南方中证500指数证券投资基金(LOF)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:中国农业银行股份有限公司
公告日期:二○○九年十一月六日

一、 重要声明与提示

《南方中证500指数证券投资基金(LOF)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500指数证券投资基金(LOF)(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。本基金托管人中国农业银行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2009年8月17日《中国证券报》及南方基金管理有限公司网站(www.nuffund.com)上公告的《南方中证500指数证券投资基金(LOF)招募说明书》。

二、 基金概览

1.基金简称:南方500
2.交易代码:160119
3.基金份额总额:3,223,217,818.45(截止:2009年11月4日)
4.基金份额净值:1.081元(截止:2009年11月4日)
5.本次上市交易份额:581,411,748份。
6.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。
7.上市交易日期:2009年11月11日。
10.基金管理人:南方基金管理有限公司。
11.基金托管人:中国农业银行股份有限公司。

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.基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2009年8月7日证监许可[2009]755号。
2.基金合同生效日:2009年9月25日。
3.基金运作方式:上市契约型开放式。
4.基金合同期限:不定期。
5.发售日期:2009年8月20日至2009年9月18日。
6.发售价格:1.00元人民币。
7.发售方式:场外、场内认购。
8.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)场外代销机构:中国农业银行、中国工商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、招商银行、邮储银行、广东发展银行、浦发银行、中信银行、光大银行、兴业银行、深圳发展银行、中国民生银行、北京银行、平安银行、宁波银行、杭州银行;
华泰证券、银河证券、兴业证券、广发证券、联合证券、国泰君安、中信证券、海通证券、中信建投、申银万国、东莞证券、国信证券、招商证券、长城证券、湘财证券、金通证券、渤海证券、南京证券、国联证券、光大证券、东北证券、广州证券、国都证券、齐鲁证券、中信万通、山西证券、长江证券、第一创业、中原证券、中银国际、东吴证券、平安证券、中投证券、江南证券、瑞银证券、德邦证券、西南证券、财通证券、方正证券、国盛证券、华安证券、大同证券、华林证券、新时代证券、上海证券、民生证券、宏源证券、安信证券、东海证券、西部证券、财富证券、恒泰证券、万联证券、国元证券、金元证券、浙商证券、银泰证券、华鑫证券、世纪证券、华宝证券、华龙证券、日信证券、国金证券、江海证券、天相投顾,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交所会员单位。
国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、联合证券、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、信泰证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、江南证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券
9.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
10.募集资金总额及入账情况
本次募集的净认购金额为3,222,521,419.53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699,512.78元人民币,按照本基金基金合同和招募说明书的约定,其中696,398.92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3,113.86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54,086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3,223,217,818.45份,其中本基金管理人于2009年9月18日认购本基金,持有的基金份额总额为49,996,750.00份(含募集期利息结转的份额),认购费用为5,000.00元。本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为1,180,628.50份(含募集期利息结转的份额),占本基金总份额的比例为0.0366%。
募集资金已于2009年9月24日划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。
11.本基金募集备案情况:本基金于2009年9月24日验资完毕,2009年9月25日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2009年9月25日获得书面确认,本基金合同自该日起正式生效。
12.基金合同生效日:2009年9月25日
13.基金合同生效日的基金份额总额:3,223,217,818.45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[2009]147号
2.上市交易日期:2009年11月11日
3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。
4.基金简称:南方500
5.交易代码:160119
6.本次上市交易份额:581,411,748份。
7.未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。
8.基金资产净值的披露:包括开放式基金每个工作日交易结束后对基金资产净值进行的估值和基金上市交易时间内的参考净值揭示两部分。
基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额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份额净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统揭示。交易时间内基金管理人将根据实时计算的基金份额参考净值传给深交所,深交所通过行情系统揭示。基金份额参考净值的揭示仅为投资者的交易提供参考,基金管理人、基金托管人不对其准确性负责。

四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2009年11月4日,本基金场内份额持有人户数为8016户,平均每户持有的基金份额为72531.40份。
(二)持有人结构
截至2009年11月4日,本基金场内份额持有人结构如下:
场内机构投资者持有的基金份额为217,907,163份,占场内基金总份额的37.4790%;场内个人投资者持有的基金份额为363,504,585份,占场内基金总份额的62.5210%。
(三)截至2009年11月4日,前十名场内基金份额持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例(%)
1	广发证券股份有限公司	100,002,990	17.20
2	齐鲁证券有限公司	50,003,000	8.60
3	招商证券股份有限公司	26,000,780	4.47
4	东方证券股份有限公司	20,001,200	3.44
5	周茂水	10,010,800	1.72
6	合肥华泽投资管理有限公司	6,000,175	1.03
7	东方科学仪器进出口集团有限公司	4,000,240	0.69
8	厦门翔凌实业有限公司	3,500,210	0.60
9	陆继峰	3,000,480	0.52
10	吴瑞宁	3,000,240	0.52

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分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
名称:南方基金管理有限公司
法定代表人:吴万善
总经理:高良玉
注册资本:1.5亿元人民币
注册地址: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
设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]4号
工商登记注册的法人营业执照文号:440301103129537
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
2.股东及其出资比例:华泰证券股份有限公司45%、深圳市机场(集团)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%。
3.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
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
风控策略部	负责投资策略的量化测算、数量化投资、投资风险监控与业绩归因分析
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
专户管理部	负责一对多专户产品的业务拓展及服务工作
产品开发部	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
策略发展部	负责品牌推广、产品推广、营销策划、媒体宣传、公共关系维护
渠道服务部	负责公募及一对多产品的营销及银行、券商代销渠道的拓展及服务工作
电子商务部	负责基金产品的网上销售及公司网站建设
市场服务部	为基金持有人提供专业服务及投资理财资讯服务
合肥分公司	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
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
综合管理部	负责办公管理、财务管理、后勤保障
党群工作部	负责党务及共青团、工会工作
基建办	负责公司办公大楼的基建工作
北京分公司	作为公司在北京地区的业务窗口
上海分公司	作为公司在上海地区的业务窗口

4.人员情况
截止到2009年9月,我公司共有员工307人,博士13人、硕士148人、本科130人、其他16人。
5.信息披露负责人:鲍文革
咨询电话:400-889-8899
6.基金管理业务情况
截至2009年9月,南方基金管理有限公司旗下共管理17只开放式基金和2只封闭式基金及多只社保投资组合和企业年金投资组合,管理总资产规模超过1680亿元人民币,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、南稳灵弓、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、南方500和南方全球;封闭式基金有开元基金和天元基金;以及多个全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。
7.本基金基金经理简介
张原,美国密歇根大学经济学硕士学位,具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金,曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员,南方高增及南方隆元基金基金经理助理。自2009年9月起担任南方500基金基金经理。
(二)基金托管人
1.基本情况
名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦
法定代表人:项俊波
成立日期:2009年1月15日
注册资本:2600亿元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-68424199
联系人:李芳菲
中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营,可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“华你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。
中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《金融时报》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。
中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。
2.主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工130名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。
3.基金托管业务经营情况
截止2009年9月8日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共68只,包括华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新世纪优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新世纪优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双益债券型证券投资基金、中海监筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金。

(三)验资机构
普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:单峰
经办注册会计师:薛竞、单峰

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

深圳证券交易所在南方中证500指数证券投资基金(LOF)募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。
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500指数证券投资基金(LOF)2009年11月04日资产负债表如下:

单位:人民币元

项目	行次	2009年11月04日
资产:		
银行存款	1	643,463,372.23
结算备付金	2	31,608,488.02
存出保证金	3	297,758.94
交易性金融资产	4	2,857,736,636.02
其中:股票投资	5	2,857,736,636.02
债券投资	6	0.00
资产支持证券投资	7	0.00
衍生金融资产	8	0.00
买入返售金融资产	9	0.00
应收证券清算款	10	0.00
应收利息	11	1,730,907.42
应收股利	12	44,226.05
应收申购款	13	0.00
其他资产	14	0.00
资产总计	15	3,534,881,388.68
负债:		
短期借款	16	0.00
交易性金融负债	17	0.00
衍生金融负债	18	0.00
卖出回购金融资产款	19	0.00
应付证券清算款	20	47,481,123.58
应付赎回款	21	0.00
应付管理人报酬	22	221,603.42
应付托管费	23	44,320.67
应付销售服务费	24	0.00
应付交易费用	25	2,164,791.47
应交税费	26	0.00
应付利息	27	0.00
应付利润	28	0.00
其他负债	29	393,955.14
负债合计	30	50,305,794.28
所有者权益:		
实收基金	31	3,223,217,818.45
未分配利润	32	261,357,775.95
所有者权益合计	33	3,484,575,594.40
负债和所有者权益总计	34	3,534,881,388.68

八、 基金投资组合

截止到2009年11月04日,南方中证500指数证券投资基金(LOF)的投资组合如下:
(一)期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	股票	2,857,736,636.02	80.84
2	债券	0.00	0.00
3	权证	0.00	0.00
4	银行存款和结算备付金	675,071,860.25	19.10
5	其他资产	2,072,892.41	0.06
	合计	3,534,881,388.68	100.00

(二)期末按行业分类的股票投资组合

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	68,289,938.88	1.96
B	采掘业	22,111,985.10	0.63
C	制造业	1,676,943,821.99	48.12
C0	食品、饮料	110,173,953.85	3.16
C1	纺织、服装、皮毛	123,864,707.14	3.55
C2	木材、家具	11,844,931.69	0.34
C3	造纸、印刷	58,326,207.32	1.67
C4	石油、化学、塑胶、塑料	370,891,856.00	10.64
C5	电子	129,493,566.21	3.72
C6	金属、非金属	190,591,780.46	5.47
C7	机械、设备、仪表	457,963,877.05	13.14
C8	医药、生物制品	197,367,161.02	5.66
C99	其他制造业	26,425,781.25	0.76
D	电力、煤气及水的生产和供应业	113,376,367.07	3.25
E	建筑业	42,165,352.55	1.21
F	交通运输、仓储业	116,328,852.73	3.34
G	信息技术业	154,364,133.59	4.43
H	批发和零售贸易	188,027,432.12	5.40
I	金融、保险业	4,741,698.00	0.14
J	房地产业	176,040,313.84	5.05
K	社会服务业	79,963,104.24	2.29
L	传播与文化产业	34,536,644.68	0.99
M	综合类	180,846,991.23	5.19
	合计	2,857,736,636.02	82.01

(三)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	600166	福田汽车	1,056,145	21,059,531.30	0.6000%
2	000078	海王生物	875,100	18,735,891.00	0.5400%
3	002073	青岛软控	951,605	16,862,440.60	0.4800%
4	600872	中炬高新	1,391,100	16,804,488.00	0.4800%
5	600312	平高电气	707,239	13,140,500.62	0.3800%
6	600546	中油化建	403,360	12,818,780.80	0.3700%
7	000503	海虹控股	1,144,920	12,605,569.20	0.3600%
8	600406	国电南瑞	291,120	12,550,183.20	0.3600%
9	600586	金晶科技	793,723	12,421,764.95	0.3600%
10	600239	云南城投	486,660	12,351,430.80	0.3500%

(四)期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金截至2009年11月04日止未持有债券。
(五)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
本基金截至2009年11月04日止未持有债券。
(六)投资组合报告附注
1.报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
2.截至2009年11月04日,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。
3.其他资产构成

其他资产明细	金额(元)
交易保证金	297,758.94
应收证券清算款	0.00
应收股利	44,226.05
应收利息	1,730,907.42
应收申购款	0.00
其他应收款	0.00
待摊费用	0.00
其他	0.00
合计	2,072,892.41

4.期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细及资产支持证券、分离交易可转债
截止到2009年11月04日,本基金没有持有处于转股期的可转换债券;本报告期间本基金也没有投资资产支持证券、分离交易可转债。

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《证券基金法》、《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》、《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、基金份额净值计算的计算、基金份额申购赎回的价格、收益分配、费用开支等实施监督和核查;如发现基金管理人违反《证券基金法》、《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,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、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。
(一)中国证监会核准基金募集的文件
(二)《南方中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》
(三)《南方中证500指数证券投资基金(LOF)托管协议》
(四)《南方中证500指数证券投资基金(LOF)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

南方基金管理有限公司
二○○九年十一月六日

附件:基金合同摘要
一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
(一)基金份额持有人的权利与义务
基金投资者自依招募说明书、基金合同取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人,直至其不再持有本基金的基金份额,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上手工签章或签字为必要条件。
每份基金份额具有同等的合法权益。
1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定,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依法转让或者赠送其所持有的基金份额;
④按照规定要求召开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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
⑨法律法规和基金合同规定的其他权利。
2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:
①遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
②缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用;
③在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;
④不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
⑤执行生效的基金份额持有人大会决议;
⑥抵还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;
⑦法律法规和基金合同规定的其他义务。
(二)基金管理人的权利与义务
1.基金管理人的权利
①自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
②获得基金管理人报酬;
③依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
④在符合有关法律法规交易所及登记结算结构相关业务规则和本基金合同的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,决定基金的除调高托管费和管理费的费率结构和收费方式;
⑤根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构,并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益;
⑥在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请;
⑦启行担任基金注册登记机构,或选择、更换注册登记机构,对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查,并从注册登记机构获取基金份额持有人名册;
⑧选择、更换代销机构,并依据销售代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;
⑨在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
⑩依法召集基金份额持有人大会;
⑪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;
⑫选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
⑬根据国家有关规定,在法律法规允许的前提下,以基金的名义依法为基金融资、融券;
⑭法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
3.基金管理人的义务
①依法募集基金,办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜;
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、勤勉尽责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财产分别管理,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计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
⑨采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;
⑩按规定受理基金份额的申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
⑪进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
⑫编制中期和年度基金报告;
⑬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;
⑭保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、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,不得向他人泄露;
⑮按照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收益;
⑯依照《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;
⑰保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
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,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
⑳基金托管人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托管人追偿;
㉑按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;
㉒建立并保存基金份额持有人名册;
㉓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;
㉔执行生效的基金份额持有人大会的决定;
㉕不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动;
㉖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,不谋求对上市公司的控股和直接管理;
㉗法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。
(三)基金托管人的权利与义务
1.基金托管人的权利
①获得基金托管费;
②监督基金管理人对本基金的投资运作;
③自本基金合同生效之日起,依法保管基金财产;
④在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;
⑤根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益;
⑥依法召集基金份额持有人大会;
⑦按规定取得基金份额持有人名册;
⑧法律法规规定的其他权利。
2.基金托管人的义务
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,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;对所托管的不同基金财产分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在名册登记、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》、基金合同及其他有关规定外,不得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和证券账户;
⑦保守基金商业秘密。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,不得向他人泄露;
⑧对基金财务会计报告、中期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的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
⑨保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于15年;
⑩按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
⑪办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
⑫复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;
⑬按照规定监督基金管理人的投资运作;
⑭按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
⑮按照基金管理人的指令或者有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
⑯按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
⑰因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
⑱按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务,基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;
⑲根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册;
⑳参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
㉑面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会和中国银监会,并通知基金管理人;
㉒执行生效的基金份额持有人大会的决定;
㉓法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。
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或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
(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;
②转换基金运作方式;
③终止基金上市交易,但因下述原因致使基金终止上市交易的无需召开基金份额持有人大会:自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形;
④变更基金类别;
⑤变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
⑥变更基金份额持有人大会议事程序;
⑦更换基金管理人、基金托管人;
⑧提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
⑨本基金与其他基金的合并;
⑩对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;
⑪法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
2.出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需