南方中证50债券指数证券投资基金（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：中国工商银行股份有限公司
公告日期：二〇一一年七月二十日

一、重要声明与提示

《南方中证50债券指数证券投资基金（LOF）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50债券指数证券投资基金（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。本基金托管人中国工商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2011年4月7日《证券时报》及南方基金管理有限公司网站（www.nuffund.com）上公告的《南方中证50债券指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

二、基金概览

1.基金简称：南方50债

2.交易代码：160123

3.基金份额总额：2,826,750,103.23（截止：2011年7月18日）

4.基金份额净值：1.0059元（截止：2011年7月18日）

5.本次上市交易份额：190,702,823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：2011年7月25日。

10.基金管理人：南方基金管理有限公司。

11.基金托管人：中国工商银行股份有限公司。

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2011年3月16日证监许可〔2011〕380号文。

2.基金合同生效日：2011年5月17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：2011年4月13日至2011年5月11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：

中国工商银行、中国建设银行、中国农业银行、中国银行、交通银行、招商银行、浦发银行、中信银行、广发银行、中国民生银行、中国光大银行、深圳发展银行、杭州银行、上海银行、北京银行、平安银行、上海农商银行、东莞银行、华夏银行、宁波银行、汉口银行、浙商银行、重庆银行、乌鲁木齐市商业银行、华泰证券、华泰联合证券、兴业证券、国信证券、银河证券、国泰君安、齐鲁证券、海通证券、中信建投、广发证券、长城证券、招商证券、中信证券、申银万国、光大证券、中投证券、宏源证券、湘财证券、中信金通、安信证券、中信万通、中银国际、信达证券、民生证券、东方证券、华融证券、长江证券、东北证券、上海证券、江海证券、国联证券、东莞证券、渤海证券、平安证券、国都证券、东吴证券、广州证券、华林证券、南京证券、华安证券、浙商证券、华宝证券、山西证券、第一创业、广发华福证券、中山证券、中原证券、西南证券、财达证券、德邦证券、中航证券、国元证券、国盛证券、中金公司、大同证券、方正证券、财通证券、东海证券、西部证券、新时代证券、瑞银证券、金元证券、万联证券、国金证券、财富证券、恒泰证券、华龙证券、华鑫证券、日信证券、英大证券、天相投顾（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、申银万国证券、中信万通证券、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、第一创业证券、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、华泰联合证券、东方证券、国泰君安证券、西南证券、银河证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、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、远东证券、江海证券、中投证券、中信建投证券、安信证券、银泰证券、瑞银证券等。

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2,825,913,889.74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836,832.14元人民币，按照本基金基金合同和招募说明书的约定，其中836,213.49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618.65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16,954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2,826,750,103.23份。其中本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为13,088.97份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为0.0005%。

募集资金已于2011年5月17日划入本基金在基金托管人中国工商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2011年5月16日验资完毕，2011年5月17日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2011年5月17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：2011年5月17日

13.基金合同生效日的基金份额总额：2,826,750,103.23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〔2011〕216号

2.上市交易日期：2011年7月25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50债

5.交易代码：160123

6.本次上市交易份额：190,702,823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：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。

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。

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2011年7月18日，本基金场内份额持有人户数为1202户，平均每户持有的基金份额为158654.59份。

（二）持有人结构

截至2011年7月18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17,037.296份，占场内基金总份额的8.9340%；场内个人投资者持有的基金份额为173,665.527份，占场内基金总份额的91.0660%。

（三）截至2011年7月18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	白伦朝	100,007.722.00	52.44
2	李建珍	15,001,250.00	7.87
3	国泰君安证券股份有限公司	10,000,694.00	5.24
4	姜广君	6,986,582.00	3.66
5	上海隆怡佳信息科技有限公司	4,986,415.00	2.61
6	戚觉定	3,000,208.00	1.57
7	冯汉斌	2,000,388.00	1.05
8	麦倩红	1,010,280.00	0.53
9	廖亚军	1,000,069.00	0.52
10	邱琦	1,000,069.00	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：440301101129537

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%。

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
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；

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
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
产品开发部	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
营销策划部	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
北京营销中心	负责所在区域公募基金、一对多专户等产品的销售工作及区域内代销渠道机构的维护和服务
上海营销中心	
深圳营销中心	
广州营销中心	
成都营销中心	
西安营销中心	
哈尔滨营销中心	
沈阳营销中心	
南京营销中心	
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
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
规划发展部	负责公司形象VI体系的管理和应用、公司社会公益事业建设
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2011年5月，我公司共有员工353人，博士12人、硕士176人、本科151人、其他13人。

5.信息披露负责人：赖文军

咨询电话：400-889-8899

6.基金管理业务情况

截至2011年5月，南方基金管理有限公司旗下共管理26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1730亿元人民币，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、南稳贰号、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、深成ETF、南方深成、南方策略、小康ETF、南方小康、南方广利、南方成长、南方50债、南方全球和南方金砖；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

刘朝阳，女，2007年毕业于北京大学光华管理学院，获金融硕士学位，3年基金行业从业经验，于2008年获得证券/基金从业资格，2007年7月加入南方基金，历任宏观研究员、债券交易员、现任南方基金管理有限公司固定收益部宏观策略高级研究员。

（二）基金托管人

1.基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币334,018,850.026元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

2.主要人员情况

截至2011年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工145人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3.基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年6月，中国工商银行共托管证券投资基金219只，其中封闭式7只，开放式212只。自2003年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的26项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）监管机构

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1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨剑信

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：陈熙

经办会计师：薛竞、陈熙

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50债券指数证券投资基金（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50债券指数证券投资基金（LOF）2011年7月18日资产负债表如下：

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	19,733,690.53	短期借款	-
结算备付金	21,698,095.24	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	1,129,962,000.00	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	3,711,699.32
债券投资	1,129,962,000.00	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	700,493.96
基金投资	-	应付托管费	140,098.78
衍生金融资产	-	应付销售服务费	329,527.23
买入返售金融资产	1,621,108,430.06	应付交易费用	4,536.71
应收证券清算款	39,733,071.63	应付税费	-
应收利息	16,219,664.80	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	151,312.68
其他资产	-	负债合计	5,037,668.68
		所有者权益：	
		实收基金	2,826,750,103.23
		未分配利润	16,667,180.35
		所有者权益合计	2,843,417,283.58
			-
资产合计：	2,848,454,952.26	负债与持有人权益总计：	2,848,454,952.26

八、基金投资组合

截止到2011年7月18日，南方中证50债券指数证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

资产项目	期末市值（元）	市值占基金总资产比例（%）
股票	-	-
债券	1,129,962,000.00	39.67
权证	-	
银行存款及清算备付金	41,431,785.77	1.45
其他资产	1,677,061,166.49	58.88
合计	2,848,454,952.26	100.00

（二）期末按行业分类的股票系投资组合

截至公告前两个工作日即2011年7月18日，本基金未持有股票。

（三）期末股票投资前十名明细

截至公告前两个工作日即2011年7月18日，本基金未持有股票。

（四）截止到2011年7月18日，按券种分类的债券投资组合

债券类别	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
国债	9,931,000.00	0.35
央行票据	-	-
金融债	289,178,000.00	10.17
企业（公司）债	-	-
可转债	-	-
短期融资券	830,853,000.00	29.22
中期票据	-	-
债券投资合计	1,129,962,000.00	39.74

（五）截止到2011年7月18日，债券投资前五名明细

序号	债券名称	市值	市值占净值比例
1	11国开40	59,670,000.00	2.10
2	10新奥CP01	50,250,000.00	1.77
3	10冀新能源CP01	50,180,000.00	1.76
4	11国开39	50,070,000.00	1.76
5	11南车CP01	50,010,000.00	1.76

（六）投资组合报告附注

1.申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。

截至公告前两个工作日即2011年7月18日，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2.申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。

截至公告前两个工作日即2011年7月18日，本基金未持有股票资产。

3.截至2011年7月18日其他资产构成

项目	金额
买入返售金融资产	1,621,108,430.06
应收证券清算款	39,733,071.63
应收利息	16,219,664.80
其他应收款	-
合计	1,677,061,166.49

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.投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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《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、勤勉尽责的原则经营基金资产。

（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、基金份额净值计算进行监督和核查；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50债券指数证券投资基金《LOF》基金合同》

（三）《南方中证50债券指数证券投资基金《LOF》托管协议》

（四）《南方中证50债券指数证券投资基金《LOF》招募说明书》

（五）法律意见书

（六）《南方中证50债券指数证券投资基金《LOF》登记结算服务协议》

（七）基金管理人业务资格批件、营业执照

（八）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
二〇一一年七月二十日

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

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依法申请赎回其持有的基金份额；

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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

⑨法律法规及《基金合同》规定的其他权利。

2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

①遵守《基金合同》；

②缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

③在其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《基金合同》当事人合法权益的活动；

⑤返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

⑥执行生效的基金份额持有人大会的决定；

⑦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依法募集基金；

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，应是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者的利益；

⑦在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

⑧选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销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注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

⑩依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

⑪在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

⑫在符合有关法律法规和《基金合同》、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则的前提下，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，决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

⑬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；

⑭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；

⑮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；

⑯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；

⑰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》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

①依法募集基金，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；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应是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者的利益；

②妥理基金备案手续；

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除依据《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采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销份额的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

⑨进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

⑩编制半年度和年度基金报告；

⑪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；

⑫保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

⑬按《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基金收益；

⑭按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

⑯按法律法规规定的年限保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料；

⑰确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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顺临解散、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托管人；

⑳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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

㉑监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

㉒其他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更换基金管理人；

③更换基金托管人；

④转换基金运作方式；

⑤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；

⑥变更基金类别；

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（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

⑨变更基金份额持有人大会程序；

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单独或合计持有本基金总份额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；

⑫对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

⑬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修改，不需召开基金份额持有人大会：

①调低基金管理费、基金托管费；

②法律法规要求增加的基金费用的收取；

③在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式；

④因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

⑤对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

⑥经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、注册登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

⑦除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1.除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2.基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3.基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4.代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

5.代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6.基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1.召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前40天，在至少一家指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

①会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

②会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

③有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

④授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

⑤会务常设联系人姓名及联系电话；

⑥出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

⑦召集人需要通知的其他事项。

2.采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3.如召集人为基金管理人，还应另行通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1.现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

①亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

②经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%（含50%）。

2.通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人约定的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

①会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在表决截止日前公布2次提示性公告；

②召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

③本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

④上述第③项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定。

⑤会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决。

（五）议事内容与程序

1.议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额10%（含10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少35天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日30天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

①关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

②程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额10%（含10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

2.议事程序

①现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所