

# 信息披露 Disclosure

## 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

# 2015 年度 报告 摘要

总经理、研究总监、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人员的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各环节之间无重大数据冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配政策的说明

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得低于面值,即:基金收益分配前的基金份额净值减去每单位基金份额应分配的收益后不得低于面值。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%;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息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者选择不进行收益分配,本基金将以现金形式发放红利,法律许可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分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

报告期内本基金托管人遵守法律法规及中国证监会有关规定,恪尽职守,履行了托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内基金投资运作遵规合规、净值计算、利润分配等情况的说明

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、基金净值计算、基金份额申购赎回价格核算、基金费用开支等方面上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在重要事项的运作严格执行基金合同约定的规定。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2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 审计报告

本基金2015年年度财务会计报告经毕华永中天会计师事务所特殊普通合伙审计,注册会计师签字出具了普华永道中天字[2016]第21227号“标准无保留意见”的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7 年度财务报表

7.1 资产负债表

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

报告截止日:2015年12月31日

资产	本报告期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	44,059,312.33	89,313,658.89
结算备付金	1,375,995.99	799,822.52
应收利息	714,224.24	133,649.09
应收股利	791,629.00	451,126,729.94
买入返售金融资产	4,088,366.36	3,683,729.88
银行存款	777,073,827.37	428,439,638.86
其他资产	—	—
资产总计	46,937,035.99	113,754,619.28
负债	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
其他负债	—	—
负债总计	—	—
所有者权益	46,937,035.99	113,754,619.28
实收基金	—	—
未分配利润	46,937,035.99	113,754,619.28
所有者权益合计	46,937,035.99	113,754,619.28

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.1744元,基金份额总额702,820,068.70份。

7.2 利润表

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

报告截止日:2015年1月1日至2015年12月31日

项目	本报告 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、营业收入	-27,705,242.50	99,904,647.73
利息收入	151,452.24	62,296.35
公允价值变动损益	931,452.24	82,296.35
其他收入	—	—
二、营业支出	931,452.24	82,296.35
三、营业利润	-27,705,242.50	99,904,647.73
四、利润总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
五、净利润	-27,705,242.50	99,904,647.73
六、每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七、其他综合收益	—	—
八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十一、其他综合收益	—	—
十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十五、其他综合收益	—	—
十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十九、其他综合收益	—	—
二十、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十一、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十二、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十三、其他综合收益	—	—
二十四、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十五、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十六、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十七、其他综合收益	—	—
二十八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十一、其他综合收益	—	—
三十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十五、其他综合收益	—	—
三十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十九、其他综合收益	—	—
四十、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十一、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十二、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十三、其他综合收益	—	—
四十四、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十五、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十六、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十七、其他综合收益	—	—
四十八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十一、其他综合收益	—	—
五十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十五、其他综合收益	—	—
五十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十九、其他综合收益	—	—
六十、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十一、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十二、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十三、其他综合收益	—	—
六十四、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十五、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十六、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十七、其他综合收益	—	—
六十八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十一、其他综合收益	—	—
七十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十五、其他综合收益	—	—
七十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十九、其他综合收益	—	—
八十、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十一、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十二、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十三、其他综合收益	—	—
八十四、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十五、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十六、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十七、其他综合收益	—	—
八十八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十一、其他综合收益	—	—
九十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十五、其他综合收益	—	—
九十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十九、其他综合收益	—	—
一百、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.1744元,基金份额总额702,820,068.70份。

7.2 利润表

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

报告截止日:2015年1月1日至2015年12月31日

项目	本报告 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、营业收入	-27,705,242.50	99,904,647.73
利息收入	151,452.24	62,296.35
公允价值变动损益	931,452.24	82,296.35
其他收入	—	—
二、营业支出	931,452.24	82,296.35
三、营业利润	-27,705,242.50	99,904,647.73
四、利润总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
五、净利润	-27,705,242.50	99,904,647.73
六、每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七、其他综合收益	—	—
八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十一、其他综合收益	—	—
十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十五、其他综合收益	—	—
十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
十九、其他综合收益	—	—
二十、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十一、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十二、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十三、其他综合收益	—	—
二十四、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十五、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十六、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十七、其他综合收益	—	—
二十八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
二十九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十一、其他综合收益	—	—
三十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十五、其他综合收益	—	—
三十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
三十九、其他综合收益	—	—
四十、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十一、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十二、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十三、其他综合收益	—	—
四十四、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十五、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十六、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十七、其他综合收益	—	—
四十八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
四十九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十一、其他综合收益	—	—
五十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十五、其他综合收益	—	—
五十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
五十九、其他综合收益	—	—
六十、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十一、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十二、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十三、其他综合收益	—	—
六十四、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十五、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十六、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十七、其他综合收益	—	—
六十八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
六十九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十一、其他综合收益	—	—
七十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十五、其他综合收益	—	—
七十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
七十九、其他综合收益	—	—
八十、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十一、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十二、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十三、其他综合收益	—	—
八十四、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十五、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十六、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十七、其他综合收益	—	—
八十八、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
八十九、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十一、其他综合收益	—	—
九十二、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十三、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十四、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十五、其他综合收益	—	—
九十六、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十七、基本每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十八、稀释每股收益	-27,705,242.50	99,904,647.73
九十九、其他综合收益	—	—
一百、综合收益总额	-27,705,242.50	99,904,647.73