

南方中国中小盘股票指数证券投资基金 LOF)

[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:中国农业银行股份有限公司

报告期出日期:2012年4月23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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定,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。投资者投资,投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称:南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)

基金代码: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9月26日

报告期末基金份额总额:64,930,492.90份

报告期基金净值收益率:64.930,492.90%

报告期基金净值收益率的计算方法:见本基金招募说明书。

基金的业绩比较基准:本基金业绩比较基准为深证成份指数,采样股票数在指数中的基尼系数指数,即基金在指数中的股票数占指数中股票数的百分比,并根据股票的成分股及权重的变动情况进行调整,在保持基金的流动性稳定性,并具有复制指数的特征的指数。本基金力争在扣除基金净值增长率与业绩比较基准之间的差额后,每年超越基准收益率达5%。

业绩比较基准:人民币计价的中国中小盘股票指数(深证成份指数)。

风险收益特征:本基金主要投资于股票,其与所持有的股票所代表的证券市场相似的风

险收益特征:本基金为股票型基金,并以股票资产占基金资产的80%以上,由小盘股投资构成,在正常情况下,净值增长率可能超过业绩比较基准的收益率,但低于大盘股。

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

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“南方中国”。

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目 境外资产托管人

名称 英文 The Bank of New York Mellon

名称 中文 中国银行股份有限公司

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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 4,904,207.80

2.本期利润 5,306,031.97

3.加权平均基金份额本期利润 0.0637

4.期末基金份额净值 65,313,596.85

5.期末基金份额净值 1.0059

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.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,计入费用后实际收益水平要低于所列示的所列示。

3.2 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(%) ② 业绩比较基准收益率 ③ 业绩比较基准收益率(%) ④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.18% 1.06% 11.33% 1.41% -8.15% -0.35%

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

注:本基金自合同生效起至披露时点不满一年。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。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 证券从业年限

黄亮 本基金的基金经理 2011年9月26日 - 11年

4.2 报告期内本基金运作合规性说明

4.3 公平交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.5 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.6 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.7 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.8 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.9 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.10 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.11 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.12 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.13 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.14 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.15 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.16 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.17 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.18 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.19 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.20 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.21 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.22 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.23 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.24 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.25 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.26 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.27 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.28 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.29 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.30 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.31 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.32 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.33 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.34 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.35 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.36 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.37 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.38 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.39 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.40 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.41 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.42 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.43 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.44 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.45 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.46 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.47 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.48 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.49 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.50 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.51 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.52 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.53 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.54 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.55 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.56 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.57 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.58 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.59 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.60 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.61 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.62 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.63 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.64 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.65 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.66 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.67 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.68 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.69 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.70 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.71 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.72 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.73 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.74 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.75 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.76 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.77 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.78 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.79 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.80 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.81 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.82 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.83 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.84 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.85 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.86 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.87 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.88 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.89 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.90 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.91 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.92 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.93 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.94 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.95 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.96 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.97 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.98 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.99 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.100 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.101 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.102 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.103 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.104 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.105 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.106 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.107 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.108 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.109 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.110 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.111 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.112 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.113 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.114 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.115 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.116 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.117 报告期内基金管理人公平交易行为