

南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

2016年年度报告摘要

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

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、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。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基金更新。

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2016年1月1日起至2016年12月31日止。

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
基金代码	159909
基金运作方式	契约型开放式
基金存续期	不定期
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
报告期末基金份额总额	28,409,300.00份
基金合同生效日期	2015年12月23日
基金管理人网址	www.namfund.com

注：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“南方恒生ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用指数复制法，本基金通过投资于标的指数的成份股票及备选成份股票，以跟踪标的指数的表现，力求获得与投资标的指数相似的回报，在保持基金资产的投资组合与标的指数高度拟合的前提下，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数（使用恒生综合指数），本基金跟踪的标的指数为恒生综合指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，跟踪恒生综合指数，属于中高风险品种，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于港股市场，具有与标的指数和股票市场不同的风险收益特征。本基金主要投资于港股市场，具有与标的指数和股票市场不同的风险收益特征。

2.3 基金管理人、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
办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦37楼	北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人	殷剑峰	姜建清
总经理	张海波	姜建清
督察长	朱海霞	姜建清

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的置备地点：基金管理人、基金托管人的办公地址

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

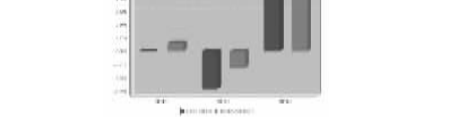
项目	2016年	2015年	2014年
3.1.1 期间损益和净利润	-4,820,775.68	23,338,060.44	221,090.96
3.1.2 期间费用	8,019,494.86	6,022,542.73	221,090.96
3.1.3 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.4 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.5 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.6 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.7 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.8 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.9 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.10 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.11 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.12 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.13 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.14 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.15 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.16 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.17 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.18 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.19 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.20 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.21 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.22 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.23 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.24 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.25 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.26 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.27 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.28 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.29 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.30 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.31 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.32 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.33 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.34 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.35 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.36 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.37 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.38 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.39 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.40 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.41 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.42 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.43 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.44 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.45 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.46 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.47 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.48 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.49 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.50 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.51 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.52 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.53 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.54 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.55 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.56 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.57 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.58 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.59 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.60 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.61 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.62 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.63 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.64 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.65 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.66 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.67 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.68 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.69 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.70 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.71 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.72 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.73 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.74 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.75 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.76 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.77 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.78 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.79 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.80 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.81 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.82 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.83 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.84 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.85 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.86 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.87 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.88 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.89 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.90 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.91 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.92 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.93 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.94 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.95 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.96 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.97 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.98 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.99 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00
3.1.100 期间费用占期间损益的比例	0.17	0.09	0.00

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

注：基金合同关于基金投资比例的约定：本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。本基金的建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同关于基金投资比例的约定：本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。本基金的建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

4.1 基金管理人及基金经营情况

4.1.1 基金管理人及基金经营情况

4.1.2 基金管理人及基金经营情况

4.1.3 基金管理人及基金经营情况

4.1.4 基金管理人及基金经营情况

4.1.5 基金管理人及基金经营情况

4.1.6 基金管理人及基金经营情况

4.1.7 基金管理人及基金经营情况

4.1.8 基金管理人及基金经营情况

4.1.9 基金管理人及基金经营情况

4.1.10 基金管理人及基金经营情况

4.1.11 基金管理人及基金经营情况

4.1.12 基金管理人及基金经营情况

4.1.13 基金管理人及基金经营情况

4.1.14 基金管理人及基金经营情况

4.1.15 基金管理人及基金经营情况

4.1.16 基金管理人及基金经营情况

管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.2 公平交易制度的执行情况

4.2.1 公平交易制度的执行情况

4.2.2 公平交易制度的执行情况

4.2.3 公平交易制度的执行情况

4.2.4 公平交易制度的执行情况

4.2.5 公平交易制度的执行情况

4.2.6 公平交易制度的执行情况

4.2.7 公平交易制度的执行情况

4.2.8 公平交易制度的执行情况

4.2.9 公平交易制度的执行情况

4.2.10 公平交易制度的执行情况

4.2.11 公平交易制度的执行情况

4.2.12 公平交易制度的执行情况

4.2.13 公平交易制度的执行情况

4.2.14 公平交易制度的执行情况

4.2.15 公平交易制度的执行情况

4.2.16 公平交易制度的执行情况

4.2.17 公平交易制度的执行情况

4.2.18 公平交易制度的执行情况

4.2.19 公平交易制度的执行情况

4.2.20 公平交易制度的执行情况

4.2.21 公平交易制度的执行情况

4.2.22 公平交易制度的执行情况

4.2.23 公平交易制度的执行情况

4.2.24 公平交易制度的执行情况

4.2.25 公平交易制度的执行情况

4.2.26 公平交易制度的执行情况

4.2.27 公平交易制度的执行情况

4.2.28 公平交易制度的执行情况

4.2.29 公平交易制度的执行情况

4.2.30 公平交易制度的执行情况

4.2.31 公平交易制度的执行情况

4.2.32 公平交易制度的执行情况

4.2.33 公平交易制度的执行情况

4.2.34 公平交易制度的执行情况

4.2.35 公平交易制度的执行情况

4.2.36 公平交易制度的执行情况

4.2.37 公平交易制度的执行情况

4.2.38 公平交易制度的执行情况

4.2.39 公平交易制度的执行情况

4.2.40 公平交易制度的执行情况

4.2.41 公平交易制度的执行情况

4.2.42 公平交易制度的执行情况

4.2.43 公平交易制度的执行情况

4.2.44 公平交易制度的执行情况

4.2.45 公平交易制度的执行情况

总额26,829,500.00份。

7.2 利润分配

公告主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金
本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期	上期
一、收入	9,162,110.89	10,262,628.61
1.利息收入	29,587.67	382,982.36
其中：存款利息收入	29,587.67	382,982.36
2.股利收入	8,892,423.22	9,879,646.25
其中：股票股利收入	8,892,423.22	9,879,646.25
3.公允价值变动收益	-	-
其中：公允价值变动收益	-	-
4.其他收入	-	-
二、费用	3,476,794.10	3,763,946.56
1.利息费用	-	-
其中：利息费用	-	-
2.其他费用	3,476,794.10	3,763,946.56
其中：其他费用	3,476,794.10	3,763,946.56
三、净利润	5,685,316.79	6,498,682.05
四、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
五、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
六、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
七、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
八、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
九、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十一、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十二、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十三、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十四、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十五、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十六、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十七、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十八、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
十九、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
二十、未分配利润	1,437,490.04	4,396,446.35
二十一、未分配利润	1,437,490.04	4,396,