南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

【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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2014年8月21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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金名称	南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
基金简称	南方中证500ETF联接(LOF)
场内简称	南方500
基金主代码	160119
前端交易代码	160119
后端交易代码	160120
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年9月25日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,650,667,836.59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	2009-11-11

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500”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年3月15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	中国农业银行股份有限公司

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“500ETF”

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标ETF,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	本基金以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。 在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	中证500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。

2.2.1 目标基金产品说明

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,采用完全复制法,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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证500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。本基金采用完全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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	李芳非
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-63201816

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	132,379,663.29
本期利润	165,256,343.30
加权平均基金份额本期利润	0.0327
本期基金份额净值增长率	1.98%
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	-0.0384
期末基金资产净值	4,472,010,611.07
期末基金份额净值	0.9616

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.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)。

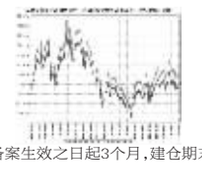
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.68%	0.93%	2.38%	0.93%	0.30%	0.00%
过去三个月	2.53%	1.01%	2.11%	1.01%	0.42%	0.00%
过去六个月	1.98%	1.20%	2.43%	1.19%	-0.45%	0.01%
过去一年	19.29%	1.26%	20.27%	1.26%	-0.98%	0.00%
过去三年	-14.44%	1.40%	-13.25%	1.40%	-1.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.26%	1.48%	11.26%	1.50%	-9.00%	-0.02%

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:本基金建仓期为基金备案生效之日起3个月,建仓期末本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

§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		
罗文杰	本基金的基金经理	2013年4月22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

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》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则,并严格按照《南方中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》的各项规定,本着诚实守信、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,为基金持有人谋求与标的指数相近的收益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。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。同期中证500指数上涨2.50%。

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”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接受申购赎回所带来的股票仓位偏离, 对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;

②本基金大额换购目标ETF所带来的成份股权重偏离,对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对;

③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;

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

自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为0.398%, 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0.9616元,报告期内,份额净值增长率为1.98%,同期业绩基准增长率为2.43%。

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,主要特征在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: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;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,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,基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年最多6次,每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的10%;基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额, 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。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式, 具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日;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规守信情况声明

在托管南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》、《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》的约定,对南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)管理人—南方基金管理有限公司2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 南方基金管理有限公司在南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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	230,896,589.88	222,842,478.79
结算备付金	6,740.28	341,911.29
存出保证金	922,964.11	505,684.42
交易性金融资产	4,241,538,218.17	4,157,992,925.20
其中:股票投资	15,651,117.30	595,391.00
基金投资	4,225,887,100.87	4,157,397,534.20
债券投资	-	-
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	15,092,457.10	15,038,010.37
应收利息	39,228.87	43,268.91
应收股利	1,691.14	1,691.14
应收申购款	1,165,501.14	2,949,389.16
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	5,367,66.67
资产总计	4,489,663,390.69	4,400,252,125.95
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	-	40,344.6
应付赎回款	17,081,109.58	7,139,490.43
应付管理人报酬	106,569.48	94,868.37
应付托管费	21,313.93	18,973.67
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	174,341.20	871,658.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	269,445.43	232,991.81
负债合计	17,652,779.62	8,357,982.38
所有者权益:		
实收基金	4,650,667,836.59	4,657,868,889.39
未分配利润	-178,657,225.52	-266,015,090.42
所有者权益合计	4,472,010,611.07	4,391,853,798.97
负债和所有者权益总计	4,489,663,390.69	4,400,252,125.95

注: 报告截止日2014年6月30日, 基金份额净值0.9616元, 基金份额总额4,650,667,836.59份。

6.2 利润表

会计主体:南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	170,081,819.13	70,595,813.67
1.利息收入	963,962.56	979,736.05
其中:存款利息收入	963,962.56	978,862.98
债券利息收入	-	873.07
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“-”填列)	133,480,153.77	-328,253,605.39
其中:股票投资收益	19,517,323.18	-325,869,813.21
基金投资收益	113,670,980.30	-4,488,241.68
债券投资收益	-	279,056.19
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	291,850.29	1,825,393.31
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	32,876,680.01	396,052,829.88
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,761,022.79	1,816,853.13
减:二、费用	4,825,475.83	13,591,962.95
1.管理人报酬	859,631.45	7,042,576.82
2.托管费	171,926.39	1,408,515.40
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,555,172.44	4,362,771.59
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	238,745.55	778,099.14
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	165,256,343.30	57,003,850.72
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	165,256,343.30	57,003,850.72

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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)	4,657,868,889.39	-266,015,090.42	4,391,853,798.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	165,256,343.30	165,256,343.30
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)	-7,201,052.80	-77,898,478.40	-85,099,531.20
其中:1.基金申购款	2,672,138,605.81	-132,832,707.43	2,539,305,898.38
2.基金赎回款	-2,679,339,658.61	54,934,229.03	-2,624,405,429.58
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)	4,650,667,836.59	-178,657,225.52	4,472,010,611.07

项目	上年度可比期间 2013年1月1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)	6,205,579,059.16	-1,163,346,449.63	5,042,232,609.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,003,850.72	57,003,850.72
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)	-1,084,239,341.90	113,538,689.56	-970,700,652.34
其中:1.基金申购款	877,214,493.69	-121,787,072.43	755,427,421.26
2.基金赎回款	-1,961,453,835.59	235,325,761.99	-1,726,128,073.60
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)	5,121,339,717.26	-992,803,909.35	4,128,535,807.91

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 重要会计政策和会计估计

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(“南方基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
南方中证500交易型开放式指数证券投资基金(“目标ETF”)	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1月1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	27,660,953.55	1.25%	170,173,386.97	4.12%

6.4.5.1.2 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	24,477.26	1.22%	-	-
	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
关联方名称	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	150,587.74	3.87%	-	-

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和经手费后的净额列示。

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等。

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1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	859,631.45	7,042,576.82
其中:支付销售机构的客户维护费	2,847,264.29	3,141,453.50

注:本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取管理费,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扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取零)的0.5%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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产) 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1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	171,926.39	1,408,515.40

注:本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,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扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取零)的0.1%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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产) 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

注:本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

注:本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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1月1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
中国农业银行	230,896,589.88	922,137.38	195,904,489.47	949,383.31

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,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

注:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末,本基金持有3,835,787,511份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为94.50%。

6.4.6 利润分配情况

无

6.4.7 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

投票代码	投票名称	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
002252	上海莱士	2014年6月13日	临时停牌	63.30	-	-	4,600	294,217.60	291,180.00	-
601012	隆基股份	2014年6月19日	临时停牌	15.50	2014年7月1日	15.60	10,200	139,172.00	158,100.00	-
600490	鹏欣资源	2014年4月1日	临时停牌	6.11	2014年7月15日	6.11	25,170	155,896.32	153,788.70	-
600755	厦门国贸	2014年6月27日	临时停牌	4.85	2014年7月7日	4.74	30,200	156,322.20	146,470.00	-
002340	格林美	2014年6月26日	临时停牌	11.19	2014年7月24日	11.77	12,700	138,923.04	142,113.00	-
600685	广船国际	2014年4月7日	临时停牌	17.13	-	-	7,470	124,212.20	127,961.10	-
600582	天地科技	2014年6月26日	临时停牌	7.97	-	-	15,300	140,202.00	121,941.00	-
600757	长江传媒	2014年6月17日	临时停牌	8.85	-	-	11,600	100,255.64	102,660.00	-
600418	江淮汽车	2014年4月14日	临时停牌	10.20	2014年7月11日	11.22	9,300	95,127.43	94,860.00	-
000762	西藏矿业	2014年4月29日	临时停牌	10.54	2014年7月28日	11.59	8,200	92,935.20	86,428.00	-
000612	焦作万方	2014年4月3日	临时停牌	6.08	-	-	12,900	81,657.00	78,432.00	-
600260	凯乐科技	2014年6月9日	临时停牌	6.59	-	-	11,500	78,752.19	75,785.00	-
600864	哈投股份	2014年4月11日	临时停牌	8.68	2014年7月15日	8.30	8,300	70,101.35	72,044.00	-
000852	江钻股份	2014年5月28日	临时停牌	15.80	-	-	4,400	71,015.29	69,520.00	-
002638	勤上光电	2014年6月10日	临时停牌	14.15	2014年7月15日	14.75	4,800	57,782.76	67,920.00	-
601777	力帆股份	2014年6月24日	临时停牌	6.39	2014年7月8日	6.70	10,200	69,226.73	65,178.00	-
600850	华东电脑	2014年4月4日	临时停牌	19.56	2014年7月11日	21.52	3,000	58,795.50	58,680.00	-
600059	古越龙山	2014年6月30日	临时停牌	7.97	2014年7月1日	7.83	5,700	45,167.94	45,429.00	-
002635	安洁科技	2014年6月30日	临时停牌	31.99	2014年8月5日	35.19	1,100	36,502.76	35,189.00	-
600507	方大特钢	2014年6月30日	临时停牌	3.16	2014年7月2日	3.03	8,300	27,544.16	26,228.00	-

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。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

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	15,651,117.30	0.35
	其中:股票	15,651,117.30	0.35
2	基金投资	4,225,887,100.87	94.13
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	230,903,330.16	5.14
8	其他各项资产	17,221,842.36	0.38
9	合计	4,489,663,390.69	100.00

7.2 期末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	267,862.02	0.01
B	采矿业	488,452.86	0.01
C	制造业	9,823,524.66	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	384,178.40	0.01
E	建筑业	385,246.00