

南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

2010 第三季度报告

2010年9月30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
报告送出日期:2010年10月26日

81 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人(南方基金)根据本基金合同约定,于2010年10月26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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资风险,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。本报告财务资料未经审计。

本报告自2010年07月01日起至2010年09月30日止。

82 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 前缀交易代码, 后缩交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

注:本基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下,可简称为“南方500”。

83 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2010年7月1日至2010年9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.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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,本期净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。

84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限, 说明.

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格执行《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》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施法规,并严格按照《南方中证500指数证券投资基金LOF基金合同》的各项规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求与合同约定的投资目标相一致的投资收益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历了二季度深度调整后,三季度A股市场整体呈现反弹的运行态势。在上上市公司业绩向好及市场整体估值修复的双重作用下,投资者信心恢复,大盘迎来了自7月初以来的强劲回升,小盘股表现尤为抢眼,季内中证500指数涨幅为27.18%。

我们对本基金报告期内跟踪偏离度分析如下:1) 跟踪偏离度:报告期内本基金跟踪偏离度为0.011%,年化跟踪误差为0.180%,日本基金建仓完成或后报告期内跟踪误差为0.483%,较好的完成了基金合同中控制跟踪误差率不超过4%的投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为1.1666元,报告期内,份额净值增长率为+25.58%,同期业绩比较基准增长率为+25.72%。

85 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%).

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 其他资产构成

5.8.1 本基金持有的前十名证券的发行主体本期没有出现在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元).

86 开放式基金份额变动

Table with columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告基金申购份额, 本报告基金赎回份额, 本报告期末基金份额总额.

87 影响投资决策的其他重要信息

8.1 各季度投资

1. 南方中证500指数证券投资基金LOF基金合同。

2. 南方中证500指数证券投资基金LOF托管协议。

3. 南方中证500指数证券投资基金LOF2010年3季度报告原文。

8.2 存放地点

8.3 查阅方式

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,本基金管理人严格执行《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施法规,并严格按照《南方中证500指数证券投资基金LOF基金合同》的各项规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求与合同约定的投资目标相一致的投资收益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

南方现金增利基金

2010 第三季度报告

2010年9月30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
报告送出日期:2010年10月26日

81 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人(南方基金)根据本基金合同约定,于2010年10月26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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资风险,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。本报告财务资料未经审计。

本报告自2010年7月1日起至2010年9月30日止。

82 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

注:本基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下,可简称为“南方现金”。

83 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2010年7月1日至2010年9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.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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,本期净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。

84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限, 说明.

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,本基金管理人严格执行《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施法规,并严格按照《南方现金增利基金基金合同》的各项规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求与合同约定的投资目标相一致的投资收益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

6.671%,同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

85 投资组合报告

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%).

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 其他资产构成

5.8.1 本基金持有的前十名证券的发行主体本期没有出现在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元).

86 开放式基金份额变动

Table with columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告基金申购份额, 本报告基金赎回份额, 本报告期末基金份额总额.

87 备查文件目录

1. 南方现金增利基金基金合同。

2. 南方现金增利基金托管协议。

3. 南方现金增利基金2010年3季度报告原文。

4.2 存放地点

4.3 查阅方式

南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

2010 第三季度报告

2010年9月30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
报告送出日期:2010年10月26日

81 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人(南方基金)根据本基金合同约定,于2010年10月26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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资风险,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。本报告财务资料未经审计。

本报告自2010年7月1日起至2010年9月30日止。

82 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 前缀交易代码, 后缩交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

注:本基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下,可简称为“南方价值”。

83 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2010年7月1日至2010年9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.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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,本期净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。

84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限, 说明.

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,本基金管理人严格执行《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施法规,并严格按照《南方中证500指数证券投资基金LOF基金合同》的各项规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求与合同约定的投资目标相一致的投资收益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

南方现金增利基金

2010 第三季度报告

2010年9月30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
报告送出日期:2010年10月26日

81 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人(南方基金)根据本基金合同约定,于2010年10月26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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资风险,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。本报告财务资料未经审计。

本报告自2010年7月1日起至2010年9月30日止。

82 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

注:本基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下,可简称为“南方现金”。

83 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2010年7月1日至2010年9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.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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,本期净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。

84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限, 说明.

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,本基金管理人严格执行《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施法规,并严格按照《南方现金增利基金基金合同》的各项规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求与合同约定的投资目标相一致的投资收益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

2010 第三季度报告

2010年9月30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
报告送出日期:2010年10月26日

81 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人(南方基金)根据本基金合同约定,于2010年10月26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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资风险,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。本报告财务资料未经审计。

本报告自2010年7月1日起至2010年9月30日止。

82 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 交易代码, 前缀交易代码, 后缩交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

注:本基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下,可简称为“南方价值”。

83 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2010年7月1日至2010年9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.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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,本期净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。

84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限, 说明.

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,本基金管理人严格执行《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施法规,并严格按照《南方中证500指数证券投资基金LOF基金合同》的各项规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求与合同约定的投资目标相一致的投资收益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析