

南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

2016年度报告摘要

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:2017年3月30日

§ 1 重要提示及目录

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、误导性陈述或者重大遗漏，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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2017年3月27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全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方恒生交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方恒生ETF
基金主代码	613000
基金运作方式	契约型开放式(ETP)
基金合同生效日	2014年12月23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
报告期基金总资产	26,029,600.00元
基金合同存续期	不定期
基金上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016年1月6日

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露方式下，可简称“南方恒生ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪恒生指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用指数基金的运用和复制策略。本基金将指数成份股在标的指数中的权重比例在正常情况下保持在95%左右，通过定期调整和不定期的现金差额调整，使本基金的跟踪误差控制在0.5%以内。
业绩比较基准	恒生综合指数
风险收益特征	本基金是一只风险较高的股票型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
2.3 基金管理人和基金托管人	

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
住所	深圳市深南大道1008号	北京市西城区复兴门内大街1号
信息披露负责人	姚文波	010-66106769
电子邮箱	manager@sfund.com	custody@icbc.com
客户服务电话	400-889-8899	96688
传真	0755-82638899	010-66106769

2.4 信息披露方式

基金管理人和基金托管人通过互联网网址: <http://www.sfund.com>

基金管理人和基金托管人办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1088号

§ 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

金额单位:人民币元

主要财务指标	2016年		2015年		2014年	
	年初至报告期期末	报告期	年初至报告期期末	报告期	年初至报告期期末	报告期
1.1 利润	-4,630,776.60	22,326,000.44	-2,211,000.00	10,262,626.61	-1,061,110.00	10,262,626.61
1.2 利润率	-0.015%	0.82%	-0.005%	0.47%	-0.001%	0.47%
1.3 净资产收益率	0.047%	0.089%	0.000%	0.000%	0.000%	0.000%
1.4 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
1.5 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
1.6 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
1.7 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
1.8 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
1.9 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.0 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.1 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.2 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.3 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.4 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.5 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.6 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.7 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.8 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.9 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.10 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.11 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.12 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.13 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.14 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.15 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.16 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.17 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.18 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.19 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.20 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.21 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.22 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.23 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.24 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.25 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.26 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.27 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.28 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.29 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.30 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.31 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.32 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.33 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.34 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.35 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.36 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.37 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.38 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.39 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.40 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.41 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.42 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.43 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.44 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.45 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.46 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.47 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.48 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.49 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.50 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.51 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.52 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.53 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.54 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2.55 净资产收益率	0.04%	-3.26%	0.00%			