

南方中证50债券指数证券投资基金(LOF)

2014 年度 报告摘要

2014年12月31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
送出日期:2015年3月26日
1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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法律责任。

2.1 基金基本情况
基金简称:南方中证50债券指数(LOF)
基金代码:160123
基金运作方式:上市型开放式(L-OF)
基金存续日期:2011年5月17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

2.2 基金产品说明
本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律和量化的风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略:本基金为被动式指数基金,采用复制复制法,主要跟踪标的指数的成份券或为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元
2014年 2013年 2012年

Table with 7 columns: 2014年, 2013年, 2012年, 本期已实现收益, 本期利润总额, 加权平均基金份额净值增长率, 基金份额持有人户数, 期末基金份额总额, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值

3.2 基金净值表现
本基金自成立以来的业绩表现,本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

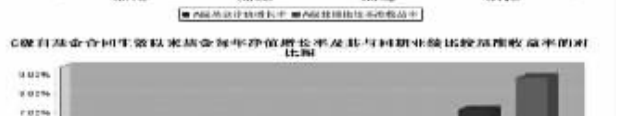
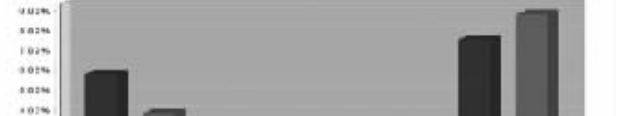
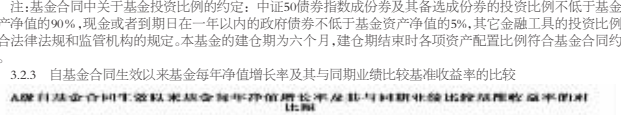
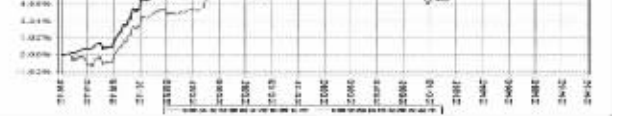
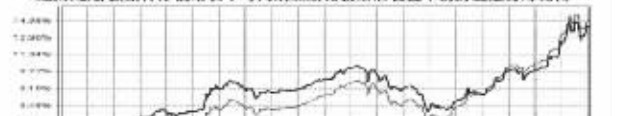


Table with 5 columns: 年份, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 基金份额持有人户数, 期末基金份额净值

Table with 5 columns: 年份, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 基金份额持有人户数, 期末基金份额净值

Table with 5 columns: 年份, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 基金份额持有人户数, 期末基金份额净值

Table with 5 columns: 年份, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 基金份额持有人户数, 期末基金份额净值

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明

注:1. 对基金的历任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定解聘日期。
2. 离任日期:指基金经理离任公告中披露的离任日期。

3. 基金经理:指基金经理离任公告中披露的离任日期。
4. 基金经理:指基金经理离任公告中披露的离任日期。

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
1998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,成为中国“基金时代”的起始标志。

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: 曹卫
职务: 基金经理
任职日期: 2011年7月25日
离任日期: 无

4.2 基金管理人内部控制制度
4.2.1 内部控制制度概述
4.2.2 内部控制制度的执行情况

4.3 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.3.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.3.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.4 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.4.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.4.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.5 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.5.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.5.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.6 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.6.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.6.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.7 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.7.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.7.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.8 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.8.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.8.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.9 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.9.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.9.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.10 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.10.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.10.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.11 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.11.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.11.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.12 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.12.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.12.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.13 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.13.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.13.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.14 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.14.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.14.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.15 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.15.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.15.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.16 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.16.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.16.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.17 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.17.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.17.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.18 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.18.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.18.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.19 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.19.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.19.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

4.20 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.20.1 基金管理人内部控制制度的执行情况
4.20.2 基金管理人内部控制制度的执行情况

Table with 5 columns: 项目, 本期, 上期, 上期, 上期

注:1. 本基金本报告期未发生赎回款项。
2. 本基金本报告期未发生赎回款项。

3. 本基金本报告期未发生赎回款项。
4. 本基金本报告期未发生赎回款项。

4. 本基金本报告期未发生赎回款项。
5. 本基金本报告期未发生赎回款项。

5. 本基金本报告期未发生赎回款项。
6. 本基金本报告期未发生赎回款项。

6. 本基金本报告期未发生赎回款项。
7. 本基金本报告期未发生赎回款项。

7. 本基金本报告期未发生赎回款项。
8. 本基金本报告期未发生赎回款项。

8. 本基金本报告期未发生赎回款项。
9. 本基金本报告期未发生赎回款项。

9. 本基金本报告期未发生赎回款项。
10. 本基金本报告期未发生赎回款项。

10. 本基金本报告期未发生赎回款项。
11. 本基金本报告期未发生赎回款项。

11. 本基金本报告期未发生赎回款项。
12. 本基金本报告期未发生赎回款项。

12. 本基金本报告期未发生赎回款项。
13. 本基金本报告期未发生赎回款项。

13. 本基金本报告期未发生赎回款项。
14. 本基金本报告期未发生赎回款项。

14. 本基金本报告期未发生赎回款项。
15. 本基金本报告期未发生赎回款项。

15. 本基金本报告期未发生赎回款项。
16. 本基金本报告期未发生赎回款项。

16. 本基金本报告期未发生赎回款项。
17. 本基金本报告期未发生赎回款项。

17. 本基金本报告期未发生赎回款项。
18. 本基金本报告期未发生赎回款项。

18. 本基金本报告期未发生赎回款项。
19. 本基金本报告期未发生赎回款项。

19. 本基金本报告期未发生赎回款项。
20. 本基金本报告期未发生赎回款项。

20. 本基金本报告期未发生赎回款项。
21. 本基金本报告期未发生赎回款项。

21. 本基金本报告期未发生赎回款项。
22. 本基金本报告期未发生赎回款项。

22. 本基金本报告期未发生赎回款项。
23. 本基金本报告期未发生赎回款项。

23. 本基金本报告期未发生赎回款项。
24. 本基金本报告期未发生赎回款项。

24. 本基金本报告期未发生赎回款项。
25. 本基金本报告期未发生赎回款项。

25. 本基金本报告期未发生赎回款项。
26. 本基金本报告期未发生赎回款项。

Table with 5 columns: 债券代码, 债券名称, 赎回日期, 期末估值净值, 数量(张), 期末估值总额

4.5.2.2 交易所非国债类债券正回购
截至本报告期末: 2014年12月31日止, 本基金从事证券交易所非国债类债券正回购交易形成的卖出回购债券余额为0。

8 投资组合报告
8.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.4 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
本基金本报告期末未持有股票。

8.5 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
本基金本报告期末未持有股票。

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
单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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
本基金本报告期末未持有股票。

8.8 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
本基金本报告期末未持有股票。

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
本基金本报告期末未持有股票。

8.10 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股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.11 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国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.12 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.13 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.14 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.15 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.16 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.17 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.18 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.19 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.20 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.21 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.22 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.23 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有股票。