

## 中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金

## [2011] 第二季度报告

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:2011年7月20日

## § 1 重要提示

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,并对其中的真实性、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基金合同规定,于2011年7月18日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容,保证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本基金,但不保证基金一定盈利。

本基金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2011年4月1日起至2011年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方小康新ETF
交易代码	510160
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年8月27日
报告期末基金份额总额	950,897,469.68份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

日公告的申购赎回清单进行申购及赎回操作,这样使得ETF基金管理人必须更加注重风险控制,一丝疏忽都可能导致严重的后果。也正因为深知此理,我们专门针对ETF的投资管理制定了科学、严谨的操作规程,使得流程中的每一个环节都清晰地知道自己在什么时候需要完成什么工作。ETF基金管理团队除基金经理之外,还由数据投资分析师、交易管理人员、IT人员等组成,为ETF基金的投资管理提供研究、交易、系统及其相关工作的快速支持响应。

对于本基金而言,本报告期跟踪误差的主要来源包括:(1)申购赎回时的申购赎回费用;(2)指仓名称或份额调整所带来跟踪误差,不忽视这部分是基金跟踪误差的主要来源。为此,本基金管理组提前进行了全面模拟测算,并制定了紧密的跟踪方案,从实施结果看,本基金成份股调仓较为成功。

本基金自上日至本报告期末的跟踪误差率为0.911%,同期业绩比较基准增长率为-6.94%。

本基金为指数化产品,作为基金管理人,我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算,精益求精的工作态度,恪守指数化投资的宗旨,实现对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对股市的判断及投资风格,借助投资基金来参与股市。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至2011年6月30日止。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币

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	12,070,829.29
2.本期利润	-21,915,797.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0231
4.期末基金资产净值	399,557,355.16
5.期末基金份额净值	0.4206

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.基金净值增长率为净值增长率,本基金的指数为中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金,简称“小康ETF”,指数代码510160。

4.1 主要财务指标

5.3 基金净值表现

5.3.1 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

5.3.2 本报告期基金份额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

5.3.3 本报告期末基金份额净值

5.3.4 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

5.3.5 本报告期基金份额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

5.3.6 本报告期末基金份额净值

5.3.7 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

5.3.8 本报告期基金份额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

5.3.9 本报告期末基金份额净值

5.3.10 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

5.3.11 本报告期基金份额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

5.3.12 本报告期末基金份额净值

5.3.13 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

5.3.14 本报告期基金份额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

5.3.15 本报告期末基金份额净值

5.3.16 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

5.3.17 本报告期基金份额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

5.3.18 本报告期末基金份额净值

5.3.19 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

5.3.20 本报告期基金份额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

5.3.21 本报告期末基金份额净值

5.3.22 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

5.3.23 本报告期基金份额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

5.3.24 本报告期末基金份额净值

5.3.25 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

5.3.26 本报告期基金份额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

5.3.27 本报告期末基金份额净值

5.3.28 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

5.3.29 本报告期基金份额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

5.3.30 本报告期末基金份额净值

5.3.31 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

5.3.32 本报告期基金份额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

5.3.33 本报告期末基金份额净值

5.3.34 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

5.3.35 本报告期基金份额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

5.3.36 本报告期末基金份额净值

5.3.37 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

5.3.38 本报告期基金份额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

5.3.39 本报告期末基金份额净值

5.3.40 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

5.3.41 本报告期基金份额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

5.3.42 本报告期末基金份额净值

5.3.43 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

5.3.44 本报告期基金份额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

5.3.45 本报告期末基金份额净值

5.3.46 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

5.3.47 本报告期基金份额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

5.3.48 本报告期末基金份额净值

5.3.49 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

5.3.50 本报告期基金份额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

5.3.51 本报告期末基金份额净值

5.3.52 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

5.3.53 本报告期基金份额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

5.3.54 本报告期末基金份额净值

5.3.55 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

5.3.56 本报告期基金份额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

5.3.57 本报告期末基金份额净值

5.3.58 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

5.3.59 本报告期基金份额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

5.3.60 本报告期末基金份额净值

5.3.61 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

5.3.62 本报告期基金份额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

5.3.63 本报告期末基金份额净值

5.3.64 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

5.3.65 本报告期基金份额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

5.3.66 本报告期末基金份额净值

5.3.67 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

5.3.68 本报告期基金份额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

5.3.69 本报告期末基金份额净值

5.3.70 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

5.3.71 本报告期基金份额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

5.3.72 本报告期末基金份额净值

5.3.73 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

5.3.74 本报告期基金份额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

5.3.75 本报告期末基金份额净值

5.3.76 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

5.3.77 本报告期基金份额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

5.3.78 本报告期末基金份额净值

5.3.79 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

5.3.80 本报告期基金份额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

5.3.81 本报告期末基金份额净值

5.3.82 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

5.3.83 本报告期基金份额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

5.3.84 本报告期末基金份额净值

5.3.85 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

5.3.86 本报告期基金份额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

5.3.87 本报告期末基金份额净值

5.3.88 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

5.3.89 本报告期基金份额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

5.3.90 本报告期末基金份额净值

5.3.91 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

5.3.92 本报告期基金份额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

5.3.93 本报告期末基金份额净值

5.3.94 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

5.3.95 本报告期基金份额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

5.3.96 本报告期末基金份额净值

5.3.97 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

5.3.98 本报告期基金份额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

5.3.99 本报告期末基金份额净值

5.3.100 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

5.3.101 本报告期基金份额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

5.3.102 本报告期末基金份额净值

5.3.103 本报告期基金份额净值增长率及其与同期