南方中证500指数证券投资基金(LOF)

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2013年3月29日

§1 重要提示及目录

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月20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及其更新。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证500指数证券投资基金(LOF)
基金简称	南方中证500指数(LOF)
基金主代码	160119
前端交易代码	160119
后端交易代码	160120
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年9月25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
报告期末基金份额总额	6,205,579,059.16份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009-11-11

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500"。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在中证500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相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	李芳菲
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-539,300,925.90	11,100,370.73	382,178,312.08
本期利润	-38,751,033.20	-1,751,917,639.63	462,616,870.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.4512	0.1374
本期基金份额净值增长率	-0.17%	-32.72%	9.40%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1875	-0.1861	0.1459
期末基金资产净值	5,042,232,609.53	4,033,578,172.24	3,658,934,810.92
期末基金份额净值	0.8125	0.8139	1.2310

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.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

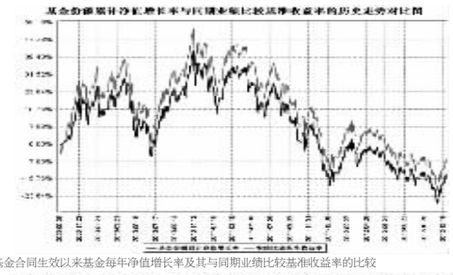
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

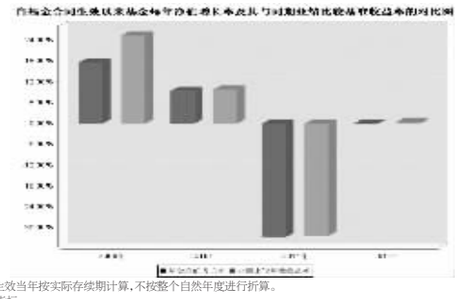
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.05%	1.37%	2.29%	1.37%	-0.24%	0.00%
过去六个月	-5.51%	1.39%	-5.28%	1.39%	-0.23%	0.00%
过去一年	-0.17%	1.46%	0.42%	1.46%	-0.59%	0.00%
过去三年	-26.52%	1.55%	-25.42%	1.55%	-1.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	-13.59%	1.56%	-6.47%	1.58%	-7.12%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	0.2000	47,591,055.34	32,229,449.82	79,820,505.16	
2010	0.5000	116,331,049.37	55,660,508.35	171,991,557.72	
合计	0.7000	163,922,104.71	87,889,958.17	251,812,062.88	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。2010年,经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场(集团)有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。公司在北京、上海、合肥等地设有分公司,在香港设有子公司--南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末,公司管理资产规模近2,300亿元,旗下管理37只开放式基金,2只封闭式基金,多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张原	本基金的基金经理	2009年9月25日	-	6	美国密歇根大学经济学硕士学位,具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金,曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员,南方高增及南方隆元基金经理助理。2009年9月至今,任南方500基金经理;2010年2月至今,任南方绩优基金经理;2011年2月至今,任南方高增基金经理。
潘海宁	本基金的基金经理	2011年2月17日	-	12	会计学学士,具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年3月加入南方基金,历任行业研究员、基金开元基金经理助理、投资部总监助理、数量化投资部副总监等职务。2009年3月至今,任南方300指数基金经理;2009年12月至今,任南方深成ETF及联接基金基金经理;2011年2月至今,任南方500基金经理;2013年2月至今,任南方500ETF基金经理;2013年2月至今,任南方开元沪深300ETF基金经理。
罗文杰	本基金的基金经理助理	2011年2月28日	-	7	美国南加州大学金融数学专业硕士、美国加州大学计算机专业硕士、双硕士学历,曾任职于美国Open Link Financial公司、美国摩根斯坦利公司,参与利率及衍生品定价模型的相关工作。2008年加盟南方基金,现任数量化投资部金融工程研究员;2011年2月至今,任南方小康及小康ETF、南方300、南方500、深成ETF及南方深成基金经理助理;2011年10月至今,任南方上证380ETF及其联接基金的基金经理助理。

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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,本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金销售管理办法》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准则、《南方中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定,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,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,制定了研究报告审核流程,股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资决策委员会议事规则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内,两两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占优比也没有明显异常,不存在不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为17次。其中,14次是由于指数型基金根据标的指数成份股调整而被动调仓所致;2次是由于基金接受投资者大额申赎后,被动增减仓位或组合配置所致;1次是由于社保201组合调整,选择期限与收益匹配较好的债券进行投资的需要。

4.4 管理人对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

2012年,中央针对经济增速下滑推出了稳健偏松的货币政策和相对积极的财政政策,主要股指在创出数年新低之后于年底展开升势,全年中证500指数涨幅为+0.28%。

期间我们通过自建的"指数化交易系统"、"日内择时交易模型"、"跟踪误差归因分析系统"等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

①接受大额申购、赎回所带来的股票仓位偏离,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;

②个别长期停牌证券,引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离;

③部分成份股分红引起的基金净值相对于业绩基准的正向偏离;

④年内我们根据指数每半年一次的成份股调整进行了基金调仓,事前我们制定了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生,从实施结果来看,效果良好,跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完成至报告期末年化跟踪误差为0.332%,今年初至报告期末年化跟踪误差为0.352%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过4%的投资目标,并保持业内同类领先。

截至报告期末,本基金份额净值为0.8125元,报告期内,份额净值增长率为-0.17%,同期业绩基准增长率为0.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过3年的调整,中国经济增速已经从之前的百分之十几回调至7.5%附近,事物必有循环规律,增速不可能持续下跌;而日本、韩国等发达国家处在和我国现在同样发展阶段时,经济增长速度也能够保持在8%左右。因此中国经济未来几年保持8%左右的增速是可行的,中国经济企稳回升将是大概率事件。

国际方面,美国经济已经处于复苏初期,失业率已经下降到警戒线以下,房价也在恢复性上升,苹果手机和页岩气开发等为美国经济的持续复苏注入了强劲动力,美联储已经表示未来将收紧印钞机器;欧债危机已告一段落,国外投资者已经开始买入希腊、西班牙等危机国家的国债,表明已经不担心这些国家的崩溃,欧洲央行也没有继续加印钞票的理由。因此,国际大宗商品价格未来将保持较低水平,而我国也将因此受益,物价水平也会继续保持低位,货币政策将保持适度宽松格局。伴随经济企稳回升、通胀水平较低、货币政策宽松,企业经营环境将大为好转,盈利能力的恢复有助于提升上市公司的分红收益率和成长性,股票资产的吸引力将逐步提升。

本基金为指数基金,作为基金管理人,我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨,实现对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格,借助投资本基金参与市场。

对于没有太多精力专注于股市的投资者,我们认为通过本基金进行定期定投,不失为一种较为省心省力且长期效果不俗的投资方式。而对于那些股市经验丰富的投资者,我们建议在主动配置个股的同时,可根据自己对市场走势的判断,用部分仓位通过指数基金进行快速加减仓的波段操作,这也是目前较多专业机构投资者的惯用方法。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、数量化投资部总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制订的相关制度,负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理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;若《基金合同》生效不满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6次,每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的10%;基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则,本报告期内未有收益分配事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管南方中证500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》等相关法律法规的规定以及《南方中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《南方中证500指数证券投资基金(LOF)托管协议》的约定,对南方中证500指数证券投资基金(LOF)管理人—南方基金管理有限公司2012年1月1日至2012年12月31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规守信、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证500指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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事务符合《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,基金管理人所编制和披露的南方中证500指数证券投资基金(LOF)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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金2012年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2013)第20091号"标准无保留意见的审计报告",投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:南方中证500指数证券投资基金(LOF)

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款		306,626,406.73	220,681,198.52
结算备付金		760,713.71	4,084,350.08
存出保证金		818,622.50	1,072,000.86
交易性金融资产		4,810,124,476.46	3,804,627,867.53
其中:股票投资		4,808,879,676.46	3,804,627,867.53
基金投资		-	-
债券投资		1,244,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		43,804,552.52	-
应收利息		49,298.73	45,626.84
应收股利		-	-
应收申购款		4,488,528.20	25,432,664.28
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		5,166,672,598.85	4,055,943,708.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		81,151,367.23	-
应付赎回款		37,251,312.39	17,121,087.36
应付管理人报酬		2,337,388.62	2,208,748.16
应付托管费		467,477.74	441,749.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,449,110.52	909,767.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,783,332.82	1,684,183.68
负债合计		124,439,989.32	22,365,535.87
所有者权益:			
实收基金		6,205,579,059.16	4,956,039,677.38
未分配利润		-1,163,346,449.63	-922,461,505.14
所有者权益合计		5,042,232,609.53	4,033,578,172.24
负债和所有者权益总计		5,166,672,598.85	4,055,943,708.11

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.8125元,基金份额总额6,205,579,059.16份。

7.2 利润表

会计主体:南方中证500指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		7,334,935.70	-1,712,056,557.10
1. 利息收入		1,910,106.32	1,658,175.11
其中:存款利息收入		1,908,751.21	1,657,346.64
债券利息收入		177.34	828.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,177.77	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以"-"填列)		-497,388,962.67	46,421,133.47
其中:股票投资收益		-535,156,866.61	25,633,631.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	177,298.19
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		37,767,903.94	20,610,204.08
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		500,549,892.70	-1,763,018,010.36
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以"-"号填列)		2,263,899.35	2,882,144.68
减:二、费用		46,085,968.90	39,861,082.53
1. 管理人报酬		28,875,821.62	25,353,558.63
2. 托管费		5,775,164.26	5,070,711.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		9,982,557.95	8,098,225.10
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		1,452,425.07	1,338,587.02
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-38,751,033.20	-1,751,917,639.63
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-38,751,033.20	-1,751,917,639.63

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方中证500指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,956,039,677.38	-922,461,505.14	4,033,578,172.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-38,751,033.20	-38,751,033.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	1,249,539,381.78	-202,133,911.29	1,047,405,470.49
其中:1.基金申购款	3,604,889,954.50	-523,216,072.86	3,081,673,881.64
2.基金赎回款	-2,355,350,572.72	321,082,161.57	-2,034,268,411.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,205,579,059.16	-1,163,346,449.63	5,042,232,609.53
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,972,289,432.83	686,645,378.09	3,658,934,810.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,751,917,639.63	-1,751,917,639.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	1,983,750,244.55	222,631,261.56	2,206,381,506.11
其中:1.基金申购款	4,172,769,994.16	476,116,732.96	4,648,886,727.12
2.基金赎回款	-2,189,019,749.61	-253,485,471.40	-2,442,505,221.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-79,820,505.16	-79,820,505.16
五、期末所有者权益(基金净值)	4,956,039,677.38	-922,461,505.14	4,033,578,172.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_____吴万善_____ _____鲍文革_____ _____鲍文革_____

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

7.4.2会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.2.3 差错更正的说明

无。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司("南方基金")	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年度		上年度可比期间 2011年度	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	1,135,890,496.18	16.59%	853,280,794.60	14.28%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年度			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	953,332.08	16.21%	214,893.50	14.83%
关联方名称	上年度可比期间 2011年度			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	693,302.28	13.94%	58,900.95	6.47%

注:

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年度	上年度可比期间 2011年度
当期发生的基金应支付的管理费	28,875,821.62	25,353,558.63
其中:支付销售机构的客户维护费	6,230,033.76	5,983,230.72

注:支付基金管理人 南方基金 的管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.6% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年度	上年度可比期间 2011年度
当期发生的基金应支付的托管费	5,775,164.26	5,070,711.78

注:支付基金托管人 中国农业银行 的托管费按前一日基金资产净值0.12%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.12% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 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

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年度		上年度可比期间 2011年度	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	306,626,406.73	1,804,257.74	220,681,198.52	1,576,763.80

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2012年度					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张)	总金额
兴业证券	600815	厦工股份	配售	255,516	1,640,412.72
上年度可比期间 2011年度					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.5 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	
000826	桑德环境	2012-12-31	2012-1-9	配股	12.71	22.99	286,738	3,644,439.98	6,592,106.62	
600815	厦工股份	2012-12-21	2013-1-8	增发流通受限	6.42	6.99	255,516	1,640,412.72	1,786,056.84	

7.4.5.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	
125099	海直转债	2012-12-19	2013-1-7	配债	100.00	100.00	12,448	1,244,800.00	1,244,800.00	

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	
000793	华闻传媒	2012-11-23	重大资产重组	6.63	2013-02-28	7.29	2,990,023	17,404,966.17	19,823,852.49	
600110	中科英华	2012-11-19	重大资产重组	3.61	2013-03-11	3.97	3,604,144	20,641,457.53	13,010,959.84	
600236	桂冠电力	2012-12-21	重大资产重组	3.98	2013-02-05	4.36	2,917,160	12,853,453.88	11,610,296.80	
000973	佛塑科技	2012-12-28	公告重大事项	4.15	2013-01-18	4.57	2,371,649	15,972,939.97	9,842,343.35	
600780	通宝能源	2012-01-18	重要事项未公告	6.70	2013-03-15	6.70	1,247,145	8,272,487.54	8,355,871.50	
002506	超日太阳	2012-12-20	公告重大事项	5.11	2013-02-01	4.85	1,615,983	13,837,980.41	8,257,673.13	
600127	金健米业	2012-12-21	公告重大事项	4.69	2013-02-08	5.16	1,741,180	11,361,499.51	8,166,134.20	
000712	锦龙股份	2012-12-10	重大资产重组	11.10	未知	未知	699,016	10,324,279.88	7,759,077.60	
000903	云内动力	2012-12-31	公告重大事项	4.65	2013-01-04	4.72	1,521,353	8,854,396.80	7,074,291.45	
600580	卧龙电气	2012-11-20	重大资产重组	3.94	2013-01-09	4.33	1,725,528	12,908,030.54	6,798,580.32	
000698	沈阳化工	2012-12-24	公告重大事项	4.22	2013-01-31	4.64	1,479,461	10,680,235.07	6,243,325.42	
000042	深长城	2012-12-18	公告重大事项	20.10	2013-02-05	22.11	305,745	5,524,129