基金管理人:南方基金管理有限公司

### 南方策略优化股票型证券投资基金

#### 2013 第一季度 报告

2013年3月31日

	§ 1 重要提示
	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
上和完整性承担个別及连帯责任。	据本基金合同规定,于2013年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投
基並代目人伯尚報「I成衍有限公司限 第41合报告等内容、保证复核内容不存在席	
description of the bit of the second	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
[未来表现。投资有风险,投资者在作出投资	6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2013年1月1日起至2013年3	月31日止。 <b>§ 2 基金产品概况</b>
基金简称	南方策略优化股票
交易代码	202019
が端交易代码	202019
前端文あれ内 后端交易代码	202019
旧場文の刊的 基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	
株田末基金份額总額	2010年3月30日
	911,763,685.75份
投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略,在积极把握证券市场及相关 行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资,力争获取超越业绩 比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资政能包含资产配置。行业配置和户股选择等三个层面,基金管理人在综合分形然活刷则,对效效 市场环境等更累的基础上,采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置领域、基金管理人开发了基于程础全上的四种通常分离,有方能化行业配置模型、在行业配置的基础上,进一步使用"南方多因子提化选度模型"。在报基本面(但面,市场面积效选性等因素对股票进行综合评分,精差各行业内具有超额收益能力或潜力的优势个股,构建本基金的股票组合。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金分股票型基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理有限公司
<b>贴金托管人</b>	招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"南方策略"。
	§ 3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标	WO. 107
ha ward to be the first	单位:人民币5
主要财务指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年3月31日)
1.本期已实现收益	-2,256,565.24
2.本期利润	-251,636.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0003
4.期末基金资产净值	592,260,196,36

		1.41以来基金累计师 增长 本 与 日	值增长率	24 740 4 4 41	司期业绩比较基	, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	0.61% 整变动的比多 <b>33.41比</b>	
基金数数 5213 0003 5213 0428 0428				24 740 4 4 41		, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	24 741141	
****				4 1/4	V .	M	non 1	
30.47% 41.68% 27.500 41.68%	SUCKED 1	TAPRENT		***	<b>以理论</b> 44 本	0.000	201-103	Manual Ma

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,计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.1 ZES	☆经理(或基金	金経理小组)简介 に ませ 合め	基金经理期限		
姓名	职务	任职日期	選任日期 選任日期	证券从业 年限	说明
刘治平	数量 化投资部总监、本基金的基金经理	2010年3月30日	2013年3月15日	17	短国库尔大学工商管理硕士、美国创 州达大学计高领理学博士、查求得美国 股票交易从业资格,具有中国基金从 营先后担任香港巴克莱投资银行司等 及美国组约美原投资银行自营投资量 度。2008年0月加入南方基金,提任南方 量化投资部总监。2010年3月至2013年3 万策略基金经过
杨德龙	本基金基金经理	2013年3月15日	_	6	北京大学经济学硕士、清华大学工学 有基金从业资格。2006年加入南方基金 研究部高级行业研究员、首席策略。 2010年8月至今,任小康ETF及南方小员 理。2011年9月至今,任南方上证380ET 基金基金经理;2013年3月至今,任南方 全经理。

后的非首任基金经理,"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。
 42 管理人对报告期外本基金管件遵理守信情况的说明
 本报告期外、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、《南方策略优化股票型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、《南方策略优化股票型证券投资

资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定。本着诚实信用、勤勉尽者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

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 华国区司河小华高级自建公、但为门、证分及风资或自建公司公丁火の则或自守感必介,无密和巡测及及创证。但是 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。 4.3.2 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党价同日反

條款调仓所款。 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 4.41 报告期内基金投资策略和运作分析 报告期内,当前签价的在继续缓慢复步、通帐压力已经有所缓和,货币政策将继续保持中性偏松,企业盈利会缓慢恢复。 市场主流指数以震荡整理与主,其中空深00%上10%。中证500涨5.29%。 本基金015年第一季度的投资操作主要体现在采用统一的量化多因子模型。在捕捉各大行业的价值,成长、盈利质量、 动量反转,市场情绪等因子的基础上。加大了研究员推荐因子的比重。仓位操作上基本保持在80%—90%之间。 4.2 报告即为生态的业场表明

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

# 截至报告期末,本基金份额净值为0.650元;报告期内,基金份额净值增长率为0.00%,同期业绩基准增长率为-0.61%

5.1		项目	金额(元	:)	占基金总资产的比	:例(%)	
1	权益投资			519,589,588.75	III III III III III III III III III II	87.50	
•	其中:股票			519.589.588.75		87.5	
2	固定收益投资			30,259,560,70		5.10	
	其中:债券		30,259,560.70			5.10	
	资产支持证券			50,257,500.70		5.11	
3	金融衍生品投资						
4	买人返售金融资	plic		40.000.000.00		6.7	
		]的买人返售金融资		-		0.7	
5	银行存款和结算	备付金合计		2,366,580.03		0.4	
6	其他资产			1,613,232.11		0.27	
7	合计			593,828,961.59		100.0	
		5.2 报	告期末按行业分类的	股票投资组合			
序号		行业类别	公允f	介值(元)	占基金资产净值	i比例(%)	
A	农、林、牧、渔业			12,312,279.93		2.0	
В	采掘业			39,344,382.95		6.64	
C	制造业			241,149,200.26		40.7	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业			15,518,712.88		2.6	
E	建筑业			19,833,187.17		3.3	
F	批发和零售业	test v		28,216,504.65		4.7	
G	交通运输、仓储和	1邮政业	4,413,560.48			0.7	
H	住宿和餐饮业 信息传输,软件和	66 内 ++ 本 B2 タ ボ		- 10.747 522.04		3.3	
I	信息传報、软件和 金融业	旧思技术服务业		19,746,533.84 110,300,641.50		18.6	
K	房地产业			14,742,672.19		2.4	
L	租赁和商务服务	lle.		6,399,110.57		1.0	
M	科学研究和技术			_			
N		能和公共设施管理业		7,612,802.33		1.2	
0	居民服务	、修理和其他服务业		-			
Р		教育		-			
Q	12.5	生和社会工作		-			
R	文化	、体育和娱乐业		-			
S		综合		-			
		合计		519,589,588.75		87.7	
	5.1	3 报告期末按公允价值	占基金资产净值比例	大小排序的前十名服			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 (%		
1	000001	平安银行	1,148,835	23,114,5	560.20	3.90	
2	600216	浙江医药	1,000,000	21,470,0	00.00	3.6.	
3	600153	建发股份	2,978,745	21,178,8	376.95	3.5	
4	600016	早出銀行	2 056 870	10 828 2	226.80	3.3	

/	000651	恰刀电器	528,583	15,10	1,616.31	2.55
8	601601	中国太保	737,388	13,48	6,826.52	2.28
9	002013	中航精机	685,369	10,10	9,192.75	1.71
10	600066	宇通客车	352,725	10,09	1,462.25	1.70
5.4	报告期末按债券品	种分类的债券投资组合	,			
序号	ਿ	券品种	公允价值	i(元)	占基	金资产净值比例(%)
1	国家债券			-		-
2	央行票据			-		-
3	金融债券			29,985,000.00		5.06
	其中:政策性金融	借		29,985,000.00		5.06
4	企业债券			-		-
5	企业短期融资券			-		-
6	中期票据			-		-

274,560.7

债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元)

601166

5.6 报告期末校公允价值占基金按严净值比例大小排名的前十名资产支持证券才 本基金本报告期末未持有资产支持证券才 本基金本报告期末未持有资产支持证券才 本基金本报告期末未持有资产 本基金本报告期末未持有权证 5.8 报告期末未益金按约除期价交易情况说明 本基金本报告期末未持有权证 5.9 报告期末未益金按约除期价交易情况说明 本基金本报告期末未授或股前期价交易情况说明 本基金本报告期末未授或股前期份。 , 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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

5.9.2					
	论投资的前十名股票没有起	23出基金合同规	]定的备选股	栗库。	
5.9.3	其他资产构成				
序号	名称			金額(元)	
1	存出保证金				89,460.36
2	应收证券清算款				1,022,323.75
3	应收股利				-
4	应收利息				355,998.25
5	应收申购款				145,449.75
6	其他应收款				-
7	待摊费用				-
8	其他				-
9	合计				1,613,232.11
5.9.4	报告期末持有的处于转股	期的可转换债券	学明细		
序号	债券代码	债券名	称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110011	歌华转	债	252,059.20	0.04

合计					1,613,232.11
报告期末持有的处于转	专股期的可转换债券	明细			
债券代码	债券名	称	公允化	住(元)	占基金资产净值比例(%)
110011 歌华紅		债	252,059.20		0.04
110012				22,501.50	0.00
	5.9.5 报告期末	前十名股票	中存在流通受	限情况的说明	
股票代码	股票名称			占基金资产净( 比例(%)	· 流通受限情况说明
600216	浙江医药		21,470,000.00	3.	63 非公开发行锁定期
	报告期末持有的处于年 债券代码 110011 110012 股票代码	报告期末持有的处于转股期的可转换债务 债券代码 债券名 110011 废华转 110012 海巡转 5.9.5 报告期末 股票代码 股票名称	报告期末持有的处于转股期的可转换债券得知 债券代码 债券名称 110011 碳华转债 110012 海运转债 5.9.5 报告期末前十名股票 股票代码 股票名称 流通受限	根告期末持有的处于转股期的可转换债券明细	根告期末持有的处于转股期的可转换债券得細 債券代码 債券名称 公允价值(元) 110011 歌华转债 252,059,20 110012 海运转债 22,501,50 5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受财情况的资于 股票代码 股票名称 就通受限部分的公允价 占基金资产 也(元)

无。	1 14(42)11/3	
760	§ 6 开放式基金份额变动	
		单位:份
本报告期期初基金份额总额		936,072,025.64
本报告期基金总申购份额		13,039,177.26
减:本报告期基金总赎回份额		37,347,517.15
本报告期基金拆分变动份额		-
本报告期期末基金份额总额		911,763,685.75

阶段

-11249

27 30%

## 深证成份交易型开放式指数证券投资基金

#### 2013 第一季度 报告

基余管理人:南方基余管理有限公司 接告送出日期:2013年4月19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、准确的完整性承担个别及连带责任。
基金任管人中国工简帧行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年04月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现受资组各报告等内容 保证复放内容不存在虚假记载、误导性除注或者重大遗漏。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2013年01月01日起至2013年03月31日止 § 2 基金产品概况 2009年12月4日 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小4 x基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在标的指; p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 投资策略 『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 『理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟 风险收益特征 基金托管力 中国工商银行股份有限公司 注:本基金在交易 § 3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 59,894,373.38

3.加权平均基金份额本期利润 5.期末基金份额净值

阶段 基金份额累计价值增长率与问期业级比较基準收益率的历史走势对比图 14.34% 16.72% 27 418 -20.30% -37.70% —从北西南部江水北州本 ——※新江北州市北市

注:本基金建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。基金合同中关于基金投资比例的约定,本 基金将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下,本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值

1.1 共全组	・理(或基金经理/	人细 ) 简介	§ 4 管理人报	告	
姓名	职务	任本基金的基 任职日期	金经理期限 選任日期	证券从业 年限	说明
番海宁	本基金的基金经理	2009年12月4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、富里公司在1003年3月加入南方基金,历任于业研究员、基金开元基金经理。2009年5月至今,任南方30位。2009年5月至今,任南方30位。2009年5月至今,任南方30位全经理。2011年2月至今,任南方500任至经里。2011年2月至今,任南方500任至经里。2011年2月至今,任南方于200任至北金经理,2013年2月至今,任南方并元沪深300任7基金经理。

42 官理人对报告期內本基金室任理場所目前於即切明 本报告期內、本基金管理人幣檢查「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 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、《深证成份交易型开放式指数 证券投资基金基金台间》和其他有关法律法规的规定。本省诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。在严格控制风 除的基础上、为基金持有人(某项最大利益。本程等内、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 图、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。

4.3.2 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1次,是由于指数型基金根据标的指数成份股结构 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2013年1季度,市场整体呈现中高回席走势,报告期内深证成指涨幅为-2-49%。 期间我们通过自建的"指数化交易系统"、"日内择时交易模型"、假踪误差归因分析系统"、"ETF现金流精算系统"等,将本基金的跟踪误差指除验帕在较好水平,并通过严格的政险管理规程,确保了本ETF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; 20按受天确审明。赎回带外的成份股权重确属,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化; 20对于现金抽票,我们通过"ETF现金流精算系统"在确保安全的前提下将现金比例降至较低水平,极大的减少了持有 现金对本外企业等还与比较特定。

对本基金跟踪目标指数产生的拖累; ③去年底前后,我们根据指数年度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,在实施过程中引人多

公認的//邮炉记》地位文主、次头推自未来有,次末年以下,那成形态化产的性产建设化组9%。 4.4. 报告制的基金的业绩资本。 自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为0.4.44%。今年初至报告期末年化跟踪误差为0.163%,较好的完成了基金 申控制年化服就误差不超过2%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0.90%元,报告期内,分额净值增长率为—2.53%。同期业绩基准增长率为—2.49%。

5.1 指	语期末基金资产组合情况 		
序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,858,709,395.99	99.6
	其中:股票	2,858,709,395.99	99.6
2	固定收益投资	-	
	其中:债券	-	
	资产支持证券	-	
3	金融衍生品投资	-	
4	买人返售金融资产	-	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
5	银行存款和结算备付金合计	11,005,940.73	0.3
6	其他资产	37,229.41	0.0
7	合计	2,869,752,566.13	100.0
34- L	主由的肌面机冷压会式自转位整件体操体;	エミかん 八江市 カア タコプロ 社体 かん	- Arter Lidde Arter

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	_
В	采掘业	169,881,108.42	5.93
С	制造业	1,617,457,353.58	56.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	39,761,168.50	1.39
F	批发和零售业	94,506,173.58	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	431,997,196.12	15.08
K	房地产业	437,312,557.16	15.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	67,794,118.63	2.37
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	_	-
S	综合	_	-
	合计	2,858,709,675.99	99.76

注:本基金本报告期未持有积极投资。 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

5.3.1 报告期末指数投资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 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 7,888,56 225,376,244.91 平安银行 184,944,166. 000858 五粮液 140,294,261.7 000776 119,535,431.6 000423 1.883.0 98.109.249.50 14,836,13 958,116 81,918,918.00

本基金本报告期末未持有积极投资

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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 本基金本报告期末未持有权证

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 本基金本报告期内未投资股指期货

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票

34,991.97 2,237.44 7 待摊费用 37,229.41

59.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明捆 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债券。 59.5 报告期末前十名股票中在在通查硬情况的说明 59.51 报告期末指数设验前十名股票中存在通查硬情况的说明 本基金本报告期末指数设验前十名股票中存在通速受限情况的说明 5.55.2 报告期末指数投资前十名股票中存在通速受限情况的说明 5.55.2 报告期末极数没资前五名股票中存在通速受限情况的说明

设告期期初基金份额总额 3,734,654,507.00 及告期基金总申购份额 1,044,300,000.0

本报告期基金总赎回份额 1,622,400,000.00 § 7 备查文件目录 深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
 深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议。

3、深证成切欠约至月~~ 7.2 存放地点 深圳市福田中心区福华1路6号免税商务大厦31至33楼

#### 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 据告送出日期:2013年4月19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 

2.1 基金产品情况	
基金简称	南方深证成份ETF联接
交易代码	202017
前端交易代码	202017
后端交易代码	202018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月9日
报告期末基金份额总额	2,469,033,355.18份
投资目标	通过投资于深成ETF,緊密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差 最小化。
投资策略	本基金为完全被武大指数基金。以源成EPF作为其主要投资标的,为6 特定的客户解通过本基金投资深成EPF。本基金并不参与深处EPF的行理。 为实现紧密膜器标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产产净值906的资产投资于厚坡页FF。其余资产可投资干除的指数成份 股。落成份股。新股、债券及中国证金会允许基金投资的其他参加 具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标 指数。 在正常市场情况下。本基金净值增长中身。增忙校基准之间的目 均跟踪偏离度不超过0.3%。年限款误差不超过4%。如因报数编制规则
业绩比较基准	调整或其他因素导致跟踪偏高度和跟踪误差超过上述范围,基金管理 人应采取合理措施避免跟踪偏高度,跟踪误差进一步扩大。 深证成份指数收益率395%+银行活期存款利率(税后)x5%
风险收益特征	本基金属股票基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与 币市场基金。同时本基金为指数型基金,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。
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 2.2 目标基金基本情况	示等其他信息披露场合下,可简称为"南方深成"。
基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2009年12月4日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年2月2日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
目标基金投资目标	
目标基金投资目标 目标基金投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法。按照成份股份 标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标均指数成份股 其权重约率化进行相位调整。 当每期成份股发生调整取成份股发生配股 增发,分年等行为时, 因基金的申购和赎回等对本基金服务标的指数的效果可能带来影响 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 服炼标的指数对,基金管理人可以对按资组合管理进行运当变通和调 整、从而使得投资组合紧密地跟陈标的指数。
	縣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 其权 確認 全 化进行相应调整。 当期期成份股发生间整取成份股发生配收 分数 今 在 今 在 方 不 方 不 方 不 方 不 方 不 方 不 方 不 方 不 方 不 方

等 3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 5.期末基金份额净值

# 南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

# 2013 第一季度 报告

2013年3月31日

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 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 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、计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本报告期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 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 净值增长率标 准差② 净值增长率① 1)-3)

基金份额累计路值增长率与同期业绩比较基础收益率的历史走势用比例 3 00% +1.56% -9 12% 13 68%

-35 1899

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
	RN 95	任职日期	离任日期	III. 35-3A, 3E, 41-PR	100 191
潘海宁	本基金的基金 经理 数量化投资部副总监	2009年12月9日	-	12	会计学学士、具有基金从业资格。曾 長后征职于决业资税的有限。 富国基金管理有限公司 2003年3月 加入南方基金。 FIE 行业研究。 金开元基金经理增强,投资部总监等。 2009年3月至今,任南方20位数数基金 定理。2009年12月至今,任南方海水 工举今,任南方500位下还基金经理2013年2月 2013年2月至今,任南方开元沪深 300FT基金是等。

本铁告期門,本基金管理人「格達子(中华人民共和国业券投资基金法)、《业券投资基金运作管理办法》、《业券投资基金运作管理办法》、《业券投资基金被比查人和《证券投资基金联接基金基金台司》和其他有关法律法规多关关键法规多及环实施推测、《前方深证成份多开形式书数证券投资基金联接基金基金台司》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、为基金持有人谋求与标的指数相压的收益。本报告期内、基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人和金金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规基金会自同的规定。
2013年3月29日 由于基金规模处生变化被动调整仓化、导致水基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券被动低于基金净值的95%。持有的目标ETF基金比例低于基金净值的95%,基金管理人已于2013年4月1日调整完毕。

4.3.1 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

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历 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1次,是由于指数型基金根据标的指数成份股结构就

2013年1季度,市场整体呈现中高回落走势,报告期内深证成指涨幅为-2.49%。 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

期间我们通过自蛀的"指数化交易系统"、"日内择时交易模型"、"跟踪误差担因分析系统"等,将本基金的跟踪误差指 这制在较好水平,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 接受大鄉申詢、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 本基金大额换购目标证于所带来的股票仓位偏离,对此我们采取了优化的"再平衡"操作进行应对; ③ 去年底前后,我们根据指数年度成份股调整进行了基金调仓。事前我们顺定了拌细的调仓方案,在实施过程中引入 方法验机制防范风险安生,从实施结果来看,效果良好,跟踪误差控制在理想范围内。

方校验机制防范风险发生,从实施结果来有,20年12年,1920年12年12年 4.4.2 报告期内基金的业绩表现 目本基金维合产率至报告期末年化跟踪误差为0.496%,今年初至报告期末年化跟踪误差为0.187%,较好的完成了基金合 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0.6914元,报告期内,份额净值增长率为一2.45%,同期业绩基准增长率为一2.33%。 8.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

	共甲: 反示	16,518,296.79	0.9
2	基金投资	1,475,842,902.05	86.3
3	固定收益投资	_	
	其中:债券	_	
	资产支持证券	_	
4	金融衍生品投资	_	
5	买人返售金融资产	_	
	其中:买断式回购的买人返售金融资 产	-	
6	银行存款和结算备付金合计	80,795,324.38	4.7
7	其他资产	135,534,201.34	7.9
8	合计	1,708,690,724.56	100.0
5.2	设告期末按行业分类的股票投资组合		
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	
В	采矿业	619,846.46	0.0
С	制造业	11,983,397.67	0.7
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	
E	建筑业	145,705.30	0.0
F	批发和零售业	344,973.72	0.0
G	交通运输、仓储和邮政业	-	
Н	住宿和餐饮业	-	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	
J	金融业	1,580,117.05	0.0
K	房地产业	1,596,750.59	0.0
L	租赁和商务服务业	-	
M	科学研究和技术服务业	-	
N	水利、环境和公共设施管理业	247,506.00	0.0
0	居民服务、修理和其他服务业	-	
P	教育	-	
Q	卫生和社会工作	-	
R	文化、体育和娱乐业	-	
S	综合	-	
	会计	16 518 296 79	0.9

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(%)
1	000527	美的电器	684,600	6,284,628.00	0.37
2	000002	万科A	110,800	1,192,208.00	0.07
3	000651	格力电器	28,926	826,415.82	0.05
4	000001	平安银行	33,664	677,319.68	0.04
5	000858	五粮液	23,003	513,887.02	0.03
6	000776	广发证券	33,814	441,272.70	0.03
7	000157	中联重科	54,292	436,507.68	0.03
8	000423	东阿阿胶	6,890	358,969.00	0.02
9	002024	苏宁电器	54,156	344,973.72	0.02
10	000895	双汇发展	4,050	327,240.00	0.02

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:本基金本报告期末末持有债券。

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。

基金名称 基金类型 运作方式 管理人

股票型 交易型开放式 1,475,842,902.05 86.4

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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

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。 5.10.3 其他资产构成

77" 5	台が	3左40(八七)
1	结算保证金	276,109.09
2	应收证券清算款	134,746,506.83
3	应收股利	-
4	应收利息	17,807.91
5	应收申购款	493,777.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,534,201.34
5.10.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债	券明细
注:本	基金本报告期末未持有处于转股期的可	转换债券。

i基金资产净值 比例(%) 流通受限情况说明 6,284,628.00

单位:份
2,837,786,959.43
133,900,457.50
502,654,061.75
-
2,469,033,355.18

§ 7 备查文件目录

1、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。 2、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》 3、南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金2013年第1季度报告原文。

深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼 7.3 查阅方式