。

## 9、标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数：中证高铁产业指数及其未来可能发生的变更。

本基金的业绩比较基准：标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

#### 10、风险收益特征

本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

#### 11、摆动定价

指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

#### 12、费率水平

(1) 基金管理人的管理费：1.0%/年；

(2) 基金托管人的托管费：0.2%/年；

(3) 基金的指数许可使用费：按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法支付。

#### 13、收益分配原则

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 14、申购费、赎回费

(1) 本基金的场外申购费率最高不高于 0.6%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

申购金额 (M)	场外申购费率
M < 100 万	0.6%
M ≥ 100 万	每笔 500 元

本基金的场内申购费率为 0。

投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

(2) 本基金场外赎回费率最高不超过 1.5%，随申请份额持有时间增加而递减（其中 1 年为 365 天）。具体如下表所示：

持有期限 (T)	场外赎回费率
T < 7 天	1.5%
7 日 ≤ T < 1 年	0.5%
1 年 ≤ T < 2 年	0.25%
T ≥ 2 年	0

本基金的场内赎回费率为 0.5%，但对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费。

#### 七、《南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金合同》的生效及后续安排

自 2020 年 12 月 1 日起，南方中证高铁产业指数分级证券投资基金正式转型为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）。基金名称将由“南方中证高铁产业指数分级证券投资基金”更名为“南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）”。《南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

《南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，基金管理人将根据相关规定办理南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）的申购赎回、上市交易等业务。

#### 八、其他修改

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套准则等法

律法规陆续颁布和实施,基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的南方中证高铁产业指数证券投资基金(LOF)的产品特征修订基金合同的相关内容。

## 九、基金转换的特别风险提示

### 1、高铁 A 份额和高铁 B 份额转换后风险收益特征发生较大变化的风险

份额转换后,高铁 A 份额持有人原持有的高铁 A 份额将变为南方中证高铁产业指数证券投资基金(LOF)场内份额,基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。份额转换后,高铁 B 份额持有人原持有的高铁 B 份额将变为南方中证高铁产业指数证券投资基金(LOF)场内份额,基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。

由于南方中证高铁产业指数证券投资基金(LOF)为股票型基金,一般而言,其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金和混合型基金。

### 2、高铁 A 份额和高铁 B 份额的流动性风险

高铁 A 份额和高铁 B 份额转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金(LOF)场内份额前,高铁 A 份额和高铁 B 份额的持有人有两种方式退出:1)在场内按市价卖出基金份额;2)在场内买入等量的对应份额(即高铁 A 份额持有人买入等量的高铁 B 份额,或者高铁 B 份额持有人买入等量的高铁 A 份额),合并为南方高铁份额,按照南方高铁份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

由于高铁 A 份额和高铁 B 份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回,场内份额数量可能发生较大下降,可能出现场内流动性不足的情况,特提请投资者注意流动性风险。

### 3、转换前存在溢价交易的高铁 A 份额和高铁 B 份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

基金份额转换基准日前(不含基金份额转换基准日),高铁 A 份额和高铁 B 份额仍可正常交易。期间,高铁 A 份额和高铁 B 份额可能存在折溢价交易情形,其折溢价率可能发生较大变化。

由于基金份额转换基准日日终,高铁 A 份额和高铁 B 份额均按各自的基金份额参考净值(而不是二级市场价格)转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金(LOF)场内份额,如果投资者在转换前以溢价买入,转换后可能遭受较大损失。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

投资者应密切关注高铁 A 份额和高铁 B 份额的基金份额参考净值变化情况,可通过本公司网站([www.nffund.com](http://www.nffund.com))等方式进行查询。

### 4、高铁 A 份额和高铁 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化的风险

基金份额转换基准日日终，高铁 A 份额和高铁 B 份额均按各自的基金份额参考净值转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）场内份额，并进行取整计算（最小单位为 1 份），因此高铁 A 份额和高铁 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化。

5、高铁 A 份额和高铁 B 份额转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）场内份额后无法办理场内赎回的风险

高铁 A 份额和高铁 B 份额转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）场内份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。具有二级市场交易资格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，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回场内基金份额。如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买高铁 A 份额或高铁 B 份额，转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）场内份额后可能无法办理场内赎回。对于无法办理场内赎回的投资者，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、在南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务；在南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，存在一定的流动性风险。

本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)）查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 400-889-8899 咨询。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

南方基金管理股份有限公司

2020 年 11 月 25 日