

深证成份交易型开放式指数证券投资基金

2012 第二季度 报告

博2012年6月30日

基金管理人:南方基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:博2012年6月30日

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、及时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，于博2012年6月30日核对了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告附录财务资料未经审计。

本报告附录自博2012年6月30日起至博2012年6月30日止。

基金基本情况

基金简称:南方深证成份

交易代码:160213

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:博2007年1月1日

报告期末基金份额总额:3.60亿份

投资目标:紧密跟踪标的指数(深证成份指数),追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略:本基金为完全复制法指数基金,原则上采用完全复制法(即成份股的标的指数在基金资产中的权重和在基金资产中的权重相一致)进行投资,但因成份股的限制,本基金在某些情况下可能采用适当的指数偏离度的策略,以期在有效复制成份股的基础上,通过投资于成份股之外的股票、债券等金融工具,以对成份股的管理进行变通调整,从而使得投资组合的跟踪误差更小。

业绩比较基准:深证成份指数

风险收益特征:本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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“深成基”

主要财务指标和基金净值表现

深成基主要财务指标

单位:人民币元

报告期深成基博2012年6月30日博2012年6月30日博2012年6月30日

本期已实现收益

报告期深成基博2012年6月30日

期末深成基博2012年6月30日

报告期深成基博2012年6月30日

报告期深成基博2012年6月30日