

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、完整性承担责任。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、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。

本半年度报告摘要概要披露半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告期自2013年01月01日起至2013年06月30日止。

§ 2 基金简介

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

基金简称 南方小康ETF

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 770,057,409.00份

基金合同存续期 不定期

基金份额上市的证券交易所 上海证券交易所

上市日期 2010-11-01

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 密踪跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的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，如期权、权证以及其他与标的指数成分股挂钩的金融产品。本基金将通过科学的风险管理流程，精确的数量化计算，精选求精的工具态度，恪守风险管理的投资原则，实现对标的指数的有效追踪，为持有人提供与之相近的收益。

本基金将根据市场情况适时地运用风险管理的原则，采取保值为目的，利用期货市场的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效控制仓位的指针的目的。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为标的指数，本基金标的指数为中国南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金的净值增长率。

如果基金份额持有人希望变更或停止享受本基金的基金份额持有人权利，可以向基金管理人提出书面申请，基金管理人将根据相关法律法规的规定办理。

本基金基金份额净值以人民币为计价货币，基金份额净值的计算方法为每份基金份额的净资产除以该类基金份额的总份额。

本基金基金份额净值每日至少公告一次，如遇特殊情况，基金管理人可以临时决定暂停或延迟披露。

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险与收益高于货币市场基金、债券基金和指数型基金，但低于完全复制跟踪标的指数的表现，具有较高的预期收益率及较大的风险收益特征。

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 谭文甫 赵会荣

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

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

基金半年度报告备置地点 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

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 -1,910,105.74

本期利润 -41,884,411.79

加权平均基金份额本期利润 -0.0518

本期基金份额净值增长率 -15.85%

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 -0.1131

期末基金份额净值 222,432,011.92

期末基金份额净值增长率 0.2889

注：1.本期已实现收益指基金本期收入，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.期末可供分配基金份额是指期末可供分配利润减去未分配利润中未实现部分的孰低数，即期末余额，不包括当期损益。
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。

3.2 基金净值表现

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(%) 份额净值增长率标准差 (%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -15.08% 1.59% -16.05% 1.63% 0.97% -0.04%

过去三个月 -13.53% 1.29% -14.71% 1.33% 1.18% -0.04%

过去六个月 -15.85% 1.31% -16.84% 1.34% 0.99% -0.03%

过去一年 -13.19% 1.23% -14.23% 1.26% 1.04% -0.03%

自基点合同生效日至至今 -28.12% 1.30% -27.05% 1.35% -0.07% -0.05%

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与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

基点份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势图

注：基金合同关于基金投资比例的约定：本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。本基金的建仓期为三月至一年，建仓期结束时各份额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情况

4.1.1 基金管理人

南方基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[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、广州证券公司共同发起设立。2000年，经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准，进行股份制改造，注册资本变更为亿元人民币。2005年，经中国证监会证监基金字[2005]145号文批准，进行股份制改造，注册资本变更为亿元人民币。2010年，经中国证监会[2010]107号文批准兼深圳市机构有限公司，将持有的%股权转让给深圳证券交易所，成为深圳证券交易所的股东。华泰证券股份有限公司占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、合肥等地设有分公司，在深圳设有子公司——南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末，公司总资产超过亿元，旗下管理资产规模超过亿元，旗下拥有只封闭式基金，多个全国社保、企业年金和货币基金投资组合。

4.1.2 基金经理、基金经理助理简介

姓名 职务 在任本基金的基金经理(助理) 从事业年限 说明

杨德龙 基金经理 2010年8月27日 2013年4月21日 任职日期 离任日期

北京大学经济学硕士，清华

大学EMBA，具有基金从业资格，2010年加入南方基金，担任研究部高级研究员，首席策略分析师，2010年8月至2014年4月，任小康ETF及南方小康基金经理；

2011年9月至今，任南方产业基金基金经理；2012年1月至今，任南方新兴产业基金基金经理；2013年3月至今，任南方上证公用事业行业基金经理。

柯晓 基金经理 2010年8月27日 2013年4月21日 任职日期 离任日期

美国纽约大学经济学硕士，

美国加州大学洛杉矶分校硕

士，具有基金从业资格，曾先

后担任美国美林证券公司助

理员，现任职于南方基金，担任研究部高级研究员，首席策略分析师，2010年8月至2014年4月，任小康

ETF及南方小康基金经理；

2011年9月至今，任南方产业基金基金经理；2012年1月至今，任南方新兴产业基金基金经理；2013年5月至今，任南方上证公用事业行业基金经理。

罗文杰 基金经理助理 2011年2月28日 2013年4月21日 任职日期 离任日期

美国加州大学数学金融硕

士，美国加州大学洛杉矶分校

硕土，具有基金从业资格，

曾先后任职于美国

OpenLink Financial公司，摩根

士利斯利公司，从事量化分析

工作。2008年9月至2010年

年5月至今，任南方基金数

据部基金经理助理；2010年5

月至今，任南方500ETF基

金经理；2013年5月至今，任

南方500ETP基金经理；2013

年5月至今，任南方深证成指

500ETF基金经理；2013年5

月至今，任南方300基金经

理；2013年5月至今，任南方

500ETF基金经理；2013年5

月至今，任南方500基金经

理；2013年5月至今，任南方

500ETF基金经理；2013年5