

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  
送出日期:2013年3月29日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员在报告期间内没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、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，并由董事长签章。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2013年3月20日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等內容，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当仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

基金简称	南方小康ETF联接		
基金主代码	202021		
前端交易代码	202021		
后端交易代码	202022		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010年8月27日		
基金管理人	南方基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	314,819,711.35份		
基金合同终止日期	不定期		
注:本基金在交易所行情系统净值揭示其他信息披露场合下,可简称为“南方小康”。			
2.1 基金基本情况			
基金名称	中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金		
基金主代码	510160		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2010年8月27日		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2010年11月1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		
注:本基金在交易所行情系统净值揭示其他信息披露场合下,可简称为“小康ETF”。			
2.2 基金产品说明			
投资目标	通过投资于小康ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。		
投资策略	本基金完全被动指数基金,以小康ETF为主要投资标的,方便特定的客户群体通过本基金投资小康ETF,本基金将参与小康ETF的投资。为实现投资目标,本基金将不以低于基准资产净值90%的资产投资于小康ETF,其余资产投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、债券、股指期货以及中国证监会允许的其他金融工具,其目的主要是为了降低交易成本,提高运作效率。本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。		
业绩比较基准	中证南方小康产业指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%		
风险收益特征	本基金属股票型基金,风险水平高于混合型基金、债券基金与货币市场基金,风险收益特征类似于股票型基金。		
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 中国工商银行股份有限公司		
信息披露负责人姓名	鲍文革 赵会军		
联系电话	0755-82763888 010-66105799		
电子邮箱	manager@southernfund.com custody@icbc.com.cn		
客户服务电话	400-889-8899 95588		
传真	0755-82763889 010-66105798		
2.4 信息披露方式			
登载年度报告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8月27日(基金合同生效日)-2010年12月31日		
本期已实现收益	-3,218,557.01 -26,633,284.78 27,044,915.39		
本期利润	10,861,978.00 -71,868,745.86 23,341,383.85		
加权平均基金份额本期利润	0.0333 -0.1816 0.0348		
本期基金份额净值增长率	4.60% -23.66% -1.80%		
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	-0.2311 -0.2649 -0.0180		
期末基金资产净值	242,072,554.56 247,106,396.46 454,904,962.92		
期末基金份额净值	0.7689 0.7351 0.9820		
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.所列基金绩效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将低于所列数据。			
3.2 基金价值表现			
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	份额单位:份 份额净值 增长率 增长率为 率(%) 基 准 率 差 率(%) ①-③ ②-④	过去三个月 8.86% 1.09% 9.37% 1.12% -0.51% -0.03% 过去六个月 2.86% 1.09% 3.03% 1.11% -0.17% -0.02% 过去一年 4.60% 1.19% 4.26% 1.21% 0.34% -0.02% 自基金合同生效起至今 -21.58% 1.22% -11.44% 1.29% -10.14% -0.07%	4.60% -23.66% -1.80%
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率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			
3.2.4 期末持有的基金份额			
3.3 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 总额 备注	2012 - - - - 2011 0.2000 5,207,320.99 2,238,678.86 7,445,999.85 2010 - - - - 合计 0.2000 5,207,320.99 2,238,678.86 7,445,999.85		
§ 4 管理人报告			
4.1 基金管理人及其基金经理情况			
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、厦门国际信托有限公司、西部信托公司共同发起成立。2006年,经中国证监会证监基字[2000]78号文批准进行扩股扩股,注册资本增加到1亿元人民币。2008年,经中国证监会证监基字[2008]1号文批准进行增资扩股,注册资本增加到2亿元人民币。2013年,经中国证监会证监基字[2013]1号文批准进行增资扩股,注册资本增加到3亿元人民币。公司目前持有49%股权转让给深圳前海投资控股有限公司,3%股权转让给360易富基金销售有限公司,5%股权转让给华泰证券股份有限公司,45%、深圳控股有限公司30%、深圳市国信投资有限公司30%、国信国际信托有限公司5%及兴证证券有限公司10%。公司总部、上海、合肥等设有分公司,在各省设有子公司——南方基金管理有限公司。			
4.1.2 基金经理或基金经理助理简介			
姓名 职务 任职本基金的基金经理(助理)期限 证券从业年限 说明	杨德龙 本基金基金经理 2010年8月27日 6 北京大学经济学硕士、清华大学工学学士,具有基金从业资格。2006年加入南方基金,任研究部高级研究员、高级行业研究员,2010年8月至今,任小康ETF和南方基金基金经理,2011年9月任南方基金旗下南方300ETF及联接基金基金经理。 柯晓 本基金基金经理 2010年8月27日 15 美国纽约大学工商管理硕士,具有基金从业资格,曾先后担任麦基林美国金融公司高级经理,2006年加入南方基金,现任公司助理总裁,担任招商证券首肯产品策略部、2006年加入南方基金,任首席产品设计师,2010年8月至今,任小康ETF和南方基金基金经理。 罗文杰 本基金的基金经理助理 2011年2月28日 7 2008年应聘南方基金,现任公司量化投资部经理,2011年8月至今,任南方300深成指ETF及其联接基金基金经理助理。		
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,“离任日期”为确定的聘任日期或解聘日期,除首次基金经理外,“离任日期”指该基金经理对确定的聘任日期或解聘日期的解聘日期。 2.4 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明			
本基金管理人及其管理基金的运作符合法律法规及基金合同的规定,不存在损害基金持有人利益的行为。			
3.4 本报告期内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 总额 备注	2012 - - - - 2011 0.2000 5,207,320.99 2,238,678.86 7,445,999.85 2010 - - - - 合计 0.2000 5,207,320.99 2,238,678.86 7,445,999.85		
§ 5 管理人报告			
5.1 报告期内基金运作揭示			
5.1.1 基金管理人及基金经理情况			
5.1.2 报告期内本基金运作合规性情况			
5.2 报告期内基金的利润分配情况			
5.3 报告期内管理人对本基金年度报告编制和披露的说明			
5.4 报告期内基金投资组合报告			
5.5 报告期内基金业绩表现			
5.6 报告期内基金净值表现			
5.7 报告期内基金利润分配情况			
5.8 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.9 报告期内基金收益分配情况			
5.10 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.11 报告期内基金投资组合报告			
5.12 报告期内基金的业绩表现			
5.13 报告期内基金净值表现			
5.14 报告期内基金利润分配情况			
5.15 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.16 报告期内基金收益分配情况			
5.17 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.18 报告期内基金投资组合报告			
5.19 报告期内基金的业绩表现			
5.20 报告期内基金净值表现			
5.21 报告期内基金利润分配情况			
5.22 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.23 报告期内基金收益分配情况			
5.24 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.25 报告期内基金投资组合报告			
5.26 报告期内基金的业绩表现			
5.27 报告期内基金净值表现			
5.28 报告期内基金利润分配情况			
5.29 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.30 报告期内基金收益分配情况			
5.31 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.32 报告期内基金投资组合报告			
5.33 报告期内基金的业绩表现			
5.34 报告期内基金净值表现			
5.35 报告期内基金利润分配情况			
5.36 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.37 报告期内基金收益分配情况			
5.38 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.39 报告期内基金投资组合报告			
5.40 报告期内基金的业绩表现			
5.41 报告期内基金净值表现			
5.42 报告期内基金利润分配情况			
5.43 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.44 报告期内基金收益分配情况			
5.45 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.46 报告期内基金投资组合报告			
5.47 报告期内基金的业绩表现			
5.48 报告期内基金净值表现			
5.49 报告期内基金利润分配情况			
5.50 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.51 报告期内基金收益分配情况			
5.52 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.53 报告期内基金投资组合报告			
5.54 报告期内基金的业绩表现			
5.55 报告期内基金净值表现			
5.56 报告期内基金利润分配情况			
5.57 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.58 报告期内基金收益分配情况			
5.59 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.60 报告期内基金投资组合报告			
5.61 报告期内基金的业绩表现			
5.62 报告期内基金净值表现			
5.63 报告期内基金利润分配情况			
5.64 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.65 报告期内基金收益分配情况			
5.66 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.67 报告期内基金投资组合报告			
5.68 报告期内基金的业绩表现			
5.69 报告期内基金净值表现			
5.70 报告期内基金利润分配情况			
5.71 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.72 报告期内基金收益分配情况			
5.73 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.74 报告期内基金投资组合报告			
5.75 报告期内基金的业绩表现			
5.76 报告期内基金净值表现			
5.77 报告期内基金利润分配情况			
5.78 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.79 报告期内基金收益分配情况			
5.80 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.81 报告期内基金投资组合报告			
5.82 报告期内基金的业绩表现			
5.83 报告期内基金净值表现			
5.84 报告期内基金利润分配情况			
5.85 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.86 报告期内基金收益分配情况			
5.87 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.88 报告期内基金投资组合报告			
5.89 报告期内基金的业绩表现			
5.90 报告期内基金净值表现			
5.91 报告期内基金利润分配情况			
5.92 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.93 报告期内基金收益分配情况			
5.94 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.95 报告期内基金投资组合报告			
5.96 报告期内基金的业绩表现			
5.97 报告期内基金净值表现			
5.98 报告期内基金利润分配情况			
5.99 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.10 报告期内基金收益分配情况			
5.11 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.12 报告期内基金投资组合报告			
5.13 报告期内基金的业绩表现			
5.14 报告期内基金净值表现			
5.15 报告期内基金利润分配情况			
5.16 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.17 报告期内基金收益分配情况			
5.18 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.19 报告期内基金投资组合报告			
5.20 报告期内基金的业绩表现			
5.21 报告期内基金净值表现			
5.22 报告期内基金利润分配情况			
5.23 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.24 报告期内基金收益分配情况			
5.25 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.26 报告期内基金投资组合报告			
5.27 报告期内基金的业绩表现			
5.28 报告期内基金净值表现			
5.29 报告期内基金利润分配情况			
5.30 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.31 报告期内基金收益分配情况			
5.32 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.33 报告期内基金投资组合报告			
5.34 报告期内基金的业绩表现			
5.35 报告期内基金净值表现			
5.36 报告期内基金利润分配情况			
5.37 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.38 报告期内基金收益分配情况			
5.39 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.40 报告期内基金投资组合报告			
5.41 报告期内基金的业绩表现			
5.42 报告期内基金净值表现			
5.43 报告期内基金利润分配情况			
5.44 报告期内基金费用计提及支付情况			
5.45 报告期内基金收益分配情况			
5.46 报告期内基金持有的证券投资基金情况			
5.47 报告期内基金投资组合报告			
5.48 报告期内基金的业绩表现			
5.49 报告期内基金净值表现			
5.50 报告期内基金利润分配情况			
5.51 报告期内基金费用计提及支付情况			