

# 南方中证高铁产业指数分级证券投资基金

## 不定期份额折算公告

根据《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当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”）之高铁B份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元时，本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日。

截至2015年8月25日，本基金高铁B份额的基金份额参考净值为0.2006元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以2015年8月26日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

### 一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为2015年8月26日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的南方高铁份额（场内简称“高铁基金”，基金代码：160135，包含场内份额和场外份额）、高铁A份额（场内简称“高铁A级”，基金代码150293）、高铁B份额（场内简称“高铁B级”，基金代码150294）。

### 三、基金份额折算方式

南方高铁份额、高铁A份额、高铁B份额按照《基金合同》“二十、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

当高铁B份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元时，本基金将分别对高铁A份额、高铁B份额和南方高铁份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保高铁A份额和高铁B份额的比例为1:1，份额折算后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均调整为1.0000元。南方高铁份额、高铁A份额和高铁B份额的份额数将相应缩减。具体折算原则及公式如下：

#### （1）高铁B份额

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B}{1.0000}$$

#### （2）高铁A份额

折算后高铁A份额与高铁B份额的份额配比保持1:1不变，即  $NUM_A^{\text{后}} = NUM_B$

高铁 A 份额持有人新增的场内南方高铁份额的份额数

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A \times 1.0000}{1.0000}$$

(3) 南方高铁份额

$$NUM_P^{\text{后}} = \frac{NAV_P^{\text{前}} \times NUM_P}{1.0000}$$

其中,

$NUM_B^{\text{后}}$ : 折算后高铁 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{前}}$ : 折算前高铁 B 份额的份额数

$NAV_B^{\text{前}}$ : 折算前高铁 B 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{\text{后}}$ : 折算后高铁 A 份额的基金份额数

$NUM_A^{\text{前}}$ : 折算前高铁 A 份额的基金份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ : 折算前高铁 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_P^{\text{后}}$ : 折算后的南方高铁份额的份额数

$NUM_P^{\text{前}}$ : 折算前南方高铁份额的份额数

$NAV_P^{\text{前}}$ : 折算后南方高铁份额的基金份额净值

(4) 折算后南方高铁份额的总份数

折算后南方高铁份额的总份数 = 南方高铁份额持有人持有的折算后的南方高铁份额的份数 + 高铁 A 份额持有人新增的场内南方高铁份额数

(5) 为保护持有人利益, 本基金在折算基准日折算前的基金份额净值/参考净值计算保留到小数点后 9 位, 小数点第 9 位以后舍去。份额折算后场外基金份额的份额数计算结果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; 场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位, 余额的处理方法按照深圳证券交易所或基金登记机构的相关规则及有关规定执行。

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。

#### 四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日, 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如下表所示, 折算后, 南方高铁份额的基金份额净值、高铁 A 份额、高铁 B 份额的基金份额参考净值均调整 1.0000 元, 则各持有南方高铁份额、高铁 A 份额、高铁 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示:

	折算前		折算后	
	折算前基金份额数（份）	折算前基金份额净值/参考净值（元）	折算后基金份额数	折算后基金份额净值/参考净值（元）
南方高铁份额	10,000	0.617000000	6,170 份南方高铁份额	1.0000
高铁 A 份额	10,000	1.028000000	2,060 份高铁 A 份额 + 8,220 份南方高铁份额	1.0000
高铁 B 份额	10,000	0.206000000	2,060 份高铁 B 份额	1.0000

## 五、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）不定期份额折算基准日（即 2015 年 8 月 26 日），本基金暂停办理申购（含定投，下同）、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；高铁 A 级、高铁 B 级将于 2015 年 8 月 26 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 8 月 26 日上午 10:30 复牌。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 8 月 27 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，高铁 A 级、高铁 B 级暂停交易。当日，本基金登记机构及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 8 月 28 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，高铁 A 级、高铁 B 级将于 2015 年 8 月 28 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 8 月 28 日上午 10:30 复牌。

（四）根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015 年 8 月 28 日高铁 A 级、高铁 B 级即时行情显示的前收盘价为 2015 年 8 月 27 日的高铁 A 级、高铁 B 级的基金份额参考净值，2015 年 8 月 28 日当日高铁 A 级和高铁 B 级均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资人注意投资风险。

## 六、重要提示

1、本基金高铁 A 级、高铁 B 级将于 2015 年 8 月 26 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 8 月 26 日上午 10:30 复牌。

本基金高铁 A 级、高铁 B 级将于 2015 年 8 月 27 日全天停牌。并将于 2015 年 8 月 28 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 8 月 28 日上午 10:30 复牌。

2、本基金高铁 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后高铁 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的高铁 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的高铁 A 份额与较高风险收益特征的南方高铁份额，因此原高

铁 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，南方高铁份额为跟踪中证高铁产业指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原高铁 A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、本基金高铁 B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始杠杆水平，相应地，高铁 B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

4、由于高铁 A 级、高铁 B 级份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，高铁 A 级、高铁 B 级的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资人注意折溢价所带来的风险。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，高铁 A 份额、高铁 B 份额、南方高铁份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量高铁 A 份额、高铁 B 份额、南方高铁份额的持有人，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、高铁 B 级折算基准日的基金份额参考净值与折算条件 0.250 元可能有一定差异。

7、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，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。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高铁 A 份额，在不定期份额折算后，则折算新增的南方高铁份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将高铁 A 份额卖出，或者在折算后将新增的南方高铁份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

8、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。投资人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。敬请投资人注意投资风险。

9、投资人若希望了解基金不定期份额折算业务详情，可访问本公司网站  
([www.nffund.com](http://www.nffund.com))或拨打全国免长途费的客户服务电话（400—889—8899）咨询相关情况。

特此公告

南方基金管理有限公司

2015年8月26日

