南方中证 500 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：中国农业银行股份有限公司

一、重要声明与提示

《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)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，南方中证 500 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。本基金托管人中国农业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 2009 年 8 月 17 日《中国证券报》及南方基金管理有限公司网站（www.nuffund.com）上公告的《南方中证 500 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 500
2、交易代码：160119
3、基金份额总额：3，223，217，818.45（截止：2009 年 11 月 4 日）
4、基金份额净值：1.081 元（截止：2009 年 11 月 4 日）
5、本次上市交易份额：581，411，748 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：2009 年 11 月 11 日。
10、基金管理人：南方基金管理有限公司。
11、基金托管人：中国农业银行股份有限公司。

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 2009 年 8 月 7 日证监许可[2009]755 号。
2、基金合同生效日：2009 年 9 月 25 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：2009 年 8 月 20 日至 2009 年 9 月 18 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：中国农业银行、中国工商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、招商银行、邮储银行、广东发展银行、浦发银行、中信银行、光大银行、兴业银行、深圳发展银行、中国民生银行、北京银行、平安银行、宁波银行、杭州银行；

华泰证券、银河证券、兴业证券、广发证券、联合证券、国泰君安、中信证券、海通证券、中信建投、申银万国、东莞证券、国信证券、招商证券、长城证券、湘财证券、金通证券、渤海证券、南京证券、国联证券、光大证券、东北证券、广州证券、国都证券、齐鲁证券、中信万通、山西证券、长江证券、第一创业、中原证券、中银国际、东吴证券、平安证券、中投证券、江南证券、瑞银证券、德邦证券、西南证券、财通证券、方正证券、国盛证券、华安证券、大同证券、华林证券、新时代证券、上海证券、民生证券、宏源证券、安信证券、东海证券、西部证券、财富证券、恒泰证券、万联证券、国元证券、金元证券、浙商证券、银泰证券、华鑫证券、世纪证券、华宝证券、华龙证券、日信证券、国金证券、江海证券、天相投顾，上述排名不分先后。

(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、中信万通、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、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、联合证券、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、信泰证券、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、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券

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 3，222，521，419.53 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 699，512.78 元人民币，按照本基金基金合同和招募说明书的约定，其中 696，398.92 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 3，113.86 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 54，086 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 3，223，217，818.45 份。其中本基金管理人于 2009 年 9 月 18 日认购本基金，持有的基金份额总额为 49，996，750.00 份(含募集期利息结转的份额)，认购费用为 5，000.00 元。本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为 1，180，628.50 份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为 0.0366%。

募集资金已于 2009 年 9 月 24 日划入本基金在基金托管人中国农业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 2009 年 9 月 24 日验资完毕，2009 年 9 月 25 日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2009 年 9 月 25 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：2009 年 9 月 25 日
13、基金合同生效日的基金份额总额：3，223，217，818.45 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【2009】147 号
2、上市交易日期：2009 年 11 月 11 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 500
5、交易代码：160119
6、本次上市交易份额：581，411，748 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：包括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和基金上市交易时间内的参考净值揭示两部分。

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。交易时间内基金管理人将根据实时计算的基金份额参考净值传给深交所，深交所通过行情系统揭示。基金份额参考净值的揭示仅为投资者的交易提供参考，基金管理人、基金托管人不对其准确性负责。

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 2009 年 11 月 4 日，本基金场内份额持有人户数为 8016 户，平均每户持有的基金份额为 72531.40 份。

（二）持有人结构

截至 2009 年 11 月 4 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 217，907，163 份，占场内基金总份额的 37.4790%；场内个人投资者持有的基金份额为 363，504，585 份，占场内基金总份额的 62.5210 %。

（三）截至 2009 年 11 月 4 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	广发证券股份有限公司	100，002，990	17.20
2	齐鲁证券有限公司	50，003，000	8.60
3	招商证券股份有限公司	26，000，780	4.47
4	东方证券股份有限公司	20，001，200	3.44
5	周茂永	10，010，800	1.72
6	合肥华津投资管理有限公司	6，000，175	1.03
7	东方科学仪器进出口集团有限公司	4，000，240	0.69
8	厦门翔凌实业有限公司	3，500，210	0.60
9	陆继峰	3，000，480	0.52
10	吴瑞宁	3，000，240	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：440301103129537
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%、深圳市机场（集团）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
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
风控策略部	负责投资策略的量化测算、数量化投资、投资风险监控与业绩归因分析
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
专户管理部	负责一对多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
策略发展部	负责品牌推广、产品推广、营销策划、媒体宣传、公共关系维护
渠道服务部	负责公募及一对多产品的营销及银行、券商代销渠道的拓展及服务工作
电子商务部	负责基金产品的网上销售及公司网站建设
市场服务部	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
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
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 2009 年 9 月，我公司共有员工 307 人，博士 13 人、硕士 148 人、本科 130 人、其他 16 人。

5、信息披露负责人：鲍文革
咨询电话：400-889-8899

6、基金管理业务情况

截至 2009 年 9 月，南方基金管理有限公司旗下共管理 17 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 1680 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 和南方全球；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

张原，美国密歇根大学经济学硕士学位，具有基金从业资格。2006 年 4 月加入南方基金，曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员，南方高增及南方隆元基金基金经理助理。自 2009 年 9 月起担任南方 500 基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况
名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
住所：北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦
法定代表人：项俊波
成立日期：2009 年 1 月 15 日
注册资本：2600 亿元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-68424199
联系人：李芳菲

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。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。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。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。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“伴你成长”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《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，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。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 130 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。

3、基金托管业务经营情况

截止 2009 年 9 月 8 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 68 只，包括华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新世纪优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新世纪优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金。

（三）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 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室
办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：单峰
经办注册会计师：薛竞、单峰

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 500 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 500 指数证券投资基金（LOF）2009 年 11 月 04 日资产负债表如下：

单位：人民币元

项目	行次	2009年11月04日
资 产：		
银行存款	1	643，463，372.23
结算备付金	2	31，608，488.02
存出保证金	3	297，758.94
交易性金融资产	4	2，857，736，636.02
其中：股票投资	5	2，857，736，636.02
债券投资	6	0.00
资产支持证券投资	7	0.00
衍生金融资产	8	0.00
买入返售金融资产	9	0.00
应收证券清算款	10	0.00
应收利息	11	1，730，907.42
应收股利	12	44，226.05
应收申购款	13	0.00
其他资产	14	0.00
资产总计	15	3，534，881，388.68
负 债：		
短期借款	16	0.00
交易性金融负债	17	0.00
衍生金融负债	18	0.00
卖出回购金融资产款	19	0.00
应付证券清算款	20	47，481，123.58
应付赎回款	21	0.00
应付管理人报酬	22	221，603.42
应付托管费	23	44，320.67
应付销售服务费	24	0.00
应付交易费用	25	2，164，791.47
应交税费	26	0.00
应付利息	27	0.00
应付利润	28	0.00
其他负债	29	393，955.14
负债合计	30	50，305，794.28
所有者权益：		
实收基金	31	3，223，217，818.45
未分配利润	32	261，357，775.95
所有者权益合计	33	3，484，575，594.40
负债和所有者权益总计	34	3，534，881，388.68

八、基金投资组合

截止到 2009 年 11 月 04 日，南方中证 500 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

序号	资产品种	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	股票	2，857，736，636.02	80.84
2	债券	0.00	0.00
3	权证	0.00	0.00
4	银行存款和结算备付金	675，071，860.25	19.10
5	其他资产	2，072，892.41	0.06
	合计	3，534，881，388.68	100.00

（二）期末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	68，289，938.88	1.96
B	采掘业	22，111，985.10	0.63
C	制造业	1，676，943，821.99	48.12
C0	食品、饮料	110，173，953.85	3.16
C1	纺织、服装、皮毛	123，864，707.14	3.55
C2	木材、家具	11，844，931.69	0.34
C3	造纸、印刷	58，326，207.32	1.67
C4	石油、化学、塑胶、塑料	370，891，856.00	10.64
C5	电子	129，493，566.21	3.72
C6	金属、非金属	190，591，780.46	5.47
C7	机械、设备、仪表	457，963，877.05	13.14
C8	医药、生物制品	197，367，161.02	5.66
C99	其他制造业	26，425，781.25	0.76
D	电力、煤气及水的生产和供应业	113，376，367.07	3.25
E	建筑业	42，165，352.55	1.21
F	交通运输、仓储业	116，328，852.73	3.34
G	信息技术业	154，364，133.59	4.43
H	批发和零售贸易	188，027，432.12	5.40
I	金融、保险业	4，741，698.00	0.14
J	房地产业	176，040，313.84	5.05
K	社会服务业	79，963，104.24	2.29
L	传播与文化产业	34，536，644.68	0.99
M	综合类	180，846，991.23	5.19
	合计	2，857，736，636.02	82.01

（三）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

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	600166	福田汽车	1，056，145	21，059，531.30	0.6000%
2	000078	海王生物	875，100	18，735，891.00	0.5400%
3	002073	青岛软控	951，605	16，862，440.60	0.4800%
4	600872	中炬高新	1，391，100	16，804，488.00	0.4800%
5	600312	平高电气	707，239	13，140，500.62	0.3800%
6	600546	中油化建	403，360	12，818，780.80	0.3700%
7	000503	海虹控股	1，144，920	12，605，569.20	0.3600%
8	600406	国电南瑞	291，120	12，550，183.20	0.3600%
9	600586	金晶科技	793，723	12，421，764.95	0.3600%
10	600239	云南城投	486，660	12，351，430.80	0.3500%

（四）期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金截至 2009 年 11 月 04 日止未持有债券。

（五）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

本基金截至 2009 年 11 月 04 日止未持有债券。

（六）投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、截至 2009 年 11 月 04 日，本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。

3、其他资产构成

其他资产明细	金额（元）
交易保证金	297，758.94
应收证券清算款	0.00
应收股利	44，226.05
应收利息	1，730，907.42
应收申购款	0.00
其他应收款	0.00
待摊费用	0.00
其他	0.00
合计	2，072，892.41

4、期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细及资产支持证券、分离交易可转债 。

截止到 2009 年 11 月 04 日，本基金没有持有处于转股期的可转换债券；本报告期间本基金也没有投资资产支持证券、分离交易可转债。

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《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。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（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、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（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 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》
(三)《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)托管协议》
(四)《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF) 招募说明书》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)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
二〇〇九年十一月六日

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

基金投资者自依招募说明书、基金合同取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，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）依法转让或者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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
（9）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》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：
（1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
（2）缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
（3）在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份额持有人合法权益的活动；
（5）执行生效的基金份额持有人大会决议；
（6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
（7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利
（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
（2）获得基金管理人报酬；
（3）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（4）在符合有关法律法规交易所及登记结算结构相关业务规则和本基金合同的前提下，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，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；
（5）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；
（6）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
（7）自行担任基金注册登记机构，或选择、更换注册登记机构，对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查，并从注册登记机构获取基金份额持有人名册；
（8）选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
（9）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（10）依法召集基金份额持有人大会；
（11）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；
（12）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；
（13）根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；
（14）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

3、基金管理人的义务
（1）依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责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财产分别管理，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）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
（10）按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（12）编制中期和年度基金报告；
（13）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；
（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
（15）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；
（16）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；
（17）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；
（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）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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（20） 基金托管人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托管人追偿；
（21）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
（22）建立并保存基金份额持有人名册；
（23）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；
（24）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
（25）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；
（26）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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
（27）法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

（三）基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利
（1）获得基金托管费；
（2）监督基金管理人对本基金的投资运作；
（3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；
（4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
（5）根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；
（6）依法召集基金份额持有人大会；
（7）按规定取得基金份额持有人名册；
（8）法律法规规定的其他权利。

2、基金托管人的义务
（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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，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；
（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应予保密，不得向他人泄露；
（8）对基金财务会计报告、中期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；
（9）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；
（10）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；
（11）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（12）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
（13）按照规定监督基金管理人的投资运作；
（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
（15）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；
（16） 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；
（17）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（18）按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
（19）根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；
（20）参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（21）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；
（22）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
（23）法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

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)转换基金运作方式；
(3)终止基金上市交易，但因下述原因致使基金终止上市交易的无需召开基金份额持有人大会：自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形；
(4)变更基金类别；
(5)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
(6)变更基金份额持有人大会议事程序；
(7)更换基金管理人、基金托管人；
(8)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；
(9)本基金与其他基金的合并；
(10)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的，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、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；
(3) 因自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形而终止基金上市交易的；
(4)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
(5)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
(6)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
(7)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；
(8)因当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的；
(9)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、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，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上（以上含本数，下同）的基金份额持有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。

4、代表基金份额 10%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5、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。

（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、基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：
(1)会议召开的时间、地点和出席方式；
(2)会议拟审议的主要事项；
(3)会议形式；
(4)议事程序；
(5)有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
(6)授权委托的内容要求(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；
(7)表决方式；
(8)会务常设联系人姓名、电话；
(9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
(10)召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由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、表达意见的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，不影响计票和表决效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

1、会议方式
(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。
(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以以召集人约定的非现场方式进行表决。

2、召开基金份额持有人大会的条件
(1)现场开会方式
在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：
1)经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；
2) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间 (至少应在 25 个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

(2)通讯开会方式
在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：
1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；
2)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和统计基金份额持有人的表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计表决意见的，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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上；
4)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表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

(1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

(2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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就召开事由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前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

(3)对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人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。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其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作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 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、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。法律法规另有规定的除外。

(5)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日前 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3、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。

（六）决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1)一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

(2)特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

4、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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票效力及表决效力。

(2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

(3)如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(4)计票过程应由公证机关予以公证。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决效力。

（八）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。

4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一） 基金收益分配原则
1、每一基金份额享有同等分配权；
2、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；
4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；
5、基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；
6、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；
7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（三）收益分配的时间和程序

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

2、在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

（四）基金收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

四、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为 0.6%
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

（二）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为 0.12%
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。

（二）投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%， 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%，权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

待指数衍生金融产品推出以后，基金管理人可以履行适当程序使本基金运用衍生金融产品进行风险管理。

（三）投资限制和禁止行为

一）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：
1、本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
2、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；
3、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；
4、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

二）禁止行为

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、当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

本基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、申购赎回代理机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在至少一家指定媒体和基金管理人网站上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：
(1)终止基金合同；
(2)转换基金运作方式；
(3)终止基金上市交易，但因下述原因致使基金终止上市交易的无需召开基金份额持有人大会：自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形；
(4)变更基金类别；
(5)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
(6)变更基金份额持有人大会议事程序；
(7)更换基金管理人、基金托管人；
(8)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；
(9)本基金与其他基金的合并；
(10)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：
(1)调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；
(3) 因自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因、基金合同终止、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形而终止基金上市交易的；
(4)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
(5)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
(6)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
(7)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；
(8)因当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的；
(9)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。

（二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：
1、基金份额持有人大会决定终止的；
2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
3、基金托管人人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
4、相关法律法规、中国证监会及基金合同规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组
(1)基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。
(2)基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。
(3)基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、基金财产清算程序
(1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
(2)对基金财产进行清理和确认；
(3)对基金财产进行估价和变现；
(4)制作清算报告；
(5)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
(6)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
(7)将基金清算结果报告中国证监会；
(8)公布基金清算报告；
(9)对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

4、基金财产按下列顺序清偿：
(1)支付清算费用；
(2)交纳所欠税款；
(3)清偿基金债务；
(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。基金财产清算基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

九、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

(一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

(二)本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

(三)本基金合同正本一式六份，除上报相关监管部门两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

(四)本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

关于南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)开放日常申购赎回业务的公告

应广大投资者要求，根据《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定，南方基金管理有限公司（以下简称“本公司”）定于 2009 年 11 月 11 日起开放南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）的日常申购赎回业务。现将有关事项公告如下：

一、投资者可以通过场外、场内两种方式申购、赎回本基金。场外申购赎回通过本基金的直销机构或场外代销机构办理，场内申购赎回通过本基金场内代销机构办理。

本基金场外代码：前端代码是 160119，后端代码则根据不同代销机构而不同——中国工商银行后端代码是 160119，其他代销机构的后端代码是 160120；场内代码：前端代码 160119（场内无后端收费模式），敬请投资者注意。

二、本基金的销售机构包括：
(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：中国农业银行、中国工商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、招商银行、邮储银行、广东发展银行、浦发银行、中信银行、光大银行、兴业银行、深圳发展银行、中国民生银行、北京银行、平安银行、宁波银行、杭州银行

华泰证券、银河证券、兴业证券、广发证券、联合证券、国泰君安、中信证券、海通证券、中信建投、申银万国、东莞证券、国信证券、招商证券、长城证券、湘财证券、金通证券、渤海证券、南京证券、国联证券、光大证券、东北证券、广州证券、国都证券、齐鲁证券、中信万通、山西证券、长江证券、第一创业、中原证券、中银国际、东吴证券、平安证券、中投证券、江南证券、瑞银证券、德邦证券、西南证券、财通证券、方正证券、国盛证券、华安证券、大同证券、华林证券、新时代证券、上海证券、民生证券、宏源证券、安信证券、东海证券、西部证券、财富证券、恒泰证券、万联证券、国元证券、金元证券、浙商证券、银泰证券、华鑫证券、世纪证券、华宝证券、华龙证券、日信证券、国金证券、江海证券、天相投顾，上述排名不分先后。

(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、中信万通、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、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、联合证券、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、信泰证券、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、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券，具体安排请以各代销机构的公告或解释为准。

三、重要提示

1、投资者欲了解本基金的详细情况，请阅读《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》。

2、投资者可登陆本公司网站 (www.nffund.com) 或拨打全国免长途费的客户服务电话 （400－889－8899）咨询相关情况。

3、本公告的解释权归本公司。

特此公告

南方基金管理有限公司
二〇〇九年十一月六日