南方天元新产业股票型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2019年4月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月17日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。

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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方天元新产业股票
场内简称	南方天元
基金主代码	160133
交易代码	160133
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2014年7月3日
报告期末基金份额总额	375,687,204.66份
投资目标	本基金为股票型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，采用自上而下和自下而上结合选股的模式，在我国经济转型的背景下，寻找传统行业中的新型企业和新兴产业中的优势企业，兼顾上市公司的安全边际，争取基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注：1.本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方天元”。

2.本基金转型日期为2014年7月3日，该日起原天元证券投资基金正式变更为南方天元新产业股票型证券投资基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月1日－2019年3月31日）
1.本期已实现收益	36,385,132.14
2.本期利润	180,796,684.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.4752
4.期末基金资产净值	889,485,467.96
5.期末基金份额净值	2.368

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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
过去三个月	24.76%	1.32%	22.76%	1.24%	2.00%	0.08%

3.2.2 自基金转型以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋秋洁	本基金基金经理	2015年6月16日	–	10年	女，清华大学光电工程硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任产品开发部研发员、研究部研究员、高级研究员，负责通信及传媒行业研究；2014年3月至2014年12月，任南方隆元基金经理助理；2014年6月至2014年12月，任南方中国梦基金经理助理；2015年7月至2018年11月，任南方消费活力基金经理；2014年12月至2019年1月，任南方消费基金经理；2015年6月至今，任南方天元基金经理；2015年7月至今，任南方隆元基金经理；2017年5月至今，任南方文旅混合基金经理；2018年7月至今，任南方配售基金经理；2019年3月至今，任南方产业活力基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年以来，市场快速反弹，投资者信心得到明显修复。2019年一季度，大部分经济宏微观指标呈现复苏状态，且呈现逐月好转趋势。同时，中美贸易谈判进入缓和期，阶段性谈判结果向乐观方向发展。在各种友好政策的推动下，一季度的经济表现是超出预期的，居民和企业的预期也从去年过度悲观中得到了修复。同时，我们也需要注意到，新旧经济增长动能的转换是一个缓慢的过程，在潜在经济增长速度下移、地产和基建未出现强刺激、以及海外经济疲弱的情况下，经济状况还有出现底部区域反复的可能。从长期视角出发，我们仍然在不断寻找未来十年中能够成为中国经济新动能的优势产业。

本基金密切关注市场环境的变化，秉承一贯风格，寻找景气度不断向上的行业进行配置，以求给投资者带来长期稳定的收益。本基金本季度总体以中等偏高仓位运作，寻找从底部复苏的行业机会；同时，优中选优，借助行业龙头的自身调整能力减少经济下行周期对投资收益的影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为2.368元，报告期内，份额净值增长率为24.76%，同期业绩基准增长率为22.76%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 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	745,779,662.25	81.98
	其中：股票	745,779,662.25	81.98
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	44,269,588.28	4.87
	其中：债券	44,269,588.28	4.87
	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	109,838,361.83	12.07
8	其他资产	9,811,465.42	1.08
9	合计	909,699,077.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	25,469,187.27	2.86
B	采矿业	745.92	0.00
C	制造业	363,734,177.24	40.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,434,432.77	1.62
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	66,249.85	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	20,407,498.92	2.29
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,279,948.76	11.95
J	金融业	55,666,733.53	6.26
K	房地产业	21,563,744.00	2.42
L	租赁和商务服务业	95,466,014.25	10.73
M	科学研究和技术服务业	13,935,767.89	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	31.85	0.00
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	28,755,130.00	3.23
S	综合	–	–
	合计	745,779,662.25	83.84

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 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

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	601888	中国国旅	808,212	56,639,496.96	6.37
2	601318	中国平安	504,500	38,896,950.00	4.37
3	002027	分众传媒	6,192,427	38,826,517.29	4.37
4	600872	中炬高新	993,712	36,349,984.96	4.09
5	002463	沪电股份	2,786,100	32,123,733.00	3.61
6	600519	贵州茅台	37,000	31,597,630.00	3.55
7	601766	中国中车	3,347,100	30,458,610.00	3.42
8	300413	芒果超媒	649,100	28,755,130.00	3.23
9	002410	广联达	963,800	28,730,878.00	3.23
10	600745	闻泰科技	848,400	25,511,388.00	2.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	43,440,343.60	4.88
	其中：政策性金融债	43,440,343.60	4.88
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	829,244.68	0.09
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	44,269,588.28	4.98

5.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开1701	434,360	43,440,343.60	4.88
2	123004	铁汉转债	7,052	829,244.68	0.09

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 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、交易活跃的股指期货合约，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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	196,079.84
2	应收证券清算款	7,556,312.93
3	应收股利	–
4	应收利息	1,636,815.53
5	应收申购款	422,257.12
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	9,811,465.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123004	铁汉转债	829,244.68	0.09

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	377,491,206.53
报告期期间基金总申购份额	52,102,715.64
减：报告期期间基金总赎回份额	53,906,717.51
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–
报告期期末基金份额总额	375,687,204.66

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190331	96,925,398.07	18,489,446.61	0.00	115,414,844.68	30.72%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方天元新产业股票型证券投资基金基金合同》；
2、《南方天元新产业股票型证券投资基金托管协议》；
3、南方天元新产业股票型证券投资基金2019年1季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼。

9.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com

南方道琼斯美国精选REIT指数证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2019年4月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月17日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。

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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	美国REIT	
基金主代码	160140	
交易代码	160140	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2017年10月26日	
报告期末基金份额总额	52,441,923.52份	
投资目标	在有效分散风险的基础上，力争获得与业绩比较基准相似的回报。	
投资策略	本基金采用被动式指数化投资，以实现对标的指数的有效跟踪。主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份券组成及其权重构建REIT投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整。	
业绩比较基准	道琼斯美国精选REIT指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金主要投资于境外市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	美国REIT	美国RE C
下属分级基金的交易代码	160140	160141
报告期末下属分级基金的份额总额	34,074,190.52份	18,367,733.00份
境外资产托管人	英文名称：Brown Brothers Harriman & Co.	
	中文名称：布朗兄弟哈里曼银行	

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“美国REIT”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月1日－2019年3月31日）	
	美国REIT	美国RE C
1.本期已实现收益	232,677.20	89,512.61
2.本期利润	4,406,280.57	1,767,667.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.1165	0.1095
4.期末基金资产净值	37,359,655.68	20,020,707.63
5.期末基金份额净值	1.0964	1.0900

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

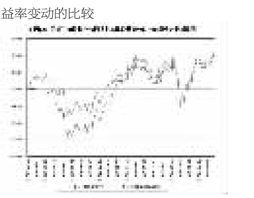
美国REIT

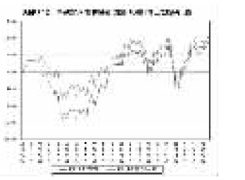
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.80%	0.78%	11.83%	0.79%	-0.03%	-0.01%

美国RE C

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
过去三个月	11.70%	0.78%	11.83%	0.79%	-0.13%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄亮	本基金基金经理	2017年10月26日	–	18年	北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司，2005年加入南方基金国际业务部，现任国际业务部总经理、国际投资决策委员会委员；2007年9月至2009年5月，担任南方全球基金经理助理；2011年9月至2015年5月，任南方中国中小盘基金经理；2015年5月至2017年11月，任南方香港优选基金经理；2009年6月至今，担任南方全球基金经理；2010年12月至今，任南方金砖基金经理；2016年6月至今，任南方原油基金经理；2017年4月至今，任国企精明基金经理；2017年10月至今，任美国REIT基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年初全球经济延续扩张态势，全球股市一季度普遍上扬。2019年1月至3月，美国供应管理协会制造业PMI分别为56.6、54.2、55.3，较2018年有所下滑，但整体保持强劲。一季度美联储态度偏鸽派，3月议息会议中多数与会者认同2019年不加息，但有未来加息的空间，基本符合市场预期，多数与会者认识到经济动能正在放缓，但认为经济偏弱仅限于2019年一季度。欧元区经济放缓趋势仍未见好转，PMI连续9个月下滑，但市场已有预期。新兴市场Markit制造业月度PMI分别为49.5、50.6、51.0，回暖趋势明显。

受益于美国经济保持强势及整体美股市场上涨，美国REIT市场在一季度稳步向好，报告期内道琼斯美国精选REIT指数以美元计价上涨15.7%。

对于美国REIT市场的后市，我们维持谨慎乐观的判断。美国经济虽存在下行风险，但经济继续扩张仍是大概率事件。美国核心通货膨胀率仍稳定在2%附近，但货币政策逐渐转向鸽派，而从历史经验看，财政政策和货币政策宽松时期美国经济表现良好的概率较大。我们认为有望降低的资金成本将继续推高各类资产的价格，具有稳定分红收益的REIT具有很高的投资价值。而且随着美国经济的保持强势，美国地产价格和租金价格都将有很好的支撑和上升空间，美国REIT市场具备非常优异的长期投资价值。

未来，本基金投资团队将密切关注市场变化趋势，谨慎勤勉、恪尽职守，实现对标的指数的有效跟踪。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为1.0964元，报告期内，份额净值增长率为11.80%，同期业绩基准增长率为11.83%；本基金C份额净值为1.090元，报告期内，份额净值增长率为11.70%，同期业绩基准增长率为11.83%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	52,169,639.84	86.07
	其中：普通股	–	0.00
	存托凭证	52,169,639.84	86.07
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	–	0.00
	其中：债券	–	0.00
	资产支持证券	–	0.00
4	金融衍生品投资	–	0.00
	其中：远期	–	0.00
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
6	货币市场工具	–	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	4,095,635.58	6.76
8	其他资产	4,349,943.89	7.17
9	合计	60,615,219.31	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	52,169,639.84	90.92
合计	52,169,639.84	90.92

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
保健REIT	5,889,078.56	10.26
酒店REIT	3,984,324.00	6.94
住宅REIT	12,126,266.47	21.13
工业REIT	5,946,793.08	10.36
多种资产类别REIT	529,932.24	0.92
办公楼REIT	8,147,189.43	14.20
停车场REIT	–	–
零售REIT	9,039,434.42	15.75
自助仓库REIT	4,397,381.93	7.66
特殊与其他REIT	2,109,239.71	3.68
合计	52,169,639.84	90.92

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

5.4 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及存托凭证投资明细

5.4.1 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Simon Property Group Inc	西蒙房地产集团公司	SPG UN	美国证券交易所	美国	3,558	4,365,349.46	7.61
2	Prologis Inc	普洛斯公司	PLD UN	美国证券交易所	美国	7,260	3,517,290.86	6.13
3	Public Storage	公共存储公司	PSA UN	美国证券交易所	美国	1,728	2,533,976.58	4.42
4	Welltower Inc	Welltower股份有限公司	WELL UN	美国证券交易所	美国	4,450	2,325,212.22	4.05
5	Equity Residential	公寓物业权益信托	EQR UN	美国证券交易所	美国	4,261	2,161,039.52	3.77
6	AvalonBay Communities Inc	AvalonBay社区股份有限公司	AVB UN	美国证券交易所	美国	1,595	2,155,826.65	3.76
7	Digital Realty Trust Inc	数字房地产信托有限公司	DLR UN	美国证券交易所	美国	2,393	1,917,478.59	3.34
8	Ventas Inc	Ventas公司	VTR UN	美国证券交易所	美国	4,013	1,724,244.18	3.00
9	Boston Properties Inc	波士顿地产公司	BXP UN	美国证券交易所	美国	1,779	1,603,734.66	2.79
10	Essex Property Trust Inc	埃塞克斯房地产信托公司	ESS UN	美国证券交易所	美国	756	1,472,383.74	2.57

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

5.4.2 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十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	182,610.97
4	应收利息	371.93
5	应收申购款	4,035,142.02
6	其他应收款	–
7	待摊费用	131,818.97
8	其他	–
9	合计	4,349,943.89

5.10.4 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债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

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的情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五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五名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	美国REIT	美国RE C
报告期期初基金份额总额	39,778,742.46	16,067,563.85
报告期期间基金总申购份额	7,986,119.52	8,416,540.76
减：报告期期间基金总赎回份额	13,690,671.46	6,116,371.61
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–	–
报告期期末基金份额总额	34,074,190.52	18,367,733.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	7,412,658.70
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,412,658.70
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	14.14

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

基金管理人按照本基金合同约定费率进行认购、申购和赎回。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方道琼斯美国精选REIT指数证券投资基金基金合同》；
2、《南方道琼斯美国精选REIT指数证券投资基金托管协议》；
3、南方道琼斯美国精选REIT指数证券投资基金2019年1季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼

9.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银河证券股份有限公司
报告送出日期：2019年4月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月17日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。

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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方中证高铁产业指数分级		
场内简称	高铁基金		
基金主代码	160135		
交易代码	160135		
基金运作方式	上市型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2015年6月10日		
报告期末基金份额总额	237,889,577.12份		
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。		
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	中证高铁产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。同时本基金为指数型基金，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。		
基金管理人	南方基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国银河证券股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	高铁基金	高铁A级	高铁B级
下属分级基金的场内简称	高铁基金	高铁A级	高铁B级
下属分级基金的交易代码	160135	150293	150294
报告期末下属分级基金的份额总额	230,462,437.12份	3,713,570.00份	3,713,570.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。同时本基金为指数型基金，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。	高铁A级份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征。	高铁B级份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“高铁基金”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月1日－2019年3月31日）
1.本期已实现收益	-8,230,362.28
2.本期利润	31,099,698.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.1224
4.期末基金资产净值	198,303,363.51
5.期末基金份额净值	0.8336

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

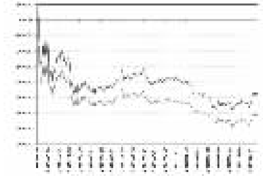
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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
过去三个月	16.54%	1.58%	16.24%	1.59%	0.30%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟	本基金基金经理	2015年7月2日	–	9年	管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010年2月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014年12月至2015年5月，担任南方恒生ETF的基金经理助理；2015年5月至2016年7月，任南方500工业ETF、南方500原材料ETF基金经理；2015年7月至今，任改革基金、高铁基金、500信息基金经理；2016年5月至今，任南方创业板ETF、南方创业板ETF联接基金经理；2016年8月至今，任500信息联接、深成ETF、南方深成基金经理；2017年3月至今，任南方全指证券ETF联接、南方中证全指证券ETF基金经理；2017年6月至今，任南方中证银行ETF、南方银行联接基金经理；2018年2月至今，任H股ETF、南方H股联接基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数分级基金，在基础份额之外，还设计了配比为1:1的高铁A级和高铁B级两类子份额，并于深交所上市。上市交易的开放式基金都存在两套价格体系，分别是上市价格体系和净值价格体系，两者之间折溢价关系的明确可预期是交易型投资者的基础需求，长期配置型投资者（主要为场外份额投资者）也希望通过投资本基金获取贴近指数的投资回报。所以，我们一直致力于为投资者提供准确、透明的指数化投资工具，不管遭遇市场剧烈波动、大额申赎还是不定期折算，都始终坚守被动投资理念，力争将投资中的主动判断和操作降至最低限度，更不会主动进行大幅增减仓操作。

我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

（1）接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

（2）报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.8336元，报告期内，份额净值增长率为16.54%，同期业绩基准增长率为16.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 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	188,201,969.20	94.09
	其中：股票	188,201,969.20	94.09
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	3,000,300.00	1.50
	其中：债券	3,000,300.00	1.50
	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	7,499,258.76	3.75
8	其他资产	1,322,984.91	0.66
9	合计	200,024,512.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	119,684,645.45	60.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	64,348,660.16	32.45
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	3,804,955.00	1.92
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	187,838,260.61	94.72

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	196,462.65	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
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	32,902.94	0.02
J	金融业	134,343.00	0.07
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	363,708.59	0.18

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 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

5.3.1 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	601186	中国铁建	2,188,220	25,186,412.20	12.70
2	601390	中国中铁	3,452,618	25,100,532.86	12.66
3	601766	中国中车	2,699,048	24,561,336.80	12.39
4	600820	隧道股份	1,915,765	14,061,715.10	7.09
5	300001	特锐德	506,513	11,330,695.81	5.71
6	000008	神州高铁	2,289,743	10,578,612.66	5.33
7	600967	内蒙一机	857,900	10,346,274.00	5.22
8	600562	国睿科技	380,584	6,922,822.96	3.49
9	600580	卧龙电驱	656,737	6,311,242.57	3.18
10	600169	太原重工	1,822,701	5,486,330.01	2.77

5.3.2 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

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	002958	青农商行	17,700	134,343.00	0.07
2	300762	上海瀚讯	1,233	82,475.37	0.04
3	603379	三美股份	1,590	51,563.70	0.03
4	603681	永冠新材	1,767	33,855.72	0.02
5	300766	每日互动	1,193	32,902.94	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	3,000,300.00	1.51
	其中：政策性金融债	3,000,300.00	1.51
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	3,000,300.00	1.51

5.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开1701	30,000	3,000,300.00	1.51

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	49,841.88
2	应收证券清算款	125,600.04
3	应收股利	–
4	应收利息	113,659.77
5	应收申购款	1,033,883.22
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,322,984.91

5.11.4 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换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603379	三美股份	51,563.70	0.03	新股未上市

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	高铁基金	高铁A级	高铁B级
报告期期初基金份额总额	244,305,480.33	3,885,739.00	3,885,739.00
报告期期间基金总申购份额	103,726,649.37	–	–
减：报告期期间基金总赎回份额	117,914,030.58	–	–
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	344,338.00	-172,169.00	-172,169.00
报告期期末基金份额总额	230,462,437.12	3,713,570.00	3,713,570.00

注：拆分变动份额包括本基金三级份额的配对转换份额及折算份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》；
2、《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金托管协议》；
3、南方中证高铁产业指数分级证券投资基金2019年1季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼。

9.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com