

中证南方小康产业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

0.849%，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0.65659元，累计净值为0.6759元。报告期内，份额净值增长率为-5.96%，同期业绩基准增长率为-6.71%。

4.5 管理人对外宏观经营、证券市场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时期，经济增速下降，经济增长方式亟待转变，改革进程为政策主旋律。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，因此在风险控制风险的同时，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再次重启，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，但中长期前景仍不确定，大市将呈现震荡走势。

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，为持有人提供与之一致的收益。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规定，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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所存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定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、总经理助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及风控保障部总监等。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，且具备风控、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：每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金份额净值减去拟分配的基金份额净值后基金份额净值不得低于面值；本基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合相关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年最多6次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于该基金份额净值每日每份基金份额可供分配利润的10%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额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是现金分红；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分配事项。

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，本基金托管人在对中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资过程中，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 管理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

报告期内，中证南方小康产业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中证南方小康产业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、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，未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均严格按照基金合同的规定执行。本报告期内，中证南方小康产业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内容真实、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中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金2014年半年度报告中财务数据、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
单位：人民币元
报告截止日：2014年6月30日

资产	本期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币资金	7,550,183.63	8,731,076.30
银行存款	999,878.52	999,878.52
结算备付金	4,490.92	12,358.38
交易性金融资产	144,063,328.80	163,906,733.50
其中：股票投资	815,018.80	796,130.50
债券投资	143,250,310.00	163,110,603.00
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收利息	1,822.39	2,334.80
应收股利	—	—
应收申购款	11,407.69	133,976.87
预付款项	—	—
应收证券清算款	—	—
其他应收款	152,633,111.95	175,786,388.37
资产总计	352,633,111.95	352,633,111.95
负债和所有者权益		
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
应付短期融资款	—	—
应付赎回款	189,114.28	145,185.46
应付管理人报酬	3,628.93	4,452.49
应付托管费	725.80	890.50
应付销售服务费	—	—
应付交易费	5,210.69	7,595.45
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
预收款项	176,700.06	155,782.56
递延所得税负债	—	—
负债合计	375,379.76	313,996.46
所有者权益：		
实收基金	232,126,752.18	251,582,252.43
未分配利润	-79,869,019.99	-76,109,800.52
所有者权益合计	152,257,732.19	175,472,451.91
负债和所有者权益总计	352,633,111.95	352,633,111.95

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.65659元，基金份额总额232,126,752.18份。

6.2 利润表

单位：人民币元
会计主体：中证南方小康产业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	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	-10,203,199.50	-32,996,862.43
1.利息收入	37,776.33	50,845.47
其中：存款利息收入	37,776.33	50,845.47
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	0.79
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.股息收入	—	-2,952,101.44
3.投资收益	-4,226,922.80	-2,952,101.44
其中：股票投资收益	-241,100.99	-241,100.99
基金投资收益	-4,127,791.48	-3,004,300.08
公允价值变动收益	163.71	—
资产支持证券投资收益	—	—
其他业务收入	1,624.66	—
汇兑收益	11,969.86	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-6,016,780.94	-30,102,955.98
4.其他收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他综合收益(损失以“-”号填列)	2,817.91	7,349.54
二、费用	227,472.21	251,730.97
1.管理人报酬	22,701.05	29,864.53
2.托管费	4,540.20	5,972.93
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	24,063.36	41,690.94
5.利息支出	—	—
6.其他费用	176,168.60	174,230.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-10,430,581.71	-33,248,601.48
减：所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-10,430,581.71	-33,248,601.48

6.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：中证南方小康产业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	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	251,582,252.43	-76,109,800.52
二、本期投资活动产生的基金净值变动(基金净值)	—	-10,430,581.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(基金净值)	-19,455,500.25	6,671,362.24
其中：1.基金申购款	6,470,766.97	-2,235,302.36
2.基金赎回款	-25,926,267.22	8,906,734.60
四、本期基金份额持有人认购、申购、赎回及转换产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五、本期所有所有者权益(基金净值)	232,126,752.18	-79,869,019.99
六、期末所有者权益(基金净值)	232,126,752.18	152,257,732.19

6.4 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

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600050	中国联通	17,800	57,494.00	0.04
2	601668	中国建发	17,300	48,786.00	0.03
3	600010	宝钢股份	11,000	39,820.00	0.03
4	600019	宝钢股份	8,600	38,260.00	0.02
5	600418	江淮汽车	3,300	33,660.00	0.02
6	600585	海螺水泥	3,300	32,780.00	0.02
7	600827	鲁南制药	3,300	32,025.00	0.02
8	600177	雅化集团	4,200	29,526.00	0.02
9	600011	华能国际	4,900	27,734.00	0.02
10	600585	海螺水泥	1,500	23,580.00	0.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.nffund.com的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600089	特变电工	759.00	0.00

注：买入包括二级市场主动买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600050	中国联通	1,222,569.00	0.70
2	600019	宝钢股份	736,816.00	0.42
3	601668	中国建发	472,245.00	0.27
4	600011	华能国际	374,093.00	0.21
5	600900	长江电力	371,060.00	0.21
6	600015	华夏银行	332,263.00	0.19
7	601169	北京银行	315,105.00	0.18
8	601390	中国中铁	285,353.00	0.16
9	601186	中国铁建	280,371.00	0.16
10	601601	光大银行	265,098.00	0.15
11	600795	国电电力	257,895.00	0.15
12	600585	海螺水泥	225,903.00	0.13
13	600048	保利地产	216,948.00	0.12
14	601600	中国建发	198,072.00	0.11
15	601880	中国交建	196,994.00	0.11
16	600837	海通证券	196,879.00	0.11
17	600690	青岛啤酒	188,533.70	0.11
18	601939	建设银行	185,049.00	0.11
19	601899	紫金矿业	166,028.00	0.09
20	601336	新华保险	166,200.00	0.09

注：卖出包括二级市场主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	759.00
卖出股票收入（成交）总额	11,694,694.40

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

7.5.1 报告期末本基金持有的债券投资组合

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	南方小康ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理有限公司	143,250,310.00	94.98

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.12.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
7.12.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.13 资产组合报告附注
7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,490.92
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收股利	1,822.39
5	应收申购款	11,407.69
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	17,721.00

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.13.5 期末持有的处于转股期的可转换债券

7.13.6 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600418	江淮汽车	33,660.00	0.02	重大事项

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有份额		占总份额比例		持有份额		占总份额比例	
11,158	20,803.62	1,528,001.29	0.66%	230,598,750.89	99.34%		

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有人员持有本基金	1,132,238.16	0.4878%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
公司高级管理人员、基金投资和研究部门人员持有本开放式基金	0

8.4 基金管理人持有本开放式基金

8.5 基金管理人持有本开放式基金

8.6 基金管理人持有本开放式基金

8.7 基金管理人持有本开放式基金

8.8 基金管理人持有本开放式基金

8.9 基金管理人持有本开放式基金

8.10 基金管理人持有本开放式基金

8.11 基金管理人持有本开放式基金

8.12 基金管理人持有本开放式基金

8.13 基金管理人持有本开放式基金

8.14 基金管理人持有本开放式基金

8.15 基金管理人持有本开放式基金

8.16 基金管理人持有本开放式基金

8.17 基金管理人持有本开放式基金

8.18 基金管理人持有本开放式基金

8.19 基金管理人持有本开放式基金

8.20 基金管理人持有本开放式基金

8.21 基金管理人持有本开放式基金

8.22 基金管理人持有本开放式基金

8.23 基金管理人持有本开放式基金

8.24 基金管理人持有本开放式基金

8.25 基金管理人持有本开放式基金

8.26 基金管理人持有本开放式基金

8.27 基金管理人持有本开放式基金

8.28 基金管理人持有本开放式基金

8.29 基金管理人持有本开放式基金

8.30 基金管理人持有本开放式基金

8.31 基金管理人持有本开放式基金

8.32 基金管理人持有本开放式基金