

基金管理人:南方基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
送出日期:2013年8月27日

## § 1 重要提示及目录

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。本基金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。

基金托管人中国建设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、资产配置情况、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摘要。

本年度报告摘要概要半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	南方上证380ETF联接
基金主代码	202025
交易代码	202025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月20日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期基金份额总额	141,286,449.38份
基金合同存续期	不定期

注:本基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息披露场合下,可简称为“南方380”。

## 2.1.1 基金基本情况

基金名称	上证380交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510290
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年9月16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	中国建设银行股份有限公司

注:上证380交易型开放式指数证券投资基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息披露场合下,可简称为“380ETF”。

## 2.2 基金产品说明

投资目标 通过投资于380ETF，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 本基金完全被动式指数基金，以380ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资380ETF。本基金并不参与380ETF的管理。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为上证380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，预期风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，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。

2.3 目标基金产品说明

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。

380ETF 为完全被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基本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对基金跟踪标的指数可能带来影响并造成某些特殊情况下偏离度可能大于5%时，本基金将根据调整成份股的指定期，基金经理人可以对投资组合管理进行适当调整和调整，从而使得投资组合紧密跟踪标的指数。

380ETF 可投资股指期货和其他中国证监会允许的衍生金融产品。380ETF 投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下对基金的负面影响，从而达到有效跟踪标的指数的目的。

380ETF 可投资股票期权和其他中国证监会允许的衍生金融产品。380ETF 投资股票期权将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下对基金的负面影响，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.4 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 中国建设银行股份有限公司

姓名 韩文革 田青

信息披露负责人 联系电话 0755-82763888 010-67595096

电子邮箱 manager@nffund.com tianqiao1@zjcb.com

客户服务电话 400-889-8899 010-67595096

传真 0755-82763889 010-66275853

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 <http://www.nffund.com>

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

金额单位: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)

本期已实现收益 -1,45,102.73

本期利润 -3,154,260.38

加权平均基金份额本期利润 -0.0215

本期基金份额净值增长率 -3.26%

报告期末基金份额净值 110,749,795.29

基金份额本期净 1.0739

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(即期末利润,不是当期利润)。

3.所列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 份额净值增 业绩比较基 业绩比较基 ①-③ ②-④

长率(%) 率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去一个月 -14.23% 1.60% -14.82% 1.63% 0.59% -0.03%

过去三个月 -8.28% 1.28% -9.04% 1.30% 0.76% -0.02%

过去六个月 -3.26% 1.27% -3.84% 1.28% 0.58% -0.01%

过去一年 -8.55% 1.27% -8.86% 1.28% 0.31% -0.01%

自基金合同生 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

效起至今 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

注:本基金业绩比较基准为:上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。业绩比较基准在每个估值日实现再平衡。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金业绩比较基准为:上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。业绩比较基准在每个估值日实现再平衡。

3.2.3 基金合同生效以来基金份额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

阶段 份额净值增 份额净值增 业绩比较基 业绩比较基 ①-③ ②-④

长率(%) 率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去一个月 -14.23% 1.60% -14.82% 1.63% 0.59% -0.03%

过去三个月 -8.28% 1.28% -9.04% 1.30% 0.76% -0.02%

过去六个月 -3.26% 1.27% -3.84% 1.28% 0.58% -0.01%

过去一年 -8.55% 1.27% -8.86% 1.28% 0.31% -0.01%

自基金合同生 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

效起至今 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

注:本基金业绩比较基准为:上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。业绩比较基准在每个估值日实现再平衡。

3.2.4 基金合同生效以来基金净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 份额净值增 份额净值增 业绩比较基 业绩比较基 ①-③ ②-④

长率(%) 率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去一个月 -14.23% 1.60% -14.82% 1.63% 0.59% -0.03%

过去三个月 -8.28% 1.28% -9.04% 1.30% 0.76% -0.02%

过去六个月 -3.26% 1.27% -3.84% 1.28% 0.58% -0.01%

过去一年 -8.55% 1.27% -8.86% 1.28% 0.31% -0.01%

自基金合同生 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

效起至今 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

注:本基金业绩比较基准为:上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。业绩比较基准在每个估值日实现再平衡。

3.2.5 基金合同生效以来基金净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 份额净值增 份额净值增 业绩比较基 业绩比较基 ①-③ ②-④

长率(%) 率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去一个月 -14.23% 1.60% -14.82% 1.63% 0.59% -0.03%

过去三个月 -8.28% 1.28% -9.04% 1.30% 0.76% -0.02%

过去六个月 -3.26% 1.27% -3.84% 1.28% 0.58% -0.01%

过去一年 -8.55% 1.27% -8.86% 1.28% 0.31% -0.01%

自基金合同生 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

效起至今 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

注:本基金业绩比较基准为:上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。业绩比较基准在每个估值日实现再平衡。

3.2.6 基金合同生效以来基金净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 份额净值增 份额净值增 业绩比较基 业绩比较基 ①-③ ②-④

长率(%) 率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去一个月 -14.23% 1.60% -14.82% 1.63% 0.59% -0.03%

过去三个月 -8.28% 1.28% -9.04% 1.30% 0.76% -0.02%

过去六个月 -3.26% 1.27% -3.84% 1.28% 0.58% -0.01%

过去一年 -8.55% 1.27% -8.86% 1.28% 0.31% -0.01%

自基金合同生 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

效起至今 -21.61% 1.30% -21.85% 1.37% 0.24% -0.07%

注:本基金业绩比较基准为:上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。业绩比较基准在每个估值日实现再平衡。

3.2.7 基金合同生效以来基金净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 份额净值增 份额净值增 业绩比较基 业绩比较基 ①-③ ②-④

长率(%) 率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去一个月 -14.23% 1.60% -14.82% 1.63% 0.59% -0.03%

过去三个月 -8.28% 1.28% -9.04% 1.30% 0.76% -0.02%

过去六个月 -3.26% 1.27% -3.84% 1.28% 0.58% -0.01%

过去一年 -8.55% 1.27% -8.86% 1.28% 0.31% -0.01%