

中证500交易型开放式指数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: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

本招募说明书(更新)摘要内容截止日:2013年8月6日

注:上表中的股票投资项含可替代权证估值值,而(二)的合计项中不含可替代权证估值值。

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1.报告期末指数投资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	60,517,384.70	1.84
B	采矿业	74,903,221.15	2.19
C	制造业	2,427,085,090.75	59.62
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	197,112,614.93	4.84
E	建筑业	113,796,690.13	2.80
F	批发和零售业	213,811,994.01	5.25
G	交通运输、仓储和邮政业	115,340,902.58	2.83
H	住宿和餐饮业	3,463,855.15	0.09
I	信息技术业	230,299,817.15	5.66
J	金融业	53,824,669.48	1.31
K	房地产业	347,448,115.52	8.53
L	租赁和商务服务业	53,824,937.02	1.32
M	科学研究和技术服务业	17,849,634.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	50,757,307.97	1.25
O	居民服务、教育和文体娱乐业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	98,375,048.06	2.42
S	综合	16,989,473.36	0.42
合计		4,055,620,755.96	99.62

2.报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末持有积极投资。

(三)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

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

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	002230	科大讯飞	893,276	41,269,351.20	1.01
2	002450	康得新	1,230,956	34,442,148.88	0.85
3	000826	桑德环境	1,016,467	32,801,390.09	0.81
4	000400	许继电气	1,071,222	29,008,691.76	0.71
5	000661	长春高新	286,618	28,062,768.38	0.69
6	600593	海南橡胶	1,958,284	27,517,638.72	0.68
7	600079	人医医药	1,039,054	27,098,523.67	0.67
8	600200	江苏吴中	1,699,200	26,559,848.00	0.65
9	600867	通化东宝	1,775,994	26,444,530.66	0.65
10	600436	丹邦医疗	190,348	26,043,314.36	0.64

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

注:本基金本报告期末持有积极投资。

(四)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债券投资明细

注:本基金本报告期末持有债券。

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末持有债券。

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末持有资产支持证券。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

(八)报告期末未持有资产支持证券说明

1.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金报告期内未使用股指期货。

2.本基金报告期内未使用股指期货说明

注:本基金报告期内未使用股指期货。

3.本基金报告期内未使用股指期货说明

注:本基金报告期内未使用股指期货。

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末前十名股票中存在受限股份的说明

序号	股票代码	股票名称	受限受限股份的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	受限受限情况说明
1	002230	科大讯飞	41,269,351.20	1.01	无
2	002450	康得新	34,442,148.88	0.85	无
3	000826	桑德环境	32,801,390.09	0.81	无
4	000400	许继电气	29,008,691.76	0.71	无
5	000661	长春高新	28,062,768.38	0.69	无
6	600593	海南橡胶	27,517,638.72	0.68	无
7	600079	人医医药	27,098,523.67	0.67	无
8	600200	江苏吴中	26,559,848.00	0.65	无
9	600867	通化东宝	26,444,530.66	0.65	无
10	600436	丹邦医疗	26,043,314.36	0.64	无

3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	435,054.07
2	应收证券清算款	15,164,098.80
3	应收股利	347,999.30
4	应收利息	2,784.59
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	15,949,936.76

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末前十名股票中存在受限股份的说明

序号	股票代码	股票名称	受限受限股份的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	受限受限情况说明
1	600436	丹邦医疗	26,043,314.36	0.64	临时停牌

注:本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外不存在受限情况说明。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金净值收益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(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
2013.2.6-2013.3.30	-9.05%	1.42%	-8.70%	1.52%	-0.35%	-0.10%
自基金成立起至今	-9.05%	1.42%	-8.70%	1.52%	-0.35%	-0.10%

十三、基金费用概览

(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.基金管理人与托管人签订的指数供应服务商订立的相应指数许可协议约定的指数使用费;

4.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5.《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;

6.基金份额持有人的费用;

7.基金的证券交易费用;

8.基金银行汇划费用;

9.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书中列明;

10.基金上市费及费用;

11.基金的开户费用、账户维护费用;

12.按照国家有关规定从《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用

(二)基金费用的计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值0.5%费率计提,管理费的计算方法如下:

H= E×0.5%÷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

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5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0.1%的费率计提,托管费的计算方法如下:

H= E×0.1%÷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

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5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.基金合同生效后的指数许可使用费

在通常情况下,指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提,指数许可使用基点费每日计算,逐日累计,计算方法如下:

H=E×0.03%÷当年天数

H为每日应付的指数许可使用基点费

E为前一日基金资产净值

许可使用基点费收取(收取为每季度人民币万元),计费周期不足一季度的,以一季度的计算,许可使用基点费的支付方式为每季度支付一次,自基金合同生效日起,于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日内支付上一季度的指数许可使用费。

如果指数许可协议约定的指数许可使用的计算方法、费用和支付方式等发生变化,本基金将采用调整后的方法或者新计算方法计算使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新使用的方法。

上述“一、基金费用的种类中第4—12项费用”,根据相关法规及相应协议约定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金管理人从基金财产中列支。

(三)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;

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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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,结合本基金管理人对本基金基金资产的投资管理活动,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在“基金管理人”部分,对基金管理人主要人员情况进行了更新。

2.在“基金托管人”部分,对基金托管人相关信息进行了更新。

3.在“相关服务机构”部分,对销售机构名单进行了更新。

4.在“基金的募集”部分,对基金的募集相关内容进行了更新。

5.在“基金合同生效”部分,对部分相关内容进行了更新,增加了基金合同生效的时间。

6.在“基金份额的交易”部分,对“基金的上市”部分相关内容进行了更新,补充了基金开放日常申购、赎回业务的时间,对“申购、赎回清单的内容与格式”部分提及的“参考基金份额净值”及“证券价格参考价格”的定义进行了更新。

7.在“基金的申购与赎回”部分,补充了基金开放日常申购、赎回业务的时间。

8.在“基金的投资”部分,补充了基金最新一期投资组合报告。

9.在“基金的业绩”部分,补充了基金最新一期业绩。

10.对“基金份额持有人服务”部分进行了更新。

11.对“其他应披露事项”进行了更新。

12.对其他信息披露进行了更新。