华商基金管理有限公司关于华商中证500指数分级证券投资基金之华商中证500A与华商中证500B基金份额上市交易公告书

基金管理人:华商基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市日期:2012 年9 月26日
公告日期:2012 年9 月21日

第一部 分重要声明与提示

《华商基金管理有限公司关于华商中证500指数分级证券投资基金之华商中证500A与华商中证500B基金份额上市交易公告书》(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,华商中证500指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")管理人华商基金管理有限公司(以下简称"本公司")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、深圳证券交易所对华商中证500指数分级证券投资基金之华商中证500A与华商中证500B基金份额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2012年7月27日三大证券报的《华商中证500指数分级证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书同时发布在本公司网站(http://www.hsfund.com)。

第二部 分基金概览

一、基金名称:华商中证500指数分级证券投资基金
二、基金类型:股票型
三、基金运作方式:契约型开放式。
四、本基金的基金份额包括华商中证500基础份额(以下简称"华商500份额")、华商中证500A份额(以下简称"华商500A份额")与华商中证500B份额(以下简称"华商500B份额")。其中,华商500A份额、华商500B份额的基金份额配比始终保持4:6的比率不变。
五、本基金的存续期限为不定期。
六、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部基金份额将确认为华商500份额;场内认购的全部基金份额按照4:6的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别,即华商500A份额和华商500B份额。《基金合同》生效后,华商500份额设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。华商500A份额与华商500B份额交易代码不同,只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。
七、华商500份额的申购与赎回:投资者可在场内申购和赎回华商500份额,投资者可选择将其在场内申购的华商500份额按4:6的比例分拆成华商500A份额和华商500B份额。投资者也可按4:6的配比将其持有的华商500A份额和华商500B份额申请合并为场内的华商500份额。投资者可在场外申购和赎回华商500份额。投资者不得申请将其场外申购的华商500份额进行分拆,但《基金合同》另有规定的除外。但投资者可将其持有的场外华商500份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成华商500A份额和华商500B份额后上市交易。
八、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的华商500份额与华商500A份额、华商500B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的每10份华商500份额的场内份额申请转换成4份华商500A份额与6份华商500B份额的行为;合并是指基金份额持有人将其持有的每4份华商500A份额与6份华商500B份额申请转换成10份华商500份额的场内份额的行为。份额配对转换自华商500A份额、华商500B份额上市交易后不超过6个月的时间内开始办理,有关份额配对转换的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。
九、定期份额折算:本基金与其他永续分级基金不同,本产品有三年的分级运作期,分级运作期内不进行定期折算。
十、不定期份额折算:基金管理人在华商中证500份额的基金份额净值大于或等于2.500元时、华商中证500B类份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元时进行不定期折算。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。
十一、基金份额总额:截至2012年9月19日,本基金的基金份额总额为344,520,333.63份,其中,华商500份额为136,205,997.63份,华商500A份额为83,325,734.00份,华商500B份额为124,988,602.00份。
十二、基金份额净值:截至2012年9月19日,华商500的基金份额净值为1.000元,华商500A的基金份额净值为1.002元,华商500B份额的基金份额净值为0.999元。
十三、本次上市交易的基金份额简称:华商500A 华商500B
十四、本次上市交易的基金份额总额:华商500A为83,325,734.00份;华商500B为124,988,602.00份(截至2012年9月19日)
十五、本次上市交易的基金份额交易代码:华商500A为150110;华商500B为150111。
十六、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
十七、上市交易日期:2012年9月26日
十八、基金管理人:华商基金管理有限公司
十九、基金托管人:中国工商银行股份有限公司
二十、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

第三部 分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2012年2月27日证监许可[2012]244号文
2、基金合同生效日:2012年9月6日
3、基金运作方式:契约型开放式
4、基金合同期限:不定期
5、发售日期:2012年8月1日至8月31日
6、发售价格:1.00元人民币
7、发售方式:本基金通过场外、场内两种方式公开发售
8、发售机构:
(1)场外认购的销售机构:本基金通过外场发售的销售机构包括直销机构和代销机构。
1)直销机构
华商基金管理有限公司直销中心和华商基金管理有限公司网上交易。
2)代销机构
中国工商银行股份有限公司中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司交通银行股份有限公司招商银行股份有限公司中国民生银行股份有限公司北京银行股份有限公司上海浦东发展银行股份有限公司乌鲁木齐市商业银行股份有限公司南京银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、华龙证券有限责任公司天相投资顾问有限公司国泰君安证券股份有限公司中信建投证券股份有限公司国信证券股份有限公司招商证券股份有限公司广发证券股份有限公司中信证券股份有限公司中国银河证券股份有限公司海通证券股份有限公司中银万国证券股份有限公司长江证券股份有限公司安信证券股份有限公司中信证券(浙江)有限责任公司民生证券有限责任公司华泰证券股份有限公司山西证券股份有限公司中信万通证券有限责任公司信达证券股份有限公司东方证券股份有限公司光大证券股份有限公司国联证券股份有限公司浙商证券有限责任公司平安证券有限责任公司国海证券股份有限公司、国都证券有限责任公司东海证券有限责任公司国盛证券有限责任公司宏源证券股份有限公司齐鲁证券有限公司世纪证券有限责任公司华福证券有限责任公司财通证券有限责任公司日信证券有限责任公司江海证券有限公司华宝证券有限责任公司厦门证券有限公司中原证券股份有限公司广州证券有限责任公司联讯证券有限责任公司、国金证券股份有限公司华鑫证券有限责任公司深圳众禄基金销售有限公司杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司。
(2)场内认购的销售机构:本基金通过场内发售的机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单可在深交所网站查询。
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
本次募集的有效净认购总金额(不含利息)为人民币344,468,319.49元,利息结转份额52,014.14份,总确认份额为344,520,333.63份。其中场内净认购金额为人民币208,302,000.00元,场外净认购金额为人民币136,166,319.49元;认购资金的银行利息52,014.14元,折算成基金份额已分别计入各基金持有人的基金账户,归各基金持有人所有。
上述资金总额已于2012年9月6日全额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华商中证500指数分级证券投资基金托管专户。根据《基金合同》的约定,本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部份额确认为华商500;场内认购的全部份额按4:6的比例确认为华商500A和华商500B份额。《基金合同》生效后,华商500份额设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。华商500A份额与华商500B份额交易代码不同,只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。
(2)场内认购的份额确认:华商500份额按照4:6的比例自动分离为华商500A份额和华商500B份额。投资者也可按4:6的配比将其持有的华商500A份额和华商500B份额申请合并为场内的华商500份额。投资者可在场外申购和赎回华商500份额。投资者不得申请将其场外申购的华商500份额进行分拆,但《基金合同》另有规定的除外。但投资者可将其持有的场外华商500份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成华商500A份额和华商500B份额后上市交易。
11、基金合同生效日:2012年9月6日。
12、基金合同生效日的基金份额总额:344,520,333.63份,其中华商500为136,205,997.63份,华商500A为83,325,734.00份,华商500B为124,988,602.00份。
13、基金合同生效日的基金份额总额:344,520,333.63份,其中华商500为136,205,997.63份,华商500A为83,325,734.00份,华商500B为124,988,602.00份。
二、日常申购、赎回业务安排:
华商500的份额自2012年9月26日起开始办理日常申购、赎回业务。具体业务安排详见2012年9月21日登于三大证券报的《华商基金管理有限公司关于华商中证500指数分级证券投资基金之基础份额开放申购、赎回等业务的公告》。
三、华商500A和华商500B上市交易的主要内容
1、华商500A和华商500B上市交易的核准机构和核准文号:深证上【2012】320号
2、上市交易日期:2012年9月26日。
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金简称:华商500A、华商500B。
5、交易代码:华商500A为150110、华商500B为150111。
6、本次上市交易份额:华商500A为83,325,734.00份、华商500B为124,988,602.00份。(截止2012年9月19日)
7、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的华商500办理跨系统转托管到场内(证券登记结算系统)后,可以向具有基金代销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,根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成华商500A和华商500B,分拆后的华商500A和华商500B可以在深圳证券交易所场内上市流通。
8、基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布该工作日的华商500、华商500A和华商500B的基金份额净值,并在深圳证券交易所行情发布系统对华商500A和华商500B进行揭示。
四、份额配对转换业务安排:自2012年9月21日起,开通本基金的份额配对转换业务,即华商500与华商500A、华商500B之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。具体规定详见2012年9月21日刊登于三大证券报的《华商基金管理有限公司关于华商中证500指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告》。

第四部分 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2012年9月19日,本基金场内份额持有人户数为855户,平均每户持有的基金份额为243,642.50份;华商500A 855户,平均每户持有的基金份额为97,457.00份;华商500B 855户,平均每户持有的基金份额为146,185.50份。
二、持有人结构
截至2012年9月19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97,949,566份,占场内基金总份额的47.0201%;场内个人投资者持有的基金份额为110,364,770份,占场内基金总份额的52.9799%。
机构投资者持有的本次上市交易的华商500A份额为39,179,826份,占本次华商500A上市交易基金份额比例为47.0201%;个人投资者持有的本次上市交易的华商500A份额为44,145,908份,占本次华商500A上市交易份额比例为52.9799%。
机构投资者持有的本次上市交易的华商500B份额为58,769,740份,占本次华商500B上市交易基金份额比例为47.0201%;个人投资者持有的本次上市交易的华商500B份额为66,218,862份,占本次华商500B上市交易份额比例为52.9799%。
三、截至2012年9月19日,前十名场内基金份额持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	证券帐户号	持有华商500A份额	占场内华商500A份额比例	持有华商500B份额	占场内华商500B份额比例
1	山西证券股份有限公司	0899031951	4,000,311	4.80%	6,000,466	4.80%
2	招商证券股份有限公司	0899038828	4,000,241	4.80%	6,000,361	4.80%
3	中信证券股份有限公司	0899046209	4,000,186	4.80%	6,000,279	4.80%
4	红塔证券股份有限公司	0899013695	4,000,116	4.80%	6,000,175	4.80%
5	浙商证券-农行-浙商汇金1号集合资产管理计划	0899054214	4,000,116	4.80%	6,000,175	4.80%
6	中国银河证券股份有限公司	0899054806	4,000,116	4.80%	6,000,175	4.80%
7	兴业证券股份有限公司	0899003034	3,600,105	4.32%	5,400,157	4.32%
8	东兴证券股份有限公司	0899053517	3,200,280	3.84%	4,800,419	3.84%
9	民生证券有限责任公司	0508007292	2,800,190	3.36%	4,200,286	3.36%
10	光大证券股份有限公司	0899029696	2,018,058	2.42%	3,027,088	2.42%

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。由于四舍五入的原因,占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

第五部分 基金主要当事人简介

一、基金管理人
1、公司概况
名称:华商基金管理有限公司
法定代表人:李晓安
总经理:王锋
设立日期:2005年12月20日
注册资本:壹亿元人民币
注册地址:北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心19层
办公地址:北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心19层
设立批准文号:中国证券监督管理委员会,证监基金字[2005]160号文
工商登记注册的法人营业执照注册号:110000009214208
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
存续期间:长期
2、股东及其出资比例:华龙证券有限责任公司持有46%的股权,中国华电集团财务有限公司持有34%的股权,济钢集团有限公司持有20%的股权。
3、内部组织结构及职能
公司设立了投资决策委员会和风险管理委员会等专业委员会。投资决策委员会负责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。风险管理委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险,并提出防范措施。
公司目前下设投资管理部、机构投资部、量化投资部、研究发展部、证券交易部、市场开发部、营销客户部、运营保障部、监察稽核部、计划财务部、综合管理部共十一个部门。投资管理部负责根据投资决策委员会制定的原则以专业经营方式管理和运作基金资产。研究发展部负责宏观、策略、行业研究和上市公司调研等研究工作,为公司的投资决策提供有效支持。机构投资部负责专户客户的开发及维护,专户资产的投资运作。量化投资部负责产品研究及新产品开发以及量化研究和量化投资工作。市场开发部分为渠道销售团队和机构销售团队,渠道销售团队负责开发和维护代销渠道、管理和监督日常的代销业务,机构销售团队负责机构客户的开发与维护。营销客户部负责市场推广、营销策略研究、基金营销方案及客户服务。证券交易部负责基金交易。运营保障部负责公司信息系统的日常运行及维护,对基金的各项交易活动进行会计处理、注册登记、基金清算等工作。监察稽核部负责监察、监督和评价公司及各部门的合法合规情况、与监管机构联系和沟通、信息披露,对投资交易过程中可能出现的风险进行研究和监控,同时进行基金绩效评价等工作。计划财务部负责公司的财务预算、财务管理及会计核算工作。综合管理负责文书档案、后勤服务、人力资源等综合事务管理及公司董事会的日常工作。
4、人员情况
截至2012年6月30日,我公司共有128名员工,其中博士学位9人、硕士学位58人和学士学位56人。
5、信息披露负责人:周亚红
咨询电话:010-58573600
6、基金管理业务情况
目前管理华商领先企业混合型证券投资基金、华商盛世成长股票型证券投资基金、华商收益增强债券型证券投资基金、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华商产业升级股票型证券投资基金、华商稳健双利债券型证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华商稳定增利债券型证券投资基金、华商价值精选股票型证券投资基金、华商主题精选股票型证券投资基金、华商中证500指数分级证券投资基金。
7、本基金基金经理简介
田明圣先生:经济学博士,拥有6年证券从业经历,熟悉债券基金的投资运作,具有基金从业资格:2005年1月至2006年1月,就职于中石油财务公司,任金融与会计研究;2006年1月至2006年5月,就职于华商基金管理有限公司,任产品设计和研究;2006年6月至2007年7月就职于西南证券投资银行部,任研究员;2007年7月加入华商基金管理有限公司,2010年7月至今担任华商领先企业混合型基金基金经理。现任公司总经理助理、研究总监、研究发展部总经理,公司投资决策委员会成员。任本只基金基金经理。
二、基金托管人
1、名称:中国工商银行股份有限公司(简称:中国工商银行)
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:娄建清
成立时间:1984年1月1日
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币349,018,545,827元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》国发[1983]146号
联系人:赵会军
联系电话:010-66105799
2、主要人员情况
截至2012年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工146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2012年6月,中国工商银行共托管证券投资基金252只,其中封闭式7只,开放式245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31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、上市推荐人
本基金无上市推荐人。
四、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1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
联系人:吴海霞
经办注册会计师:许康玮、吴海霞

第六部分 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

第七部分 基金财务状况

深圳证券交易所在华商中证500指分级证券投资基金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。
华商中证500指分级证券投资基金2012年9月19日资产负债表如下:

资产	期末	负债和所有者权益	期末
	余额		余额
资产:		负债:	
银行存款	34,351,130.95	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	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	122,379.11
基金投资		应付托管费	26,923.42
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产	311,000,000.00	应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	140,871.47	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	770,276.59
其他资产	52,014.14	负债合计	919,579.12
		所有者权益:	
		实收基金	344,520,333.63
		未分配利润	104,103.81
		所有者权益合计	344,624,437.44
资产合计:	345,544,016.56	负债与持有人权益总计:	345,544,016.56

第八部分 基金投资组合

截止到2012年9月19日,华商中证500指数分级证券投资基金的投资组合如下:
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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	311,000,000.00	90.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	34,351,130.95	9.94
6	其他资产	192,885.61	0.06
7	合计	345,544,016.56	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票投资。
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
本基金本报告期末未持有股票投资,无前十名股票投资明细。
4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。
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
本基金本报告期末未持有债券投资,无前五名债券投资明细。
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,无前十名资产支持证券投资明细。
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五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证,无前五名权证投资明细。
8 投资组合报告附注
8.1 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。
8.2 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。
8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	140,871.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	52,014.14
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	192,885.61

8.4 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。
8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票投资,无前十名股票中存在流通受限情况的说明。

第九部分 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。

第十部分 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。

第十一部分 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,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。
(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,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、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。
(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

第十二部分 基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

第十三部分 备查文件目录

以下备查文件分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,供公众查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅:
(一)中国证监会批准华商中证500指数分级证券投资基金募集的文件
(二)《华商中证500指数分级证券投资基金基金合同》
(三)《华商中证500指数分级证券投资基金托管协议》
(四)法律意见书
(五)基金管理人业务资格批件、营业执照
(六)基金托管人业务资格批件和营业执照
(七)中国证监会要求的其他文件

华商基金管理有限公司
二 〇 一二 年九月二十一日

附件:基金合同摘要
1、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利及义务
(一)基金管理人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:
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,应呈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》的前提下,制订和调整《业务规则》,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。
(二)基金管理人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:
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,应呈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.办理基金备案手续;
3.《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、赎回和注销价格的方法符合《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.按规定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15年以上;
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.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;
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,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
22.当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;
23.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
24.基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
25.执行生效的基金份额持有人大会的决定;
26. 建立并保存基金份额持有人名册,定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;
27.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)基金托管人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利为:
1.自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
2.依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
3.监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为、对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
4.以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户;
5.以基金托管人名义开立证券交易资金账户,用于证券交易资金清算;
6.以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户,负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算;
7.提议召开或召集基金份额持有人大会;
8.在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
9.法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
(四)基金托管人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务为:
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门,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;对所托管的不同的基金分别设置账户,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,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;
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予以保密,不得向他人泄露;
8.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;
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》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;
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.建立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. 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;
16.按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;
17.参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;
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监管机构,并通知基金管理人;
19.因违反《基金合同》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定;
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。
(五)基金份额持有人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的权利为:
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、基金合同规定的其他权利。
(六)基金份额持有人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的义务为:
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;

(下转D11版)

华商基金管理有限公司关于华商中证500指数分级证券投资基金之基础份额开放申购及赎回业务的公告

公告送出日期:2012年9月21日

1 公告基本信息

基金名称	华商中证500指数分级证券投资基金
基金简称	华商中证500指数分级
基金主代码	166301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月6日
基金管理人名称	华商基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《华商中证500指数分级证券投资基金合同》、《华商中证500指数分级证券投资基金招募说明书》
申购起始日	2012年9月26日
赎回起始日	2