南方中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关约定，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”）B类份额的基金份额参考净值小于0.2500元时，南方中证高铁份额（场内简称：高铁基金，场内代码：160135）、南方中证高铁A类份额（场内简称：高铁A级，场内代码：150293）、南方中证高铁B类份额（场内简称：高铁B级，场内代码：150294）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2020年9月28日收盘，高铁B级的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，提请投资者密切关注南方中证高铁B类份额近期基金份额参考净值的波动情况。

针对不定期份额折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

1、根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，本基金将在2020年底前完成规范整改，请投资者关注相关风险以及基金管理人届时发布的相关公告。

2、由于高铁A级、高铁B级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者注意高溢价所带来的风险。

3、高铁B级表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

4、由于触发折算阈值当日，高铁B级的参考净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日之后才能确定，因此折算基准日高铁B级的参考净值可能与折算阈值0.2500元有一定差异。

5、高铁A级表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后高铁A级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高铁A级变为同时持有较低风险收益特征高铁A级与较高风险收益特征高铁基金的情况，因此高铁A级持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

1、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算(最小单位为1份)，舍去部分计入基金资产，持有极小数量高铁基金、高铁A级、高铁B级的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

2、如本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、登记结算机构的相关业务规则，暂停高铁A级与高铁B级的上市交易、配对转换，以及高铁基金的申购、赎回、转托管等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金基金合同及《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本公司客服电话400-889-8899。

3、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9月29日

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金B类份额风险提示及停复牌公告

南方基金管理股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下南方中证高铁产业指数分级证券投资基金B类份额（场内简称：高铁B级；交易代码：150294），2020年9月25日在二级市场的收盘价为0.546元，相对于当日0.2983元的基金份额参考净值，溢价幅度83.04%。截至2020年9月28日，高铁B级二级市场的收盘价为0.499元，二级市场交易价格相对于基金份额参考净值的溢价幅度较高，投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失。

为了保护基金份额持有人的利益，高铁B级将于2020年9月29日开市起至当日10:30停牌，自2020年9月29日10:30起复牌，恢复正常交易。

为此，本基金管理人提示如下：

1、根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，本基金将在2020年底前完成规范整改，投资者如果高溢价买入高铁B级，可能遭受重大损失，请理性投资。

2、由于高铁B级内含杠杆机制的设计，高铁B级参考净值的变动幅度将大于南方中证高铁份额（场内简称：高铁基金，场内代码：160135）净值和南方中证高铁A类份额（场内简称：高铁A级，场内代码：150293）参考净值的变动幅度，即高铁B级的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。高铁B级的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

3、高铁B级的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。

4、截至本公告披露日，南方中证高铁产业指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日，南方中证高铁产业指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

6、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9月29日

南方基金管理股份有限公司关于中国国际期货股份有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告

经南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）与中国国际期货股份有限公司（以下简称“中国国际期货”）协商一致，中国国际期货已终止代理销售本公司旗下基金，具体基金如下：

编号	基金代码	基金名称
1	202001	南方稳健成长证券投资基金
2	202101	南方宝元债券型基金A类
3	202301	南方现金增利基金A级
4	202302	南方现金增利基金B级
5	202102	南方多利增强债券型证券投资基金C类
6	202103	南方多利增强债券型证券投资基金A类
7	202002	南方稳健成长贰号证券投资基金
8	202003	南方绩优成长混合型证券投资基金A类（前端）
9	202004	南方绩优成长混合型证券投资基金A类（后端）
10	202005	南方成份精选混合型证券投资基金A类（前端）
11	202006	南方成份精选混合型证券投资基金A类（后端）
12	202801	南方全球精选配置证券投资基金
13	202007	南方隆元产业主题混合型证券投资基金（前端）
14	202008	南方隆元产业主题混合型证券投资基金（后端）
15	202009	南方盛元红利混合型证券投资基金（前端）
16	202010	南方盛元红利混合型证券投资基金（后端）
17	202011	南方优选价值混合型证券投资基金A类（前端）
18	202012	南方优选价值混合型证券投资基金A类（后端）
19	202015	南方护深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类（前端）
20	202016	南方护深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类（后端）
21	202017	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类（前端）
22	202018	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类（后端）
23	202019	南方策略优化混合型证券投资基金（前端）
24	202020	南方策略优化混合型证券投资基金（后端）
25	202021	中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类（前端）
26	202022	中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类（后端）
27	202105	南方广利回报债券型证券投资基金A类
28	202106	南方广利回报债券型证券投资基金B类
29	202107	南方广利回报债券型证券投资基金C类
30	202023	南方优选成长混合型证券投资基金A类（前端）
31	202024	南方优选成长混合型证券投资基金A类（后端）
32	202025	南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类（前端）
33	202026	南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类（后端）
34	202108	南方润元纯债债券型证券投资基金A类
35	202109	南方润元纯债债券型证券投资基金B类
36	202110	南方润元纯债债券型证券投资基金C类
37	202027	南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金A类（前端）
38	202028	南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金A类（后端）
39	000086	南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金A类
40	000720	南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金C类
41	000355	南方丰元信用增强债券型证券投资基金A类
42	000356	南方丰元信用增强债券型证券投资基金C类
43	000452	南方医药保健灵活配置混合型证券投资基金
44	000527	南方新优享灵活配置混合型证券投资基金A类
45	000563	南方通利债券型证券投资基金A类
46	000564	南方通利债券型证券投资基金C类
47	000554	中国梦灵活配置混合型证券投资基金
48	000561	南方启元债券型证券投资基金A类
49	000562	南方启元债券型证券投资基金C类
50	000844	南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
51	000816	南方理财金交易型货币市场基金A类
52	202307	南方收益宝货币市场基金A类
53	000997	南方双元债券型证券投资基金A类
54	000998	南方双元债券型证券投资基金C类
55	001053	南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金
56	002656	南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类
57	202212	南方平衡配置混合型证券投资基金
58	202211	南方中证100指数证券投资基金A类
59	000327	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金
60	202213	南方核心竞争混合型证券投资基金

中国国际期货已终止办理上述基金的各项业务。

本公司在法律法规允许的前提下对于本公告享有解释权。

投资者也可以通过以下途径咨询有关情况：

中国国际期货客服电话：95162、400-8888-160

中国国际期货网址：www.cifco.net

南方基金客服电话：400-889-8899

南方基金网址：www.nffund.com

特此公告。

南方基金管理股份有限公司

2020年9月29日

南方基金管理股份有限公司关于中证高铁产业指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告

南方基金管理股份有限公司已于2020年9月25日在《中国证券报》及基金管理人网站（www.nffund.com）发布了《南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开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的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

南方基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）依据中国证监会证监许可[2015]885号文注册募集的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”）于2015年6月10日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》”）的有关规定，基金管理人决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2020年9月25日起，至2020年10月28日17:00止（投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的送达地点：

地址：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦37楼

邮政编码：518017

联系电话：0755-82763888

收件人：南方基金管理股份有限公司

请在信封表面注明：“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专用”。

二、会议审议事项

《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》（见附件一）。

对上述议案的说明请参见附件四《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方案的说明》。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年9月25日，权益登记日当天下午交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括南方高铁份额、高铁A份额和高铁B份额的基金份额持有人）均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权；权益登记日当天卖出的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天买入的基金份额享有本次会议表决权）。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登录基金管理人网站(http://www.nffund.com)下载并打印或按以上格式自制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人有效身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件或护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者有效身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（5）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件在自2020年9月25日起至2020年10月28日17:00止的期间内（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至基金管理人的办公地址，并请在信封表面注明：“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专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

4、网络投权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人提供官方微信（微信号：南方基金）、官方APP（APP名称：南方基金）和官方网站(http://www.nffund.com)通道供个人投资者进行授权，由基金管理人根据投权人的表决意见代为行使表决权。

网络投权的起止时间自2020年9月28日起至2020年10月27日15:00止（授权时间以系统记录时间为准）。通过网络进行授权的基金份额持有人，应正确填写姓名、证件号码等信息，以核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过上述网络授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

5、短信授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人可提供短信通道供基金份额持有人进行授权。基金管理人和本基金的部分销售机构可通过短信平台向预留手机号码的个人投资者发送征集授权短信，持有人回复短信表明授权意见。

短信授权的起止时间自2020年9月25日起至2020年10月27日15:00止（授权时间以系统记录的短信接收时间为准），敬请投资者注意。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行授权。如因投票短信通道受阻或通讯故障等不可抗力或非基金管理人人为因素，导致投票短信无法接收到或逾期接收到，短信投票失效，基金管理人不承担责任，基金份额持有人可以选择基金管理人认可的其他投票方式进行授权。

6、电话授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与本次大会，基金管理人可开设录音电话授权方式，基金管理人和部分销售机构可通过各自的客服代表与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由客服代表根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

电话授权的起止时间自2020年9月25日起至2020年10月27日15:00止（授权时间以系统记录的电话接通时间为准），敬请投资者注意。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

7、授权的确定原则

（1）直接表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托，又存在直接投票表决，则以直接表决为有效表决，授权委托无效。

（2）最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次进行有效授权，无论表决意见是否相同，均以最后一次授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次，不能确定最后一次授权的，按以下原则处理：若多次授权的表决意见一致的，按照该表决意见计票；若多次授权但授权意见不一致的，视为委托人授权受托人投弃权票。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银河证券股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日（即2020年10月28日）后2个工作日内进行计票，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。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公议通知规定，且在规定截止时间之内送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定截止时间之内送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达日所填写的有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

六、决议生效条件

1、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）；

2、《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》应当由提交有效表决票的南方高铁份额、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；

3、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》和本公告的规定，并与基金登记机构记录相符；

4、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起5日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

七、本次大会相关机构

1、召集人：南方基金管理股份有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼

法定代表人：张海波

成立时间：1998年3月6日

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

2、基金托管人：中国银河证券股份有限公司

3、公证机构：北京市中信公证处

公证员：王雪

联系方式：（010）81136530

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

八、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于2020年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将高铁A份额与高铁B份额按照基金份额参考净值转换为南方高铁份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

2、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

3、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）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。

4、根据深圳证券交易所的业务规则，基金管理人将向深圳证券交易所申请本基金高铁A份额、高铁B份额自2020年10月29日（计票日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告发布日10:30停牌。如基金份额持有人大会决议生效公告日为非交易日，则下一交易日开市恢复交易。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

南方基金管理股份有限公司

2020年9月29日

附件一：

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

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：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规和《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》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国银河证券股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开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”）基金份额持有人大会，审议《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》。本次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属于实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

2、本次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方案需经提交有效表决票的南方高铁份额、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，因此本次议案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。中国证监会对本次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决议的备案，不表明其对本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金转型方案的主要内容如下：

（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）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，南方中证高铁产业指数分级证券投资基金将安排不少于20个交易日的选择期（具体以基金管理人届时发布的公告为准）。原基金份额持有人可以选择卖出高铁A份额或高铁B份额，或者选择赎回南方高铁份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的南方高铁份额、高铁A份额、高铁B份额将在份额转换基准日进行转换，最终转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额。基金份额持有人选择继续持有转型后的南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额，无需支付南方中证高铁产业指数分级证券投资基金的赎回费用和南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）的申购费用。转型选择期内，基金费用仍按照《南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》的约定进行计提和支付。

根据有关业务规则，基金份额持有人持有的南方高铁份额转换为南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额后，其原基金份额持有期计入南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额的持有期；基金份额持有人持有的高铁A份额、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）基金份额后，基金份额持有期自南方中证高铁产业指数证券投资基金（LOF）基金份额确认之日起计算；基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费用。

由于南方中证高铁产业指数分级证券投资基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免南方中证高铁产业指数分级证券投资基金基金同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、配对转换或调整申购、赎回的方式及限额等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（四）高铁A份额与高铁B份额的终止上市

在本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理高铁A份额、高铁B份额的终止上市等相关业务。

（五）基金份额的转换

转型选择期届满的次一工作日为份额转换基准日，同日高铁A份额、高铁B份额终止上市。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=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=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。由于上述基金份额转换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。

（六）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。

（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

份额转换完成后，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。具体详见基金管理人届时发布的相关公告。

（八）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）、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。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；

（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）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