

## 中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金

## [2014] 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:2015年3月26日

## § 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。本基金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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月20日复核了本报告中的财务数据、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摘要。

本年度报告摘要自年度报告正式披露之日起供投资者查阅，内容详细，阅读年度报告全文。

本报告期自2014年01月01日起至2014年12月31日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	南方小康ETF
基金代码	510660
交易方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年06月21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
报告期天数	960/05,409,000
基金份额持有人数	不适用
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010-06-21

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“小康ETF”。

## 2.2 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	本基金主要通过完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重进行证券投资,以尽可能地跟踪代表标的指数的整体走势。本基金将结合对宏观经济运行状况、政策因素、市场因素、行业因素、公司因素等的深入研究,并结合对股票市场的预测,在综合评估和控制跟踪误差的前提下,适时调整股票组合的构成,从而有效降低跟踪误差。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金的净值,即本基金的净值除以其成立时点的基金份额净值,并乘以100%。
风险收益特征	本基金是股票型基金,风险收益特征高于货币市场基金、债券基金与混合型基金,本基金的预期收益和预期风险均高于股票型基金。

## 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
住所	深圳市深南大道7018号国信金融中心20层	北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人	徐明	嵇晓华
信息披露负责人	董承非 0755-82783088	010-66050000
客户服务电话	董承非 mfang@sfam.com.cn	comfund@icbc.com.cn
网址	http://www.sffund.com	http://www.icbc.com.cn

## 2.4 信息披露方式

基金基本情况公告的发布媒介	http://www.sffund.com
基金份额年度报告	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

项 目	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	30,028,178.40	-37,545,408.64	-30,018,241.60
本期利润	19,141,479.82	-21,250,008.84	15,239,399.52
加权平均基金份额本期利润	0.983	-0.021	0.073
期末基金份额净值	67.00%	-9.61%	5.05%
3.1.2 期末可供分配基金份额利润	0.0681	-0.0197	-0.0586
期末基金资产净值	497,513,032.21	203,946,298.02	207,014,501.01
期末基金净值	0.5182	0.3013	0.4543

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,采用月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)。

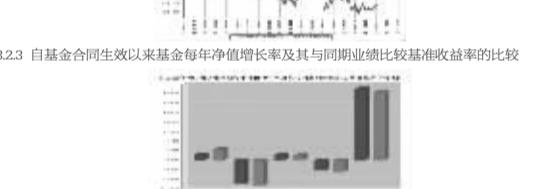
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的计算结果。

## 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	净值增长 率标准差	业绩比较基 准收益率	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	53.35%	1.84%	53.56%	-1.84%	-0.05%
过去六个月	78.01%	1.43%	76.64%	1.43%	-1.37%
过去一年	67.00%	1.28%	64.13%	1.28%	-2.87%
过去三年	58.57%	1.27%	52.74%	1.29%	-5.83%
自基金合同生效起至今	28.02%	1.29%	28.38%	1.33%	-0.54%

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与其同期业绩比较基准收益率的比较



注:基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:无。

## § 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

1996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“基金元年”的发起者。

南方基金总部在深圳,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,在深圳和深圳设有公司——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3,000亿元,旗下管理57只开放式基金,多个全国社保、企业年金和客户理财投资组合。

## 4.1.2 基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(或基金经理助理)时间	辞职日期	说明
陈树	本基金基金经理	2010年08月27日	-	17年

注:1.对于基金的前任基金经理,“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期;对此前的非前任基金经理,“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.证券从业人员的含义从行业协会《证券从业人员执业行为准则》的规定。

本基金报告期内,本公司严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和治理理念运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内整体合法合规,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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场买卖等投资管理行为,以及研究、分析、决策、投资、交易、执行、评估等投资源管理相关的各个环节,建立了股票、债券、基金等投资管理制度和细则,投资源管理制度和细则,集中交易管理办法、公平交易操作指引、异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资源管理的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资源管理行为中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

## 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内,两报告期内,两报告组合间同日向交易所买入股票交易量均值显著不为0的情况不存在,并且交易占比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

## 4.3.3 交易价格公平性的说明

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.4 基金管理人对报告期内的异常交易行为的专项说明

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.5 投资组合的异常情况

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.6 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.7 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.8 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.9 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.10 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.11 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.12 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.13 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.14 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.15 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。

## 4.3.16 为公平对待所有客户而支付的费用

本基金报告期内,我们通过定期报告中的基金的资产配置、基金的交易量、基金的交易金额、基金的交易占比等数据,对基金的交易公平性进行分析,从而判断是否存在不公平对待某类客户的情况。