

南方开元沪深300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

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

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:南方开元沪深300ETF联接
基金代码:200205

2.2 基金投资组合
截至2014年12月31日,本基金资产组合如下:
股票投资:1,740,693,350.50元
债券投资:27,350.40元

2.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

2.4 基金投资策略
本基金为被动式指数基金,采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

2.5 基金风险收益特征
本基金属于股票型基金,风险和收益高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

2.6 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

2.7 基金销售机构
基金销售机构:南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

3.1 主要财务数据和财务指标
3.1.1 本期主要财务数据和财务指标
3.1.2 本期主要财务数据和财务指标

3.2 基金份额持有人数量及持有基金份额集中度
截至2014年12月31日,本基金基金份额持有人数量为1,243,313人。

3.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

3.4 基金投资策略
本基金为被动式指数基金,采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。

3.5 基金风险收益特征
本基金属于股票型基金,风险和收益高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

3.6 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

3.7 基金销售机构
基金销售机构:南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

3.8 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

3.9 基金投资策略
本基金为被动式指数基金,采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。

3.10 基金风险收益特征
本基金属于股票型基金,风险和收益高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

3.11 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

3.12 基金销售机构
基金销售机构:南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

3.13 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

3.14 基金投资策略
本基金为被动式指数基金,采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。

3.15 基金风险收益特征
本基金属于股票型基金,风险和收益高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

3.16 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

3.17 基金销售机构
基金销售机构:南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

3.18 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

3.19 基金投资策略
本基金为被动式指数基金,采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。

3.20 基金风险收益特征
本基金属于股票型基金,风险和收益高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

3.21 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

3.22 基金销售机构
基金销售机构:南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

6.6 审计报告
6.7 年度财务报表
7.1 资产负债表

7.2 利润表
7.3 所有者权益变动表
7.4 现金流量表

7.5 关联方关系及其交易
7.6 关联方交易
7.7 关联方交易

7.8 关联方交易
7.9 关联方交易
7.10 关联方交易

7.11 关联方交易
7.12 关联方交易
7.13 关联方交易

7.14 关联方交易
7.15 关联方交易
7.16 关联方交易

7.17 关联方交易
7.18 关联方交易
7.19 关联方交易

7.20 关联方交易
7.21 关联方交易
7.22 关联方交易

7.23 关联方交易
7.24 关联方交易
7.25 关联方交易

7.26 关联方交易
7.27 关联方交易
7.28 关联方交易

7.29 关联方交易
7.30 关联方交易
7.31 关联方交易

7.32 关联方交易
7.33 关联方交易
7.34 关联方交易

7.35 关联方交易
7.36 关联方交易
7.37 关联方交易

7.38 关联方交易
7.39 关联方交易
7.40 关联方交易

7.41 关联方交易
7.42 关联方交易
7.43 关联方交易

7.44 关联方交易
7.45 关联方交易
7.46 关联方交易

7.47 关联方交易
7.48 关联方交易
7.49 关联方交易

7.50 关联方交易
7.51 关联方交易
7.52 关联方交易

7.53 关联方交易
7.54 关联方交易
7.55 关联方交易

7.56 关联方交易
7.57 关联方交易
7.58 关联方交易

7.59 关联方交易
7.60 关联方交易
7.61 关联方交易

7.62 关联方交易
7.63 关联方交易
7.64 关联方交易

7.65 关联方交易
7.66 关联方交易
7.67 关联方交易

7.68 关联方交易
7.69 关联方交易
7.70 关联方交易

7.71 关联方交易
7.72 关联方交易
7.73 关联方交易

7.74 关联方交易
7.75 关联方交易
7.76 关联方交易

7.77 关联方交易
7.78 关联方交易
7.79 关联方交易

7.80 关联方交易
7.81 关联方交易
7.82 关联方交易

7.83 关联方交易
7.84 关联方交易
7.85 关联方交易

7.86 关联方交易
7.87 关联方交易
7.88 关联方交易

8.1 基金投资组合
8.2 基金业绩比较基准
8.3 基金投资策略

8.4 基金风险收益特征
8.5 基金管理人及基金托管人
8.6 基金销售机构

8.7 基金业绩比较基准
8.8 基金投资策略
8.9 基金风险收益特征

8.10 基金管理人及基金托管人
8.11 基金销售机构
8.12 基金业绩比较基准

8.13 基金投资策略
8.14 基金风险收益特征
8.15 基金管理人及基金托管人

8.16 基金销售机构
8.17 基金业绩比较基准
8.18 基金投资策略

8.19 基金风险收益特征
8.20 基金管理人及基金托管人
8.21 基金销售机构

8.22 基金业绩比较基准
8.23 基金投资策略
8.24 基金风险收益特征

8.25 基金管理人及基金托管人
8.26 基金销售机构
8.27 基金业绩比较基准

8.28 基金投资策略
8.29 基金风险收益特征
8.30 基金管理人及基金托管人

8.31 基金销售机构
8.32 基金业绩比较基准
8.33 基金投资策略

8.34 基金风险收益特征
8.35 基金管理人及基金托管人
8.36 基金销售机构

8.37 基金业绩比较基准
8.38 基金投资策略
8.39 基金风险收益特征

8.40 基金管理人及基金托管人
8.41 基金销售机构
8.42 基金业绩比较基准

8.43 基金投资策略
8.44 基金风险收益特征
8.45 基金管理人及基金托管人

8.46 基金销售机构
8.47 基金业绩比较基准
8.48 基金投资策略

8.49 基金风险收益特征
8.50 基金管理人及基金托管人
8.51 基金销售机构

8.52 基金业绩比较基准
8.53 基金投资策略
8.54 基金风险收益特征

8.55 基金管理人及基金托管人
8.56 基金销售机构
8.57 基金业绩比较基准

8.58 基金投资策略
8.59 基金风险收益特征
8.60 基金管理人及基金托管人

8.61 基金销售机构
8.62 基金业绩比较基准
8.63 基金投资策略

8.64 基金风险收益特征
8.65 基金管理人及基金托管人
8.66 基金销售机构

8.67 基金业绩比较基准
8.68 基金投资策略
8.69 基金风险收益特征

8.70 基金管理人及基金托管人
8.71 基金销售机构
8.72 基金业绩比较基准

8.73 基金投资策略
8.74 基金风险收益特征
8.75 基金管理人及基金托管人

8.76 基金销售机构
8.77 基金业绩比较基准
8.78 基金投资策略

8.79 基金风险收益特征
8.80 基金管理人及基金托管人
8.81 基金销售机构

8.82 基金业绩比较基准
8.83 基金投资策略
8.84 基金风险收益特征

8.85 基金管理人及基金托管人
8.86 基金销售机构
8.87 基金业绩比较基准

8.88 基金投资策略
8.89 基金风险收益特征
8.90 基金管理人及基金托管人

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1.53, 1.34, 1.33, 0.89, 0.83, 0.74, 0.65, 0.64, 0.60, 0.54, 0.52, 0.50, 0.49, 0.46, 0.46, 0.45, 0.44, 0.41, 0.40, 0.39

注:卖出包括二级市场主动的买卖,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(成交金额乘以成交比例)填写,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额
单位:人民币元
买入股票成本:506,436,316.28
卖出股票收入:576,654,440.26

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交金额乘以成交比例)填写,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券:

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
本基金本报告期末持有债券:

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券:

8.8 报告期末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
本基金本报告期末持有贵金属:

8.9 报告期末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权证:

8.10 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 管理人, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货:

8.12 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.13 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.14 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.15 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.16 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.17 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.18 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.19 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.20 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.21 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.22 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.23 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.24 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.25 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.26 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.27 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.28 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.29 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.30 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.31 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.32 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.33 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.34 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.35 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.36 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.37 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.38 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.39 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权:

8.40 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:

8.41 报告期末本基金投资的期权投资情况说明
本基金本报告期末未持有期权: