中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

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

重要提示

本基金经中国证监会2012年12月21日证监许可[2012]1727号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,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,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是跟踪中证500指数的交易型开放式基金,投资本基金可能遇到的风险还包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。本基金被动跟踪标的指数“中证500指数”,因此,本基金的业绩表现与中证500指数的表现密切相关。同时,本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。

投资者申购的基金份额当日可卖出,当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回;即在目前结算规则下,T日申购的基金份额当日可卖出,T日申购当日未卖出的基金份额,T+1日不得卖出和赎回,T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约,将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额,投资者的利益可能受到影响。

投资者投资本基金时需具有上海证券交易所A股账户或基金账户。其中,上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资者需要使用中证500指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户;如投资者需要使用中证500指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购,则还应开立深圳证券交易所A股账户。

投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况、基金份额上市交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》),以及《中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

《招募说明书》中除非文意另有所指,下列词语具有如下含义:

1、基金或本基金:指中证500交易型开放式指数证券投资基金

2、基金管理人:指南方基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同或本基金合同:指《中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书:指《中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》

8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》:指《中证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》:指《中证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》:指《中证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、交易型开放式指数证券投资基金:指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”

14、ETF联接基金:是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF(以下简称目标ETF),紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金,简称联接基金

15、中证监会:指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构:指中国人民银行和或中国银行业监督管理委员会

17、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

18、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

19、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、合格境外机构投资者:指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者:指按照《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》(包括其不时修订)及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

22、投资人:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

23、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。

25、销售机构:指直销机构、发售代理机构及申购赎回代理券商

26、基金销售网点:基金销售机构的销售网点

27、发售代理机构:指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

28、发售协议:指基金管理人指定的协调本基金发售等工作的代理机构

29、申购赎回代理券商:指基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司,又称为代办证券公司

30、登记业务:指《中证监券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务

31、登记机构:指中国证券登记结算有限责任公司

32、指定交易:《上海证券交易所指定交易实施细则》中定义的“指定交易”

33、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

34、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

35、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

36、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

37、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月

38、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

41、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

42、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

43、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他业务的时间段

44、上交所:《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》

45、认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为

46、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定,以申购赎回清单规定的申购对价向基金管理人购买基金份额的行为

47、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同规定的条件,向基金管理人卖出基金份额以取得申购赎回清单所规定的赎回对价的行为

48、申购赎回清单:指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件;

49、申购对价:指投资者申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

50、赎回对价:指基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

51、标的指数:指中证指数有限公司编制并发布的中证500指数及其未来可能发生的变更

52、组合证券:指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

53、最小申购赎回单位:指本基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资者申购或赎回的基金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍

54、现金替代:指申购或赎回过程中,投资者按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金

55、现金差额:指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差;投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

56、元:指人民币元

57、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

58、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

59、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

60、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

61、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

62、指定媒体:指中国证监会指定的用以进行有信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

63、不可抗力:指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:南方基金管理有限公司

住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

成立时间:1998年3月6日

法定代表人:吴万善

注册资本:1.5亿元人民币

电话:0755-82763888

传真:0755-82763889

联系人:鲍立革

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。目前股权结构: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%。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

吴万善先生,董事,中共党员,工商管理硕士,高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员;华泰证券证券发行部副经理、总经理助理;江苏省证券登记处总经理;华泰证券副总经理、总裁,现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、代总经理。

张涛先生,董事,中共党员,博士研究生。历任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理、深圳总部副总经理、深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任;现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员。

姜随先生,董事,中共党员,硕士研究生。历任南京农业大学教师;华泰证券人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行部股票事务部副经理、投资银行一部副总经理、投资银行一部高级经理、投资银行总部副总经理兼发行部总经理、资产管理总部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务南京总部总经理、总裁助理兼上海总部总经理、公司机构客户服务部总经理。现任华泰证券股份有限公司副总裁、董事会秘书、党委委员。

李真先生,董事,中共党员,材料工程、企业管理双学士,高级工程师。历任机械工业部科技司材料工艺处、科研管理处副主任科员、总工程师秘书、科技与质量监督司行政处处长;深圳亚洲飞利石有限公司副总经理(干部交流);深圳市投资管理公司董事局秘书处副主任、综合部副部长、部长、总裁助理兼工业一部部长、办公室主任;深圳市通产实业有限公司党委书记、董事长;深圳会展中心管理有限责任公司党委书记、总经理、董事长;现任深圳市投资控股有限公司董事、总经理、党委副书记。

余钢先生,董事,中共党员,毕业于湘潭大学英语专业,高级经济师,中共党员。历任广州军区技术局四处见习学员;广州军区技术局组织处助理翻译、中尉;广州军区情报部副连参谋、正连参谋、副营参谋;深圳市投资管理公司人事部、董办、办公室业务经理;深圳市国资委企业领导人员管理处主任科员;深圳市国资委办公室副主任、党委秘书;深圳市国资委企业领导人员管理处副处长;深圳市地铁有限公司人力资源部部长、党支部书记;深圳市地铁集团有限公司党委委员人力资源部部长、党支部书记(2009-2010年4月兼深圳通公司董事、深圳大学轨道交通学院理事会理事);2009.09—2009.11深圳市市委中青班培训学习;现任深圳市投资控股有限公司党委副书记、纪委书记、董事。

洪文瑾女士,董事,中共党员,硕士研究生。历任厦门经济特区建设发展公司财务部,厦门建发集团有限公司财务部副经理、厦门建发信托投资公司副总经理、总经理,厦门国际信托投资有限公司总经理,现任厦门国际信托有限公司董事长。

庄园芳女士,董事,工商管理硕士,经济师。历任兴业证券交易业务部总经理助理,负责人,证券投资部副总经理、总经理,投资总监;现任兴业证券股份有限公司副总裁。

高良玉先生,董事,中共党员,经济学硕士,经济师。历任南京农业大学审计处干部、中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长。1998年加入南方基金担任副总经理、总裁,现任南方基金管理有限公司副董事长兼党委副书记、南方东英资产管理有限公司(香港)董事会主席。

张磊先生,独立董事,工商管理硕士(MBA)及国际关系硕士,注册金融分析师(CFA),获得美国NASD Series 7 & 65证书。曾工作于耶鲁大学投资基金办公室(Yale Endowment)及美国新生市场投资基金(Emerging Markets Management,LLC),主要从事基金管理及投资研究。历任纽约证券交易所国际董事及中国首席代表;现任HCM投资管理有限公司高级合伙人、United World College of Southeast Asia Foundation校董、耶鲁大学校务委员会成员、国际顾问委员会成员、纽约金融分析师协会会员。

周春生先生,独立董事,博士。历任美国联邦储备委员会经济学家、美国加州大学及香港大学商学院教授、中国证监会规划发展委员会委员(副级)、中国留美金融学会理事、美国经济学会、美国金融研究会会员、Annals of Economics and Finance编委、北京大学光华管理学院院长助理、EMBA中心主任、高层管理者培训与发展中心主任、财务金融学教授、香港大学荣誉教授、深圳证券交易所第一、二、三届上市委员会委员;现为长江商学院金融教授、EMBA和高层培训项目学术主任,国家杰出青年基金获得者。

王金洲先生,独立董事,中共党员,大学学历,1997年中国人民大学会计专业研究生班毕业,注册会计师、资产评估师、注册税务师;历任北京市财政局会计处副处长、北京会计公司总经理(正处级);现任北京兴华会计师事务所董事长、主任会计师。

从培国先生,独立董事,法学硕士。历任北京大学法律系经济法教研室助教、经济师讲师、经济法教研室副主任,美国加州大学洛杉矶校区(UCLA)客座教授、北京大学副教授;现任北京君佑律师事务所合伙人、事务所主任。

米志明先生,独立董事,本科,高级经济师、注册会计师。历任江苏省姜堰税务局副局长、扬州市税务局副局长、扬州市财政局局长、党组书记、扬州市人民政府副秘书长,建设银行扬州市分行行长、党组书记,财政部深圳专员办专员、巡视员。

2、监事会成员

骆新都女士,职工监事,经济学硕士,经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、顾问;现任南方基金管理有限公司监事会主席。

舒本娥女士,监事,本科。历任熊猫电子集团公司财务处财务处长,华泰证券计划资金部副总经理(主持工作),稽查监察部副总经理、总经理;现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。

周展民先生,监事,工学硕士、工商管理硕士(MBA),经济师。历任深圳三九企业集团三九贸易公司职员,深圳大鹏证券有限公司投资银行部项目经理、加拿大西蒙弗雷泽大学工商管理学院MBA学生兼助教,广东美的集团战略发展部高级经理,招商局集团中国南山开发(集团)公司研究发展部高级项目经理,深圳市投资控股有限公司投资部副经理、经理;现任深圳市投资控股有限公司投资部高级主管。

苏荣坚先生,监事,学士学位,高级经济师。历任三明市财政局、财委,厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理,自营业务部经理;现任厦门国际信托有限公司财务部总监兼财务部总经理。

郑城美先生,监事,中共党员,经济学硕士。历任兴业证券华林营业部客户经理、研究发展中心市场分析师、经纪业务部市场分析师、办公室文秘部经理、南平滨江路营业部副总经理(主持工作)、计划财务部副总经理、财务部总经理;现任兴业证券财务总监兼计划财务部总经理。

苏民先生,职工监事,博士研究生,工程师。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师,华夏证券深圳分公司电脑部经理助理,南方基金管理有限公司运作保障部副总监、市场服务部总监、电子商务部总监;现任南方基金管理有限公司风险管理部总监。

3、公司高级管理人员

吴万善先生,董事,中共党员,工商管理硕士,高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员;华泰证券证券发行部副经理、总经理助理;江苏省证券登记处总经理;华泰证券副总经理、总裁,现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、代总经理。

俞文宏先生,副总裁,中共党员,工商管理硕士,经济师,历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际招商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。2003年加入南方基金,现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

郑文祥先生,副总裁,工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司。2000年加入南方基金,历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方避险增值基金基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监,现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱运东先生,副总裁,中共党员,经济学学士。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司,2002年加入南方基金,历任北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官,现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

秦长奎先生,副总裁,中共党员,工商管理硕士。历任南京汽车制造厂经营计划处科员,华泰证券有限责任公司营业部总经理、总裁助理兼基金部总经理、投资银行总部副总经理兼债券部总经理。2005年加入南方基金,曾任督察长兼监察稽核部总监,现任南方基金管理有限公司副总裁、纪委委员、南方东英资产管理有限公司(香港)董事。

杨小松先生,督察长,中共党员,会计学硕士,注册会计师。历任德勤国际会计师行会计专业翻译,光大银行证券部职员,证监会国际部、上市部、发行部主任科员、副处长、处长(期间曾派往美国NASDAQ工作),证监会上海监管局党委委员兼局长助理、副局长,证监会发行监管部副主任。2012年加入南方基金,现任南方基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

潘海宁,会计学学士,12年证券从业经历,具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年3月加入南方基金,历任行业研究员、基金开元基金经理助理、投资部总监助理、数量化投资部副总监等职务。2009年3月至今,任南方300指数基金经理;2009年12月至今,任南方深成ETF及联接基金基金经理;2011年2月至今,任南方500基金经理。

5、投资决策委员会成员

副董事长高良玉先生,总裁助理兼投资总监邱国鹭先生,研究部总监史博先生,投资部执行总监陈键先生,专户投资管理部执行总监蒋峰先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

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;

2、办理基金备案手续;

3、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;

4、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;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制中期和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回清单;

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9、召集基金份额持有人大会;

10、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;

11、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者实施其他法律行为;

12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

(四)基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

①将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

②不公平地对待管理的不同基金财产;

③利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

④向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

⑤依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

①越权或违规经营;

②违反基金合同或托管协议;

③欺瞒报告基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;

④在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

⑤拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

⑥玩忽职守,滥用职权;

⑦泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

⑧除按本公司制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票投资;

⑨劝勉、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;

⑩违反证券交易场所业务规则,利用对敲倒、对仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

⑪聚拢同行,以提高自己;

⑫在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

⑬以不正当手段谋求业务发展;

⑭有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

⑮其他法律、行政法规禁止的行为。

(五)基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

1、承销证券;

2、向他人贷款或者提供担保;

3、从事承担无限责任的投资;

4、买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

8、依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(六)基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(七)基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作,有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险,确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整,从而最大程度地保护基金份额持有人的利益,本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是对各项基本管理制度的总揽和指导,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门、和岗位在职能上应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡,并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性,运用科学化的方法尽量降低经营运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、主要内部控制制度

①内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《会计财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

②风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定,风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

③监察稽核制度

公司设立督察长,负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名,董事会聘任,并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外,督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要,有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告,并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门,具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员,明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立,检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况;检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

四、基金托管人

一、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人:蒋超良

成立时间:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:国务院国发[1979]056号

组织形式:股份有限公司

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

联系电话:010-63201510

传真:010-63201816

联系人:李芳菲

发展概况:

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。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“作你成长”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《金球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内控报告,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。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金牌理财’TOP10”颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

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。

二、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工146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。

三、基金托管业务经营情况

截止2012年6月30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124只。

四、基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、上市推荐人

申银万国证券股份有限公司

2、发售主协调人

华泰证券股份有限公司

3、网下现金发售直销机构

南方基金管理有限公司

住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

法定代表人:吴万善

电话:0755-82763905

传真:0755-82763900

联系人:张锐珊

4、网下现金发售代理机构、网下股票发售代理机构和网上现金发售代理机构

详见《发售公告》。

(下转D6版)

中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

[重要提示]

1、中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)的发售已获中国证监会2012年12月21日证监许可[2012]1727号文批准。

2、本基金类别为股票型证券投资基金,运作方式为交易型开放式。

3、本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司,登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、本基金自2013年1月10日至2013年1月31日进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。其中,网下现金发售的日期为2013年1月10日至2013年1月31日,网下股票发售的日期为2013年1月10日至2013年1月31日,网上现金发售的日期为2013年1月29日至2013年1月31日。如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整,我司将相应调整并及时公告。

6、本基金管理人可办理网下现金发售。

7、本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

8、同时办理本基金的网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构:华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、安信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、江海证券有限公司、国联证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、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、东吴证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、山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、国海证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、西南