

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

【2014】半年度报告摘要

低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额拥有同等的分配权；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期末未收益分配事项。

5.1 报告期内本基金托管人遵守信托信託说明

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联接基金的托管过程中，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联接基金的管理人——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联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金收益分配和基金份额净值计价、基金申购和赎回价格计算、基金申购和赎回款项支付等方面，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各项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联接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相关信息的真实、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的南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金2014年半年度基金管理人报告、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。

5.6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

单位：人民币元

资产 2014年6月30日 2013年12月31日

货币存款 60,593,807.25 59,750,394.50

结算备付金 6,932,475.44 13,023,844.54

存出保证金 229,986.56 441,150.03

交易性金融资产 1,215,402,827.07 1,247,331,455.70

其中：股票投资 43,671,139.42 54,509,762.81

基金投资 1,171,731,687.65 1,192,794,333.49

债券投资 — 27,359.40

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 687,984.61 —

应收利息 14,906.17 21,169.11

应收股利 — —

应收申购款 199,082.23 724,641.26

递延所得税资产 — —

其他资产 — —

资产总计 1,284,061,004.33 1,321,292,675.14

负债和所有者权益 1,284,061,004.33 1,321,292,675.14

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 — —

应付赎回款 1,768,065.76 1,402,329.47

应付管理人报酬 51,979.87 53,162.99

应付托管费 10,395.96 10,632.60

应付销售服务费 — —

应付交易费 789,903.24 442,583.91

应交税费 — —

应付利息 — —

应付利润 — —

递延所得税负债 — —

其他负债 198,224.62 197,387.16

负债合计 2,818,569.45 2,106,096.13

所有者权益： — —

实收基金 1,656,268,206.79 1,606,504,032.41

未分配利润 -37,025,771.91 -287,317,453.40

所有者权益合计 1,281,242,434.88 1,319,186,579.01

负债和所有者权益总计 1,284,061,004.33 1,321,292,675.14

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.7736元，基金份额总额1,656,268,206.79份。

6.2 利润表

单位：人民币元

资产 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

一、收入 -74,313,875.04 -36,932,334.13

1.利息收入 311,823.26 544,712.31

其中：存款利息收入 311,823.26 544,712.31

债券利息收入 22.04 2,468.20

资产支持证券利息收入 — —

买入返售金融资产收入 — —

其他利息收入 — —

2.投资收益(损失以“-”号填列) -2,833,314.69 -181,029,062.67

其中：股票投资收益 -101,331.97 -211,295,897.08

基金投资收益 -197,893.28 —

债券投资收益 — —

资产支持证券投资损益 — —

贵金属投资收益 — —

衍生工具收益 -3,206,250.00 —

公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 674,444.97 29,637,449.61

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -71,861,759.06 -126,018,744.53

4.汇兑收益(损失以“-”号填列) — —

5.其他收入(损失以“-”号填列) 69,375.45 570,700.76

减：二、费用 1,138,247.53 12,351,170.72

1.管理人报酬 273,767.75 8,419,755.60

2.托管费 54,793.50 1,893,478.24

3.销售服务费 — —

4.交易费用 614,934.71 1,753,441.20

5.利息支出 — —

其中：卖出回购金融资产支出 — —

6.其他费用 194,551.57 284,495.68

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) -75,452,122.57 -318,283,504.85

减：所得税费用 — —

四、净利润(净亏损以“-”号填列) -75,452,122.57 -318,283,504.85

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联接基金

报告期间：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

期初所有者权益(基金净值) 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01

其中：前期差错更正 1,606,504,032.41 -287,317,453.40 1,319,186,579.01