

深证成份交易型开放式指数证券投资基金

[2014] 第一季度报告

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

报告送出日期:2014年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:深成ETF

交易代码:159903

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2009年12月4日

报告期末基金份额总额:2,156,054,507.00份

投资目标:紧密跟踪深证成份指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略:本基金为被动型指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股的权重构造指数化投资组合,并根据成份股的变动及时调整组合的构成。

本基金将定期对成份股的股息率和股利发放率进行调整,增补、补充或剔除成份股,并根据定期调整的成份股股息率和股利发放率的变化对组合进行适时调整。

当期定期调整成份股股息率和股利发放率时,本基金将根据成份股股息率和股利发放率的变化对组合进行适时调整,从而使得本基金在组合构建时选择成份股的股息率和股利发放率,使本基金的股息率和股利发放率与成份股股息率和股利发放率相匹配。

本基金的业绩比较基准是深证成份指数。本基金的指数化投资风险较小。

业绩比较基准:深证成份指数

风险收益特征:本基金为股票型基金,风险与收益高于货币市场基金和债券型基金,并力求在有效控制风险的前提下,通过股票投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。

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

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“深成ETF”

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)

1.本期已实现收益 -136,346,196.00

2.本期利润 -219,611,804.12

3.期初至报告期末的累计损益 -1,609,299,186.70

4.期末基金资产净值 0.7464

注:1.本期已实现收益不包括公允价值变动收益。

2.所列数据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。

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -11.43% 1.38% -11.46% 1.39% -0.15% -0.01%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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:本基金合同中关于基金投资比例的约定,本基金将全部或近全额的基金资产用于跟踪标的指数的指

的实现,正常情况下,本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的95%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

柯晓 本基金的基金经理 2013年4月22日 - 16 年

注:东华理工大学计算机软件硕士,美国印第安纳大学工商管理硕士,具有基金从业资格,2006年加入南方基金管理有限公司,历任基金研究员、基金经理助理、基金经理,现任本基金基金经理。2013年5月至今,任小鹏人寿保险有限公司投资经理,2013年5月至今,任南方深成ETF基金经理,2013年5月至今,任南方深成ETF基金经理及深成股基基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,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》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规的规定,本基金管理人勤勉尽责的履行管理基金的职责,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人实现最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守法律法规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合相关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

本基金报告期内,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,通过系统和人工等方式在各业务环节严格执行公平执行,公平对待旗下管理的所有基金投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内不存在异常交易行为。本基金报告期内基金管理人严格按照《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规的规定,本基金管理人勤勉尽责的履行管理基金的职责,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人实现最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等方式在各业务环节严格执行公平执行,公平对待旗下管理的所有基金投资组合。

4.4 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.5 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停赎回的情况。

4.6 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.7 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.8 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.9 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.10 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.11 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.12 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.13 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.14 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.15 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.16 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.17 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.18 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.19 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.20 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.21 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.22 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.23 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.24 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.25 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.26 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.27 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.28 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.29 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.30 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.31 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.32 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.33 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.34 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.35 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.36 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.37 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.38 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.39 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.40 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.41 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.42 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.43 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.44 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.45 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.46 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.47 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.48 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.49 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停申购、赎回的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停申购、赎回的情况。

4.50 报告期内基金管理人因投资策略调整而暂停转换的情况说明

本基金报告期内不存在投资策略调整而暂停转换的情况。

4.51 报告期末基金份额净值

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“深成ETF”

2.本基金合同生效后一年内为封闭式,基金合同生效一年后转为开放式,本基金已于2009年3月23日转为开放式。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)

1.本期已实现收益 -73,240,131.59

2.本期利润 -1,094,078,076.69

3.期初至报告期末的累计损益 -1,094,078,076.69

4.期末基金资产净值 0.763

注:本基金已实现收益指本基金本期收入,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;扣除非经常性损益后,本期利润即为本期实现收益加上本期公允价值变动收益;扣除非经常性损益后,本期利润即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益