

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：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、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。

基金管理人：中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月22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。

本报告涉及财务资料未经审计。

本报告期自2014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
基金代码	560205
基金运作方式	契约型开放式
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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金总资产	170,461,121.73份
基金份额持有人数	不定期

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380”。

## 2.1.1 基金基本概况

基金名称	上证380交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	510290
基金运作方式	契约型开放式
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
报告期末基金总资产	170,461,121.73份
基金份额持有人数	不定期

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380”。

## 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	本基金主要投资于股票型基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股的重大变化定期调整股票组合，增减、分红等变动时，根据成份股的基准权重和调整比例对股票组合进行相应调整；当指数成份股发生调整且不能被有效复制时，本基金将采用适当的变通方法以确保跟踪误差符合标的指数的风险收益特征。
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	本基金是股票型基金，股票型基金是高风险、高收益的投资品种，具有较高的预期收益，同时具有较高的预期风险，因此本基金属于高风险、高收益的基金品种。
2.2.1 基目标基金产品说明	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：本基金主要投资于股票型基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股的重大变化定期调整股票组合，增减、分红等变动时，根据成份股的基准权重和调整比例对股票组合进行相应调整；当指数成份股发生调整且不能被有效复制时，本基金将采用适当的变通方法以确保跟踪误差符合标的指数的风险收益特征。
2.2.2 基金产品说明	投资目标：南方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：本基金主要投资于股票型基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股的重大变化定期调整股票组合，增减、分红等变动时，根据成份股的基准权重和调整比例对股票组合进行相应调整；当指数成份股发生调整且不能被有效复制时，本基金将采用适当的变通方法以确保跟踪误差符合标的指数的风险收益特征。

## 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	中国建设银行股份有限公司
姓名	赵文华	田青
信息披露负责人	0755-26733888	010-67595096
电子邮箱	manager@sofiafund.com	tianq@cbcbank.com
客户服务电话	4008-889-889	010-67595096
传真	0755-26733889	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

基金管理人定期报告公告的管理人互联网网址	http://www.sofiafund.com
基金管理人年度报告备查地点	基金管理人办公地址

注：基金管理人定期报告公告的管理人互联网网址

基金管理人年度报告备查地点

§ 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 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

项目	本期末	本年初至期末
本期末基金资产总额	-547,635.03	-
本期初基金资产总额	889,974.58	-
加权平均基金份额本期利润	0.0935	-
本期基金份额净值增长率为	0.61%	-
报告期末基金份额净值	1.00	-
报告期末可供分配基金份额利润	-0.0934	-
期末基金资产净值	157,459.94	-
报告期末可供分配基金份额利润	0.2388	-

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)扣减相关费用后的余额，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，采用月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.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不计费用的。

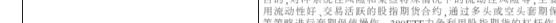
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其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	2.36%	0.83%	1.99%	0.83%	0.37%	0.00%
过去三个月	1.83%	0.92%	1.29%	0.94%	0.54%	-0.02%
过去六个月	0.61%	1.09%	0.45%	1.11%	0.16%	-0.02%
过去一年	17.85%	1.18%	18.34%	1.20%	-0.49%	-0.02%
自基金合同生效以来	-7.62%	1.26%	-7.52%	1.31%	-0.10%	-0.05%

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%。

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



报告：截止日2014年6月30日，基金份额净值0.9238元，基金份额总额170,461,121.73份。

121.73%。

3.2.3 利润表

3.2.3.1 会计主体：南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期末	2013年12月31日
资产			
银行存款		8,854,533.92	8,001,467.79
结算备付金		35,153.38	49,903.03
在途保证金		17,034,666	10,293.21
交易性金融资产		149,331,754.30	127,852,750.76
其中：股票投资		705,169.37	607,845.00
基金投资		148,626,585.33	127,244,905.76
货币市场基金		-	-
应收利息		-	-
应收股利		1,805.00	1,679.16
应收申购款		-	-
应收赎回款		65,584.94	135,459.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
负债			
应付管理费		3,875.67	3,367.99
应付托管费		775.15	673.39
应付交易费用		56,637.55	17,588.30
应付利息		-	-
应付股利		-	-
应付申购款		-	-
应付赎回款		-	-
应付交易费用		-	-
应付管理费		-	-
应付托管费		-	-
应付交易费用		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
应付申购款		-	-
应付赎回款		-	-
应付交易费用		-	-
应付管理费		-	-
应付托管费		-	-
应付交易费用		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
应付申购款		-	-
应付赎回款		-	-
应付交易费用		-	-
应付管理费		-	-
应付托管费		-	-
应付交易费用		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
应付申购款		-	-
应付赎回款		-	-
应付交易费用		-	-
应付管理费		-	-
应付托管费		-	-
应付交易费用		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
应付申购款		-	-
应付赎回款		-	-
应付交易费用		-	-
应付管理费		-	-
应付托管费		-	-
应付交易费用		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
应付申购款		-	-
应付赎回款		-	-
应付交易费用		-	-
应付管理费			