

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

1.1 重要提示
基金管理人、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。

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,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,投资者有风险,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更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本年度报告自2015年1月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况
基金名称:南方小康ETF联接
基金代码:160168

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
基金合同生效日期:2010年8月27日

2.1.1 目标基金基本情况
基金名称:中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金

基金代码:160168
基金管理人:南方基金管理有限公司

基金合同生效日期:2010年8月27日
基金上市交易所:上海证券交易所

2.2 基金业绩表现
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“南方小康”。

2.3 基金投资组合
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”。

2.4 基金投资策略
本基金为完全复制式指数基金,跟踪中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金。

2.5 基金风险收益特征
本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.6 基金费用
本基金的管理费、托管费、销售服务费、申购赎回费、基金赎回费、基金转换费等。

2.7 基金分红
本基金在符合基金合同约定条件下,可以进行分红。

2.8 基金信息披露
本基金的信息披露遵循相关法律法规的要求。

2.9 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.10 基金管理人承诺
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。

2.11 基金托管人承诺
基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产。

2.12 基金销售
本基金在全国各大银行、证券公司、基金销售机构均有销售。

2.13 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.14 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.15 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.16 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.17 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.18 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.19 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.20 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.21 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.22 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.23 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.24 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.25 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.26 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.27 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.28 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.29 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.30 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.31 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.32 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.33 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.34 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.35 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.36 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.37 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.38 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.39 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.40 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.41 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.42 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.43 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.44 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.45 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.46 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.47 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.48 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.49 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.50 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.51 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.52 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.53 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.54 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.55 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.56 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.57 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.58 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.59 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.60 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.61 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.62 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.63 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.64 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.65 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.66 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.67 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.68 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.69 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.70 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.71 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.72 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.73 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.74 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.75 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.76 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.77 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

2.78 基金其他重要事项
本基金的其他重要事项包括基金合同的变更、终止等。

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

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

供研究、交易、系统及其相关工作的高效支持响应。
对于本基金而言,本报告期跟踪误差的主要来源包括:①本基金自身接受的申购赎回所带来的股票仓位偏离,对此我们通过日内持仓交易争取跟踪误差最小化;②本基金大额换购目标ETF所带来的成份股买入/卖出导致的“再平衡”操作进行应对;③指数成份股调整所带来的跟踪误差。

4.2 报告期内基金的业绩表现
本基金自建仓以来至本报告期末的指数跟踪期间,相对于业绩基准的年化跟踪误差为0.959%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过4%的投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为1.1379元,累计净值为1.1579元。报告期内,份额净值增长率为63.14%,同期业绩基准增长率为60.29%。

4.3 管理人对宏观经济、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策,如国企改革、土地改革、“一带一路”等,将给经济带来深刻而持久的改变,同时创造出更多的投资机会。随着稳增长政策的持续,经济基本面将得到明显改善,短期经济数据反复并不改变长期向好趋势,随着稳增长、促改革、调结构的持续推进,海外资金加大对A股的配置力度,展望2015年,经济复苏预期将深化,各路资金持续入场,预计A股震荡走势将更加强劲。

本基金作为指数化产品,作为基金管理人,我们将通过专业的投资管理流程、精确的数量化计量、精益求精的工作态度,恪守指数化投资的理念,针对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之相应的收益,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。

4.4 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
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约定,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净值计算的复核责任,会计师事务所则在估值调整导致基金资产净值的变化(即≥25%以上)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证估值工作的合规性,建立了估值委员会和执行工作的专门机构,成员包括副总经理、权益投资部负责人、风险管理部负责人、基金会计负责人等,其中,超过二分之一以上的人员具有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,基金估值程序符合法律法规及基金合同的约定,但不参与估值程序的最后决策,本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.5 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:每一基金份额享有同等分配权;若(基金合同)生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;本基金收益分配基准日(即期末)可供分配利润计算截止日,在符合相关基金分红条件的前提下,本基金收益分配每年最多6次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%;本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或在现金分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红,法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

4.6 基金合同约定的基金的实际运作情况,本报告期末基金未付分配事项。
4.8 报告期内管理人对本基金持有人户数或基金份额净值预警情形的说明
无。

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
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联接基金的投资管理过程中,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 托管人对报告期内本基金投资遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
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联接基金的投资管理——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联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各项业务方面均严格按照基金合同的约定进行。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联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息的真实、准确和完整发表意见
5.4 托管人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联接基金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 审计师报告
6.1 注册会计师出具了普华永道中天审字(2015)第20362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 资产负债表
7.1 资产: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
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

项目 2014年12月31日 2013年12月31日

流动资产: 39,311,030.09 8,731,076.30

其中:货币资金 999,879.52 999,879.52

交易性金融资产 13,130.60 12,588.38

可供出售金融资产 431,326,729.94 165,906,733.50

其中:股票投资 3,063,729.08 776,103.50

其中:债券投资 428,264,998.86 165,130,630.00

其中:资产支持证券投资 -- --

其中:买入返售金融资产 -- --

应收利息 117,736.34 2,836 --

应收股利 6,384.90 2,348.80

其他应收款 19,752,826.25 13,976.67

其他流动资产 19,911.81 --

资产总计 491,583,129.94 175,786,588.37

负债和所有者权益: 788,644.10 145,185.46

其中:短期借款 -- --

交易性金融负债 -- --

应付利息 8,905.16 4,452.49

应付股利 1,781.06 890.50

应付债券 -- --

应付账款 -- --

预收款项 -- --

应付职工薪酬 186,431.61 7,595.45

应交税费 -- --

应付利息 -- --

应付股利 -- --

其他应付款 312,325.52 15,782.56

其他负债 18,361,796.80 33,096.46

所有者权益: 415,819,580.92 251,582,524.43

其中:实收资本 25,388,922.22 26,709,808.22

未分配利润 47,188,414.14 175,472,419.91

所有者权益合计 491,583,129.94 175,786,588.37

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.1379元,基金份额总额415,819,580.92份。

7.2 利润表
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联接基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

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

一、收入 99,595,681.72 -19,748,499.22

1.利息收入 83,293.55 94,783.81

其中:存款利息收入 83,293.55 94,783.82

债券利息收入 -- 0.79

其他利息收入 -- --

2.投资收益(损失以“-”号填列) -9,262,864.43 -9,265,007.83

其中:股票投资收益 1,046,304.30 21,806.16

其中:债券投资收益 -9,893,796.31 -9,291,841.26

其中:资产支持证券投资 -- --

公允价值变动收益 18,771 --

3.其他综合收益 -- --

4.汇兑收益(损失以“-”号填列) 20,624.54 4,799.56

5.其他收入(损失以“-”号填列) 71,752.52 --

二、费用 720,207.11 512,800.22

1.管理费用 51,448.88 58,890.32

2.托管费 10,288.82 11,161.10

3.销售服务费 -- --

4.交易费用 303,554.41 90,714.58

5.利息支出 -- --

其中:卖出回购金融资产支出 -- --

6.其他费用 355,219.00 355,263.00

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) 98,875,474.61 -20,260,807.24

减:所得税费用 -- --

四、净利润(净亏损以“-”号填列) 98,875,474.61 -20,260,807.24

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联接基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

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

一、期初所有者权益(基金净值) 251,582,524.43 -76,109,800.52

二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(减少以“-”号填列) 164,257,528.49 34,585,193.15

其中:基金申购 323,585,219.23 17,857,187.13

其中:基金赎回 -159,347,890.74 17,525,971.98

三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列) -78,759,292.31 21,019,975.51

四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(净额以“-”号填列) 415,819,580.92 87,348,832.22

五、期末所有者权益(基金净值) 251,582,524.43 -76,109,800.52

本报告作为财务报表的组成部分。
附注7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:
杨小松 徐超

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 报表附注
7.4.1 会计政策变更的说明
7.4.1.1 会计政策变更的说明
7.4.1.2 会计政策变更的说明

7.4.1.3 会计政策变更的说明
7.4.1.4 会计政策变更的说明

7.4.1.5 会计政策变更的说明
7.4.1.6 会计政策变更的说明

7.4.1.7 会计政策变更的说明
7.4.1.8 会计政策变更的说明

7.4.1.9 会计政策变更的说明
7.4.1.10 会计政策变更的说明

7.4.1.11 会计政策变更的说明
7.4.1.12 会计政策变更的说明

7.4.1.13 会计政策变更的说明
7.4.1.14 会计政策变更的说明

7.4.1.15 会计政策变更的说明
7.4.1.16 会计政策变更的说明

7.4.1.17 会计政策变更的说明
7.4.1.18 会计政策变更的说明

7.4.1.19 会计政策变更的说明
7.4.1.20 会计政策变更的说明

7.4.1.21 会计政策变更的说明
7.4.1.22 会计政策变更的说明

7.4.1.23 会计政策变更的说明
7.4.1.24 会计政策变更的说明

7.4.1.25 会计政策变更的说明
7.4.1.26 会计政策变更的说明

7.4.1.27 会计政策变更的说明
7.4.1.28 会计政策变更的说明

7.4.1.29 会计政策变更的说明
7.4.1.30 会计政策变更的说明

7.4.1.31 会计政策变更的说明
7.4.1.32 会计政策变更的说明

7.4.1.33 会计政策变更的说明
7.4.1.34 会计政策变更的说明

7.4.1.35 会计政策变更的说明
7.4.1.36 会计政策变更的说明

7.4.1.37 会计政策变更的说明
7.4.1.38 会计政策变更的说明

7.4.1.39 会计政策变更的说明
7.4.1.40 会计政策变更的说明

7.4.1.41 会计政策变更的说明
7.4.1.42 会计政策变更的说明

7.4.1.43 会计政策变更的说明
7.4.1.44 会计政策变更的说明

7.4.1.45 会计政策变更的说明
7.4.1.46 会计政策变更的说明

7.4.1.47 会计政策变更的说明
7.4.1.48 会计政策变更的说明