

# 关于南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）修改基金合同、托管协议并变更基金名称的公告

南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）自 2009 年 8 月 20 日至 2009 年 9 月 18 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》于 2009 年 9 月 25 日生效。

2013 年 2 月 6 日，本公司管理的中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金合同生效。根据《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，将本基金变更为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，本基金的名称相应变更为“南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）”。同时根据变更情况对基金合同中“释义”、“基金的基本情况”、“基金份额的申购与赎回”、“基金合同当事人及权利义务”、“基金份额持有人大会”、“基金的投资”、“基金资产的估值”、“基金的费用与税收”、“基金的信息披露”和“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”等章节的内容及托管协议的相应内容进行了修订，修订内容详见附件，投资者可访问本公司网站([www.nffund.com](http://www.nffund.com))查阅修订后的基金合同、托管协议全文。上述修改事项已报中国证监会备案,自 2013 年 2 月 22 日起生效。

此次修订是基金合同规定的基金管理人与基金托管人可以协商一致变更基金合同的事项，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

本公司将据此在更新基金招募说明书时，对招募说明书中的上述相关内容进行修订。

投资者可访问南方基金管理有限公司网站([www.nffund.com](http://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。

特此公告。

南方基金管理有限公司

二〇一三年 二月二十日

附件一：《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的修改内容

**【一】** 基金名称由南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）变更为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

**【二】** 基金合同第二部分“释义”增加了“22、目标 ETF”和“23、ETF 联接基金”的表述，其他释义序号相应顺延（下同）。具体内容如下：

22、目标 ETF：指南方基金管理有限公司管理的中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（简称中证 500ETF）

23、ETF 联接基金：是指将其绝大部分基金财产投资于目标 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

**【三】** 基金合同第三部分“基金的基本情况”中调整了“二、基金类别”和“七、基金的投资目标”的表述，同时增加了“五、目标 ETF 及联接基金”的表述，具体内容如下：

二、基金类别

股票型证券投资基金（ETF 联接基金）。

五、目标 ETF 及联接基金

2013 年 2 月 6 日，南方基金管理有限公司管理的中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（目标 ETF）成立。根据《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，将本基金变更为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，本基金的名称相应变更为“南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）”，并对基金合同中“释义”、“基金的基本情况”、“基金份额的申购与赎回”、“基金合同当事人及权利义务”、“基金份额持有人大会”、“基金的投资”、“基金资产的估值”、“基金的费用与税收”、“基金的信息披露”和“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”等章节的内容进行了修改。上述修改事项已报中国证监会备案，自 2013 年 2 月 22 日起生效。本基金合同第 4 章“基金份额的发售与认购”和第 5 章“基金备案”及其他章节中有关基金募集、《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效等表述仅适用于此次变更前的基金合同，对此次变更后的基金合同不适用。

本基金为目标 ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：

（1）在投资方法方面，目标 ETF 主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；

而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标 ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

(2) 在交易方式方面，投资者既可以在二级市场买卖目标 ETF，也可以按照申购赎回清单的要求，采用份额申购和份额赎回的方式申赎目标 ETF；而本基金是上市开放式基金（LOF），投资者可以在二级市场买卖本基金份额，也可以通过交易所场内和场外销售机构申购和赎回本基金份额。

(3) 申购赎回方式不同。目标 ETF 的投资人依据申购赎回清单，按以组合证券为主的申购对价、赎回对价进行申购赎回，申购赎回均以份额申报；本基金的投资人依据基金份额净值，以现金方式进行申购赎回，金额申购、份额赎回。

本基金与目标 ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：

(1) 法规对投资比例的要求。目标 ETF 作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值 5% 的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。

(2) 申购赎回的影响。目标 ETF 采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申购赎回采用现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

(3) 投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同。

## 七、基金的投资目标

本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

**【四】** 基金合同第七部分“基金份额的申购与赎回”中“八、拒绝或暂停申购的情形”和“九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”中增加及修改的部分条款如下：

### 八、拒绝或暂停申购的情形

5、目标 ETF 暂停基金资产估值；

6、目标 ETF 暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形；

该条最后一段修改为“发生上述 1-8 项暂停申购的情形时，基金管理人应当根据有关规定在至少一家指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除后，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并公告。发生上述第 9 项拒绝申购的情形时，被拒绝

的申购款项将退还给投资者。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

5、目标 ETF 暂停基金资产估值；

6、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形；

**【五】** 基金合同第九部分“基金合同当事人及权利义务”中“三、基金份额持有人”第 1 项“基金份额持有人的权利”增加如下条款：

(6) 出席或者委派代表出席目标 ETF 份额持有人大会，对目标 ETF 份额持有人大会审议事项行使表决权。本基金参会份额和票数按权益登记日本基金所持有的目标 ETF 份额占本基金资产的比例折算；

**【六】** 基金合同第十部分“基金份额持有人大会”中“二、召开事由”中部分内容进行调整：

一、在“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”中增加如下条款：

(5) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

二、在“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”中增加如下条款：

(4) 由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；

**【七】** 基金合同第十部分“基金份额持有人大会”中增加以下内容：

十、鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 基金份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金份额折算为目标 ETF 后的每一参会份额和目标 ETF 的每一参会份额拥有平等的投票

权。

【八】 基金合同第十四部分“基金的投资”中调整了“一、投资目标”、“二、投资范围”、“三、投资理念”、“四、投资策略”和“八、基金风险收益特征”的表述，调整了“六、投资限制和禁止行为”中“（二）禁止行为”的部分条款，增加了“十一、目标 ETF 的变更”的表述，具体内容如下：

#### 一、投资目标

本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### 二、投资范围

本基金主要投资于中证 500ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（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。其中投资于中证 500ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内），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。

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

#### 三、投资理念

本基金遵循指数化投资理念，通过投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股等，力求获得与目标 ETF 所跟踪的标的指数相近的平均收益率，满足基金投资者的投资需求。

#### 四、投资策略

本基金为完全被动式指数基金，以中证 500ETF 作为其主要投资标的。本基金并不参与中证 500ETF 的管理。

##### （一）资产配置策略

为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

## （二）目标 ETF 投资策略

### 1、特殊申购

在目标 ETF 基金合同生效后、开放日常申购之前，将向本基金开通特殊申购，特殊申购仅开通一日，本基金以股票或现金特殊申购目标 ETF 基金份额，申购价格以特殊申购日的目标 ETF 基金份额净值（保留到小数点后 9 位）为基准计算，特殊申购过程中按照中国证券登记结算有限责任公司和上海证券交易所的相关规定缴纳的费用由基金资产承担。

### 2、投资组合的日常投资方式

在目标 ETF 上市交易、开放申购赎回后，本基金通过两种方式投资目标 ETF：

（1）申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，根据申购赎回清单进行申购赎回。

（2）二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。

当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

本基金将在目标 ETF 上市交易、开放申购赎回 3 个月内，使得本基金投资目标 ETF 的比例满足基金合同有关投资比例的要求。

## （三）成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

## （四）债券投资策略

本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择，同时着重考虑基金的流动性管理需要，选取到期日在一年以内的中央银行票据、国家债券、政策性金融债等进行配置。

## 六、投资限制和禁止行为

### （二）禁止行为

4、买卖除目标 ETF 外的其他基金份额，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，但在法律法规或监管机构允许的情况下，目标 ETF 与标的指数成份股除外；

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，但在法律法规或监管机构允许的情况下，目标 ETF 与标的指数成份股除外；

#### 八、风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### 十一、目标 ETF 的变更

目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中将去掉关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

- 1、目标 ETF 交易方式变更；
- 2、目标 ETF 终止上市；
- 3、目标 ETF 基金合同终止。

若目标 ETF 变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。

**【九】** 基金合同第十六部分“基金资产的估值”中调整了“三、估值对象”的表述，“四、估值方法”中增加了“1、目标 ETF 份额的估值”，“七、暂停估值的情形”中增加了部分条款，具体内容如下：

#### 三、估值对象

基金依法拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券、权证及其他基金资产。

#### 四、估值方法

##### 1、目标 ETF 份额的估值

本基金投资的目标 ETF 份额以其估值日当日基金份额净值估值。

#### 七、暂停估值的情形

- 3、本基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

【十】 下调了本基金的管理费率和托管费率，基金合同第十七部分“基金的费用与税收”中调整了“三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式”的表述，具体内容如下：

### 三、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

本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times\text{年管理费率}\div\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值—前一日所持有 ETF 基金份额部分的基金资产，若为负数，则 E 取 0

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。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times\text{年托管费率}\div\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值—前一日所持有 ETF 基金份额部分的基金资产，若为负数，则 E 取 0

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。

【十一】 基金合同第二十部分“基金的信息披露”中“五、公开披露的基金信息”的“8、临时报告”中增加了部分条款如下：

#### 8、临时报告

(28) 目标 ETF 变更；



**【十二】** 基金合同第二十一部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“一、基金合同的变更”的“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”第(5)项修改为：“(5)变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；”、“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变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案”增加以下内容“(4)由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；”

附件二：《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议》的修改内容

**【一】** 《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》中的基金名称由南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）变更为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），据此，原《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议》变为《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议》，托管协议中的基金名称也进行对应修改。

**【二】** 《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议》的开始增加了如下内容：

2013 年 2 月 6 日，南方基金管理有限公司管理的中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（目标 ETF）成立。根据《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定，南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）变更成为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，基金名称变更为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）。基金管理人经与基金托管人协商一致对南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议的投资范围、估值、费用及其他部分条款进行相应修改，上述修改事项已报中国证监会备案，自 2013 年 2 月 22 日起生效。

**【三】** 托管协议第三部分“基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”中

“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对

基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。”的内容调整如下:

本基金主要投资于中证 500ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于新股(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。其中投资于中证 500ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内),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。

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

**【四】** 托管协议第八部分“基金资产净值计算和会计核算”的“(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理”中调整了“1、估值对象”的表述,“2、估值方法”中增加了“(1)目标 ETF 份额的估值”,“(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形”中增加了部分条款,具体内容如下:

(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理

1、估值对象

基金依法拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券、权证及其他基金资产。

2、估值方法

(1)目标 ETF 份额的估值

本基金投资的目标 ETF 份额以其估值日当日基金份额净值估值。

(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形

(3)本基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形;

**【五】** 下调了本基金的管理费率和托管费率,托管协议第十一部分“基金的费用”中调整了“(一)基金管理费的计提比例和计提方法”和“(二)基金托管费的计提比例和计提方法”的表述,具体内容如下:

(一)基金管理费的计提比例和计提方法

本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取 0)的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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－前一日所持有 ETF 基金份额部分的基金资产，若为负数，则 E 取 0

(二) 基金托管费的计提比例和计提方法

本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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－前一日所持有 ETF 基金份额部分的基金资产，若为负数，则 E 取 0

**【六】** 托管协议第十五部分“禁止行为”调整了“(九)基金财产用于下列投资或者活动”中的部分条款，内容如下：

(九) 基金财产用于下列投资或者活动：

- 4、买卖除目标 ETF 外的其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券，但在法律法规或监管机构允许的情况下，目标 ETF 与标的指数成份股除外；
- 6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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，但在法律法规或监管机构允许的情况下，目标 ETF 与标的指数成份股除外；