

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

南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

2014 年度报告摘要

2014年12月31日

1.1 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...

2.1 基金基本情况 基金名称:南方开元沪深300ETF 简称:开元300 基金代码:501002

2.2 基金产品说明 投资目标:本基金为被动式指数基金,跟踪标的指数的成份股,力争获得与标的指数相一致的长期资本增值...

2.3 基金管理人及基金托管人 名称: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

2.4 信息披露方式 基金年度报告全文的披露网址: http://www.sfnf.com.cn

3.1 主要财务数据和财务指标 金额单位:人民币元

3.2 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:沪深300价格指数收益率

3.3 基金投资策略 本基金为被动式指数基金,跟踪标的指数的成份股,力争获得与标的指数相一致的长期资本增值...



3.4 基金管理人情况 4.1 基金管理人及其基金管理人情况

4.2 基金业绩比较基准 4.3 基金投资策略

4.4 基金管理人及其基金管理人情况 4.5 基金业绩比较基准

4.6 基金投资策略 4.7 基金管理人及其基金管理人情况

4.8 基金管理人及其基金管理人情况 4.9 基金业绩比较基准

以上对所采用的估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告,定价服务机构按照合同约定提供定价服务...

4.7 基金合同约定,本基金的收益分配原则为:当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到14%以上时,可进行收益分配...

5.1 报告期内本基金经理人遵守情况声明 本报告期内,本基金经理人在南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格按照《证券投资基金法》...

5.2 托管人报告 本报告期内,南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金的托管人——南方基金管理有限公司,严格按照《证券投资基金法》...

5.3 会计师事务所报告 本会计师事务所接受南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金管理人委托,按照中国注册会计师执业准则...

5.4 年度财务报表 7.1 资产负债表 资产 2014年12月31日 2013年12月31日

Table with 3 columns: Item, 2014年12月31日, 2013年12月31日. Rows include 流动资产, 非流动资产, 资产总计.

7.2 利润表 项目 2014年1月1日至2014年12月31日 2013年1月1日至2013年12月31日

Table with 3 columns: Item, 2014年1月1日至2014年12月31日, 2013年1月1日至2013年12月31日. Rows include 营业收入, 营业支出, 利润总额.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表 项目 2014年1月1日 2014年12月31日 2013年1月1日 2013年12月31日

Table with 5 columns: Item, 2014年1月1日, 2014年12月31日, 2013年1月1日, 2013年12月31日. Rows include 基金份额持有人权益.

7.4 投资组合报告 7.4.1 基金资产配置情况 7.4.2 基金行业配置情况

Table with 3 columns: 代码, 名称, 公允价值. Rows include 股票, 债券, 其他资产.

7.4.3 基金业绩比较基准 7.4.4 基金投资策略

7.4.5 基金管理人及其基金管理人情况 7.4.6 基金业绩比较基准

7.4.3 关联方关系 关联方名称 与本基金的关系

7.4.4 1 关联方关系 7.4.4.1 关联方关系 7.4.4.2 关联方关系

7.4.4.1 关联方关系 7.4.4.2 关联方关系 7.4.4.3 关联方关系

7.4.4.4 关联方关系 7.4.4.5 关联方关系

7.4.4.6 关联方关系 7.4.4.7 关联方关系

7.4.4.8 关联方关系 7.4.4.9 关联方关系

7.4.4.10 关联方关系 7.4.4.11 关联方关系

7.4.4.12 关联方关系 7.4.4.13 关联方关系

7.4.4.14 关联方关系 7.4.4.15 关联方关系

7.4.4.16 关联方关系 7.4.4.17 关联方关系

7.4.4.18 关联方关系 7.4.4.19 关联方关系

7.4.4.20 关联方关系 7.4.4.21 关联方关系

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.sfnf.com.cn的年度报告正文。

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(人民币元). Rows include 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(人民币元). Rows include 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(人民币元). Rows include 21, 22, 23, 24, 25, 26, 27, 28, 29, 30.

注:卖出包括二级市场主动的卖出,换股、要约收购、发行人回购及发行等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不涉及相关交易费用。

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(人民币元). Rows include 31, 32, 33, 34, 35, 36, 37, 38, 39, 40.

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 持有人户名(户), 持有基金份额, 机构投资者, 个人投资者.

9.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构 9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(人民币元). Rows include 41, 42, 43, 44, 45, 46, 47, 48, 49, 50.

9.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构 9.3.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构