华商中证500指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2013年第1号）

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

【重要提示】

华商中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2012年 2月 27日经中国证监会证监许可【 2012 】244号文核准募集，本基金基金合同于2012年9月6日生效。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预测其未来表现。

本摘要根据基金合同和招募说明书编写，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。

本招募说明书所载内容截止日为2013年3月6日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
1.名称：华商基金管理有限公司
2.住所：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心19层
3.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
4.法定代表人：李晓安
5.设立日期：2005年12月20日
6.注册资本：壹亿元
7.电话：010－58573600　传真：010－58573520
8.联系人：周亚红
9.股权结构

股东名称	出资比例
华龙证券有限责任公司	46%
中国华电集团财务有限公司	34%
济钢集团有限公司	20%

10.客户服务电话：010－58573300 400－700－8880（免长途费）

11.管理基金情况：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、华商现金增利货币市场基金、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金。

（二）基金管理人主要人员情况

1.董事会成员

李晓安：董事长。男，清华大学EMBA。现任华龙证券有限责任公司董事长兼党委书记，历任天水市信托投资公司副总经理、总经理、党委书记，天水市财政局副局长、局长、党组书记。

郭怀保：副董事长。男，硕士、工程师。现任中国华电集团财务有限公司总经理，曾就职于新疆奎屯河水电站、伊犁电力局、伊犁二电厂，历任中国华电集团财务有限公司副总经理，中国华电集团发电运营有限公司总经理。

邵明天：董事。男，高级工程师。现任济钢集团有限公司副总经理，历任济钢第一炼钢厂副厂长、济钢第二炼钢厂厂长、济钢第三炼钢厂筹备组组长及厂长等职务。

韩鹏：董事。男，工商管理硕士。现任华龙证券有限责任公司总经理，曾就职于甘肃经济管理干部学院、兰州信托上海武昌路营业部、闽发证券公司，历任华龙证券有限责任公司资产管理部总经理、总裁助理兼投资总监。

徐国兴：董事。男，工商管理硕士。现任华龙证券有限责任公司副总经理，曾就职于招商银行兰州分行、甘肃省国税局、中国化工集团，历任华龙证券有限责任公司委托投资部总经理、投资副总监。

李文峰：董事。男，硕士研究生学历。高级经济师，现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理。曾就职于中国人民保险公司、中国电力信托投资有限公司、中国电力财务有限公司、中国华电集团财务有限公司。

徐信忠：独立董事。男，金融学博士、教授。现任中山大学岭南学院院长，历任WARWICK大学（英国）研究员，MANCHESTER大学（英国）会计与金融系讲师和高级讲师，BANK OF ENGLAND（英国）货币政策局金融经济家，LANCASTER大学（英国）高级讲师和讲座教授，北京大学光华管理学院金融系教授兼金融系主任。

李业：独立董事。男，管理学博士、教授。现任华南理工大学管理学院副院长、教授，历任广州华南理工大学管理工程系助教、讲师，华南理工大学工商管理学院副教授。

方国春：独立董事。男，教育学硕士。现任英大人寿保险股份有限公司监事、人力资源部主任，历任国家教育委员会政策法规司副处长、中国光大国际信托投资公司总经理助理、国家留学基金委中澳项目办公室副主任、长城人寿保险股份有限公司项目中心经理。

2.监事会成员

吴艳坤：监事。硕士研究生学历，中级经济师。现任职于中国华电集团资本控股有限公司机构管理与发展部。曾就职于中国华电集团公司、中国华电集团财务有限公司。

徐亮天：监事。会计师。现任济钢集团有限公司财务处副处长，历任济钢财务处物价科科员、财务处成本科科长、财务处副处长等职务。

申艳丽：职工监事。经济学硕士。现任职于华商基金管理有限公司投资管理部。

3.总经理及其他高级管理人员

王锋：总经理。男，工学学士、经济学硕士。曾任博时基金管理公司研究部研究员、基金管理部基金经理助理，云南国际信托投资管理有限公司资产管理总部执行总经理；自2005年9月加入华商基金管理有限公司，历任公司投资管理部总经理、公司投资决策委员会委员、华商领先企业混合型证券投资基金基金经理、公司副总经理等职务。

程丹倩：副总经理。女，工商管理学硕士。曾任职于中国经济开发信托投资公司证券总部计财部和证券投资部。2002年7月至2005年12月，担任华商基金管理公司（筹）筹备组成员，2005年12月至2011年8月担任华商基金管理有限公司督察长。

周亚红：督察长。女，经济学博士。2011年7月加入华商基金管理有限公司，曾任云南财经大学金融系副教授，博时基金管理有限公司研究员、TA主管、产品设计师、渠道主管、市场部副总经理，国金通用基金管理有限公司（筹）总经理助理等职务。

4.基金经理

田明圣先生：经济学博士，拥有7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，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。2010年7月至今担任华商领先企业混合型基金基金经理，2012年9月6日至今担任本基金基金经理，2013年2月至今担任华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2013年3月担任华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

本基金自基金合同生效之日起未发生基金经理变动情形。

5.投资决策委员会成员

本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

王锋：华商基金管理有限公司总经理、投资决策委员会主席；

田明圣：华商基金管理有限公司总经理助理、研究总监、研究发展部总经理、华商领先企业混合型证券投资基金基金经理、华商中证500指数分级股票型证券投资基金基金经理、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

梁永强：华商基金管理有限公司量化投资部总经理、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华商主题精选股票型证券投资基金基金经理；

刘宏：华商基金管理有限公司投资管理部副总经理、华商产业升级股票型证券投资基金基金经理、华商价值精选股票型证券投资基金基金经理、华商盛世成长股票型证券投资基金基金经理；

梁伟泓：华商收益增强债券型证券投资基金基金经理；

王华：华商基金管理有限公司证券交易部总经理；

上述人员之间无近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况
名称：中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”）
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）
设立日期：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：（010）—66105799
托管部门联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至2012年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工157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。

（三）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12月，中国工商银行共托管证券投资基金282只，其中封闭式5只，开放式277只。自2003 年以来，本行连续九年获得香港《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35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。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010年四次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2011年中国工商银行资产托管部第五次通过ISAE3402（原SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；托管部内部设置独立的负责内部风险的部门，专责内控制度的检查。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制，横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据基金合同、基金托管人与基金管理人签署的《华商中证500指数分级证券投资基金托管协议》和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资监督和检查自本基金合同生效之日开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《《基金合同》本协议或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。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，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1. 场外发售机构
1）直销机构：
名称：华商基金管理有限公司
住所：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
法定代表人：李晓安
直销中心：华商基金管理有限公司
电话：010-58573768
传真：010-58573737
网址：www.hsfund.com

2）代销机构：

(1)　中国工商银行股份有限公司
注册地址：中国北京复兴门内大街55号
办公地址：中国北京复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客服电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

(2)　中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
客服电话：95599
网址：www.abchina.com

(3)　中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
客服电话：95533
网址：www.ccb.com

(4)　交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
电话：021-58781234
传真：021-58408483
联系人：曹榕
客服电话：95559
网址：www.bankcomm.com

(5)　招商银行股份有限公司
注册地点：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
电话：0755-83198888
传真：0755-83195109
客服电话：95555
网址：www.cmbchina.com

(6)　中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
电话：010-58560666
客户服务咨询电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

(7)　北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：谢小华
电话：010-66223587
传真：010-66226045
客户服务电话：95526
网址：www.bankofbeijing.com.cn

(8)　上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
客服电话：95528
网站：www.spdb.com.cn

(9)　温州银行股份有限公司
住所：温州市车站大道196号
法定代表人：邢增福
客服电话：浙江省内96699，上海地区962699
公司网址：www.wzbank.com.cn

(10) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司
注册地址：乌鲁木齐市新华北路8号
办公地址：乌鲁木齐市扬子江路339号商行科技大厦7楼
法定代表人：农惠臣
电话：0991-8824667
联系人：何佳
客服电话：96518
网址：www.uccb.com.cn

(11) 南京银行股份有限公司
注册地址：南京市中山路288号
办公地址：南京市中山路288号
法定代表人：林复
电话：025-86775335
传真：025-86775376
联系人：刘晔
服务热线：400-88-96400
网址：www.njcb.com.cn

(12) 华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心
法定代表人：李晓安
电话：0931-4890619
传真：0931-4890628
联系人：李昕田
客服热线：400-689-8888
网址：www.hlzqgs.com

(13)　国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
电话：0755－82130833
传真：0755-82133952
联系人：齐晓燕
客服热线：95536
网址：www.guosen.com.cn

(14)　浙商证券股份有限公司
注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场
办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场
法定代表人：吴承根
电话：0571-87901963
传真：0571-87901955
联系人：胡岩
客服热线：0571-967777
网址：www.stocke.com.cn

(15)　光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：刘晨、李芳芳
客服电话：95525、4008888788、10108998
网址：www.ebscn.com

(16)　国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：万建华
电话：021-38676666
传真：021-38670666
联系人：芮敏祺
客服电话：400-8888-666
网址：www.gtja.com

(17)　申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：储晓明
电话：021-54041654
传真：021-54033888
联系人：李清怡
客服电话：95523或4008895523
网址：www.sywg.com

(18)　海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
联系人：金芸、李笑鸣
客服电话：95553、400-8888-001
网址：www.htsec.com

(19)　山西证券股份有限公司
注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

(20)　中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安
电话：010-66568430
传真：010-66568990
联系人：田薇
客服电话：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn

(21)　中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
开放式基金业务传真：（010）65182261
联系人：权唐
客服电话：400-8888-108
网址：www.csc108.com

(22)　中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）
法定代表人：杨宝林
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：吴忠超
客服电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

(23)　中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：刘军
联系电话：0571-86811958
传真：0571-86078823
联系人：周妍
公司网站：www.bigsun.com.cn
客户服务中心电话：0571-96598

(24)　中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
法定代表人：王东明
联系电话：010-84588888
传真：010-84865560
联系人：滕艳
网址：www.citics.com

(25)　财通证券有限责任公司
注册地址：杭州市杭大路15号
办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：沈继宁
联系电话：0571-87822359
传真：0571-87818329
联系人：徐轶青
客服电话：96336（浙江），40086-96336（全国）
网址：www.ctsec.com

(26) 广发证券股份有限公司
注册地址：广东广州天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
客服电话：95575或致电各营业网点
网址：www.gf.com.cn

(27)　平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
电话：0755-22626391
传真：0755-82400862
联系人：郑舒丽
客服电话：95511-8
网址：www.pingan.com

(28)　安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
开放式基金咨询电话：4008001001
开放式基金业务传真：0755-82558355
联系人：陈剑虹
联系电话：0755-82825551
网址：www.essence.com.cn

(29) 招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
联系人：林生迎
客服电话：95565　4008888111
网址：www.newone.com.cn

(30)　东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人：潘鑫军
电话：021-63325888
传真：021-63326173
联系人：吴宇
客服电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn

(31)　宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号宏源证券
法定代表人：冯戎
电话：010-88085858
联系人：李巍
客服电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

(32)　信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：高冠江
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
传真：010-63080978
客服电话：400-800-8899
公司网址：www.cindasc.com

(33)　东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：朱科敏
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
联系人：梁旭
客服电话：95531；400-888-8588
网址：www.longone.com.cn

(34)　华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
联系电话：0591-87383623
业务传真：0591-87383610
联系人：张腾
客服电话：96326（福建省外请加拨0591）
网址：www.hfzq.com.cn

(35) 国都证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
电话：010-84183333
传真：010-84183311-3389
联系人：黄静
客户服务电话: 400-818-8118
网址：www.guodu.com

(36)　国联证券股份有限公司
注册地址：无锡市县前东街168号国联大厦
办公地址：无锡太湖新城金融一街8号国联金融大厦
法定代表人：雷建辉
电话：0510-82831662
联系人：沈刚
客服电话：95570
网址：www.glsc.com.cn

(37)　华宝证券有限责任公司
办公地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
联系人：宋歌
电话：（021）68778081
传真：（021）68777723
服务热线：4008209898
网址：www.cnhbstock.com

(38)　华泰证券股份有限公司
注册地址：南京市中山东路90号
办公地址：南京市中山东路90号华泰证券大厦、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦24楼
法定代表人：吴万善
电话：025-84457777
传真：025-84579763
联系人：庞晓芸
服务热线：95597
网址：www.htsc.com.cn

(39) 世纪证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层
法定代表人：卢长才
电话：0755-83199599
传真：0755-83199545
联系人：袁媛
客服电话：0755-83199511
网址：www.csco.com.cn

(40) 长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
客户服务热线：95579或4008-888-999
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
网址：www.95579.com

(41) 民生证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表人：余政
联系人：赵明
电话：010-85127622
传真: 010-85127917
客服电话：4006198888
公司网址：www.mszq.com

(42) 国盛证券有限责任公司
注册地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）
办公地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）
法定代表人：曾小普
电话0791-86281305
传真0791-86285337
客服电话：4008222111
公司网址：www.gsstock.com

(43) 齐鲁证券有限公司
办公地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客服电话：95538
公司网址：www.qlzq.com.cn

(44) 日信证券有限责任公司
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层（100031）
法定代表人：孔佑杰
联系人：文思婷
客服电话：010-83991737
网址：www.rxzq.com.cn

(45) 江海证券有限公司
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
客服电话：4006662288
公司网址：www.jhzq.com.cn

(46) 厦门证券有限公司
注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人：傅毅辉
客服电话：0592-5163588
公司网址：www.xmzq.com.cn

(47) 天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
电话：（010）66045608
传真：（010）66045521
联系人：林爽
客服电话：（010）66045678
天相投顾网址： http://www.txsec.com
天相基金网网址：

(48) 中原证券股份有限公司
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：菅明军
联系人：程月艳、耿铭
客服电话：400-813-9666、0371-967218
公司网址：www.ccnew.com

(49) 广州证券有限责任公司
注册地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人：刘东
电话：020-88836999
传真：020-88836654
联系人：林洁茹
客服电话：020-961303
公司网址：www.gzs.com.cn

(50) 联讯证券有限责任公司
注册地址：广东省惠州市下埔路14号
办公地址：广东省惠州市下埔路14号
法定代表人：徐刚
电话：0752-2119391
传真：0752-2119369
联系人：丁宁
客服电话：400-8888-929
公司网址：www.lxzq.com.cn

(51) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
联系人：汤素娅
客户服务电话： 4006788887
网址：www.jjmmw.com

(52) 国金证券股份有限公司
注册地址：成都市青羊区东城根上街95号
办公地址：成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人：冉云
电话：028-86690070
传真：028-86690126
联系人：刘一宏
客服电话：4006600109
网址：www.gjzq.com.cn

(53) 华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
法定代表人：王文学
电话：0755-82083788
传真：0755-82083408
联系人：黄旭成
客服电话：021-32109999，029-68918888
网址：www.cfsc.com.cn

(54) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市高翔路526弄2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
电话：021-58788678-8201
传真：021-58787698
联系人：敖玲
客服电话：400-089-1289
网址：www.erichfund.com

(55) 上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
电话：021-58870011
传真：021-68596916
联系人：张茹
客服电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

(56) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
电话：0571-28829790，021-60897869
传真：0571-26698533
联系人：周嬿旻
客服电话：4000-766-123
网址：http://www.fund123.cn/

(57) 国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅锋
电话：0755-83709350
传真：0755-83704850
联系人：牛孟宇
客户服务电话： 95563
网址：http://www.ghzq.com.cn

(58) 华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人：李工
电话：0551-65161666
传真：0551-65161600
客户服务电话： 96518（安徽省内）、4008096518（全国）（基金业务咨询电话）
网址：www.hazq.com

(59) 东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
客户服务电话：4006000686
网址：www.nesc.cn

(60) 中国中投证券有限责任公司
注册地址： 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
联系人：刘毅
客户服务电话： 400 600 8008、95532
网址：www.china-invs.cn

(61) 方正证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22—24层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22—24层
法定代表人：雷杰
客户服务电话： 95571
网址：www.foundersc.com

(62) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人：汪静波
联系电话：021-38600735
传真：021-38509777
联系人：方成
客户服务电话： 400－821－5399
网址：www.noah-fund.com

(63) 中期时代基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层
法定代表人：路瑶
客户服务电话：95162
网址： www.cifcofund.com

2.场内发售机构

（1）本基金的场内发售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）。

（2）本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
电话：010-58598835
传真：010-58598907
联系人：任瑞新
网址：http://www.chinaclear.cn

（三）律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：安冬
经办律师：吕红、安冬

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：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
传真：（021）23238800
联系人：吴海霞
经办会计师：许康玮、吴海霞

四、基金的名称

华商中证500指数分级证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金运用完全复制的被动型指数化投资方法，通过严格的投资纪律约束和数量化风险手段，力争将本基金的净值增长率与标的指数之间的日均跟踪误差偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，获得与标的指数收益相似的回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于股票组合的比例占基金资产的85%-95%，其中投资于中证500指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用完全复制法，以中证500指数作为标的指数，按照成份股在指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，严格控制与目标指数的偏离风险，以拟合、跟踪标的指数的收益表现，并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整，获得与标的指数收益相似的回报。

1. 股票投资策略

（1）股票投资组合的构建

本基金对中证500指数进行完全复制，在初始建仓期或者为申购资金建仓时，按照中证500指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中，本基金采取相应的交易策略降低建仓成本，力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中，本基金以标的指数权重为标准配置个股，并进行适时调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法达到预期指数复制效果时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

（2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证500指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将依据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况等变化，对股票组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与标的指数的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

股票投资组合的调整分为定期调整、不定期调整和其他调整。

(a)　定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据标的指数对其成份股的调整以及权重的定期调整而进行相应的跟踪调整。

(b)　不定期调整

在一些特殊情况下，本基金将适当调整投资标的。

▲根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送股、分红等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整；

▲当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代；

▲根据本基金的申购赎回情况，对组合进行相应调整，力求达到跟踪误差最小化。

（3）其他调整

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股申购，所申购的非成份股将在规定持有期之后的一定时间以内卖出。

2. 债券投资策略

本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成、获取流动性为目的，采取自上而下的投资策略制定投资策略。通过对宏观经济和金融市场运行趋势深入研究和分析，把握货币政策和财政政策取向，对未来利率变动趋势和债券市场投资环境做出科学、合理判断；主要关注指标包括国民生产总值、固定资产投资、物价指数、货币供应量、信贷投放和汇率变动等宏观经济指标。

本基金债券投资主要是流动性管理的需要、获得适当收益，因此债券投资以流动性好，风险较小的短期政府债券为主；中国的债券市场处于扩张阶段，品种丰富、衍生工具有所增加，本基金的债券投资将注重创新品种的选择和创新工具的运用。本基金采取的主动性投资策略主要包括久期管理、期限结构配置、个券信用风险管理等策略，通过持有国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离债）、短期融资券、回购以及资产证券化产品和其他固定收益类证券，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券组合，在获取较高的利息收入的同时兼顾资本利得。

3. 其他投资品种投资策略

权证投资策略：本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

资产支持证券投资策略：在控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从五个方面综合定价，选择低估的品种进行投资。五个方面包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

基金业绩比较基准=95%*中证500指数收益率+5%*商业银行人民币活期存款利率（税后）

中证500指数是由中证指数有限公司编制并发布。该指数选取在上海证券交易所和深圳证券交易所中上市的500只A股作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。本基金变更业绩比较基准，应与托管人协商一致，并在履行适当程序后报中国证监会备案，以及在中国证监会指定的媒体上及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金是股票型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于其它类型的基金产品；同时本基金为指数型基金，紧密跟踪中证500指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。从本基金所分离的两类基金份额来看，华商中证500A类份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华商中证500B类份额具有高风险、高预期收益的特征。

十一、基金的投资组合报告

本基金按照《基金法》、《信息披露办法》及中国证监会的其他规定中关于投资组合报告的要求披露基金的投资组合。

1.报告期末基金资产组合情况

截至2012年12月31日，华商中证500指数分级证券投资基金基金资产净值为37,275,815.64元，份额净值为1.019元；华商中证500指数分级证券投资基金A类基金资产净值为9,552,308.77元，份额净值为1.020元；B类基金资产净值为14,306,139.11元，份额净值为1.018元。其投资组合情况如下：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	58,367,548.69	91.84
	其中：股票	58,367,548.69	91.84
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	–	–
	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	3,683,864.29	5.80
6	其他资产	1,501,459.54	2.36
7	合计	63,552,872.52	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

2012年12月31日

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	1,334,319.10	2.18
B	采掘业	1,128,675.25	1.85
C	制造业	31,890,253.58	52.16
C0	食品、饮料	3,282,922.20	5.37
C1	纺织、服装、皮毛	1,585,164.70	2.59
C2	木材、家具	233,641.71	0.38
C3	造纸、印刷	867,153.50	1.42
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,258,507.40	8.60
C5	电子	2,889,133.01	4.73
C6	金属、非金属	3,589,021.72	5.87
C7	机械、设备、仪表	8,468,340.08	13.85
C8	医药、生物制品	4,949,496.26	8.10
C99	其他制造业	766,873.00	1.25
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,465,903.30	4.03
E	建筑业	1,393,579.50	2.28
F	交通运输、仓储业	2,359,430.22	3.86
G	信息技术业	3,468,047.45	5.67
H	批发和零售贸易	3,002,890.04	4.91
I	金融、保险业	548,047.00	0.90
J	房地产业	5,120,413.62	8.38
K	社会服务业	2,006,336.36	3.28
L	传播与文化产业	1,640,061.57	2.68
M	综合类	1,926,827.70	3.15
	合计	58,284,784.69	95.34

2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

2012年12月31日

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	–	–
B	采掘业	–	–
C	制造业	–	–
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	–	–
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	–	–
H	批发和零售贸易	–	–
I	金融、保险业	–	–
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	82,764.00	0.14
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	82,764.00	0.14

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

3.1报告期末指数投资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

2012年12月31日

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	600340	华夏幸福	14,150	399,454.50	0.65
2	600079	人福医药	15,700	367,223.00	0.60
3	002230	科大讯飞	12,100	366,630.00	0.60
4	600637	百视通	22,300	353,901.00	0.58
5	002450	康得新	12,350	300,105.00	0.49
6	600199	金种子酒	15,600	299,676.00	0.49
7	000963	华东医药	8,750	297,500.00	0.49
8	600436	片仔癀	2,699	293,975.08	0.48
9	000917	电广传媒	28,481	283,955.57	0.46
10	002250	联化科技	14,455	281,872.50	0.46

3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

2012年12月31日

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	000826	桑德环境	3,600	82,764.00	0.14

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。

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。

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。

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。

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未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.2本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.3其他资产构成

2012年12月31日

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,500,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,459.54
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,501,459.54

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

8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000826	桑德环境	82,764.00	0.14	配股流通受限

8.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

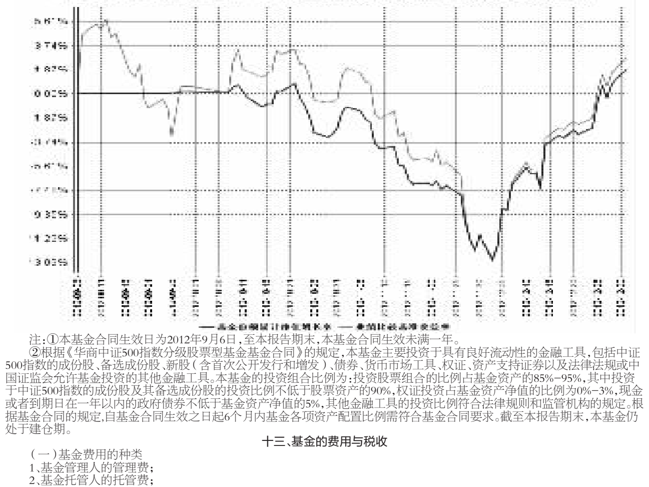
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

（十一）基金净值表现

1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2012.10.01—2012.12.31	1.70%	1.12%	2.29%	1.37%	−0.59%	−0.25%
2012. 09.06—（基金合同生效日）—2012.12.31	1.90%	0.99%	2.86%	1.43%	−0.96%	−0.44%

2.自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：①本基金合同生效日为2012年9月6日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

②根据《华商中证500指数分级股票型基金基金合同》的规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：投资股票组合的比例占基金资产的85%-95%，其中投资于中证500指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其他金融工具的投资比例符合法律规则和监管机构的规定。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金上市初费和上市年费；
9、基金的指数使用费；
10、证券账户开户费用和银行账户维护费；
11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在分级运作期内，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。分级运作期届满后，本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×年管理费÷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2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、公休假等，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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×年托管费÷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2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法每日计提指数许可使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.02%÷当年天数
H　为每日计提的指数使用费
E　为前一日的基金资产净值
支付方式为：每季支付一次

如基金管理人与标的指数许可方的指数使用许可协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行。

上述一、基金费用的种类中第3—8项及第10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，我公司结合中证500指数分级基金的运行情况，对其原招募说明书进行了更新，主要更新的内容说明如下：

（一）在“重要提示”部分更新了相关内容。
（二）更新了“三、基金管理人”的相关信息。
（三）更新了“四、基金托管人”的相关信息。
（四）更新了“五、相关服务机构”中代销机构信息。
（五）在“七、基金的募集”中删除了关于基金认购的相关内容；增加基金的实际募集情况。
（六）在“八、基金合同的生效”中删除基金备案条件和基金合同不能生效时募集资金的处理方式等；增加基金合同生效的生效日期。
（七）在“十二、基金的投资”中增加了“基金投资组合报告”及“基金净值表现”。根据本基金的实际运作情况，更新了最近一期投资组合报告的内容，并更新了合同生效之日起到2012年12月31日的基金业绩和比较基准的表现。
（八）在“二十四、对基金份额持有人的服务”增加了“红利再投资服务”、“定期定额投资计划”、“在线客服”、“信息定制服务”等内容。
（九）在“二十七、其他应披露事项”中披露了本期已刊登的公告内容。

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

华商基金管理有限公司
2013年4月19日