

深证成份交易型开放式指数证券投资基金

2012第一季度报告

2012年3月31日

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、准确性和完整性承担个别及连带责任。**本基金于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，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 南方深证成份ETF

交易代码 159903

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2009年12月4日

报告期末基金份额总额 2,904,254,307.00份

投资目标 寻找业绩相对稳定的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

基金的基本原则和策略 基金管理人按照完全复制法指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行定期调整。

投资策略 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分派等行为时，或因基金的申购和赎回等对基金的资产规模有较大影响时，或因标的指数成份股特殊情况导致成份股无法正常交易或被剔除时，基金管理人可以对投资组合进行适当的调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益高于混合型基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数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“深成ETF”

§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.本期已实现收益 -108,276,575.47

2.本期利润 161,680,813.72

3.加权平均基金份额本期利润 0.0543

4.期末基金资产净值 2,772,576,176.05

5.期末基金份额净值 0.9547

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入，投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)所减相关费用后的余额，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交易费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

3.2.2 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的比较

3.2.3 业绩表现评价与基准收益率的历史走势对比图

3.2.4 与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.5 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.6 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.7 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.8 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.9 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.10 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.11 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.12 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.13 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.14 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.15 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.16 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.17 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.18 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.19 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.20 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.21 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.22 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.23 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.24 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.25 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.26 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.27 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.28 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.29 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.30 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.31 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.32 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.33 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.34 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.35 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.36 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.37 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.38 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.39 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.40 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.41 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.42 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.43 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.44 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.45 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.46 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.47 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.48 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.49 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.50 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.51 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.52 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.53 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.54 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.55 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.56 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.57 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.58 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.59 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.60 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.61 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.62 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.63 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.64 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.65 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.66 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.67 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.68 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.69 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.70 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.71 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.72 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.73 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.74 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.75 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.76 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.77 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.78 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.79 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.80 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.81 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.82 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.83 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.84 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.85 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.86 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.87 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.88 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.89 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.90 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.91 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.92 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.93 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.94 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.95 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.96 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.97 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.98 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.99 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.100 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.101 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.102 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图