

南方中国中小盘股票指数证券投资基金 LOF)

[2012] 第四季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称 南方中国中小盘股票指数(LOF-LOF)

交易代码 160125

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2011年3月26日

报告期末基金份额总额 97,268,678.89份

投资目标 本基金采用被动式指数化投资，以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金被被动式指数基金，采用指数复制法。本基金按照成份股在标的指数中的权重重新构建指数成份股，并根据标的指数成份股及其权重的变化适时地进行调整，在保持基金资产的流动性前提下，使本基金的净值增长率与标的指数的净值增长率在任何时期之内的日均跟踪偏离度不超过0.5%，年跟踪误差不超过5%。

业绩比较基准 人民币计价的境内中小指数净资产(税后)。

本基金主要投资标的指数成份股，具有与标的指数和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金风险与预期收益率高

于混合基金，债券基金与货币市场基金，由于中小盘股票的特点，一般情况下，本基金投资面临的风险要高于投资大盘股票。

基金管理人 南方基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值揭示其他信息披露场合下，可简称为“南方中国”。

项目 境外资产托管人

名称 英文 The Bank of New York Mellon

中文 组团梅伦银行有限公司

注册地址 One Wall Street New York, NY10286

办公地址 One Wall Street New York, NY10286

邮政编码 10286

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日)

1.本期已实现收益 266,508.03

2.本期利润 15,123,409.37

3.加权平均基金份额本期利润 0.1560

4.期末基金份额净值 103,581,636.18

5.期末基金份额净值 1.0649

注:1.经本基金管理人确认，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益扣除相关费用后的余额，即本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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(%) 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

过去三个月 16.72% 0.85% 18.25% 0.83% -1.53% 0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

图示:自基金合同生效以来基金累计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:根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人报告期内基金运作合规性的说明

报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券投资基金法》，履行基金投资运作管理

办法》、《证券投资基金销售行为管理办法》和《基金投资信息揭示管理办法》等有关法律法规及各项实施细则，履行了中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同以及其他有关法律法规的规定，诚实信用、勤勉尽责的履行了基金的管理职责，严格执行了基金合同，不存在损害基金持有人利益的情况。

4.2 报告期内基金业绩指标表现

4.2.1 本报告期基金份额净值增长率为16.72%，基金基准增长18.25%。

4.2.2 报告期内基金的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》，完善相应制

度及流程，通过系统和人工等多种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金及投资组合。

4.3 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的定期报告

4.4.1 报告期内基金的定期报告

4.4.2 报告期内基金的半年报

4.4.3 报告期内基金的季报

4.4.4 报告期内基金的半年报

4.4.5 报告期内基金的年报

4.4.6 报告期内基金的半年报

4.4.7 报告期内基金的半年报

4.4.8 报告期内基金的半年报

4.4.9 报告期内基金的半年报

4.4.10 报告期内基金的半年报

4.4.11 报告期内基金的半年报

4.4.12 报告期内基金的半年报

4.4.13 报告期内基金的半年报

4.4.14 报告期内基金的半年报

4.4.15 报告期内基金的半年报

4.4.16 报告期内基金的半年报

4.4.17 报告期内基金的半年报

4.4.18 报告期内基金的半年报

4.4.19 报告期内基金的半年报

4.4.20 报告期内基金的半年报

4.4.21 报告期内基金的半年报

4.4.22 报告期内基金的半年报

4.4.23 报告期内基金的半年报

4.4.24 报告期内基金的半年报

4.4.25 报告期内基金的半年报

4.4.26 报告期内基金的半年报

4.4.27 报告期内基金的半年报

4.4.28 报告期内基金的半年报

4.4.29 报告期内基金的半年报

4.4.30 报告期内基金的半年报

4.4.31 报告期内基金的半年报

4.4.32 报告期内基金的半年报

4.4.33 报告期内基金的半年报

4.4.34 报告期内基金的半年报

4.4.35 报告期内基金的半年报

4.4.36 报告期内基金的半年报

4.4.37 报告期内基金的半年报

4.4.38 报告期内基金的半年报

4.4.39 报告期内基金的半年报

4.4.40 报告期内基金的半年报

4.4.41 报告期内基金的半年报

4.4.42 报告期内基金的半年报

4.4.43 报告期内基金的半年报

4.4.44 报告期内基金的半年报

4.4.45 报告期内基金的半年报

4.4.46 报告期内基金的半年报

4.4.47 报告期内基金的半年报

4.4.48 报告期内基金的半年报

4.4.49 报告期内基金的半年报

4.4.50 报告期内基金的半年报

4.4.51 报告期内基金的半年报

4.4.52 报告期内基金的半年报

4.4.53 报告期内基金的半年报

4.4.54 报告期内基金的半年报

4.4.55 报告期内基金的半年报

4.4.56 报告期内基金的半年报

4.4.57 报告期内基金的半年报

4.4.58 报告期内基金的半年报

4.4.59 报告期内基金的半年报

4.4.60 报告期内基金的半年报

4.4.61 报告期内基金的半年报

4.4.62 报告期内基金的半年报

4.4.63 报告期内基金的半年报

4.4.64 报告期内基金的半年报

4.4.65 报告期内基金的半年报

4.4.66 报告期内基金的半年报

4.4.67 报告期内基金的半年报

4.4.68 报告期内基金的半年报

4.4.69 报告期内基金的半年报

4.4.70 报告期内基金的半年报

4.4.71 报告期内基金的半年报

4.4.72 报告期内基金的半年报

4.4.73 报告期内基金的半年报

4.4.74 报告期内基金的半年报

4.4.75 报告期内基金的半年报

4.4.76 报告期内基金的半年报

4.4.77 报告期内基金的半年报

4.4.78 报告期内基金的半年报

4.4.79 报告期内基金的半年报

4.4.80 报告期内基金的半年报

4.4.81 报告期内基金的半年报

4.4.82 报告期内基金的半年报

4.4.83 报告期内基金的半年报

4.4.84 报告期内基金的半年报

4.4.85 报告期内基金的半年报

4.4.86 报告期内基金的半年报

4.4.87 报告期内基金的半年报

4.4.88 报告期内基金的半年报

4.4.89 报告期内基金的半年报

4.4.90 报告期内基金的半年报

4.4.91 报告期内基金的半年报

4.4.92 报告期内基金的半年报

4.4.93 报告期内基金的半年报

4.4.94 报告期内基金的半年报

4.4.95 报告期内基金的半年报

4.4.96 报告期内基金的半年报

4.4.97 报告期内基金的半年报