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

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“本公告书”）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》》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》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，承诺其中不不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担相应的法律责任。

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级与高铁基金的产品开运作。
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级份额以上市交易，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10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0.25000元时。有关基金份额折算的约定，参见基金合同“一十、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0.0990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、本次上市交易场所：深圳证券交易所
14、上市交易日期：2015年6月23日
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、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券（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、中信证券（浙江）有限责任公司、东吴证券股份有限公司、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、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、东莞证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、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、中山证券有限责任公司、中银证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、上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、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、宏信证券有限责任公司、诺亚正行（上海）基金销售股份有限公司、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、上海长量基金销售股份有限公司、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、上海天天基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、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、上海长量基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售股份有限公司、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、上海天天基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）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、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、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、上海利得基金销售有限公司、上海红塔证券投资咨询有限公司等。

上述排名不分先后。

三、特别提示

1、本基金股票的详细事项请查阅本基金的份额发售公告、招募说明书及最新相关公告。投资人可访问南方基金管理有限公司网站(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。

2、在投资本基金前，投资人应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策，获得基金份额收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资有风险，投资人认购基金时应认真阅读本基金的基金合同及招募说明书。

南方基金管理有限公司
2015年6月17日

关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告

根据中国证监会2008年9月12日下发的（2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，中国证券投资基金业协会2013年5月20日下发的(2013]13号《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》及南方基金管理有限公司（以下简称“我公司”）长期停牌股票的估值政策和程序，基金持有已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25％以上的，相应投票应参考应用上述有关规定中的行业估值指数确定其公允价值。

我公司旗下南方沪深基本面混合型证券投资基金、南方改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、南方利淘灵活配置混合型证券投资基金、南方稳健成长证券投资基金、南方稳健成长债券投资基金、南方优选价值股票型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、南方优选成长混合型证券投资基金、南方宝元债券型基金、南方鑫欣增值基金、南方恒元保本混合型证券投资基金、南方保本混合型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金持有的皖能电力（股票代码000543）自2015年6月15日起停牌；中国梦双活配置混合型基金、南方猎优成长股票型证券投资基金、南方隆元产业主题股票型证券投资基金、南方盛元红利股票型证券投资基金、南方广利回报债券型证券投资基金持有的信雅达（股票代码600571）自2015年6月11日起停牌；南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金持有的龙马环卫（股票代码603686）自2015年6月15日起停牌。经我公司与托管行协商一致，自2015年6月16日起采用“指数收益法”对上述基金持有的皖能电力、信雅达和龙马环卫估值，且其复牌之日起其其交易体现了活跃市场交易特征后，按市场价格进行估值，届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

特此公告。

南方基金管理有限公司
2015年6月17日

关于南方宝元债券型基金变更基金经理的公告

公告送出日期：2015年6月17日

1 公告基本信息

基金名称	南方宝元债券型基金
基金简称	南方宝元债券
基金主代码	202101
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	应帅
离任基金经理姓名	蒋炯宾

注：-
2离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	蒋炯宾
离任原因	个人发展原因
离任日期	2015-06-16
是否转任本公司其他工作岗位	否
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	否
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	是

注：-

南方基金管理有限公司
2015年6月17日

关于南方策略优化股票型证券投资基金变更基金经理的公告

公告送出日期：2015年6月17日

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	北京千石创富一华泰证券－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－艾方多策略对冲增强1号	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	蔡铭旗	2,500,048.00	1.45%
10	上海赛金投资中心(有限合伙)	2,500,048.00	1.45%
11	北京千石创富一华泰证券－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：深圳市福田中心区福华一路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
数量化投资部	负责数量化基金、指数基金的投资运作及数量化投资策略、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工作
金划部	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	
上海分公司	
分肥分公司	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
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 客户管理及服务中心
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登记的后台清算、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

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规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	期末金额	负债和所有者权益	期末金额
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	应付利息	
应收利息	64,696.56	应付利润	
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
1、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
1、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，以被实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

（2）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。

（3）在知悉可能对基金份额产生误导性影响或引起投资决策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《证券基金法》、《公开募集证券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《证券基金法》、《公开募集证券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级份额的基金份额净值、高铁A级份额和高铁B级份额的收益分配、基金费用的开支范围和标准、基金资产的会计核算、基金份额持有人名册的登记、基金合同规定的其他事项进行监督和核查，并按照《证券基金法》、《公开募集证券基金投资运作管理办法》及本基金《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》及国家有关法律规定，应延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》及有关法律规定决定基收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，处理基金财产的投资事宜；
（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）以基金管理人、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外包机构；
（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、托管费率之外的基础和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）除依照《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，不得将其固有财产或他人财产混同于基金财产从事投资活动；
（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；如果基金管理人有未执行《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）参加基金护卫小组，参与基金护卫的保管、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）以出席或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）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。
（四）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）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）以出席或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）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召开方式；
（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确定，并在基金份额持有人大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人，且不低于出席会议的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，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人会议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绝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×1.0％÷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×0.2％÷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付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与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（包括国债、金融债、央