

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

基金管理人和基金托管人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、准确性及完整性承担个别及连带的法律责任。本基金半年度报告已经三分之二以上独立董事签章同意，且报中国证监会备案。基金合同由基金管理人和基金托管人订立，对双方具有同等法律效力。基金财产由基金管理人管理，基金托管人保管，由基金管理人代表基金份额的持有人利益，根据基金合同运用基金财产，遵照法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行投资运作。基金财产独立于基金管理人、基金托管人、基金份额持有人和基金管理人的固有财产。基金管理人不以基金财产为自身谋取不当利益。

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。

本报告期财务报告摘要半年度报告正文，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

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 购买开放式

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

中国工商银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 286,117,742.03份

基金合同终止日 不定期

基金名称在交易所行情系统净值揭示及其他信息披露场合，可简称为“南方小康”。

2.1 目标基金基本情况

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

基金份额净值的证券交易所 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及其他信息披露场合,可简称为“南方小康”。

2.2 基金产品说明

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。

本基金为完全被动式指数基金，以小康ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资小康ETF。本基金将不会低于基金净资产90%的投资资金于小康ETF，其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更有效地跟踪标的指数。

在正常市场情况下，本基金单位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±0.3%，年跟踪误差不超过4%，因指数组合规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

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%

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票相似的风险特征。

2.3 目标基金情况

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金为完全被动式指数基金，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。

本基金可投资于指数期货和其他中国经济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份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证南方小康产业指数，简称小康指数。

如果指数组合单位变更或停止中证南方小康产业指数的编制，发布或授权，或由中证南方小康产业指数由其他指数组合，或由于指数组合的重大变更等事项导致基金管理人认为中证南方小康产业指数不能继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的指数，业绩比较基准随之变更。

本基金属股票基金，风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全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。

3.1 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 -3,145,165.50

本期利润 -33,248,601.48

加权平均基金份额本期利润 -0.1105

本期基金份额净值增长率 -15.14%

本期可供基金份额利润 -0.3475

期末基金份额净值 186,686,718.84

期末基金份额净值 0.6525

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入，投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益、不含期初至报告期开始日按最新收盘价计算的期末至报告期开始日的差额。2.期末可供基金份额利润中未分摊利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，即为本期可供基金份额利润。3.前述基金利润指标不包括持有人认购或交易基金的费用，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 -14.35% 1.51% -15.30% 1.55% 0.95% -0.04%

过去三个月 -12.90% 1.22% -14.00% 1.26% 1.10% -0.04%

过去六个月 -15.14% 1.24% -16.02% 1.27% 0.88% -0.03%

过去一年 -12.71% 1.16% -13.48% 1.19% 0.77% -0.03%

自基金合同生效以来 -33.46% 1.22% -25.63% 1.28% -7.83% -0.06%

起至今

3.2.2 基金份额生效以来基金份额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约定。

4 管理人报告

4.1 基金经理及其基金经理助理的情况

南方基金管理有限公司根据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、广西壮族自治区投资公司联合发起设立。2006年，经中国证监会证监基字[2000]78号文批准进行股权变更，更名为南方基金管理有限公司。2005年，经中国证监会证监基字[2005]103号文批准，公司名称变更为南方基金管理有限公司。2010年5月，经中国证监会证监基字[2010]107号文批准，公司名称变更为南方基金管理有限公司。公司股东变更为：深圳市投资控股有限公司占股30%、深圳市国际信托有限公司占股15%、兴业证券股份有限公司占股10%。公司在北京、上海、合肥等地设有分公司，在香港设有子公司—南方东英资产管理有限公司。

本公司报告期末，公司管理资产规模超过2,000亿元，旗下管理42只开放式基金，1只封闭式基金，多个全国性理财产品。

4.2 基金经理

基金经理姓名:杨德龙

基金经理助理姓名:柯晓

基金经理助理姓名:罗文杰

基金经理助理姓名:陈军

基金经理助理姓名:王海峰

基金经理助理姓名:王海峰