

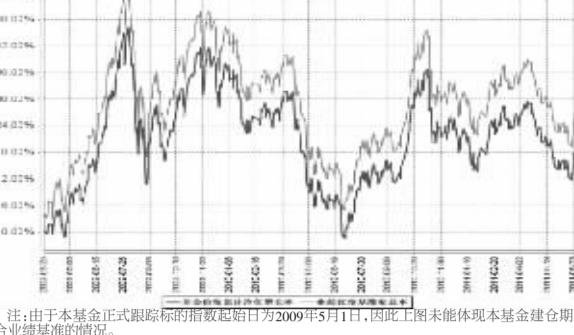
B098

信息披露 Disclosure

南方沪深300指数证券投资基金

[2011] 第二季度报告

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注:由于本基金正式跟踪的指数起始日为2009年5月1日,因此上图未能体现本基金建仓期之后拟合业绩基准的情况。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明	
				离任日期	10年
潘海宁	本基金的基金经理	2009年3月25日	-	会计学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、2003年3月加入南方基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理、投资部总监助理,数量化投资部总监助理兼基金经理。2009年1月加入鹏华基金管理有限公司,历任2010年12月至今年,任南方深成ETF及联接基金基金经理;2011年2月至今,任南方500基金经理。	

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方300”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)			
1.本期已实现收益	2.本期利润	3.加权平均基金份额本期利润	4.期末基金份额净值	5.期末基金份额总额	6.期末可供分配基金份额总额
3,924,463.51	-123,963,712.22	-0.0521	2,685,260,215.45	2,591,557,396.29	2,591,557,396.29
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.所述基金绩效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将低于所列数字。 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① 准差②	业绩比较基准 收益率③ 收益率差④	业绩比较基准收 益率标准差⑤	①-③ ②-④	
过去三个月	-4.75% 1.05%	-5.24% 1.04%	-0.49% 0.01%	-0.02% 0.01%	
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					

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.75% 1.05% -5.24% 1.04% -0.49% 0.01%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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

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.所述基金绩效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将低于所列数字。

3.2.3.基金净值表现表
3.2.4.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①
准差② 业绩比较基准
收益率③ 收益率差④ 业绩比较基准收
益率标准差⑤ ①-③
②-④

过去三个月 -4.23% 0.82% -4.70% 0.85% -0.47% -0.03%

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