

南方中国中小盘股票指数证券投资基金 (LOF) 2011 年年度报告

2011 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：2012 年 3 月 26 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 2012 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 2011 年 9 月 26 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	37
8.1 期末基金资产组合情况	37
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	38
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	38
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	57
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	58

8.7 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	58
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	58
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	58
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	58
8.11 投资组合报告附注	58
§9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末上市基金前十名持有人	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	60
§10 开放式基金份额变动	60
§11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	62
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)
基金简称	南方中国中小盘股票指数(QDII-LOF) 场内基金简称：南方中国
基金主代码	160125
前端交易代码	160125
后端交易代码	160126
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011 年 9 月 26 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	107,855,384.95 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	2011-11-01

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“南方中国”。

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，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金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相应调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的。本基金力争控制基金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 0.5%，年跟踪误差不超过 5%。
业绩比较基准	人民币计价的中国中小盘指数净收益率（税后）。
风险收益特征	本基金主要投资标的指数成份股，具有与标的指数和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。由于中小盘股票的特点，一般情况下投资中小盘股票面临的波动要高于投资大盘股票。

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“南方中国”。

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	010-63201510

	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
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		吴万善	蒋超良

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Bank of New York Mellon
	中文	纽约梅隆银行有限公司
注册地址		One Wall Street New York, NY10286
办公地址		One Wall Street New York, NY10286
邮政编码		10286

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2011 年 9 月 26 日-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	745, 519. 98
本期利润	-282, 433. 69

加权平均基金份额本期利润	-0.0019
本期加权平均净值利润率	-0.19%
本期基金份额净值增长率	-0.66%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末
期末可供分配利润	-713,019.05
期末可供分配基金份额利润	-0.0066
期末基金资产净值	107,142,365.90
期末基金份额净值	0.9934
3.1.3 累计期末指标	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-0.66%

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。

4、本基金自基金合同生效日（2011 年 9 月 26 日）至报告期末不满一年。

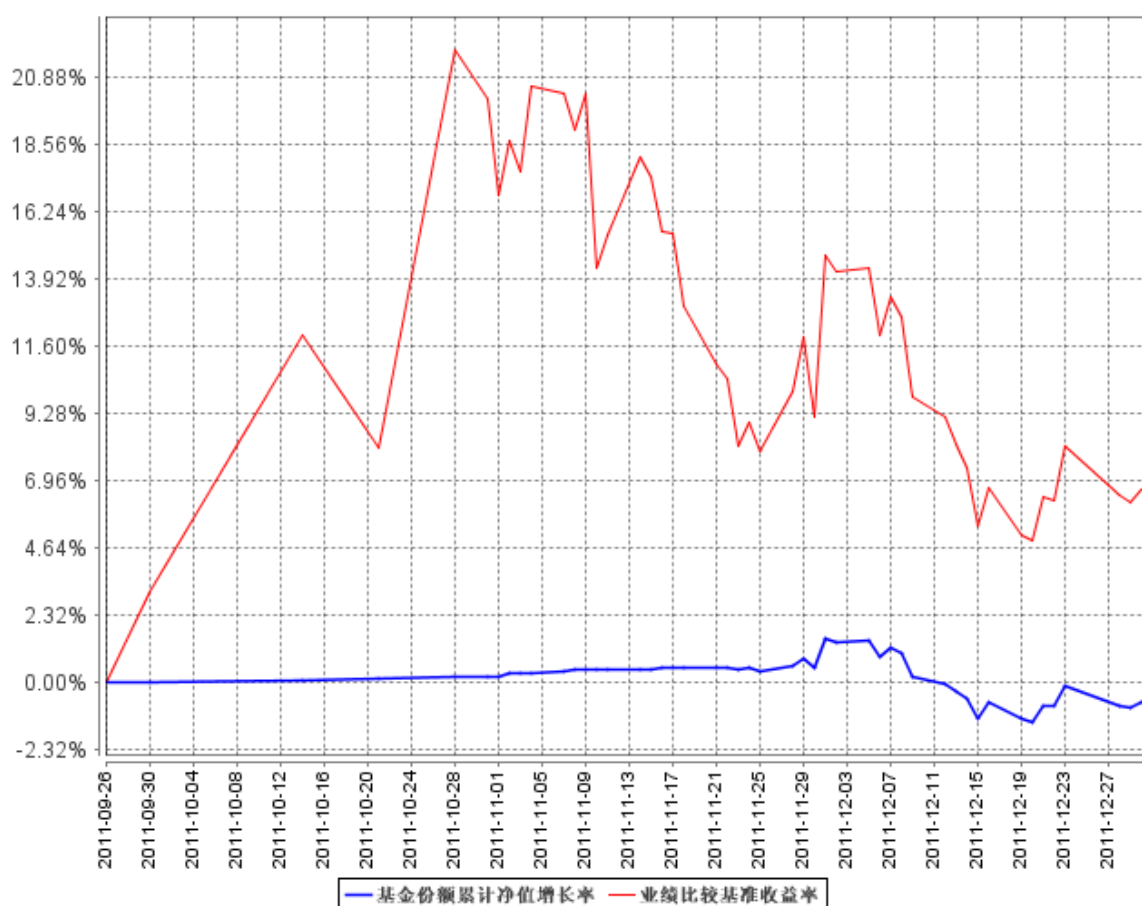
3.2 净值表现

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	-0.68%	0.33%	3.40%	2.89%	-4.08%	-2.56%
自基金合同生效起至今	-0.66%	0.32%	6.64%	2.87%	-7.30%	-2.55%

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

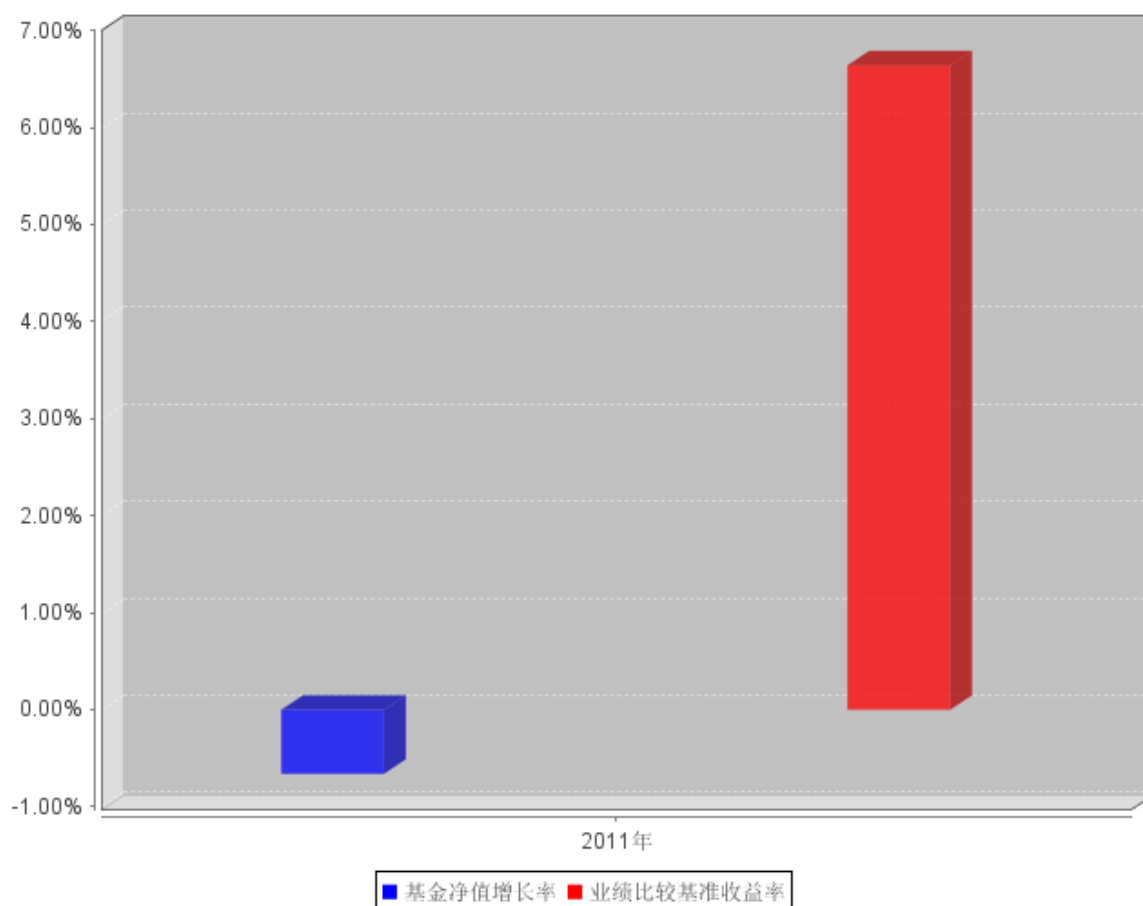
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金自合同生效起至披露时点不满一年。根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月内。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

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

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对比图



注：本基金基金合同生效日为 2011 年 9 月 26 日，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 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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%。

截至报告期末，公司管理资产规模达 1,700 多亿元，管理 2 只封闭式基金——基金开元、基金天元；30 只开放式基金——南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金、南方高增长基金、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方全球精选配置基金（QDII 基金）、南方盛元红利股票型基金、南方优选价值股票型基金、南方恒元保本混合型基金、南方沪深 300 指数基金、南方中证 500 指数基金、深证成份交易型开放式指数基金、南方深证成份交易型开放式指数基金联接基金、南方策略优化股票型基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金联接基金、南方广利回报债券型基金、南方金砖四国指数基金（QDII 基金）、南方优选成长混合型基金、南方中证 50 债券指数基金、南方保本混合型基金、上证 380 交易型开放式指数基金、南方上证 380 交易型开放式指数基金联接基金和南方中国中小盘基金（QDII 基金）；以及多个全国社保、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		
黄 亮	本基金的基金经理	2011 年 9 月 26 日	-	10 年	北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司，2005 年加入南方基金国际业务部，负责 QDII 产品设计及国际业务开拓工作，2007 年 9 月至 2009 年 5 月，担任南方全球基金经理助理；2009 年 6 月至今，担任南方全球基金经理；2010 年 12 月至今，任南方金砖基金经理；2011 年 9 月至今，任南方中小盘指数基金基金经理。

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，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(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。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人没有管理与本基金投资风格相似的其他投资组合。

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。

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

2011 年 2 月底北非和中东局势动荡一度加剧，加剧了投资人对于新兴市场风险的担忧。市场出现了一定程度的波动。相比今年一季度北非中东事件、日本大地震而言，二季度全球的政治经济局势相对平稳，二季度的主线仍然是发达市场经济复苏的疲软和新兴市场的调控。美国的 QE2 在二季度末已经正式结束，在经济增长没有表现出预期的活力的情况下，美联储维持了低利率的宽松货币政策，希望借此降低 QE2 结束的影响，维持经济复苏态势。在欧债危机的影响下，全球资本市场在三季度出现了大幅度的调整，尤其是在资金从新兴市场大幅回流发达市场的影响下，新兴市场的跌幅要远远超过了发达市场。经历了三季度大幅下跌后，全球股市在四季度呈现了明显反弹。风险资产的价格反弹和 11 月 30 日全球六大央行联手干预市场有密切关系。欧央行在权衡利弊后也开始了隐性的量化宽松，以稳定欧洲银行系统。同时，美国和中国的经济数据显示经济增长并没有出现像大家所担心的快速下滑。所以，市场过度下跌后出现反弹是比较正常的现象。

基金在 9 月底成立后就遭遇到了市场的大幅震荡。本着谨慎的原则，基金在 11 月市场调整中逐渐

增加了仓位。2012 年一季度，全球资本市场还将面临着非常多的不确定性，我们也将努力把握市场调整的时机完成基金的建仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内南方中国中小盘指数基金收益-0.66%，基金基准增长 6.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为中国经济虽然面临着各种挑战，但我们的增长速度依然是其他大多经济体所难超越的。中国企业也将继续吸引越来越多的投资资金的关注，仍然具有广阔的投资前景。从目前来看，MSCI 中国中小盘指数的估值水平已经达到了近几年的低位，根据彭博财经的数据，截至 2011 年 12 月 31 日，该指数的预期 PE 为 6.8 倍，PB1 倍，预期年派息率 3.3%。我们认为在市场恐慌情绪逐渐平息后，MSCI 中国中小盘指数的投资机遇就会被投资者重新审视，当前的低估值水平也蕴含了长期的投资价值。

本基金管理团队将继续遵循长期、稳健、价值投资的理念，继续加深研究的层次，加大研究的力度，努力挖掘投资机会，为投资者创造更好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（1）进一步完善公司各项内部管理制度

本年度监察稽核部加强公司各项内部管理制度的制订、修订工作，对公司各业务部门的内部控制制度提出修改意见和建议，并关注制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度，达到更好地防范风险的目的。

（2）内部审计和开展 SAS70 国际专项认证工作

按照证监会的要求对公司投资、研究、交易、信息技术、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对投资研究、信息技术、基金直销、后台运营等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。经过一年多的努力，SAS70 项目圆满完成，普华永道会计师事务所于 2011 年 3 月 15 日出具了无保留意见的 SAS70 内部控制报告。

(3) 采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 继续做好反商业贿赂工作，从源头上控制销售风险

本年度，我公司积极开展反商业贿赂工作，对公司旗下基金的代销、直销业务进行自查，此项工作有利于更好地控制销售风险。

(5) 对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训

本年度，我公司采取外聘专家和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(6) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(7) 信息披露和投资者关系管理工作

完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生禁止性关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。会计师事务所对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。

4.8 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；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；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则，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 2011 年 9 月 26 日至 2011 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、基金资产净值的计算、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国中小盘股票指数证券投资基金(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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2012)第 20638 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)(以下简称“南方中国中小盘指数基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年 09 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是南方中国中小盘指数基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述南方中国中小盘指数基金的财务报表在所有重大方面按

	照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了南方中国中小盘指数基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 09 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛 竞 徐振晨
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2012 年 3 月 21 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

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：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	21,633,275.00
结算备付金		1,840,909.09
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	46,125,909.16
其中：股票投资		46,125,909.16
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	42,996,179.99
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	61,033.56
应收股利		11,095.56
应收申购款		19,282.96
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		112,687,685.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,000,000.00
应付赎回款		2,266,121.36
应付管理人报酬		96,427.95
应付托管费		28,928.38
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	978.43
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	152,863.30
负债合计		5,545,319.42
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	107,855,384.95
未分配利润	7.4.7.10	-713,019.05
所有者权益合计		107,142,365.90
负债和所有者权益总计		112,687,685.32

注：1. 报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9934 元，基金份额总额 107,855,384.95 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.2 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)

本报告期：2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		664,658.07
1. 利息收入		1,651,280.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	54,281.61
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,596,999.04
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,195.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	12,874.98
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-

衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	14,320.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,027,953.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-228,698.18
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	242,834.16
减：二、费用		947,091.76
1. 管理人报酬		499,544.95
2. 托管费		149,863.47
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	116,393.34
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	181,290.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-282,433.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-282,433.69

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)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）	299,844,354.08	-	299,844,354.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期净利润）	-	-282,433.69	-282,433.69
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）	-191,988,969.13	-430,585.36	-192,419,554.49
其中：1. 基金申购款	1,830,993.26	15,376.63	1,846,369.89
2. 基金赎回款	-193,819,962.39	-445,961.99	-194,265,924.38
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）	107,855,384.95	-713,019.05	107,142,365.90

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：

高良玉 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 基金基本情况

南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 968 号《关于同意南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 299,752,082.81 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 399 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 299,844,354.08 份基金份额,其中认购资金利息折合 92,271.27 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]第 325 号文审核同意,本基金 28,537,217.00 份基金份额于 2011 年 11 月 1 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、新股(一级市场首次发行或增发),其中标的指数成份股及备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的标的指数为 MSCI China Free SMID Index(MSCI 中国自由投资中小盘股票指数,简称“中国中小盘指数”)。本基金的业绩比较基准为:人民币计价的中国中小盘指数净收益率(税后)。

根据《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金的投资组合应在基金成立 6 个月内达到基金合同规定的比例限制。截至 2011 年 12 月 31 日止,本基金尚处于建仓期。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2012 年 3 月 21 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方

中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年 09 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的 财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 09 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为本基金 2011 年 09 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益;

对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收

入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	21,633,275.00
定期存款	—

其他存款	-
合计：	21,633,275.00

注：货币资金中包括以下外币余额：

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	外币金额	汇率	折合人民币
港元	19,856,106.93	0.8107	16,097,345.89
美元	19.44	6.3009	122.49
合计	-	-	16,097,468.38

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		47,153,862.83	46,125,909.16	-1,027,953.67
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		47,153,862.83	46,125,909.16	-1,027,953.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	3,000,000.00	-
银行间买入返售证券	39,996,179.99	-
合计	42,996,179.99	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,544.55
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	911.24
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	58,577.77
应收申购款利息	-
其他	-
合计	61,033.56

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	978.43
合计	978.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,563.30
预提费用	140,300.00
合计	152,863.30

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	299,844,354.08	299,844,354.08
本期申购	1,830,993.26	1,830,993.26
本期赎回（以“-”号填列）	-193,819,962.39	-193,819,962.39
本期末	107,855,384.95	107,855,384.95

注：1. 本基金自 2011 年 8 月 25 日至 2011 年 9 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 299,752,082.81 元。根据《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 92,271.27 元在本基金成立后，折算为 92,271.27 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》的相关规定，本基金于 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 10 月 31 日止期间暂不向投资人开放基金交易。日常申购业务和赎回业务自 2011 年 11 月 1 日起开始办理。

3. 截至 2011 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 3,769,635.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 104,085,749.95 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	745,519.98	-1,027,953.67	-282,433.69
本期基金份额交易产生的变动数	-480,876.48	50,291.12	-430,585.36
其中：基金申购款	7,163.07	8,213.56	15,376.63
基金赎回款	-488,039.55	42,077.56	-445,961.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	264,643.50	-977,662.55	-713,019.05

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	47,702.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,579.36
其他	-
合计	54,281.61

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,887,984.77
减：卖出股票成本总额	1,875,109.79
买卖股票差价收入	12,874.98

7.4.7.13 债券投资收益

无发生额。

7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	14,320.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,320.13

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-1,027,953.67
——股票投资	-1,027,953.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,027,953.67

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	242,834.16
合计	242,834.16

注：本基金场内部分的赎回费率为 0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	116,393.34
银行间市场交易费用	-
合计	116,393.34

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
审计费用	60,800.00
信息披露费	75,000.00
银行划款手续费	90.00
债券托管账户维护费	4,500.00
其他	40,900.00
合计	181,290.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2012 年 2 月 15 日宣告分红，向截至 2012 年 2 月 20 日止在本基金注册登

记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.20 元。

7.4.9 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
纽约梅隆银行股份有限公司(“纽约梅隆银行”)	境外资产托管人
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	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

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	499,544.95
其中：支付销售机构的客户维护费	139,417.84

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 1%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 1% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	149,863.47

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 0.3% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 9 月 26 日）持有的基金份额	20,004,500.22
期间申购总份额	—
期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回总份额	—
期末持有的基金份额	20,004,500.22
期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.55%

注：本基金的基金管理人南方基金在本年度认购本基金的交易委托华泰联合办理，适用费率为 1,000 元/笔(认购金额 $\geq$ 1,000 万)和 1.1%(认购金额 $<$ 100 万)。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券	2,100,583.00	1.95%

7.4.10.5 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 2011 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
-------	--

	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	5, 535, 929. 11	47, 702. 25
纽约梅隆银行	16, 097, 345. 89	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人纽约梅隆银行保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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，具有与标的指数和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制

的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风控管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风控管理部对公司总经理负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 中国农业银行及境外资产托管人纽约梅隆银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券

在证券交易所上市，因此均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过参与证券借贷交易和正回购交易融入短期资金应对流动性需求，所有已售出而未回购证券总市值不得超过本基金总资产的 50%。

于 2011 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为三个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及买入返售金融资产等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,535,806.62	-	-	16,097,468.38	21,633,275.00
结算备付金	1,840,909.09	-	-	-	1,840,909.09
交易性金融资产	-	-	-	46,125,909.16	46,125,909.16
买入返售金融资产	42,996,179.99	-	-	-	42,996,179.99
应收利息	-	-	-	61,033.56	61,033.56
应收股利	-	-	-	11,095.56	11,095.56
应收申购款	1,432.01	-	-	17,850.95	19,282.96
资产总计	50,374,327.71	-	-	62,313,357.61	112,687,685.32
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,000,000.00	3,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	2,266,121.36	2,266,121.36
应付管理人报酬	-	-	-	96,427.95	96,427.95

应付托管费	-	-	-	28,928.38	28,928.38
应付交易费用	-	-	-	978.43	978.43
其他负债	-	-	-	152,863.30	152,863.30
负债总计	-	-	-	5,545,319.42	5,545,319.42
利率敏感度缺口	50,374,327.71	-	-	56,768,038.19	107,142,365.90

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	122.49	16,097,345.89	5,535,806.62	21,633,275.00
结算备付金	-	-	1,840,909.09	1,840,909.09
交易性金融资产	-	46,125,909.16		46,125,909.16
买入返售金融资产	-	-	42,996,179.99	42,996,179.99
应收利息	-	-	61,033.56	61,033.56
应收股利	-	11,095.56		11,095.56
应收申购款	-	-	19,282.96	19,282.96
资产合计	122.49	62,234,350.61	50,453,212.22	112,687,685.32
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	3,000,000.00	3,000,000.00
应付赎回款	-	-	2,266,121.36	2,266,121.36
应付管理人报酬	-	-	96,427.95	96,427.95
应付托管费	-	-	28,928.38	28,928.38

应付交易费用	-	-	978.43	978.43
其他负债	-	-	152,863.30	152,863.30
负债合计	-	-	5,545,319.42	5,545,319.42
资产负债表外汇风险敞口净额	122.49	62,234,350.61	44,907,892.80	107,142,365.90

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币和美元以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末(2011年12月31日)	
	港币和美元均相对人民币升值 5%	增加约 311	
	港币和美元均相对人民币贬值 5%	减少约 311	

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金,采用指数复制法。本基金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相应调整。本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险,投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成份股、新股(一级市场首次发行或增发),其中标的指数成份股及备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	46,125,909.16	43.05
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-

衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	46,125,909.16	43.05

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)
		本期末(2011年12月31日)
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 509
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 509

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 46,125,909.16 元,无属于第二层级以及第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间不将相关股票的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值

应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	46,125,909.16	40.93
	其中：普通股票	46,125,909.16	40.93
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
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	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	42,996,179.99	38.16
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,474,184.09	20.83
8	其他各项资产	91,412.08	0.08
9	合计	112,687,685.32	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	46,125,909.16	43.05
合计	46,125,909.16	43.05

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	696,108.38	0.65
材料	9,145,383.50	8.54
工业	7,100,672.43	6.63
非必需消费品	10,470,552.13	9.77
必需消费品	3,021,409.18	2.82
保健	1,974,597.67	1.84
金融	6,906,308.72	6.45
信息技术	3,327,015.51	3.11
电信服务	356,935.00	0.33
公用事业	3,126,926.64	2.92
合计	46,125,909.16	43.05

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金报告期末未持有积极投资。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

8.4.1 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所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	华晨中国汽车控股有限公司	1114 HK	香港交易所	中国	128,000	869,589.25	0.81
2	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	新奥能源控股有限公司	2688 HK	香港交易所	中国	42,000	847,830.06	0.79
3	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	国美电器控股有限公司	493 HK	香港交易所	中国	579,000	844,911.54	0.79
4	COSCO PACIFIC LTD	中远太平洋有限公司	1199 HK	香港交易所	中国	94,000	691,186.61	0.65

5	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控股有限公司	1313 HK	香港交易所	中国	140,000	657,153.42	0.61
6	China Yurun Food Group Limited	中国雨润食品集团有限公司	1068 HK	香港交易所	中国	78,000	644,992.92	0.6
7	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	建滔化工集团有限公司	148 HK	香港交易所	中国	34,000	633,967.40	0.59
8	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业股份有限公司	1818 HK	香港交易所	中国	63,000	630,254.39	0.59
9	PARKSON RETAIL GROUP LTD	百盛商业集团有限公司	3368 HK	香港交易所	中国	80,500	621,288.05	0.58
10	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学股份有限公司	3983 HK	香港交易所	中国	128,000	610,165.25	0.57
11	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车股份有限公司	2333 HK	香港交易所	中国	59,000	542,406.94	0.51
12	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资有限公司	270 HK	香港交易所	中国	142,000	542,212.37	0.51
13	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	上海实业控股有限公司	363 HK	香港交易所	中国	31,000	541,588.14	0.51
14	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	金鹰商贸集团有限公司	3308 HK	香港交易所	中国	39,000	519,156.07	0.48
15	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	山东威高集团医用高分子制品股份有限公司	1066 HK	香港交易所	中国	90,000	510,011.37	0.48
16	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	中国山水水泥集团有限公司	691 HK	香港交易所	中国	121,000	507,149.60	0.47
17	SOHO CHINA LTD	SOHO 中国有限公司	410 HK	香港交易所	中国	120,000	502,958.28	0.47
18	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大控股有限公司	165 HK	香港交易所	中国	50,000	492,905.60	0.46
19	LONGFOR PROPERTIES	龙湖地产有限公司	960 HK	香港交易所	中国	67,500	480,461.36	0.45
20	NINE DRAGONS PAPER (HOLDINGS) LIMITED	玖龙纸业(控股)有限公司	2689 HK	香港交易所	中国	117,000	463,825.79	0.43
21	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢福山资源集团有限公司	639 HK	香港交易所	中国	212,000	452,013.89	0.42
22	CHINA	中国粮油控	606	香港交	中	92,000	440,793.80	0.41

	AGRI-INDUSTRIES HLDGS	股份有限公司	HK	易所	国			
23	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际控 股有限公司	336 HK	香港交 易所	中 国	136,000	437,713.14	0.41
24	RENHE COMMERCIAL HOLDINGS	人和商业控 股有限公司	1387 HK	香港交 易所	中 国	604,000	435,799.89	0.41
25	YINGDE GASES GROUP COMPANY	盈德气体集 团有限公司	2168 HK	香港交 易所	中 国	65,000	417,875.32	0.39
26	WUMART STORES INC-H	北京物美商 业集团股份 有限公司	1025 HK	香港交 易所	中 国	31,000	407,636.17	0.38
27	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	远洋地产控 股有限公司	3377 HK	香港交 易所	中 国	138,000	402,755.76	0.38
28	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州数码控 股有限公司	861 HK	香港交 易所	中 国	41,000	400,193.95	0.37
29	FOSUN INTERNATIONAL	复星国际有 限公司	656 HK	香港交 易所	中 国	115,500	380,161.55	0.35
30	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国燃气控 股有限公司	384 HK	香港交 易所	中 国	130,000	376,245.87	0.35
31	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育用 品有限公司	2020 HK	香港交 易所	中 国	50,000	374,138.05	0.35
32	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国 际集团有限 公司	3311 HK	香港交 易所	中 国	82,000	366,290.47	0.34
33	FAR EAST HORIZON LIMITED	远东宏信有 限公司	3360 HK	香港交 易所	中 国	65,000	365,179.82	0.34
34	DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	达芙妮国际 控股有限公 司	210 HK	香港交 易所	中 国	52,000	364,652.86	0.34
35	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	株洲南车时 代电气股份 有限公司	3898 HK	香港交 易所	中 国	26,000	358,750.96	0.33
36	INTIME DEPARTMENT STORE	银泰百货(集 团)有限公司	1833 HK	香港交 易所	中 国	55,000	354,478.58	0.33
37	DAH CHONG HONG	大昌行集团 有限公司	1828 HK	香港交 易所	中 国	47,000	348,641.54	0.33
38	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LIMITED	中升集团控 股有限公司	881 HK	香港交 易所	中 国	33,000	346,185.11	0.32
39	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	北京首都国 际机场股份 有限公司	694 HK	香港交 易所	中 国	108,000	341,466.84	0.32
40	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际集 成电路制造	981 HK	香港交 易所	中 国	1,104,00 0	335,629.80	0.31

		有限公司						
41	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭甬 高速公路股 份有限公司	576 HK	香港交 易所	中 国	82,000	335,046.10	0.31
42	ChongQing Rural Commercial-H	重庆农村商 业银行股份 有限公司	3618 HK	香港交 易所	中 国	100,000	325,901.40	0.3
43	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	中国通信服 务股份有限 公司	552 HK	香港交 易所	中 国	114,000	323,469.30	0.3
44	China ZhengTong Auto Services Holdings Limited	中国正通汽 车服务控股 有限公司	1728 HK	香港交 易所	中 国	50,500	311,965.47	0.29
45	INTERNATIONAL MINING MACHIN	国际煤机集 团	1683 HK	香港交 易所	中 国	45,000	311,916.83	0.29
46	POLY HONG KONG INVESTMENTS	保利(香港) 投资有限公 司	119 HK	香港交 易所	中 国	114,000	311,454.73	0.29
47	MINMETALS RESOURCES LTD	五矿资源有 限公司	1208 HK	香港交 易所	中 国	116,000	309,395.55	0.29
48	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	华润燃气控 股有限公司	1193 HK	香港交 易所	中 国	34,000	305,958.18	0.29
49	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	江苏宁沪高 速公路股份 有限公司	177 HK	香港交 易所	中 国	52,000	301,418.26	0.28
50	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	吉利汽车控 股有限公司	175 HK	香港交 易所	中 国	215,000	296,310.85	0.28
51	SINO BIOPHARMACEUTICA L	中国生物制 药有限公司	1177 HK	香港交 易所	中 国	156,000	292,143.85	0.27
52	China Shipping Development Company Limited	中海发展股 份有限公司	1138 HK	香港交 易所	中 国	74,000	290,960.23	0.27
53	Dongyue Group Limited	东岳集团有 限公司	189 HK	香港交 易所	中 国	69,000	286,404.10	0.27
54	SHUI ON LAND LTD	瑞安房地产 有限公司	272 HK	香港交 易所	中 国	145,500	278,378.17	0.26
55	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一重装国 际控股有限 公司	631 HK	香港交 易所	中 国	54,000	277,113.47	0.26
56	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中国航空科 技工业股份 有限公司	2357 HK	香港交 易所	中 国	104,000	274,016.60	0.26
57	BEIJING	北控水务集	371	香港交	中	158,000	271,552.07	0.25

	ENTERPRISES WATER GR	团有限公司	HK	易所	国			
58	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥控股有限公司	297 HK	香港交易所	中国	152,000	268,633.55	0.25
59	Haier Electronics Group Co	海尔电器集团有限公司	1169 HK	香港交易所	中国	47,000	264,815.16	0.25
60	HENGDELI HOLDINGS LTD	亨得利控股有限公司	3389 HK	香港交易所	中国	128,000	263,574.78	0.25
61	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	中国忠旺控股有限公司	1333 HK	香港交易所	中国	116,800	251,874.76	0.24
62	FRANSHION PROPERTIES	方兴地产(中国)有限公司	817 HK	香港交易所	中国	206,000	250,506.30	0.23
63	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂房地产控股有限公司	813 HK	香港交易所	中国	46,500	249,934.76	0.23
64	CHINA METAL RECYCLING	中国金属再生资源(控股)有限公司	773 HK	香港交易所	中国	36,600	249,241.61	0.23
65	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	京信通信系统控股有限公司	2342 HK	香港交易所	中国	48,000	243,599.14	0.23
66	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳栾川钼业集团股份有限公司	3993 HK	香港交易所	中国	90,000	242,237.16	0.23
67	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸有限公司	2314 HK	香港交易所	中国	118,000	240,113.13	0.22
68	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	中国光大国际有限公司	257 HK	香港交易所	中国	105,000	239,197.04	0.22
69	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登国际控股有限公司	3998 HK	香港交易所	中国	134,000	238,994.36	0.22
70	LONKING HOLDINGS LTD	中国龙工控股有限公司	3339 HK	香港交易所	中国	111,000	235,767.77	0.22
71	UNITED ENERGY GROUP LTD	联合能源集团有限公司	467 HK	香港交易所	中国	220,000	233,643.74	0.22
72	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药控股集团有限公司	460 HK	香港交易所	中国	104,000	231,860.20	0.22
73	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码控股有限公司	751 HK	香港交易所	中国	104,000	229,330.82	0.21
74	WINSWAY COKING COAL HOLDINGS LIMITED	永晖焦煤股份有限公司	1733 HK	香港交易所	中国	123,000	228,349.87	0.21
75	AGILE PROPERTY	雅居乐地产	3383	香港交	中	40,000	225,698.88	0.21

	HOLDINGS LTD	控股有限公司	HK	易所	国			
76	HUNAN NON-FERROUS METALS-H	湖南有色金属股份有限公司	2626 HK	香港交易所	中国	118,000	220,980.61	0.21
77	AJISEN CHINA HOLDINGS LTD	味千(中国)控股有限公司	538 HK	香港交易所	中国	31,000	214,876.04	0.2
78	HARBIN ELECTRIC CO LTD-H	哈尔滨电气股份有限公司	1133 HK	香港交易所	中国	39,000	214,365.29	0.2
79	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际控股有限公司	152 HK	香港交易所	中国	517,500	213,964.00	0.2
80	CHINA LUMENA NEW MATERIALS	中国旭光高新材料集团有限公司	67 HK	香港交易所	中国	182,000	212,468.26	0.2
81	MINTH GROUP LTD	敏实集团有限公司	425 HK	香港交易所	中国	34,000	200,940.10	0.19
82	PORTS DESIGN LTD	宝姿时装有限公司	589 HK	香港交易所	中国	21,000	199,869.98	0.19
83	YUEXIU PROPERTY CO LTD	越秀地产股份有限公司	123 HK	香港交易所	中国	218,000	197,940.51	0.18
84	LI NING CO LTD	李宁有限公司	2331 HK	香港交易所	中国	39,500	197,579.75	0.18
85	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达国际控股有限公司	3331 HK	香港交易所	中国	24,000	193,984.30	0.18
86	NEW WORLD CHINA LAND LTD	新世界中国地产有限公司	917 HK	香港交易所	中国	148,000	185,974.58	0.17
87	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速传动设备集团有限公司	658 HK	香港交易所	中国	66,000	181,921.08	0.17
88	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际集团有限公司	2313 HK	香港交易所	中国	21,000	179,440.34	0.17
89	WEST CHINA CEMENT LTD	中国西部水泥有限公司	2233 HK	香港交易所	中国	168,000	177,056.88	0.17
90	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络股份有限公司	696 HK	香港交易所	中国	54,000	176,862.31	0.17
91	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅国际投资有限公司	308 HK	香港交易所	中国	164,000	174,170.79	0.16

92	KINGBOARD LAMINATES HOLDING	建滔积层板 控股有限公司	1888 HK	香港交 易所	中 国	60,500	173,627.62	0.16
93	CHINA RONGSHENG HEAVY INDUSTRIES GROUP HOLDINGS LIMITED	中国熔盛重 工集团控股 有限公司	1101 HK	香港交 易所	中 国	100,000	173,489.80	0.16
94	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向(集 团)有限公司	3818 HK	香港交 易所	中 国	162,000	173,360.09	0.16
95	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	海天国际控 股有限公司	1882 HK	香港交 易所	中 国	32,000	173,295.23	0.16
96	Glorious Property Holdings Limited	恒盛地产控 股有限公司	845 HK	香港交 易所	中 国	156,000	171,998.11	0.16
97	XINGDA INTL HOLDINGS	兴达国际控 股有限公司	1899 HK	香港交 易所	中 国	60,000	170,247.00	0.16
98	CHINA SHINeway PHARMACEUTICA	中国神威药 业集团有限 公司	2877 HK	香港交 易所	中 国	19,000	169,744.37	0.16
99	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际软 件集团有限 公司	268 HK	香港交 易所	中 国	100,000	169,436.30	0.16
100	NVC LIGHTING HOLDINGS LTD	雷士照明控 股有限公司	2222 HK	香港交 易所	中 国	72,000	167,523.05	0.16
101	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团有 限公司	546 HK	香港交 易所	中 国	56,000	161,621.15	0.15
102	Greentown China Holdings Limited	绿城中国控 股有限公司	3900 HK	香港交 易所	中 国	59,000	161,191.48	0.15
103	REXLOT HOLDINGS LTD	御泰中彩控 股有限公司	555 HK	香港交 易所	中 国	375,000	155,046.38	0.14
104	TCC INTL HLDGS LTD	台泥国际集 团有限公司	1136 HK	香港交 易所	中 国	72,000	154,681.56	0.14
105	CHINA DATANG CORP RENEWABLE-H	中国大唐集 团新能源股 份有限公司	1798 HK	香港交 易所	中 国	136,000	154,357.28	0.14
106	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力国 际发展有限 公司	2380 HK	香港交 易所	中 国	103,000	151,973.82	0.14
107	GLOBAL BIO-CHEM TECHNOLOGY	大成生化科 技集团有限 公司	809 HK	香港交 易所	中 国	112,000	143,461.47	0.13
108	First Tractor Company Limited	第一拖拉机 股份有限公 司	38 HK	香港交 易所	中 国	24,000	141,450.94	0.13

109	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富地产控股有限公司	1813 HK	香港交易所	中国	66,500	141,248.26	0.13
110	Hi Sun Technology (China) Ltd.	高阳科技(中国)有限公司	818 HK	香港交易所	中国	81,000	139,213.40	0.13
111	Hidili Industry International Development Ltd.	恒鼎实业国际发展有限公司	1393 HK	香港交易所	中国	74,000	138,581.06	0.13
112	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股有限公司	604 HK	香港交易所	中国	122,000	137,478.51	0.13
113	PCD STORES GROUP LTD	中国春天百货集团有限公司	331 HK	香港交易所	中国	158,000	137,056.94	0.13
114	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源控股有限公司	1205 HK	香港交易所	中国	158,000	135,776.04	0.13
115	China Medical System Holdings Limited	康哲药业控股有限公司	867 HK	香港交易所	中国	32,000	134,381.63	0.13
116	China Lilang Limited	中国利郎有限公司	1234 HK	香港交易所	中国	24,000	132,111.67	0.12
117	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	中国现代牧业控股有限公司	1117 HK	香港交易所	中国	96,000	127,636.61	0.12
118	ASIAN CITRUS HOLDINGS LTD	亚洲果业控股有限公司	73 HK	香港交易所	中国	38,000	125,998.99	0.12
119	Hopson Development Holdings Ltd.	合生创展集团有限公司	754 HK	香港交易所	中国	38,000	124,150.60	0.12
120	China Precious Metal Resources Holdings Co., Ltd.	中国贵金属资源控股有限公司	1194 HK	香港交易所	中国	106,000	123,745.25	0.12
121	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	佳兆业集团控股有限公司	1638 HK	香港交易所	中国	113,000	122,756.19	0.11
122	Sinotrans Shipping Ltd.	中外运航运有限公司	368 HK	香港交易所	中国	80,000	122,577.84	0.11
123	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	中国海外宏洋集团有限公司	81 HK	香港交易所	中国	22,000	121,280.72	0.11
124	Towngas China Company Limited	港华燃气有限公司	1083 HK	香港交易所	中国	35,000	119,172.90	0.11
125	China Oil And Gas Group Ltd.	中油燃气集团有限公司	603 HK	香港交易所	中国	220,000	115,930.10	0.11

126	Anxin-China Holdings Limited	中国安芯控股有限公司	1149 HK	香港交易所	中国	96,000	113,627.71	0.11
127	GZI Real Estate Investment Trust	越秀房地产投资信托基金	405 HK	香港交易所	中国	40,000	111,228.04	0.1
128	BILLION INDUSTRIAL HLDGS LTD	百宏实业控股有限公司	2299 HK	香港交易所	中国	33,000	109,420.18	0.1
129	CHINA WATER AFFAIRS GROUP LIMITED	中国水务集团有限公司	855 HK	香港交易所	中国	62,000	108,568.94	0.1
130	Sino Oil and Gas Holdings Limited	中国油气控股有限公司	702 HK	香港交易所	中国	475,000	105,897.69	0.1
131	VODone Ltd.	第一视频集团有限公司	82 HK	香港交易所	中国	128,000	105,844.99	0.1
132	Silver Grant International Industries Limited	银建国际实业有限公司	171 HK	香港交易所	中国	80,000	105,715.28	0.1
133	COSCO International Holdings Limited	中远国际控股有限公司	517 HK	香港交易所	中国	40,000	105,715.28	0.1
134	Shougang Concord International Enterprises Company Limited	首长国际企业有限公司	697 HK	香港交易所	中国	282,000	105,164.00	0.1
135	New World Department Store China Limited	新世界百货中国有限公司	825 HK	香港交易所	中国	29,000	104,150.63	0.1
136	YUANDA CHINA HOLDINGS LTD	远大中国控股有限公司	2789 HK	香港交易所	中国	124,000	103,542.60	0.1
137	Anhui Expressway Company Limited	安徽皖通高速公路股份有限公司	995 HK	香港交易所	中国	28,000	103,510.18	0.1
138	Tong Ren Tang Technologies Co., Ltd.	北京同仁堂科技发展股份有限公司	1666 HK	香港交易所	中国	15,000	103,364.25	0.1
139	SINOTRANS LIMITED	中国外运股份有限公司	598 HK	香港交易所	中国	92,000	102,926.47	0.1
140	Shenzhen Expressway Company Limited	深圳高速公路股份有限公司	548 HK	香港交易所	中国	38,000	101,045.65	0.09
141	AMVIG Holdings Ltd.	澳科控股有限公司	2300 HK	香港交易所	中国	30,000	100,202.52	0.09

142	TIBET 5100 WATER RESOURCES	西藏 5100 水资源控股有限公司	1115 HK	香港交易所	中国	59,000	99,967.42	0.09
143	Maoye International Holdings Limited	茂业国际控股有限公司	848 HK	香港交易所	中国	78,000	99,910.67	0.09
144	Tianjin Development Holdings Limited	天津发展控股有限公司	882 HK	香港交易所	中国	30,000	97,527.21	0.09
145	Tianneng Power INTL LTD	天能动力国际有限公司	819 HK	香港交易所	中国	34,000	96,473.30	0.09
146	Sino Union Energy Investment Group Limited	中联能源投资集团有限公司	346 HK	香港交易所	中国	220,000	94,527.62	0.09
147	Little Sheep Group Limited	小肥羊集团有限公司	968 HK	香港交易所	中国	18,000	93,830.42	0.09
148	GZI Transport Limited	越秀交通基建有限公司	1052 HK	香港交易所	中国	34,000	93,716.92	0.09
149	PHOENIX SATELLITE TELEVISION HOLDINGS LIMITED	凤凰卫视控股有限公司	2008 HK	香港交易所	中国	58,000	92,160.38	0.09
150	KINGSOFT CORP LTD	金山软件有限公司	3888 HK	香港交易所	中国	39,000	91,690.17	0.09
151	CHINA WIRELESS TECHNOLOGIES LIMITED	中国无线科技有限公司	2369 HK	香港交易所	中国	80,000	90,798.40	0.08
152	361 Degrees International Limited	361 度国际有限公司	1361 HK	香港交易所	中国	36,000	90,182.27	0.08
153	MicroPort Scientific Corporation	微创医疗科学有限公司	853 HK	香港交易所	中国	29,000	90,044.45	0.08
154	Tianjin Port Development Holdings Limited	天津港发展控股有限公司	3382 HK	香港交易所	中国	106,000	87,652.88	0.08
155	Shanghai Industrial Urban Development Group Limited	上海实业城市开发集团有限公司	563 HK	香港交易所	中国	76,000	86,258.48	0.08
156	China Suntien Green Energy Corporation Limited	新天绿色能源股份有限公司	956 HK	香港交易所	中国	78,000	85,999.06	0.08
157	C C Land Holdings	中渝置地控股	1224	香港交易所	中	73,000	85,220.78	0.08

	Ltd.	股有限公司	HK	易所	国			
158	China South City Holdings Limited	华南城控股有限公司	1668 HK	香港交易所	中国	104,000	84,312.80	0.08
159	China Power New Energy Development Company Limited	中国电力新能源发展有限公司	735 HK	香港交易所	中国	280,000	82,853.54	0.08
160	TCL Communication Technology Holdings Limited	TCL 通讯科技控股有限公司	2618 HK	香港交易所	中国	29,000	82,050.95	0.08
161	BYD Electronic (International) Co Ltd.	比亚迪电子(国际)有限公司	285 HK	香港交易所	中国	45,000	80,624.12	0.08
162	Real Nutriceutical Group Limited	瑞年国际有限公司	2010 HK	香港交易所	中国	39,000	80,307.94	0.07
163	Asia Cement (China) Holdings Corporation	亚洲水泥(中国)控股公司	743 HK	香港交易所	中国	27,000	79,675.60	0.07
164	China Rare Earth Holdings Limited	中国稀土控股有限公司	769 HK	香港交易所	中国	62,000	77,405.64	0.07
165	Weiqiao Textile Company Limited	魏桥纺织股份有限公司	2698 HK	香港交易所	中国	23,500	74,110.14	0.07
166	MIE HOLDINGS CORPORATION	MI 能源控股有限公司	1555 HK	香港交易所	中国	46,000	73,465.63	0.07
167	China Huiyuan Juice Group Limited	中国汇源果汁集团有限公司	1886 HK	香港交易所	中国	34,000	72,768.43	0.07
168	Biostime International Holdings Limited	合生元国际控股有限公司	1112 HK	香港交易所	中国	6,500	72,192.84	0.07
169	Beijing Capital Land Ltd	首创置业股份有限公司	2868 HK	香港交易所	中国	58,000	71,941.52	0.07
170	Jinchuan Group International Resources Co. Ltd	金川集团国际资源有限公司	2362 HK	香港交易所	中国	37,000	62,691.43	0.06
171	TECH PRO TECHNOLOGY DEVELOPM	德普科技发展有限公司	3823 HK	香港交易所	中国	26,000	62,602.25	0.06
172	Yips Chemical Holdings Limited	叶氏化工集团有限公司	408 HK	香港交易所	中国	12,000	56,911.14	0.05
173	Xtep International Holdings Limited	特步国际控股有限公司	1368 HK	香港交易所	中国	28,000	55,841.02	0.05

174	CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LIMITED	中骏置业控 股有限公司	1966 HK	香港交 易所	中 国	43,000	55,427.56	0.05
175	Qingling Motors Co. Limited	庆铃汽车股 份有限公司	1122 HK	香港交 易所	中 国	32,000	53,181.92	0.05
176	Xinjiang Xinxin Mining Industry Co. Ltd.	新疆新鑫矿 业股份有限 公司	3833 HK	香港交 易所	中 国	31,000	52,776.57	0.05
177	Chinasoft International Ltd.	中软国际有 限公司	354 HK	香港交 易所	中 国	30,000	52,290.15	0.05
178	Magic Holdings International Limited	美即控股国 际有限公司	1633 HK	香港交 易所	中 国	21,600	51,482.69	0.05
179	Powerlong Real Estate Holdings Limited	宝龙地产控 股有限公司	1238 HK	香港交 易所	中 国	61,000	51,430.81	0.05
180	PEAK Sprout Products Co., Limited	匹克体育用 品有限公司	1968 HK	香港交 易所	中 国	31,000	51,268.67	0.05
181	Pou Sheng International (Holdings) Limited	宝胜国际(控 股)有限公司	3813 HK	香港交 易所	中 国	64,000	50,847.10	0.05
182	Sunac China Holdings Limited	融创中国控 股有限公司	1918 HK	香港交 易所	中 国	38,000	49,598.63	0.05
183	China Vanadium Titano-Magnetite Mining Company Limited	中国钒钛铁 矿业有限公司	893 HK	香港交 易所	中 国	40,000	49,290.56	0.05
184	Sinopec Kantons Holdings Limited	中石化冠德 控股有限公司	934 HK	香港交 易所	中 国	14,000	49,258.13	0.05
185	TCL Multimedia Technology Holdings Limited	TCL 多媒体科 技控股有限 公司	1070 HK	香港交 易所	中 国	24,000	48,252.86	0.05
186	Pacific Online Limited	太平洋网络 有限公司	543 HK	香港交 易所	中 国	16,000	47,993.44	0.04
187	Golden Meditech Holdings Limited	金卫医疗集 团有限公司	801 HK	香港交 易所	中 国	68,000	47,409.74	0.04
188	CHIHO-TIANDE GROUP LIMITED	齐合天地集 团有限公司	976 HK	香港交 易所	中 国	14,000	46,534.18	0.04
189	TPV Technology Limited	冠捷科技有 限公司	903 HK	香港交 易所	中 国	40,000	46,047.76	0.04

190	Xinhua Winshare Publishing and Media Co., Ltd.	新华文轩出版传媒股份有限公司	811 HK	香港交易所	中国	18,000	45,966.69	0.04
191	Chongqing Machinery and Electric Co., Ltd.	重庆机电股份有限公司	2722 HK	香港交易所	中国	44,000	45,658.62	0.04
192	Hua Han Bio-Pharmaceutical Holdings Ltd.	华瀚生物制药控股有限公司	587 HK	香港交易所	中国	43,200	45,528.91	0.04
193	DBA Telecommunication (Asia) Holdings Ltd	DBA 电讯(亚洲)控股有限公司	3335 HK	香港交易所	中国	24,000	45,139.78	0.04
194	North Mining Shares Company Limited	北方矿业股份有限公司	433 HK	香港交易所	中国	280,000	44,718.21	0.04
195	China Pharmaceutical Group Limited	中国制药集团有限公司	1093 HK	香港交易所	中国	32,000	44,361.50	0.04
196	Goodtop Tin International Holdings Limited	万佳锡业国际控股有限公司	195 HK	香港交易所	中国	60,000	44,264.22	0.04
197	Sparkle Roll Group Limited	耀莱集团有限公司	970 HK	香港交易所	中国	72,000	43,777.80	0.04
198	China Automation Group Limited	中国自动化集团有限公司	569 HK	香港交易所	中国	24,000	43,777.80	0.04
199	Kai Yuan Holdings Limited	开源控股有限公司	1215 HK	香港交易所	中国	300,000	43,291.38	0.04
200	China Haidian Holdings Limited	中国海淀集团有限公司	256 HK	香港交易所	中国	70,000	43,129.24	0.04
201	Fantasia Holdings Group Co Limited	花样年控股集团有限公司	1777 HK	香港交易所	中国	78,000	42,999.53	0.04
202	Beijing Jingkelong Company Limited	北京京客隆商业集团股份有限公司	814 HK	香港交易所	中国	8,000	42,804.96	0.04
203	Greatview Aseptic Packaging Company Limited	纷美包装有限公司	468 HK	香港交易所	中国	20,000	42,156.40	0.04
204	SHANDONG CHENMING PAPER-H	山东晨鸣纸业集团股份有限公司	1812 HK	香港交易所	中国	13,500	41,588.91	0.04
205	Shanghai Jin	上海锦江国	2006	香港交	中	54,000	41,151.13	0.04

	Jiang International Hotels (Group) Company Limited	际酒店（集团）股份有限公司	HK	易所	国			
206	Welling Holding Limited	威灵控股有限公司	382 HK	香港交易所	中国	42,000	40,859.28	0.04
207	Baoye Group Company Limited	宝业集团股份有限公司	2355 HK	香港交易所	中国	14,000	40,745.78	0.04
208	HUTCHISON HARBOUR RING LTD	和记港陆有限公司	715 HK	香港交易所	中国	76,000	40,664.71	0.04
209	Heng Tai Consumables Group Limited	亨泰消费品集团有限公司	197 HK	香港交易所	中国	124,250	40,291.79	0.04
210	Heng Xin China Holdings Limited	恒芯中国控股有限公司	8046 HK	香港交易所	中国	80,000	40,210.72	0.04
211	China Aerospace International Holdings Limited	中国航天国际控股有限公司	31 HK	香港交易所	中国	86,000	39,740.51	0.04
212	Road King Infrastructure Limited	路劲基建有限公司	1098 HK	香港交易所	中国	11,000	39,683.77	0.04
213	SINOLINK WORLDWIDE HOLDINGS	百仕达控股有限公司	1168 HK	香港交易所	中国	84,000	39,497.30	0.04
214	Chaowei Power Holdings LTD	超威动力控股有限公司	951 HK	香港交易所	中国	15,000	39,035.21	0.04
215	CHINA SANJIANG FINE CHEMICALS COMPANY LIMITED	中国三江精细化工有限公司	2198 HK	香港交易所	中国	26,000	38,994.67	0.04
216	CGN Mining Co LTD	中广核矿业有限公司	1164 HK	香港交易所	中国	50,000	38,913.60	0.04
217	China Properties Group Limited	中国地产集团有限公司	1838 HK	香港交易所	中国	23,000	38,783.89	0.04
218	BOSHIWA INTERNATIONAL HOLDIN	博士蛙国际控股有限公司	1698 HK	香港交易所	中国	27,000	38,305.58	0.04
219	Tiangong International Company Limited	天工国际有限公司	826 HK	香港交易所	中国	36,000	37,940.76	0.04
220	Guangzhou Shipyard International Company Limited	广州广船国际股份有限公司	317 HK	香港交易所	中国	8,000	37,875.90	0.04
221	CHINA ALL ACCESS	中国全通(控	633	香港交	中	28,000	37,454.34	0.03

	HOLDINGS	股)有限公司	HK	易所	国			
222	XIAMEN INTERNATIONAL PORT-H	厦门国际港务股份有限公司	3378 HK	香港交易所	中国	40,000	37,292.20	0.03
223	Wasion Group Limited	威胜集团控股有限公司	3393 HK	香港交易所	中国	20,000	37,292.20	0.03
224	Global Energy Resources International Group Limited	环球能源资源国际集团有限公司	8192 HK	香港交易所	中国	272,000	37,266.26	0.03
225	Regent Manner International Holdings Limited	峻凌国际控股有限公司	1997 HK	香港交易所	中国	26,000	37,097.63	0.03
226	Min Xin Holdings Limited	闽信集团有限公司	222 HK	香港交易所	中国	10,000	36,886.85	0.03
227	Ba Wang International (Group) Holding Limited	霸王国际(集团)控股有限公司	1338 HK	香港交易所	中国	44,000	36,384.22	0.03
228	CITIC DAMENG HOLDINGS LIMITED	中信大锰控股有限公司	1091 HK	香港交易所	中国	39,000	36,359.90	0.03
229	CHINA SINGYES SOLAR TECH	中国兴业太阳能技术控股有限公司	750 HK	香港交易所	中国	15,000	36,359.90	0.03
230	YASHILI INTERNATIONAL HOLDIN	雅士利国际控股有限公司	1230 HK	香港交易所	中国	38,000	36,043.72	0.03
231	GOLDLION HOLDINGS LTD	金利来集团有限公司	533 HK	香港交易所	中国	15,000	35,873.48	0.03
232	TOMSON GROUP LTD	汤臣集团有限公司	258 HK	香港交易所	中国	24,000	35,605.94	0.03
233	INTERCHINA HOLDINGS CO	国中控股有限公司	202 HK	香港交易所	中国	105,000	35,326.25	0.03
234	CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP	中国奥园地产集团股份有限公司	3883 HK	香港交易所	中国	50,000	35,265.45	0.03
235	China Green (Holdings) Limited	中国绿色食品(控股)有限公司	904 HK	香港交易所	中国	21,000	34,900.64	0.03
236	SHANDONG LUOXIN PHARMACY-H	山东罗欣药业股份有限公司	8058 HK	香港交易所	中国	8,000	34,049.40	0.03
237	CITIC 21CN COMPANY LIMITED	中信 21 世纪有限公司	241 HK	香港交易所	中国	96,000	33,465.70	0.03

238	CHINA TONTINE WINES GROUP	中国通天酒 业集团有限 公司	389 HK	香港交 易所	中 国	44,000	33,173.84	0.03
239	Central China Real Estate Limited	建业地产股 份有限公司	832 HK	香港交 易所	中 国	26,000	32,671.21	0.03
240	China Kingstone Mining Holdings Limited	中国金石矿 业控股有限 公司	1380 HK	香港交 易所	中 国	34,000	32,525.28	0.03
241	Dongjiang Environmental Company Limited	东江环保股 份有限公司	895 HK	香港交 易所	中 国	1,600	32,168.58	0.03
242	ZHONG AN REAL ESTATE LTD	众安房产有 限公司	672 HK	香港交 易所	中 国	36,000	30,936.31	0.03
243	CHINA MERCHANTS CHINA DIRECT	招商局中国 基金有限公 司	133 HK	香港交 易所	中 国	4,000	30,806.60	0.03
244	MINMETALS LAND LTD	五矿建设有 限公司	230 HK	香港交 易所	中 国	50,000	30,401.25	0.03
245	CPMC HOLDINGS LTD	中粮包装控 股有限公司	906 HK	香港交 易所	中 国	11,000	29,874.30	0.03
246	NETDRAGON WEBSOFT INC	网龙网络有 限公司	777 HK	香港交 易所	中 国	8,000	29,768.90	0.03
247	LIJUN INTL PHARMACETL HLDG	利君国际医 药(控股)有 限公司	2005 HK	香港交 易所	中 国	40,000	28,860.92	0.03
248	CHINA ITS HOLDINGS CO LTD	中国智能交 通系统(控 股)有限公司	1900 HK	香港交 易所	中 国	33,000	28,625.82	0.03
249	O-NET COMMUNICATIONS GROUP	昂纳光通信 (集团)有限 公司	877 HK	香港交 易所	中 国	16,000	28,536.64	0.03
250	ROYALE FURNITURE HOLDINGS	皇朝家俬控 股有限公司	1198 HK	香港交 易所	中 国	18,000	28,455.57	0.03
251	LOUDONG GENERAL NICE RESOURC	楼东俊安资 源(中国)控 股有限公司	988 HK	香港交 易所	中 国	57,000	28,188.04	0.03
252	China Qinfa Group Limited	中国秦发集 团有限公司	866 HK	香港交 易所	中 国	26,000	28,034.01	0.03
253	BEIJING NORTH STAR CO LTD-H	北京北辰实 业股份有限 公司	588 HK	香港交 易所	中 国	30,000	27,969.15	0.03
254	LINGBAO GOLD CO LTD-H	灵宝黄金股 份有限公司	3330 HK	香港交 易所	中 国	12,000	27,531.37	0.03

255	BESUNYEN HOLDINGS CO LTD	碧生源控股有限公司	926 HK	香港交易所	中国	29,000	27,507.05	0.03
256	EXTRAWEILL PHARMACEUTICAL	精优药业控股有限公司	858 HK	香港交易所	中国	80,000	27,239.52	0.03
257	Yuzhou Properties Company Limited	禹洲地产股份有限公司	1628 HK	香港交易所	中国	17,000	27,150.34	0.03
258	CHINA CORN OIL CO LTD	中国玉米油股份有限公司	1006 HK	香港交易所	中国	11,000	26,931.45	0.03
259	SHENGLI OIL&GAS PIPE HOLDING	胜利油气管道控股有限公司	1080 HK	香港交易所	中国	42,000	26,899.03	0.03
260	PRINCE FROG INTL HLDGS LTD	青蛙王子国际控股有限公司	1259 HK	香港交易所	中国	17,000	26,874.71	0.03
261	Hong Kong Construction (Holdings) Limited	香港建设(控股)有限公司	190 HK	香港交易所	中国	116,000	26,801.74	0.03
262	SRE GROUP LTD	上置集团有限公司	1207 HK	香港交易所	中国	94,000	26,291.00	0.02
263	AVIC INTERNATIONAL HLDGS HK	中国航空技术国际控股有限公司(香港)	232 HK	香港交易所	中国	130,000	26,242.36	0.02
264	JU TENG INTERNATIONAL HLDGS	巨腾国际控股有限公司	3336 HK	香港交易所	中国	36,000	25,974.83	0.02
265	GREAT WALL TECHNOLOGY CO-H	长城科技股份有限公司	74 HK	香港交易所	中国	20,000	25,942.40	0.02
266	LE SAUNDA HOLDINGS	利信达集团有限公司	738 HK	香港交易所	中国	12,000	25,780.26	0.02
267	HAINAN MEILAN INTL AIRPORT-H	海南美兰国际机场股份有限公司	357 HK	香港交易所	中国	6,000	25,780.26	0.02
268	Beijing Properties (Holdings) Limited	北京建设(控股)有限公司	925 HK	香港交易所	中国	70,000	25,537.05	0.02
269	CATIC SHENZHEN HLDGS LTD-H	深圳中航集团股份有限公司	161 HK	香港交易所	中国	10,000	25,293.84	0.02
270	ANTON OILFIELD SERVICES GP	安东油田服务集团	3337 HK	香港交易所	中国	36,000	25,099.27	0.02

271	Chu Kong Petroleum and Natural Gas Steel Pipe Holdings Limited	珠江石油天然气钢管控股有限公司	1938 HK	香港交易所	中国	15,000	25,050.63	0.02
272	HONGHUA GROUP	宏华集团有限公司	196 HK	香港交易所	中国	41,000	24,929.03	0.02
273	CHIGO HOLDING LTD	志高控股有限公司	449 HK	香港交易所	中国	162,000	24,690.68	0.02
274	Solargiga Energy Holdings Limited	阳光能源控股有限公司	757 HK	香港交易所	中国	39,000	24,661.49	0.02
275	ASIA ENERGY LOGISTICS GROUP	亚洲能源物流集团有限公司	351 HK	香港交易所	中国	250,000	24,321.00	0.02
276	JINGWEI TEXTILE MACHINERY-H	经纬纺织机械股份有限公司	350 HK	香港交易所	中国	8,000	24,256.14	0.02
277	INTERNATIONAL TAIFENG HOLD	国际泰丰控股有限公司	873 HK	香港交易所	中国	12,000	24,126.43	0.02
278	Binhai Investment Company Limited	滨海投资有限公司	8035 HK	香港交易所	中国	76,000	24,029.15	0.02
279	VIVA CHINA HOLDINGS LTD	非凡中国控股有限公司	8032 HK	香港交易所	中国	284,000	23,714.60	0.02
280	YOUYUAN INTERNATIONAL HOLDIN	优源国际控股有限公司	2268 HK	香港交易所	中国	15,000	23,712.98	0.02
281	DAQING DAIRY HOLDINGS LTD	大庆乳业控股有限公司	1007 HK	香港交易所	中国	20,000	23,510.30	0.02
282	DYNASTY FINE WINES GROUP LTD	王朝酒业集团有限公司	828 HK	香港交易所	中国	16,000	23,218.45	0.02
283	China Flooring Holding Company Limited	中国地板控股有限公司	2083 HK	香港交易所	中国	20,000	23,186.02	0.02
284	WINTEAM PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	盈天医药集团有限公司	570 HK	香港交易所	中国	22,000	23,007.67	0.02
285	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港交易所	中国	15,000	22,983.35	0.02
286	L. K. TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	力劲科技集团有限公司	558 HK	香港交易所	中国	12,500	22,800.94	0.02
287	TIANJIN CAPITAL ENVIRON-H	天津创业环保集团股份	1065 HK	香港交易所	中国	14,000	22,586.10	0.02

		有限公司						
288	DAWN RAYS PHARMACEUTICAL HOLD	东瑞制药(控股)有限公司	2348 HK	香港交易所	中国	12,000	21,888.90	0.02
289	LEOCH INTERNATIONAL TECH	理士国际技术有限公司	842 HK	香港交易所	中国	14,000	21,791.62	0.02
290	PAX Global Technology Limited	百富环球科技有限公司	327 HK	香港交易所	中国	16,000	21,791.62	0.02
291	Hilong Holding Limited	海隆控股有限公司	1623 HK	香港交易所	中国	20,000	21,726.76	0.02
292	SHANGHAI PRIME MACHINERY-H	上海集优机械股份有限公司	2345 HK	香港交易所	中国	22,000	21,224.13	0.02
293	TRONY SOLAR HOLDINGS CO LTD	创益太阳能控股有限公司	2468 HK	香港交易所	中国	24,000	21,207.91	0.02
294	Shandong Molong Petroleum Machinery Company Limited	山东墨龙石油机械股份有限公司	568 HK	香港交易所	中国	5,600	21,156.03	0.02
295	XIWANG SUGAR HOLDINGS CO LTD	西王糖业控股有限公司	2088 HK	香港交易所	中国	22,000	20,689.06	0.02
296	DaChan Food (Asia) Ltd.	大成食品(亚洲)有限公司	3999 HK	香港交易所	中国	19,000	20,332.36	0.02
297	SIM Technology Group Ltd.	晨讯科技集团有限公司	2000 HK	香港交易所	中国	32,000	19,716.22	0.02
298	CHONGQING IRON & STEEL CO-H	重庆钢铁股份有限公司	1053 HK	香港交易所	中国	22,000	19,618.94	0.02
299	MINGYUAN MEDICARE DEVELOPME	铭源医疗发展有限公司	233 HK	香港交易所	中国	100,000	18,159.68	0.02
300	HENDERSON INVESTMENT LTD	恒基兆业发展有限公司	97 HK	香港交易所	中国	31,000	14,325.07	0.01
301	SMI CORP LTD	星美国际集团有限公司	198 HK	香港交易所	中国	72,000	12,783.12	0.01
302	CHINA COMMUNICATION TELECOM	神通电信服务有限公司	8206 HK	香港交易所	中国	16,000	11,933.50	0.01

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

8.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金报告期末未持有积极投资。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	493 HK	931,672.47	0.87
2	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	910,878.79	0.85
3	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	860,763.61	0.80
4	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	761,795.18	0.71
5	China Yurun Food Group Limited	1068 HK	695,833.64	0.65
6	COSCO PACIFIC LTD	1199 HK	690,562.58	0.64
7	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1818 HK	675,891.23	0.63
8	CHINA RESOURCES CEMENT	1313 HK	661,947.25	0.62
9	PARKSON RETAIL GROUP LTD	3368 HK	626,737.14	0.58
10	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	624,660.40	0.58
11	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	3983 HK	618,581.50	0.58
12	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	148 HK	590,790.63	0.55
13	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	561,226.56	0.52
14	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	691 HK	546,139.66	0.51
15	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	3308 HK	540,149.15	0.50
16	NINE DRAGONS PAPER (HOLDINGS) LIMITED	2689 HK	529,927.42	0.49
17	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	363 HK	525,615.01	0.49
18	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	516,156.00	0.48
19	RENHE COMMERCIAL HOLDINGS	1387 HK	504,197.85	0.47
20	SOHO CHINA LTD	410 HK	501,382.82	0.47

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	770,377.52	0.72
2	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	632,048.80	0.59
3	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	220 HK	112,151.33	0.10
4	MAANSHAN IRON & STEEL-H	323 HK	92,095.00	0.09
5	CHINA NATIONAL MATERIALS - H	1893 HK	82,934.40	0.08
6	HOPEWELL HIGHWAY INFRASTRUCT	737 HK	80,843.92	0.08
7	Mingfa Group (International) Company	846 HK	42,771.12	0.04

	Limited			
8	Truly International Holdings Ltd.	732 HK	35,468.80	0.03
9	Zhengzhou China Resources Gas Company Limited	3928 HK	25,976.78	0.02
10	SINO PROSPER STATE GOLD RESO	766 HK	13,317.10	0.01

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	49,028,972.62
卖出收入（成交）总额	1,887,984.77

注：买入成本和卖出收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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、处罚的情形。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	11,095.56
4	应收利息	61,033.56
5	应收申购款	19,282.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,412.08

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有积极投资。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,602	23,436.63	25,758,312.52	23.88%	82,097,072.43	76.12%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华泰证券股份有限公司	2,100,583.00	55.72%
2	郑志坤	419,000.00	11.12%
3	沈皓	250,000.00	6.63%
4	熊正升	218,000.00	5.78%
5	郑凯鹏	152,000.00	4.03%
6	梁淑华	124,300.00	3.30%

7	竺方华	90,500.00	2.40%
8	李海莲	60,000.00	1.59%
9	穆丽蓉	50,019.00	1.33%
10	程杰	43,000.00	1.14%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,569,722.67	1.4554%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月26日）基金份额总额	299,844,354.08
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	1,830,993.26
减：本报告期基金总赎回份额	193,819,962.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	107,855,384.95

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2011年8月16日，基金管理人发布公告，聘任朱运东为公司副总经理。

2011年1月21日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格(证监许可[2011]116号)，张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金基金合同生效日为 2011 年 9 月 26 日，聘请的事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 60,800.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
First Shanghai Securities Ltd.	36,530,941.43	71.75%	43,837.12	71.78%	-
Nomura (Hong Kong) Limited	14,085,682.03	27.66%	16,902.87	27.68%	-
CITIC Securities International Company Limited	154,412.18	0.30%	154.41	0.25%	-
UBS Securities Asia Limited	145,921.78	0.29%	175.1	0.29%	-
China Construction Bank International Securities Limited	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
First Shanghai Securities Ltd.	-	-
Nomura (Hong Kong) Limited	-	-
CITIC Securities International Company Limited	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-
China Construction Bank International Securities Limited	-	-

国泰君安	1,096,300,000.00	95.64%
东方证券	50,000,000.00	4.36%
华泰证券	-	-

1、本基金本报告期内新增 8 家券商：First Shanghai Securities Ltd.、Nomura (Hong Kong) Limited、CITIC Securities International Company Limited、UBS Securities Asia Limited、China Construction Bank International Securities Limited、国泰君安股份有限公司、东方证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司。

2、券商选择标准和程序：

为保障公司境外证券投资的顺利开展，规范券商选择及交易量分配标准与原则，基金管理人明确了券商选择、考核及交易量的分配等流程。

A. 券商的选择。券商的交易执行能力、研究实力和提供的研究服务、IPO 的支持等是选择券商以及分配交易量最主要的原则和标准，包括以下几个方面：

(a) 交易执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响等。

(b) 研究机构的实力和水平。主要是指券商能否所提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确。

(c) 提供研究服务的质量。主要指券商承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座。

(d) IPO 的支持。是指券商是否有充足的 IPO 资源，是否能够在 IPO 项目上给予一定的支持。

国际业务部根据上述标准对境外券商进行遴选，筛选出符合条件的券商开立交易账户。

B. 券商交易量分仓标准

公司在券商的交易量分配上主要采取如下标准：

(a) IPO 的支持。基金经理在每月初根据券商在 IPO 上的支持以及未来 IPO 项目的分配对该部分交易量进行分配。

(b) 研究上的支持。每季度由投资人员（基金经理、基金经理助理、研究员）对各券商的研究支持进行打分根据各券商的得分进行交易量的分配。

(c) 交易执行能力。该部分交易量由交易部根据券商的执行能力进行分配，每季度一次。

(d) 成交数据的准确与及时。由运作保障部根据券商成交数据的准确性与及时性进行分配，每季度一次。

国际业务部统计上述分配结果，拟定交易量分仓比例，单一券商的分配比例不能超过 30%，如统计结果超过了该上限，由国际业务部进行调整。分仓结果报备投决会后，由交易部实施。

交易券商的评价和交易量的分配比例于每季度末最后一周进行，新的分配标准在下季度进行实施。

3、基金债券回购交易与南方绩优成长基金共用交易单元。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 31 日
2	南方基金关于旗下基金 2011 年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 31 日
3	关于南方中国中小盘股票指数基金 2012 年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 30 日
4	南方基金关于旗下部分基金参加东莞银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 29 日

5	南方基金关于旗下部分基金参加汉口银行电子渠道申购费率与定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 29 日
6	南方基金关于旗下部分基金增加中信万通证券为代销机构并开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 22 日
7	关于南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）2011 年 12 月 26 日、27 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 21 日
8	南方基金关于增加红塔证券为南方中国及南方 380 基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 11 月 1 日
9	关于南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）参与部分代销机构电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 11 月 1 日
10	关于南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）参与部分代销机构开展的定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 11 月 1 日
11	南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 11 月 1 日
12	南方基金关于增加深圳发展银行为南方中国及南方 380 基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 10 月 27 日
13	南方基金关于旗下南方积配等 6 只开放式证券投资基金增加广州银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 10 月 27 日
14	南方基金关于旗下南方积配等 6 只基金参加广州银行网上银行申购及定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 10 月 27 日
15	关于南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）开放申购、赎回及定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 10 月 27 日
16	南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 10 月 27 日
17	南方基金管理有限公司关于自有资金投资的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 9 月 17 日
18	南方基金关于增加华夏银行为南方 380 及南方中国基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 9 月 5 日
19	南方基金关于开展农行卡网上直销费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 9 月 2 日
20	南方基金关于增加广发银行为南方 380 及南方中国基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 9 月 2 日
21	南方基金关于开展工行卡网上直销费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 9 月 2 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)的文件。
- 2、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同。
- 3、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华 1 路 6 号免税商务大厦 31 至 33 楼

12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>