南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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8月27日

§1 重要提示

1.1 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

开元证券投资基金份额持有人大会于2013年1月4日审议通过了《关于开元证券投资基金转型有关事项的议案》,同意将开元证券投资基金变更为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金。基金管理人已收到中国证券监督管理委员会《关于核准开元证券投资基金基金份额持有人大会有关转型基金运作方式议案的批复》(证监许可〔2013〕61号)。南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同自2013年2月18日生效。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

南方开元证券投资基金本报告期自2013年1月1日起至2月17日止,南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金本报告期自2013年2月18日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	南方开元封闭
基金主代码	184688
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1998年3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	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1998年4月7日

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露略各下,可简称为"基金开元"。

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	南方开元沪深300ETF
基金主代码	159925
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2013年2月18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	2,313,199,451.00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	2013年4月11日

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露略各下,可简称为"南方300"。

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金坚持投资于经济增长中的领先行业,以及行业内相对价值较高的股票,并根据不同股票相对价值的变化动态调整组合,力求使基金净值平稳、持续增长。

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用指数复制法,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。 基金管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踪标的指数。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数:沪深300指数。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	聂会军
	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)	
	转型前	转型后
本期已实现收益	-269,163,704.51	-151,505,589.24
本期利润	104,699,245.78	-439,513,879.42
加权平均基金份额本期利润	0.0523	-0.1841
本期基金份额净值增长率	5.98%	-19.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1251	-0.2914
期末基金资产净值	1,853,841,542.50	1,964,360,207.82
期末基金份额净值	0.9269	0.8492

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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或赎回基金份额的费用,计入费用后实际收益水平低于所列数字。

3.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(净期末余额)。本期末,本期发生数)。

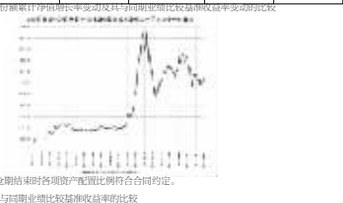
4.本基金已于2013年3月11日对原开元证券投资基金进行了折算,基金折算比例为1:0.876726296。

3.2 基金净值表现(转型前)

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①②	份额净值增长率标准差③	业绩比较基准收益率④	业绩比较基准收益率标准差⑤	①-④	②-⑤
过去一个月	8.09%	2.41%	-	-	-	-
过去三个月	14.36%	2.01%	-	-	-	-
过去六个月	9.58%	2.19%	-	-	-	-
过去一年	4.18%	2.07%	-	-	-	-
过去三年	-7.96%	2.37%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	523.87%	3.51%	-	-	-	-

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

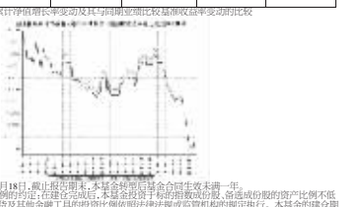


注:本基金建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 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

转型后					
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
过去一个月	-14.73%	1.86%	-15.57%	1.86%	0.84%	0.00%
过去三个月	-11.86%	1.44%	-11.80%	1.45%	-0.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-19.68%	1.43%	-19.61%	1.54%	-0.07%	-0.11%

3.2.2 自基金转型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



注:1.本基金转型日期为2013年2月18日,截止报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。

2.本基金自转型日起至报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。

3.本基金投资于股票的资产比例为基金资产的80%-95%,其中,投资于股票的外币资产比例为基金资产的0%-95%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简况

4.1.1 基金管理人及其投资管理业务概况

南方基金管理公司是经中国证监会批准设立的全国性基金管理公司之一,于1998年3月5日在北京注册成立,注册资本1亿元人民币。2005年,经证监会批准,公司注册资本增加至2亿元人民币。2006年,经证监会批准,公司注册资本增加至3亿元人民币。2010年,经证监会批准,公司注册资本增加至3.2亿元人民币。公司现有股东为:中国证券金融股份有限公司持有股份数3,000,000,000股,持股比例为93.75%;中国证券登记结算有限公司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、长沙、成都、广州、深圳、珠海、厦门、青岛、南京、杭州、重庆、天津、武汉、佛山、东莞、宁波、合肥、济南、郑州、沈阳、大连、昆明、乌鲁木齐共22个分公司,并在香港设有全资子公司——南方东英资产管理有限公司。公司主要业务为证券投资基金管理、发起设立基金、经中国证监会核准的其他业务。

公司秉承"诚实守信、勤勉尽责"的企业文化理念,以"为投资者创造财富,为员工搭建事业平台,为社会贡献力量"为己任,以"成为一个长期稳定盈利的、具有国际竞争力的、受人尊敬的证券投资基金管理公司"为目标,以"为基金持有人利益最大化"为宗旨,以"为投资者提供多样化的证券投资基金产品和高质量的投资管理服务"为己任,以"为国民财富的保值增值"为己任,以"为证券市场的长期稳定发展"为己任,以"为证券市场的规范发展"为己任,以"为证券市场的繁荣发展"为己任,以"为证券市场的和谐发展"为己任,以"为证券市场的国际化发展"为己任,以"为证券市场的人才发展"为己任,以"为证券市场的文化发展"为己任,以"为证券市场的科技发展"为己任,以"为证券市场的信息发展"为己任,以"为证券市场的法制发展"为己任,以"为证券市场的诚信