



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

2014年12月31日

截至报告期末,本基金份额净值为0.5182元,报告期内,份额净值增长率为67.00%,同期业绩基准增长率为64.13%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
2014年,中国经济处于改革转型中的增速下降时期,针对当前经济状况,中央提出经济“新常态”的概念,我国政府主导的一系列国家,如国企改革、土地改革、一带一路等,都将经济结构带来深层次的改变,同时创造出众多的投资机会,随着稳增长政策的持续出台,经济增长质量将得到明显改善,短期经济数据反复并不改变市场长期走势,随着沪港通、深港通的陆续开港,海外资金将加大对A股的配置力度。展望2015年,经济改革预期强化,各路资金转入市场,预计A股震荡走势将更加明显。

本基金为指数化产品,作为基金管理人,我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度,恪守指数化投资的宗旨,实现对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之一致的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格,借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对于报告期内本基金投资运作等事项的说明
根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的规定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及复核工作的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在±25%以内时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告,定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的顺利开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总经理、权益投资部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及基金会计负责人等,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方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值调整各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
本基金合同约定,本基金的收益分配原则为:当基金份额净值增长率超过指数的同期增长率率达到1%以上,可进行收益分配。在收益评价日,基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数的同期增长率。基金份额净值增长率=收益评价日基金份额净值/基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%(期间发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算),收益评价日的指数同期增长率=收益评价日的指数收盘值与基金上市前一目标的指数收盘值之比减去1乘以100%(期间发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算)。本基金收益分配后基金份额净值不得低于面值,本基金每年收益分配次数最多为12次,基金份额净值每次收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;本基金收益分配采取现金分红方式;若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;本基金份额净值有同等分配权,法律法规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情况,本报告期末本基金未分配利润。

4.8 报告期末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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内,本基金托管人在对中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 管理人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各方面的运作严格按照基金合同的规定进行。
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的中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金2014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

本基金的2014年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2015)第20361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
报告截止日:2014年12月31日

资产	本报告 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	5,482,927.35	1,917,227.59
结算备付金	25,775.66	41,579.09
存出保证金	6,307.12	8,955.93
交易性金融资产	492,925,453.67	201,289,250.19
其中:股票投资	492,925,453.67	201,419,250.19
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	100,167.17	-
其他应收款	1,144.16	452.34
应收利息	-	-
应收中期票据	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	498,541,775.13	201,387,466.14
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	-	-
应付短期融资券	-	-
应付票据	-	-
应付账款	-	-
应付证券清算款	146,999.42	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	121,551.66	88,802.75
应付托管费	24,278.51	17,778.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	354,305.32	131,324.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	381,845.21	209,171.02
负债合计	1,028,771.92	447,162.10
所有者权益:		
实收基金	385,889,497.59	262,894,575.34
未分配利润	111,623,508.62	-99,594,277.32
所有者权益合计	497,513,003.21	202,940,298.02
负债和所有者权益总计	498,541,775.13	201,387,466.14

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值0.5182元,基金份额总额960,057,409.00份。

7.2 利润表

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	121,557,494.26	-21,613,499.48
1.利息收入	19,709.94	33,153.41
其中:存款利息收入	19,692.92	33,153.41
债券利息收入	18.02	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	32,623,557.18	-35,009,926.30
其中:股票投资收益	27,973,584.66	-40,734,620.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,634.78	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	4,643,337.94	5,724,094.56
3.其他综合收益	88,786,268.42	13,295,339.80
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他	68,773,062.67	67,933.61
减:二、费用	2,143,017.44	2,636,569.36
1.管理费用	965,742.20	1,239,107.37
2.托管费	193,148.47	247,821.47
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	368,732.27	504,352.92
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	615,393.50	645,267.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	119,414,476.82	-64,280,084.94
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	119,414,476.82	-64,280,084.94

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
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
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

项目	2014年1月1日 期初余额	2014年12月31日 期末余额	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	262,894,575.34	-39,054,277.32	202,940,298.02
二、本期综合收益产生的基金净值变动(金额以“+”号填列)	-	119,414,476.82	119,414,476.82
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额以“-”号填列)	122,994,922.25	52,163,306.12	175,158,228.37
其中:申购(赎回)“+”号填列)	721,087,876.29	-59,941,055.88	661,146,840.41
基金转换	-598,002,954.04	112,104,342.00	-485,988,612.04
四、本期基金份额持有人申购/赎回产生的基金净值变动(金额以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	385,889,497.59	111,623,508.62	497,513,003.21

本报告截止于财务报表的组成部份。

本报告于1至7.4 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报告附注

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601688	中国铁建	10,364,537.00	5.11
2	600887	伊泰股份	9,028,268.29	3.95
3	601818	光大银行	7,440,849.99	3.62
4	600837	南通证券	6,852,169.74	3.38
5	601006	大秦铁路	4,480,736.50	2.21
6	600585	海螺水泥	4,336,877.47	2.14
7	601939	绿达银行	3,197,646.46	1.58
8	600839	四川长虹	3,002,200.00	1.48
9	600090	青岛海尔	2,757,166.27	1.36
10	601186	中国铁建	2,688,650.00	1.32
11	601000	中国铝业	2,580,714.74	1.26
12	601018	中国中铁	2,474,167.00	1.22
13	600027	华电国际	2,408,254.66	1.19
14	600418	江苏汽车	2,391,733.64	1.18
15	600827	鲁银债投	2,235,288.02	1.10
16	600795	国电电力	2,136,774.00	1.05
17	600547	山东黄金	1,857,220.20	0.92
18	600362	江西铜业	1,734,219.29	0.85
19	600348	南京钢铁	1,711,443.43	0.84
20	600060	中信证券	1,565,172.00	0.77

注:买入包括一级市场上主要的买入、新股、竞价、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额或成交单乘以成交数量填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601688	中国铁建	13,778,393.03	6.79
2	600887	伊泰股份	11,396,647.60	5.62
3	600300	长江电力	8,408,119.65	4.14
4	600919	国电电力	5,489,646.76	2.71
5	601601	中国太保	5,275,032.71	2.60
6	600887	伊泰股份	4,753,744.85	1.99
7	600505	中国铝业	3,853,996.00	1.90
8	601186	中国铁建	2,691,879.71	1.33
9	600027	华电国际	2,657,064.31	1.31
10	601800	中国交建	2,533,070.00	1.25
11	601006	大秦铁路	2,262,560.00	1.09
12	600585	海螺水泥	2,029,971.98	1.00
13	601000	中国铝业	1,992,029.00	0.98
14	600188	洛阳钼业	1,892,545.10	0.93
15	600166	福耀汽车	1,794,184.00	0.88
16	601169	北京银行	1,676,102.00	0.83
17	601390	中国中铁	1,652,099.00	0.81
18	601336	新华保险	1,567,028.85	0.77
19	601168	中国矿业	1,542,540.00	0.76
20	601111	华能国际	1,415,943.71	0.70

注:卖出包括一级市场上主要的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额或成交单乘以成交数量填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本	卖出股票收入
131,710,045.12	113,195,365.17

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人将按照风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,307.12
2	应收证券清算款	100,167.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,144.16
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,618.45

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:无

8.9 基金份额持有人信息

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者持有份额	个人投资者持有份额
5,103	188,135.88	835,252,530.00	87,009

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额(份)	占基金份额比例
中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金	826,447,300.00	86.08%

注:机构投资者持有“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行-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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末本基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占基金份额比例(%)
1	方正证券股份有限公司	3,344,300.00	0.33%
2	江苏证券股份有限公司	3,195,322.00	0.33%
3	中国平安人寿保险股份有限公司-万能-个险万能	2,063,000.00	0.22%
4	德盛安	1,780,000.00	0.18%
5	赫达	1,609,000.00	0.17%
6	源汉源	1,386,000.00	0.14%
7	叶代伟	1,361,000.00	0.14%
8	叶代伟	1,081,446.00	0.11%
9	华安证券股份有限公司	1,085,000.00	0.11%
10	陈建强	1,011,500.00	0.11%
11	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	826,447,300.00	86.08%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的所有从业人员(含高级管理人员、基金投资和研究人员)均持有本基金。

9.4 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.5 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.6 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.7 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.8 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.9 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.10 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.11 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.12 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.13 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.14 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.15 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.16 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.17 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.18 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.19 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。

9.20 期末基金基金经理的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的基金经理持有本基金。