南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金

【2014】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:2014年8月26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2014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。

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。

本报告期自2014年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	1,995,199,451.00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场合下,可简称为“南方300”。

2.2 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。
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	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-17,418,002.11
本期利润	-114,778,999.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0594
本期基金份额净值增长率	-6.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2916
期末基金资产净值	1,693,915,425.05
期末基金份额净值	0.8490

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。

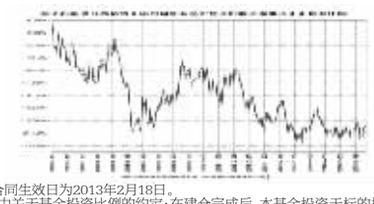
3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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	1.19%	0.77%	0.40%	0.78%	0.79%	-0.01%
过去三个月	1.93%	0.87%	0.88%	0.87%	1.05%	0.00%
过去六个月	-6.25%	1.04%	-7.08%	1.04%	0.83%	0.00%
过去一年	-0.02%	1.17%	-1.61%	1.17%	1.59%	0.00%
自基金合同生效起至今	-19.70%	1.25%	-20.91%	1.28%	1.21%	-0.03%

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:1、本基金合同生效日为2013年2月18日。

2.本基金合同中关于基金投资比例的约定:在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的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情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳,注册资本1.5亿元人民币。股东结构为:华泰证券股份有限公司(45%);深圳市投资控股有限公司(30%);厦门国际信托有限公司(15%);兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近2,800亿元,旗下管理51只开放式基金,1只封闭式基金,多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨德龙	本基金基金经理	2013年4月22日	-	7	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,担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师;2010年8月至2013年4月,任小康ETF及南方小康基金经理;2011年9月至今,任南方上证380ETF及联接基金基金经理;2013年3月至今,任南方策略基金经理;2013年4月至今,任南方300基金经理;2013年4月至今,任南方开元沪深300ETF基金经理。
罗文杰	本基金基金经理	2013年5月17日	-	9	女,美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士,具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国Open Link Financial公司、摩根斯坦利公司,从事量化分析工作,2008年9月加入南方基金,任南方基金数量化投资部基金经理助理;2013年4月至今,任南方500基金经理;2013年4月至今,任南方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,任南方开元沪深300ETF基金经理;2013年5月至今,任南方策略基金经理。

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”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《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》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,其中1次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,3次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,我国经济增长力度有所放缓,但整体保持在平稳状态。同期沪深300指数下跌7.08%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF现金流精算系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本ETF基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

①大额申购赎回带来的成份股权重偏差,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;

②个别长期停牌证券,引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离;

③股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离。

④6月中,我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓,事前我们制定了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生,从实施结果来看,效果良好,跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金上市以来至报告期末年化跟踪误差为0.472%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过2%的投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为0.8490元,报告期内,份额净值增长率为-6.25%,同期业绩基准增长率为-7.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前,中国经济进入增长第二季,主要特征为重工业化时代渐行渐远,经济增速下降,经济增长方式亟待转变,改革转型为政策主旋律。海外方面,基本面较为平稳,美国当前经济活动日渐回升,对美国经济复苏的趋势不必过分怀疑。

我国经济已经连续出现企稳信号,大盘短期内迎来阶段性反弹机会,因此在注意控制风险的同时,可以看好一些中长期前景良好的板块。

本基金为指数基金,作为基金管理人,我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨,实现对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格,借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,本基金的收益分配原则为:当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;在符合基金收益分配条件的前提下,本基金收益分配每年最多12次,基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;本基金收益分配采取现金分红方式;基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金未有分配事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内南方开元沪深300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方开元沪深300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,南方开元沪深300 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	9,845,640.56	4,227,365.16
结算备付金	865,815.93	9,178,139.30
存出保证金	509,887.59	2,021,907.84
交易性金融资产	1,685,716,222.51	1,951,150,759.59
其中:股票投资	1,685,716,222.51	1,950,225,268.95
基金投资	-	-
债券投资	-	925,490.64
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	535,371.54
应收利息	2,447.45	8,485.92
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,696,940,014.04	1,967,122,029.35
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	647,115.28	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	634,869.14	961,133.49
应付托管费	126,973.81	192,226.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	195,556.91	396,457.62
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,420,073.85	1,186,934.94
负债合计	3,024,588.99	2,736,752.74
所有者权益:		
实收基金	2,275,738,117.96	2,474,203,706.13
未分配利润	-581,822,692.91	-509,818,429.52
所有者权益合计	1,693,915,425.05	1,964,385,276.61
负债和所有者权益总计	1,696,940,014.04	1,967,122,029.35

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.8490元,基金份额总额1,995,199,451.00份。

6.2 利润表

会计主体: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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入	-108,831,790.74	-428,969,533.76
1.利息收入	182,440.96	668,853.67
其中:存款利息收入	111,502.62	618,093.53
债券利息收入	769.55	18,455.40
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	70,168.79	32,304.74
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-11,659,646.34	-141,632,563.21
其中:股票投资收益	-26,312,414.55	-161,962,169.87
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-72,081.37	426,559.76
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-3,700,272.00	-
股利收益	18,425,121.58	19,903,046.90
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-97,360,997.06	-288,008,290.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6,411.70	2,465.96
减:二、费用	5,947,208.43	10,544,345.66
1.管理人报酬	4,083,292.34	4,137,194.48
2.托管费	816,658.46	827,438.91
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	577,691.72	4,904,793.31
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	469,565.91	674,918.96
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-114,778,999.17	-439,513,879.42
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-114,778,999.17	-439,513,879.42

注:本基金合同生效日为2013年2月18日,故上年度可比期间从2013年2月18日开始至2013年6月30日止(下同)。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,474,203,706.13	-509,818,429.52	1,964,385,276.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-114,778,999.17	-114,778,999.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-198,465,588.17	42,774,735.78	-155,690,852.39
其中:1.基金申购款	266,901,997.85	-71,063,823.59	195,838,174.26
2.基金赎回款	-465,367,586.02	113,838,559.37	-351,529,026.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,275,738,117.96	-581,822,692.91	1,693,915,425.05

项目	上年度可比期间 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-146,158,457.50	1,853,841,542.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-439,513,879.42	-439,513,879.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	638,451,089.46	-88,418,544.72	550,032,544.74
其中:1.基金申购款	3,435,219,033.06	-556,696,971.33	2,878,522,061.73
2.基金赎回款	-2,796,767,943.60	468,278,426.61	-2,328,489,516.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,638,451,089.46	-674,090,881.64	1,964,360,207.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨小松 邓见梁 邓见梁

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方开元沪深300ETF联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	2,983,379.08	0.80%	270,585,889.00	5.54%

6.4.5.1.2 权证交易

无。

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	2,635.09	0.79%	2,635.09	1.35%

关联方名称	上年度可比期间 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	25,311.71	1.84%

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,083,292.34	4,137,194.48
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人南方基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	816,658.46	827,438.91

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% /当年天数。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日
基金合同生效日(2013年2月18日)持有的基金份额	-	50,686,168.00
期初持有的基金份额	44,437,896.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-6,248,272.00
减,期间赎回/卖出总份额	44,437,896.00	-
期末持有的基金份额	-	44,437,896.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.92%

注:本基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

6.4.5.4.2 报告期未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国工商银行-南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,380,131,552.00	69.17%	1,317,131,552.00	60.72%

注:南方开元沪深300ETF联接基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	9,845,640.56	51,062.23	15,642,188.69	565,212.99

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期					
2014年1月1日至2014年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
兴业证券	110025	国金转债	老股东配售	3,170	317,000.00

上年度可比期间					
2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600637	百视通	2014年5月29日	重大资产重组	32.03	-	-	214,122	5,766,028.23	6,858,327.66	-
000562	宏源证券	2013年10月31日	重大资产重组	8.22	2014年7月28日	8.93	685,172	6,015,298.42	5,632,113.84	-
600832	东方明珠	2014年5月29日	重大资产重组	10.98	-	-	508,810	3,225,267.61	5,586,733.80	-
000009	中国宝安	2014年5月28日	重大事项	10.21	-	-	401,810	3,778,860.23	4,102,480.10	-
601669	中国电建	2014年5月13日	重大事项	2.79	-	-	1,229,442	3,726,895.84	3,430,143.18	-
002570	贝因美	2014年6月19日	重大事项	14.36	-	-	201,015	3,402,601.85	2,886,575.40	-
600516	方大炭素	2014年6月30日	重大事项	9.59	2014年7月2日	9.05	290,941	2,435,101.40	2,790,124.19	-
600498	烽火通信	2014年6月28日	重大事项	11.91	2014年7月7日	12.10	163,250	2,434,668.91	1,944,307.50	-
000960	锡业股份	2014年5月6日	重大资产重组	12.44	2014年8月5日	13.68	144,640	1,984,823.62	1,799,321.60	-
000878	云南铜业	2014年4月17日	重大事项	7.61	2014年7月17日	7.50	227,721	2,396,960.44	1,732,956.81	-
000536	华映科技	2014年5月23日	重大事项	23.10	-	-	43,771	1,095,757.04	1,011,110.10	-

注:本基金截至2014年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,685,716,222.51	99.34
	其中:股票	1,685,716,222.51	99.34
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,711,456.49	0.63
7	其他各项资产	512,335.04	0.03
8	合计	1,696,940,014.04	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,361,047.77	0.32
B	采矿业	102,312,774.87	6.04
C	制造业	612,949,815.79	36.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,881,757.14	3.48
E	建筑业	53,256,002.05	3.14
F	批发和零售业	45,708,749.90	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	41,827,930.33	2.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,080,166.87	3.90
J	金融业	568,842,793.70	33.58
K	房地产业	77,515,562.47	4.58
L	租赁和商务服务业	16,029,024.35	0.95
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,263,861.17	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,664,279.58	0.87
S	综合	7,022,456.52	0.41
	合计	1,685,716,222.51	99.52

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

| 代码 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---