

信息披露 Disclosure

南方上证380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

本基金自建仓结束至本报告期末的指数跟踪期间,相对于业绩基准的年化跟踪误差为0.423%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过4%的投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为0.9238元。报告期内,份额净值增长率为0.61%,同期业绩基准增长率为0.46%。

4.6 管理人宏观预期、经济走势及行业走势的简要展望
当前中国经济的主要特征为工业化时代新都市圈,经济增长方式亟待转变,改革进入攻坚关键期。我国经济已经接近出现黄金拐点,大盘短期内迎来政策反弹契机。因此在注重控制风险的同时,可以看好一些中长期前景良好的板块。6月中旬,暂停三个多月的IPO重启由于,由于新股发行密度受到严格控制,给市场带来冲击小于预期。下半年“微刺激”政策将继续实施,经济增长有望企稳回升,但中长期前景仍旧不确定,大市将呈现震荡反弹走势。

本基金为指数化产品,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、恪守指数化投资宗旨,实现对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之相应的工作收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风险,借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人入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约定,对基金所有资产进行估值。本基金管理人根据法律法规规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值变化的影响,在估值调整前,由基金管理人提供估值调整说明,并经会计师事务所审核后出具报告。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持续工作的顺利开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总监、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,超过三分之二的以上人员具有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规则和方法的讨论,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 管理人入对报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金合同约定,本基金的收益分配原则为:本基金的每份基金份额享有同等分配权;本基金收益每年最多分配12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%;若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式为现金分红;基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值,基金收益分配基准日前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;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,本报告期末本基金未有收益分配事项。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况
本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核事项为本报告中的财务信息、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,前述复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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:南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金
会计截止日:2014年6月30日

资产	附注号	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款		8,854,533.92	8,007,467.79
结算备付金		35,135.35	49,905.63
存出保证金		17,034.66	10,292.31
交易性金融资产		149,331,755.30	127,852,750.76
其中:股票投资		705,169.97	607,845.00
基金投资		148,626,585.33	127,244,905.76
期货投资		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收利息		1,805.00	1,679.16
应收股利		-	-
应收申购款		65,584.94	135,450.01
递延所得税资产		-	7,393.10
资产总计		158,365,849.17	136,059,139.06
负债和所有者权益	附注号	本期 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		-	-
应付短期融资券		-	-
应付赎回款		591,368.89	165,192.22
应付管理人报酬		3,875.67	3,367.99
应付托管费		775.15	673.59
应付销售服务费		-	-
应交税费		56,637.55	17,588.30
应付利息		-	-
应付股利		-	-
预收账款		177,337.30	-
递延所得税负债		-	155,732.73
负债合计		829,894.56	342,555.83
所有者权益:			
实收基金		170,461,121.73	147,810,013.54
未分配利润		-12,985,167.12	-12,093,430.31
所有者权益合计		157,475,954.61	135,716,583.23
负债和所有者权益总计		158,365,849.17	136,059,139.06

注: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。

6.2 利润表
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
会计期间:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		1,155,054.01	-2,920,636.47
1.利息收入		327,478.82	24,191.01
其中:存款利息收入		327,478.82	24,191.01
债券利息收入		-	-
基金投资收益		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.股息收入		591,368.89	165,192.22
3.公允价值变动收益		3,875.67	3,367.99
4.其他收入		775.15	673.59
二、费用		-	-
1.销售服务费		-	-
2.管理人报酬		-	-
3.托管费		-	-
4.其他费用		-	-
三、利润总额(亏损总额)		-344,833.02	-1,230,667.71
四、净利润(净亏损)		65,866.78	208,354.46
五、每股收益(元)		-424,646.32	-1,454,137.40
六、其他综合收益		-	-
七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
一百、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-

注: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。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
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
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		1,155,054.01	-2,920,636.47
1.利息收入		327,478.82	24,191.01
其中:存款利息收入		327,478.82	24,191.01
债券利息收入		-	-
基金投资收益		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.股息收入		591,368.89	165,192.22
3.公允价值变动收益		3,875.67	3,367.99
4.其他收入		775.15	673.59
二、费用		-	-
1.销售服务费		-	-
2.管理人报酬		-	-
3.托管费		-	-
4.其他费用		-	-
三、利润总额(亏损总额)		-344,833.02	-1,230,667.71
四、净利润(净亏损)		65,866.78	208,354.46
五、每股收益(元)		-424,646.32	-1,454,137.40
六、其他综合收益		-	-
七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
二十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
三十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
四十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
五十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
六十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
七十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十七、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十八、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
八十九、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十一、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十二、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十三、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十四、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十五、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-
九十六、其他综合收益变动(损失以“-”号填列)		-	-