

中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2016年3月30日

1.1 重要提示及目录

基金管理人的董事、董事会、监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。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签署同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司于2016年3月25日复核了本报表中的财务数据、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，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未来表现，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本年度报告摘要自公告之日起至12月31日止。

2.2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方小康ETF
场内简称	小康ETF
基金代码	631010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年8月7日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,552,067,409.02
基金份额净值	不适用
基金资产的券别	上海证券交易所
上市日期	2010-11-01

注:本基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息披露场合下,可简称为“小康ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金跟踪标的指数,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,原则上采用完全复制法,按照所跟踪的指数的构成比例购买指数成份股,并根据其权重调整其持有的组合。

业绩比较基准 本基金的业绩基准和其跟踪的中证综合债券指数的基金产品,即为银行存款利率(税后)与中证综合债券指数的平均收益率之差(以期初为重估日重新计算)。

风险收益特征 本基金为债券型基金,风险与收益高于货币基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,并力求与标的指数所代表的市场价格相似的风格。

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	中国工商银行股份有限公司
姓名	蔡文波	洪洲
信息披露负责人	联系电话	0756-82763898 010-66016799
	电子邮箱	manager@sunfondsf.com eustudy@sohu.com
客户服务电话	400-999-3899	95588
传真	0756-82763899	010-66105708

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 <http://www.sunfondsf.com>
基金年度报告备置地点 基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年	2014年	2013年
本期初次收入	170,467,193.33	30,628,178.40	-37,446,408.64
本期末余额	-48,104,558.74	119,414,470.02	-24,260,068.84
期末平均基金份额总额	-0.0329	0.0193	-0.0221
本期平均净值增长率	-0.5129%	61.69%	-0.83%
本期份额净值增长率	3.61%	67.00%	-0.61%

注:1.本期实现收益指基金本期收入,包括收入、公允价值变动收益、利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用的余额,本期利润为本期已实现收入加上公允价值变动收益。

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(为期末利润,不是当期利润数)。

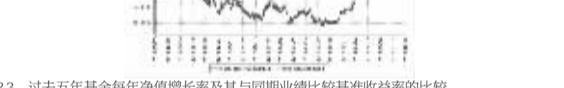
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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(%)	份额增长 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
过去三个月	9.04%	1.64%	9.55%	1.67%	-0.51%	-0.03%
过去六个月	-23.67%	3.01%	-24.01%	3.06%	0.34%	-0.06%
过去一年	3.61%	2.79%	4.95%	2.82%	-1.34%	-0.03%
过去三年	56.39%	1.92%	53.60%	1.94%	2.79%	-0.02%
过去五年	27.08%	1.69%	22.46%	1.71%	4.62%	-0.02%
自基金合同生 效至今	33.58%	1.68%	34.73%	1.71%	-1.15%	-0.03%

3.2.2 基金合同生效以来以基金份额累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人对管理基金的经验

1990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“基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳,注册资本3亿元人民币。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)管理资产规模超过5,000亿元,旗下管理85只开放式基金,多个全国社保、企业年金和专户理财产品投资组合。

4.1.2 基金经理/基金经理小组介绍

基金经理姓名:蔡文波,性别:男,国籍:中国,大学本科,经济学学士,基金从业15年,历任南方基金研究员、基金经理助理、基金经理,现任南方基金管理有限公司基金经理。

基金经理姓名:洪洲,性别:男,国籍:中国,大学本科,金融学学士,基金从业15年,历任南方基金研究员、基金经理助理、基金经理,现任南方基金管理有限公司基金经理。

基金经理姓名:蔡文波,性别:男,国籍:中国,大学本科,金融学学士,基金从业15年,历任南方基金研究员、基金经理助理、基金经理,现任南方基金管理有限公司基金经理。

基金经理姓名:洪洲,性别:男,国籍:中国,大学本科,金融学学士,基金从业15年,历任南方基金研究员、基金经理助理、基金经理,现任南方基金管理有限公司基金经理。