

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金 之高铁 A 级与高铁 B 级上市交易公告书

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

公告日期：二〇一五年六月十七日

目录

一、	重要声明与提示	3
二、	基金概览	3
三、	基金的募集与上市交易	4
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人	7
五、	基金主要当事人简介	10
六、	基金合同摘要	13
七、	基金财务状况	13
八、	基金投资组合	14
九、	重大事件揭示	16
十、	基金管理人承诺	16
十一、	基金托管人承诺	16
十二、	基金上市推荐人意见	17
十三、	备查文件目录	17
附件：	基金合同摘要	18

一、 重要声明与提示

《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，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”）管理人南方基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人中国银河证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2015年5月22日《上海证券报》、2015年5月25日《中国证券报》及南方基金管理有限公司网站（www.nffund.com）上公告的《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、 基金概览

1、基金名称：南方中证高铁产业指数分级证券投资基金

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金份额分级：

本基金的基金份额包括南方中证高铁产业指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称“高铁基金”，基金代码：160135）、南方中证高铁产业指数分级证券投资基金之A份额（场内简称“高铁A级”，基金代码：150293）与南方中证高铁产业指数分级证券投资基金之B份额（场内简称“高铁B级”，基金代码：150294）。其中，高铁A级份额和高铁B级份额的数量保持1:1的比例不变。

5、本基金的存续期为不定期。

6、高铁A级、高铁B级与高铁基金的资产合并运作。

7、南方中证高铁产业指数分级证券投资基金之基础份额的申购与赎回：投资人可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和其他场外销售机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，具体销售网点和会员单位的

名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。高铁A级份额与高铁B级份额只上市交易，不接受申购和赎回。

8、场内份额配对转换：场内份额配对转换指根据基金合同约定，南方高铁份额与高铁A份额和高铁B份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份场内南方高铁份额按照1：1的份额配比转换成1份高铁A份额与1份高铁B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每1份高铁A份额与1份高铁B份额按照1：1的基金份额配比转换成2份场内南方高铁份额的行为。场外的南方高铁份额不进行份额配对转换。在场外的南方高铁份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

9、基金份额折算：基金份额定期折算的频率为每年折算1次。基金份额不定期折算的条件是基础份额的基金份额净值大于或等于1.5000元时，或高铁B级的基金份额参考净值小于或等于0.2500元时。有关基金份额折算的约定，参见基金合同“二十、基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

10、基金份额总额：截至2015年6月15日，本基金的份额总额为639,238,860.88份；其中，基础份额为295,526,819.88份；高铁A级为171,856,020份；高铁B级为171,856,021份。

11、基金份额净值：截至2015年6月15日，基础份额的基金份额净值为1.0000元，高铁A级的基金份额参考净值为1.0010元，高铁B级的基金份额参考净值为0.9990元。

12、本次上市交易的基金份额简称及交易代码：份额简称：高铁A级，交易代码：150293；份额简称：高铁B级，交易代码：150294。

13、本次上市交易份额：高铁A级：171,856,020份；高铁B级：171,856,021份

14、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

15、上市交易日期：2015年6月23日

16、基金管理人：南方基金管理有限公司

17、基金托管人：中国银河证券股份有限公司

18、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、 基金的募集与上市交易

（一）本次基金上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的注册机构和注册批复文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]885号。

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金存续期：不定期

4、发售日期：2015年5月25日至2015年6月5日

5、发售价格：1.00元人民币

6、发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

7、发售机构：

（1）场外销售机构：

1) 直销机构：南方基金管理有限公司

2) 代销机构：中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、汉口银行股份有限公司、乌鲁木齐市商业银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、河北银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、光大证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、湘财证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、安信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、信达证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、中航证券有限公司、国盛证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、大同证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、日信证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、联讯证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、泛华普益基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、海银基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、北京增财基金销售有限公司（上述排名不分先后）

(2) 场内代销机构:

场内代销机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

1) 已经具有基金代销业务资格的深交所会员单位, 具体名单如下:

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后, 若有变动, 以深圳证券交易所网站披露为准)。

2) 本基金募集期结束前获得基金代销资格同时具备深交所会员单位资格的证券公司也可代理场内的基金份额发售。具体名单可在深交所网站查询, 本基金管理人将不就此事项进行公告。

3) 尚未取得基金代销资格, 但属于深交所会员的其他机构, 可在本基金上市交易后, 代理投资者通过深交所交易系统参与本基金的上市交易。

8、验资机构名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为639, 138, 030. 65元人民币, 认购资金在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计102,361.63人民币, 按照本基金基金合同和招募说明书的约定, 其中100,830.23元折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户, 归基金份额持有人所有; 其余的1,531.40元为利息折份额计算尾差归入基金财产。

本次募集有效认购总户数为25196户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,募集期募集资金及利息结转的基金份额共计639, 238, 860. 88份, 场外认购的基金份额为295, 526, 819. 88份(含募集期利息结转的份额), 场内认购的基金份额为343, 712, 041. 00份(含募集期利息结转的份额)。其中本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为0份(含募集期利息结转的份额), 占本基金总份额的比例为0%; 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人认购本基金份额总量的数量区间为0; 本基金基金经理认购本基金份额总量的数量区间为0。

募集资金已于2015年6月10日划入本基金在基金托管人处开立的基金托管专户。

10、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《南方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”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，南方基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2015年6月10日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2015年6月10日

12、基金合同生效日的基金份额总额：639,238,860.88份

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2015】282号

2、上市交易日期：2015年6月23日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、基础份额简称及代码：南方中证高铁产业指数分级，场内简称：高铁基金，基金代码：160135。

5、上市交易份额简称及代码：高铁A级，基金代码：150293；高铁B级，基金代码：

150294。6、本次上市交易份额：高铁A级：171,856,020份；高铁B级：171,856,021份

7、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值及基础份额的基金份额净值、高铁A级份额和高铁B级份额的基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率I”揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的高铁基金份额，基金份额持有人符合相关办理条件的前提下，将其分拆为高铁A级份额和高铁B级份额即可上市流通；对于托管在场外的份额，基金份额持有人符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为高铁A级份额和高铁B级份额即可上市流通。

9、本基金开通跨系统转托管业务日期：2015年6月23日，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。

四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）本基金基金份额持有情况

截至 2015 年 6 月 15 日，南方中证高铁产业指数分级证券投资基金之基础份额（“高铁基金”）的持有人总户数为 23,062 户，其中场外持有人总户数为 23,062 户；高铁 A 级持有人总户数为 2,123 户，全部为场内持有人；高铁 B 级持有人总户数为 2,123 户，全部为场内持有人；高铁基金平均每户持有的场外基金份额为 12,814.45 份，高铁 A 级平均每户持有的场内基金份额为 80,949.61 份，高铁 B 级平均每户持有的场内基金份额为 80,949.61 份。

（二）场内基金份额持有人结构

高铁 A 级：场内机构投资者持有的基金份额 29,658,994.00 份，占比 17.2580%；场内个人投资者持有的基金份额 142,197,026.00 份，占比 82.7420%。

高铁 B 级：场内机构投资者持有的基金份额 29,658,995.00 份，占比 17.2580%；场内个人投资者持有的基金份额 142,197,026.00 份，占比 82.7420%。

（三）截至 2015 年 6 月 15 日，场内高铁 A 级基金份额前十名持有人情况

1、基金简称：高铁 A 级 基金代码：150293

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
1	李鹏	10,500,204.00	6.11%
2	上海大正投资有限公司	9,000,437.00	5.24%
3	赵峰	3,815,074.00	2.22%
4	李星影	3,500,408.00	2.04%
5	深圳平安大华汇通财富—平安银行—平安汇通—艾方多策略对冲增	2,500,219.00	1.45%
6	北京千石创富—华泰证券—千石资本—艾方多策略对冲增强 6 号	2,500,218.00	1.45%
7	完美（中国）有限公司	2,500,170.00	1.45%

8	蔡镛骏	2,500,049.00	1.45%
9	上海得金投资中心（有限合伙）	2,500,049.00	1.45%
10	北京千石创富—华泰证券—南京银行股份有限公司	2,500,049.00	1.45%
合计		41,816,877.00	24.33%

2、基金简称：高铁B级 基金代码：150294

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
1	李鹏	10,500,204.00	6.11%
2	上海大正投资有限公司	9,000,437.00	5.24%
3	赵峰	3,815,074.00	2.22%
4	李星影	3,500,408.00	2.04%
5	北京千石创富—华泰证券—千石资本—艾方多策略对冲增强6号	2,500,219.00	1.45%
6	深圳平安大华汇通财富—平安银行—平安汇通—艾方多策略对冲增	2,500,218.00	1.45%
7	完美（中国）有限公司	2,500,170.00	1.45%
8	银河资本—中国银行—银河资本—艾方多策略对冲套利2号资产	2,500,049.00	1.45%
9	蔡镛骏	2,500,048.00	1.45%

10	上海得金投资中心（有限合伙）	2,500,048.00	1.45%
11	北京千石创富—华泰证券—南京银行股份有限公司	2,500,048.00	1.45%
合计		44,316,923.00	25.79%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、 基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：南方基金管理有限公司
- 2、法定代表人：吴万善
- 3、总裁：杨小松
- 4、注册资本：人民币3亿元
- 5、住所及办公地址：深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]4号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：440301103129537
- 8、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
- 9、股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。
- 10、内部组织结构及职能：

委员会名称	职责
投资决策委员会	指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则
风险控制委员会	研究制定风险管理政策和制度，提出重大风险的解决方案，指导和监督各职能部门开展风险管理工作
估值委员会	负责公司估值原则的确定及调整；对特殊品种及特殊情况的估值予以确定。
信息技术治理委员会	负责公司中长期信息技术的规划及信息技术治理工作。
市场营销委员会	审议公司营销、宣传、产品设计等方案；督促并指导市场体系各部门的工作；
年金投资决策委员会	对年金大类资产配置进行决策。
部门名称	职能定位

投资部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
专户投资管理部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理
国际业务部	负责国际基金的投资管理与业务合作
量化投资部	负责量化基金、指数基金的投资运作及量化投资策略、金融工程的研究
产品开发部	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
养老金业务部	负责企业年金基金的市场开拓与服务
机构业务部	负责机构直销及一对一专户产品的业务拓展及服务
企划部	负责品牌及产品推广、营销策划、媒体宣传、公共关系维护
市场管理部	负责对各营销中心的监督管理、代销渠道总部的开发及维护、渠道经理的培训等
北京分公司	负责所辖片区的渠道、机构销售业务及政府部门、监管机构、行业协会的公共关系维护和相关接待及后勤服务工作
上海分公司	
合肥分公司	
成都分公司	
深圳分公司	
电子商务部	负责基金产品的网上销售及公司网站建设
客户服务部	为基金持有人提供专业服务及投资理财资讯服务
合肥理财中心	CALL-CENTER 客户营销及服务中心
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理
风险管理部	负责投资风险识别、评估、控制、应急处理及业绩归因分析
交易管理部	负责执行基金、组合交易指令，实施一线风险监控
信息技术部	负责信息技术平台建设，保障业务开展
运作保障部	负责投资交易与产品销售的后台清算、核算及投资运作的定期信息披露
人力资源部	负责人力资源管理与服务，使公司获取并保持人力资源竞争优势
财务部	负责公司的财务管理工作
办公室	负责公司战略研究、创新业务研究与孵化、办公文秘管理、董事会事务、党群工作管理
行政管理部	负责建设、完善和组织公司行政后勤管理、基建管理、招投标与采购管理、工会事务管理和公益事业管理

11、人员情况：

截止到 2015 年 3 月，我公司共有员工 414 人，博士 20 人、硕士 234 人、本科 141 人、其他 19 人。

12、信息披露负责人：鲍文革

咨询电话：400-889-8899

13、基金管理业务情况简介：

截至 2015 年 3 月底，南方基金管理有限公司旗下共管理 60 只开放式基金及多只专户产品、社保投资组合和企业年金投资组合，管理总资产规模约 2800 亿元人民币，旗下管理的开放式基金有南方稳健、南方宝元、南方避险、南方现金、南方积配、南方高增、南方多利、南稳贰号、南方绩优、南方隆元、南方成份、南方价值、南方盛元、南方恒元、南方 300 联接、南方 500、深成 ETF、南方深成、南方全球、南方策略、小康 ETF、南方小康、南方广利、南方金砖、南方成长、南方 50 债、南方保本、380ETF、南方 380、南方中国、南方消费、南方金利、南方润元、南方理财 14 天、南方高端装备、南方理财 60 天、南方安心、南方理财 30 天、500ETF、300ETF、南方永利、南方中票、南方稳利、南方丰元、南方聚利、南方医保、南方现金通、南方新优享、南方通利、中国梦基金、南方薪金宝、南方天元、南方启元、500 医药、南方绝对收益、南方理财金、恒指 ETF、南方产业活力、南方双元、南方创新经济；以及多个专户产品、全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。

14、本基金基金经理简介

雷俊先生，北京大学工学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员；2014 年 12 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任大数据 100 基金经理。

(二) 基金托管人

1、基本情况

名称：中国银河证券股份有限公司

注册地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

成立日期：2007 年 1 月 26 日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2007]25 号

注册资本：75.37 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】629 号

联系人：李蔚

联系电话：010-66568278

中国银河证券股份有限公司是中国证券行业领先的综合性金融服务提供商，提供经纪、销售和交易、投资银行等综合证券服务。2007年1月26日，公司经中国证监会批准，由中国银河金融控股有限责任公司作为主发起人，联合4家国内机构投资者共同发起正式成立。中央汇金投资有限责任公司为公司实际控制人。公司本部设在北京，注册资本为人民币75.37亿元。公司于2013年5月22日在香港联合交易所上市，控股股东为中国银河金融控股有限责任公司。

2、主要人员情况

银河证券托管部管理团队具有十年以上银行、公募基金、证券清算等金融从业经验，骨干员工从公司原有运营部门抽调，可为客户提供更多安全高效的资金保管、产品核算及产品估值等服务。

3、基金托管业务经营情况

银河证券托管部于2014年1月正式成立，在获得证券监管部门批准获得托管资格后已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，同时秉承公司“忠诚、包容、创新、卓越”的企业精神，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。

（三）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：杨绍信

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：汪棣 陈熹

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、 基金财务状况

本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付。其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金

比例收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金 2015 年 6 月 15 日资产负债表如下：

资 产	期 末 余 额	负债和所有者权益	期 末 余 额
资 产：		负 债：	
银行存款	39,138,030.65	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	
基金投资		应付赎回款	
债券投资		应付管理人报酬	87,566.71
资产支持证券投资		应付托管费	17,513.35
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款	600,028,349.41	应付税费	
应收利息	64,696.56	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	8,044.00
其他资产	100,830.23	负债合计	113,124.06
		所有者权益：	
		实收基金	639,238,860.88
		未分配利润	-20,078.09
		所有者权益合计	639,218,782.79
资产合计：	639,331,906.85	负债与持有人权益总计：	639,331,906.85

八、 基金投资组合

截止到 2015 年 6 月 15 日，南方中证高铁产业指数分级证券投资基金的投资组合如下：

(一) 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	39,138,030.65	6.12
7	其他资产	600,193,876.20	93.88
8	合计	639,331,906.85	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

（三）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

注：本基金本报告期末未持有股票。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

（五）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

注：本基金本报告期末未持有债券。

（六）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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）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

注：本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注**1、其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	600,028,349.41
3	应收股利	-
4	应收利息	64,696.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	100,830.23
9	合计	600,193,876.20

2、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

3、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算及基础份额的基金份额净值、高铁 A 级份额和高铁 B 级份额的基金份额参考净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；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，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、 基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、 备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

- （一）中国证监会准予南方中证高铁产业指数分级证券投资基金注册的批复
- （二）《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》
- （三）《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金托管协议》
- （四）《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件。

南方基金管理有限公司
二〇一五年六月十七日

附件：基金合同摘要**一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务****(一) 基金管理人的权利与义务**

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、法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、法规规定，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人的利益；
- (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；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法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、赎回和配对转换申请；
- (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、融券及转融通；
- (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/期货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、配对转换、定投和非交易过户等业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高管理费率、托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- (17) 在遵守届时有效的法律法规和监管规定，且对基金份额持有人利益无实质性不

利影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项，基金管理人有权代表基金份额持有人在必要限度内以基金资产作为质押进行融资；

- (18) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；
- (19) 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，确定南方高铁份额申购、赎回的价格、高铁 A 份额和高铁 B 份额的基金份额参考净值；

(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人提供的各项文件或资料在规定时间发出, 并且保证投资人能够按照《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条件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。

(二) 基金托管人的权利与义务

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人的利益;

(4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券账户、为基金办理证券等交易资金清算;

(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》、《托管协议》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资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》及《托管协议》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》、《托管协议》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，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、南方高铁份额的基金份额净值、高铁 A 份额与高铁 B 份额的基金份额参考净值；
- (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》及《托管协议》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》及《托管协议》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) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收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、《基金合同》和《托管协议》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业监督管理机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》及《托管协议》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。

(三) 基金份额持有人的权利和义务

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) 依法转让或申请赎回其持有的南方高铁份额，依法转让其持有的高铁 A 份额或高铁 B 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南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额的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基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权，且相同类别基金份额的同等投票权不因基金份额持有人取得基金份额的方式（场内认申购、场外认申购或上市交易）而有所差异。

本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

（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》，但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，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外；
- (6) 变更基金类别，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外；
- (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，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外；
- (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) 终止高铁 A 份额与高铁 B 份额的运作；
- (12) 终止高铁 A 份额与高铁 B 份额上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (13) 单独或合计持有南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（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;

(14)对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(15)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、基金托管费和其他应由基金承担的费用;

(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》规定的范围内调整本基金的申购费率、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或增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整;

(4)在不违反法律法规、《基金合同》的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;

(5)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(6)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;

(7)当法律法规或中国证监会的相关规定变更时,本基金在履行相关程序后可对资产配置比例进行适当调整;

(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、单独或合计持有南方高铁份额、高铁A份额、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,单独或合计持有南方高铁份额、

高铁 A 份额、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、单独或合计持有南方高铁份额、高铁 A 份额、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，单独或合计代表南方高铁份额、高铁 A 份额、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、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、通讯开会方式召开或法律法规和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，有效的代表南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自基金份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自基金份额少于本基金在权益登记日南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自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南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自基金份额应不少于本基金在权益登记日南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自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召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自基金份额持有人所持有的南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自基金份额不小于在权益登记日南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自基金份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额各自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三分之一以上（含三分之一）南方高铁份额、高铁A份额、高铁B份额各自基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（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，则由出席大会的南方高铁份额、高铁A份额、高铁B份额各自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

基金份额持有人所持每份南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额在其对应的份额类别内有同等表决权。。

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南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额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南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额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。转换基金运作方式、与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，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、基金收益分配原则、执行方式

在存续期内，本基金（包括南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额）不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

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 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休日等，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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、基金合同生效后标的指数许可使用费

本基金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指数使用许可费。

指数使用许可费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

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。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）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）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、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。

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。

基金的投资组合比例为：

本基金80%以上的基金资产投资于股票。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%。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%。

（二）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 80%以上的基金资产投资于股票；
- （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；
- （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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- （14）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%；在任何交易日日终，持有的买入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）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；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；

（15）基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（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。

除上述第（11）项另有约定外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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，但是法律法规或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。

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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，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，遵循持有人利益优先原则，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。

如法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

南方高铁份额的基金份额净值、高铁 A 份额和高铁 B 份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及南方高铁份额的基金份额净值、高铁 A 份额和高铁 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本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，将南方高铁份额的基金份额净值、高铁 A 份额和高铁 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。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（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。对于法律法规规定和基金合同约定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 2 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；

6、基金管理人与基金托管人协商一致或基金资产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

(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，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人根据其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。

八、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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。