

# 南方沪深300指数证券投资基金

## [2012]第一季度报告

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:2012年4月23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，并对其内容的真实性、准确性、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2012年4月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年01月01日起至2012年03月31日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称	南方沪深300指数
交易代码	202015
前端交易代码	202015
后端交易代码	202016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月25日
报告期末基金份额总额	2,711,146,629.37份
投资目标	本基金将进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数据化管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过0.3%，年跟踪误差不超过1.4%，以求对沪深300指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将完全被动地指数化投资，原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据成份股的指数成分股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金的跟踪效果可能产生影响，或因某些特殊情况下导致被动投资不能及时、或以其他原因导致导致无法有效调整成份股的权重时，基金管理人可以对基金的跟踪误差进行适当的调整，并将调整后的跟踪误差控制在限定的范围内。
业绩比较基准	沪深300指数收益率±0.95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，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。
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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期累计实现收益 -96,535,110.72

2.本期利润 104,498,632.90

3.加权平均基金份额本期利润 0.0376

4.期末基金资产净值 2,283,452,973.68

5.期末基金份额净值 0.8422

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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 4.26% 1.44% 4.49% 1.44% -0.23% 0.00%

3.2.2 本基金成立以来本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

基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动对比图

注:本基金建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。由于本基金正式跟踪标的指数起始日为2009年5月1日，因此上图表未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

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金期限 证券从业年限 说明

潘海宁 本基金的基金经理 2009年3月25日 11年 会计学硕士，具有基金从业资格，曾先后任职于广发证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。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、数量化投资部总监、基金经理，2009年3月至今，任南方300指数基金经理；2009年12月至今，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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、证券投资基金运作管理办法、证券投资基金销售管理办法和《证券投资基金管理办法》等有关法律法规及各项实施准则，履行南方300指数证券投资基金基本信息披露义务，保证信息披露不存在虚假记载、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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为13次，其中12次是由于报告期内指数基金成份股调整，1次是由于接受大额申赎使得基金规模增大，配置债券所导致。

4.4 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.1 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.2 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.3 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.4 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.5 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.6 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.7 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.8 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.9 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.10 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.11 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.12 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.13 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.14 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.15 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.16 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.17 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.18 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.19 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.20 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.21 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.22 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.23 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.24 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.25 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.26 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.27 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.28 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.29 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.30 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.31 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.32 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.33 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.34 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.35 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.36 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.37 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.38 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.39 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.40 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.41 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.42 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.43 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.44 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.45 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.46 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.47 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.48 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.49 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.50 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.51 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.52 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.53 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.54 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.55 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.56 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.57 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.58 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.59 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.60 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.61 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.62 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.63 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.64 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.65 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.66 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.67 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.68 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.69 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.70 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.71 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.72 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.73 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.74 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.75 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.76 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.77 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.78 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.79 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.80 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.81 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.82 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.83 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.84 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.85 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.86 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.87 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.88 报告期内本基金的公平交易说明

4.4.89 报告期内本基金的公平交易说明

</