

## 南方中证500交易型开放式指数证券投资基金管理基金联接基金(LOF)

## [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:中国农业银行股份有限公司  
送出日期:2015年3月26日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、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、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署同意，并由董事长签章。

基金行业自律组织、基金管理人和基金份额持有人共同遵守《关于进一步规范证券投资基金销售行为的指导意见》、净价报价、净值披露情况、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、误导性陈述或者严重遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。投资者在作出投资决策前应认真阅读该基金的招募说明书及其更新、年度报告、半年度报告。

本报告期内公告日期至2014年1月1日起至12月31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管理基金联接基金(LOF)
基金简称	南方500ETF联接(LOF)
场内简称	南方500
基金代码	160119
基金托管代码	160119
基金合同代码	160120
基金运作方式	上证红利交易型开放式(LOF)
基金成立日	2009年7月2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
基金类别	股票型基金
风险收益特征	股票型基金
基金总资产	3,178,800,245.80元
基金总负债	-
基金所有者权益	3,178,800,245.80元
基金存续期间	自基金合同生效之日起
基金合同终止日	无
基金募集期间	2009年7月1日至2009年7月2日
基金募集金额	3,178,800,245.80元
基金募集期间利息	0.00元
基金募集期间费用	0.00元
基金募集期间利息收入	0.00元
基金募集期间费用支出	0.00元
基金募集期间利息收入扣除费用后的余额	0.00元

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 基金基本信息

基金名称	中证500交易型开放式指数证券投资基金管理基金联接基金(LOF)
基金代码	500500
基金简称	南方500
基金托管方式	上证红利开放式(LOF)
基金合同期限	2009年7月2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
基金类别	股票型基金
风险收益特征	股票型基金
基金总资产	3,178,800,245.80元
基金总负债	-
基金所有者权益	3,178,800,245.80元
基金存续期间	自基金合同生效之日起
基金合同终止日	无
基金募集期间	2009年7月1日至2009年7月2日
基金募集金额	3,178,800,245.80元
基金募集期间利息	0.00元
基金募集期间费用	0.00元
基金募集期间利息收入	0.00元
基金募集期间费用支出	0.00元
基金募集期间利息收入扣除费用后的余额	0.00元

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

投资项目	基金资产的投资方向、投资策略、投资比例、投资限制、投资风险、投资收益特征等。
投资策略	本基金为被动管理的指数基金，原则上采用指数复制法。根据指数在投资范围内的权重比例，将基金资产在500只成分股中的权重重新分配，从而获得与该指数相似的收益。本基金通过定期调整和不定期调整两种方法来实现对指数的跟踪。定期调整是指每季度对成分股的权重进行重新分配，以使基金的成分股构成与指数的成分股构成相一致；不定期调整是指根据市场情况，对成分股的权重进行临时性调整，以使基金的成分股构成与指数的成分股构成相一致。
投资风格	本基金为被动管理的指数基金，具有低风险、高收益的特征。
基金经理	2013年2月6日
基金管理人员	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
基金类别	股票型基金
风险收益特征	股票型基金
基金总资产	3,178,800,245.80元
基金总负债	-
基金所有者权益	3,178,800,245.80元
基金存续期间	自基金合同生效之日起
基金合同终止日	无
基金募集期间	2009年7月1日至2009年7月2日
基金募集金额	3,178,800,245.80元
基金募集期间利息	0.00元
基金募集期间费用	0.00元
基金募集期间利息收入	0.00元
基金募集期间费用支出	0.00元
基金募集期间利息收入扣除费用后的余额	0.00元

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”。

## 2.3 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
法定代表人	杨文斌	林桂军
信息披露负责人	陈晓华	010-66060009
联系电话	0755-82763888	tgsq@abcchina.com
电子邮箱	manager@sifm.com	
客户服务电话	400-888-8888	95599
传真	0755-82763889	0755-82121616

2.4 信息披露方式

披露方式	http://www.sifm.com
基金定期报告披露地点	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

金额单位:人民币元

3.1 本期利润和报告期	2014年	2013年	2012年
本期利润	320,263.72	-352,187,101.50	-35,930,925.95
本期利润总额	1,429,875,469.90	699,917,36.39	-38,751,033.20
加权平均基金份额利润	0.3235	0.1302	-0.0067
期末基金份额净值	3.29%	16.05%	-0.17%

3.2 期末可供分配利润

3.3 本期末可供分配利润

3.4 本期利润和报告期

3.5 本期利润和报告期

3.6 本期利润和报告期

3.7 本期利润和报告期

3.8 本期利润和报告期

3.9 本期利润和报告期

3.10 本期利润和报告期

3.11 本期利润和报告期

3.12 本期利润和报告期

3.13 本期利润和报告期

3.14 本期利润和报告期

3.15 本期利润和报告期

3.16 本期利润和报告期

3.17 本期利润和报告期

3.18 本期利润和报告期

3.19 本期利润和报告期

3.20 本期利润和报告期

3.21 本期利润和报告期

3.22 本期利润和报告期

3.23 本期利润和报告期

3.24 本期利润和报告期

3.25 本期利润和报告期

3.26 本期利润和报告期

3.27 本期利润和报告期

3.28 本期利润和报告期

3.29 本期利润和报告期

3.30 本期利润和报告期

3.31 本期利润和报告期

3.32 本期利润和报告期

3.33 本期利润和报告期

3.34 本期利润和报告期

3.35 本期利润和报告期

3.36 本期利润和报告期

3.37 本期利润和报告期

3.38 本期利润和报告期

3.39 本期利润和报告期

3.40 本期利润和报告期

3.41 本期利润和报告期

3.42 本期利润和报告期

3.43 本期利润和报告期

3.44 本期利润和报告期

3.45 本期利润和报告期

3.46 本期利润和报告期

3.47 本期利润和报告期

3.48 本期利润和报告期

3.49 本期利润和报告期

3.50 本期利润和报告期

3.51 本期利润和报告期

3.52 本期利润和报告期

3.53 本期利润和报告期

3.54 本期利润和报告期

3.55 本期利润和报告期

3.56 本期利润和报告期

3.57 本期利润和报告期

3.58 本期利润和报告期

3.59 本期利润和报告期

3.60 本期利润和报告期

3.61 本期利润和报告期

3.62 本期利润和报告期

3.63 本期利润和报告期

3.64 本期利润和报告期

3.65 本期利润和报告期

3.66 本期利润和报告期

3.67 本期利润和报告期

&lt;p