

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
送出日期:2012年8月29日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2012年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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预示其未来表现,投资者有风险,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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告中财务资料截止于2012年01月01日起至06月30日止。

Table with 2 columns: 2.1 基金基本情况, 2.2 基金产品说明. Includes details on fund type, investment objectives, and risk management.

2.3 基金管理人及基金托管人
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

Table with 2 columns: 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人. Lists advisors like The Bank of New York Mellon and托管人 like Citicorp.

Table with 2 columns: 2.5 信息披露方式. Lists website (http://www.nffund.com) and contact information for the fund manager.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.2 基金净值表现. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.3 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.4 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.5 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.6 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.7 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.8 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.9 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.10 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.11 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.12 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.13 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.14 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.15 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.16 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.17 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.18 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.19 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.20 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.21 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.22 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 3.23 基金业绩比较基准. Shows performance metrics for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

基金合同于估值日的约定,对基金所持有的投资组合进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对估值调整对基金资产净值的影响在0.25%以上时对所采用的估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

4.7 持有人对报告期内基金利润分配情况的说明
本基金合同约定,本基金的收益分配原则为:每一基金份额享有同等分配权;基金合同生效当年不满3个月,可不进行收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即:基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值,基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年最多不超过12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%;基金收益分配方式为两种:现金分红与红利再投资。

5.1 报告期内本基金托管人遵循信守情况的说明
在托管南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)托管协议》的约定,对南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金管理人—南方基金管理有限公司2012年01月01日至2012年06月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵信守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本托管人认为,南方基金管理有限公司在南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等事项上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人认为,南方基金管理有限公司的信息披露符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制披露的南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的情况。

6.1 资产负债表
资产: 2012年6月30日, 2011年12月31日
负债: 2012年6月30日, 2011年12月31日
所有者权益: 2012年6月30日, 2011年12月31日

6.2 利润表
会计主体:南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)
报告截止日期:2012年6月30日

Table with 2 columns: 6.3 所有者权益变动表. Shows changes in equity components for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 6.4 现金流量表. Shows cash flow components for the period 2012年1月1日至2012年6月30日.

Table with 2 columns: 6.5 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.6 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.7 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.8 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.9 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.10 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.11 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.12 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.13 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.14 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.15 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.16 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.17 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.18 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.19 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.20 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.21 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.22 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.23 关联方关系及其交易. Lists related parties and transactions.

Table with 2 columns: 6.4.4.1.6 应支付关联方的佣金. Shows commission payments to related parties.

Table with 2 columns: 6.4.4.2 关联方报酬. Shows compensation for related parties.

Table with 2 columns: 6.4.4.2.1 基金管理费. Shows management fees for the fund.

Table with 2 columns: 6.4.4.2.2 基金托管费. Shows custody fees for the fund.

Table with 2 columns: 6.4.4.2.3 销售服务费. Shows sales service fees for the fund.

Table with 2 columns: 6.4.4.3 关联方为基金进行银行间债券市场交易. Shows interbank bond market transactions.

Table with 2 columns: 6.4.4.4 各关联方为基金提供的相关服务. Shows services provided by related parties.

Table with 2 columns: 6.4.4.4.1 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况. Shows fund manager's own investment.

Table with 2 columns: 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况. Shows other related party investments.

Table with 2 columns: 6.4.4.5 由关联方为基金提供担保. Shows guarantees provided by related parties.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.1 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.2 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.3 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.4 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.5 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.6 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.7 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.8 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.9 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.10 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.11 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.12 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.13 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.14 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.15 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.16 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.17 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.18 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

Table with 2 columns: 6.4.4.5.19 期末基金银行存款余额及当期产生的利息收入. Shows bank deposits and interest income.

注:1.本基金对以上证券代码采用当地市场代码。
2.买入包括一级市场上主动的买入、新股、配股、增发、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额或成交金额乘以成交数量 孰列,不考虑相关交易费用。

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.

Table with 2 columns: 7.5.2 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细. Lists top equity investments.