

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  
送出日期:2013年8月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员、基金经理、基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签章。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月26日复核了本报吿中的财务指标、净值表现、净值计算、收益分配政策、财务会计报告、投资组合报告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，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及其更新。

本半年度报告摘要简要披露自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自2013年01月01日起至2013年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)

基金主代码 160125

前端交易代码 160125

后端交易代码 160126

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2011年9月26日

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

报告期末基金份额总额 68,432,763.30份

基金合同存续期 不定期

基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2011-11-01

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

2.2 基金产品说明

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。

本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其股

重变化进行相应调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复

制标的指数的目的。本基金力求在控制基金净值增长率与业绩比较基准

之间的日均跟踪误差不超过0.5%，年跟踪误差不超过5%。

业绩比较基准 人民币计价的南方中国中小盘股票指数收益率(税后)

本基金主要投资的指数成份股，具有代表性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，一般情况下投资中

小盘股票面临的波动要高于投资大盘股票。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 南方基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

姓名 赵建平 李芳菲

信息披露负责人 姓名 0755-82763888 010-66060699

联系电话 电子邮箱 manager@southernfund.com lifangfei@abcchina.com

客户服务电话 400-889-8899 95599

传真 0755-82763889 010-63201816

2.4 境外资产托管人

项目 境外资产托管人

名称 The Bank of New York Mellon

纽约梅隆银行有限公司

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

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.nffund.com

基金半年度报告置地 基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

本期已实现收益 4,936,344.43

本期利润 -3,756,928.42

加权平均基金份额本期利润 -0.0471

本期基金份额净值增长率 -6.72%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.0516

期末基金资产净值 64,899,991.55

期末基金份额净值 0.9848

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(简称期末利润，不是当期发生数)。

3.所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，计入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 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 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率标准差(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -8.64% 1.72% -5.53% 1.76% -0.11% -0.04%

过去三个月 -6.29% 1.27% -5.75% 1.32% -0.54% -0.05%

过去六个月 -6.72% 1.29% -5.12% 1.35% -1.60% -0.06%

过去一年 -12.30% 1.10% -15.17% 1.15% -2.87% -0.05%

自基金合同生效以来基金份额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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 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 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率标准差(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -8.64% 1.72% -5.53% 1.76% -0.11% -0.04%

过去三个月 -6.29% 1.27% -5.75% 1.32% -0.54% -0.05%

过去六个月 -6.72% 1.29% -5.12% 1.35% -1.60% -0.06%

过去一年 -12.30% 1.10% -15.17% 1.15% -2.87% -0.05%

自基金合同生效以来基金份额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

3.2.5 基金净值表现

3.2.6 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 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率标准差(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -8.64% 1.72% -5.53% 1.76% -0.11% -0.04%

过去三个月 -6.29% 1.27% -5.75% 1.32% -0.54% -0.05%

过去六个月 -6.72% 1.29% -5.12% 1.35% -1.60% -0.06%

过去一年 -12.30% 1.10% -15.17% 1.15% -2.87% -0.05%

自基金合同生效以来基金份额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

3.2.7 基金净值表现

3.2.8 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 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率标准差(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -8.64% 1.72% -5.53% 1.76% -0.11% -0.04%

过去三个月 -6.29% 1.27% -5.75% 1.32% -0.54% -0.05%

过去六个月 -6.72% 1.29% -5.12% 1.35% -1.60% -0.06%

过去一年 -12.30% 1.10% -15.17% 1.15% -2.87% -0.05%

自基金合同生效以来基金份额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

3.2.9 基金净值表现

3.2.10 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 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率标准差(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -8.64% 1.72% -5.53% 1.76% -0.11% -0.04%

过去三个月 -6.29% 1.27% -5.75% 1.32% -0.54% -0.05%

过去六个月 -6.72% 1.29% -5.12% 1.35% -1.60% -0.06%

过去一年 -12.30% 1.10% -15.17% 1.15% -2.87% -0.05%

自基金合同生效以来基金份额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

3.2.11 基金净值表现

3.2.12 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 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率标准差(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -8.64% 1.72% -5.53% 1.76% -0.11% -0.04%

过去三个月 -6.29% 1.27% -5.75% 1.32% -0.54% -0.05%

过去六个月 -6.72% 1.29% -5.12% 1.35% -1.60% -0.06%

过去一年 -12.30% 1.10% -15.17% 1.15% -2.87% -0.05%

自基金合同生效以来基金份额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

3.2.13 基金净值表现

3.2.14 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 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率标准差(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -8.64% 1.72% -5.53% 1.76% -0.11% -0.04%

过去三个月 -6.29% 1.27% -5.75% 1.32% -0.54% -0.05%

过去六个月 -6.72% 1.29% -5.12% 1.35% -1.60% -0.06%

过去一年 -12.30% 1.10% -15.17% 1.15% -2.87% -0.05%

自基金合同生效以来基金份额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

3.2.15 基金净值表现

3.2.16 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 份额净值增长 率(%) 份额净值增长 率标准差(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -8.64% 1.72% -5.53% 1.76% -0.11% -0.04%

过去三个月 -6.29% 1.27% -5.75% 1.32% -0.54% -0.05%

过去六个月 -6.72% 1.29% -5.12% 1.35% -1.60% -0.06%

过去一年 -12.30% 1.10% -15.17% 1.15% -2.87% -0.05%

自基金合同生效以来基金份额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

3.2.17 基金净值表现

3.2.18 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