

信息披露

南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
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。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。

基金托管人中国建设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预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告所载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。

本报告自2016年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方上证380ETF联接
基金简称	南方380
基金代码	040209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月20日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同终止日	如,400,706,223
基金合同存续期	

注:本基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下,可简称为“南方380”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证380交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	380ETF
基金代码	513600
基金运作方式	交易型开放式
基金上市日期	2014年11月11日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注:上证380交易型开放式指数证券投资基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下,可简称为“380ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于380ETF,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,以380ETF作为其主要投资标的,力争所构建投资组合净值增长率与380ETF净值增长率相接近,力争实现日均跟踪偏离度不超过0.2%,跟踪误差控制在0.5%以内。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金属股票基金,预期风险收益水平高于混合基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。本基金的风险收益特征与标的指数所表征的风险收益特征相一致。

2.2.1 目标基金产品说明

基金名称	上证380交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	380ETF
基金代码	513600
基金运作方式	交易型开放式
基金上市日期	2014年11月11日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注:上证380交易型开放式指数证券投资基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下,可简称为“380ETF”。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息联络负责人	姓名: 杨小松 联系电话: 0755-82983888 电子邮箱: yangxiaosong@nffund.com	姓名: 田苗 联系电话: 400-829-8888 电子邮箱: 400829888@ccb.com
传真	0755-82983888	010-66259333

2.4 信息披露方式

基金年度报告登载网址	http://www.nffund.com
基金年度报告登载日期	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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间回报和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-1,217,469.08	83,406,744.81	207,489,456.96
本期利润	-37,579,099.92	90,546,763.38	57,397,793.21
期末基金份额净值	-0.0286	0.0287	0.0289
本期基金份额净值增长率	-13.36%	33.34%	41.15%
3.1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额净值	0.0286	0.0287	0.0289
基金份额净值增长率	13.36%	33.34%	41.15%
基金份额净值增长率	13.36%	33.34%	41.15%

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低者。本期未分配利润,不当期度分配。

3.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平更低于所列数据。

3.2 基金净值表现

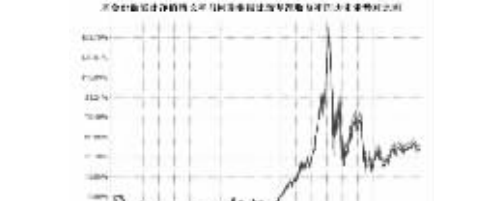
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.1.1 期间回报和指标	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	1.00%	0.09%	0.04%	0.03%	0.06%	-0.01%
过去六个月	4.00%	0.08%	4.17%	0.07%	-0.17%	-0.01%
过去一年	-13.36%	1.76%	-14.64%	1.77%	1.18%	-0.01%
过去三年	19.24%	2.07%	12.40%	2.05%	-6.84%	0.00%
过去五年	70.64%	1.81%	62.40%	1.80%	-8.41%	0.00%
自基金合同生效以来	66.21%	1.76%	60.39%	1.76%	-5.18%	0.00%

注:本基金业绩比较基准为:上证380指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

业绩比较基准在每个估值日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:过去三年本基金未实施利润分配事项。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金运作情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况
1990年6月8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,成为我国“首批基金试点”的创始单位。

南方基金总部设在深圳,注册资本亿元人民币,股权结构为:华泰证券股份有限公司(45%),深圳前海投资控股有限公司(30%),厦门国际信托有限公司(15%),兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方基金管理有限公司(深圳子公司)。

截至报告期末,南方基金管理有限责任公司(不含子公司)管理资产规模近6,500亿元,旗下管理116只开放式基金产品,全部合规运作,基金资产和客户财产均得到安全。

4.1.2 基金治理(或基金治理)及基金治理措施简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限
李伟	基金管理人	2014年11月17日	2016年11月25日	16年

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期;除首任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同约定确定的聘任和解聘日期。

2.证券投资基金的合意通过行业协会《证券投资基金人力资源管理方法》的相关规定。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

注:本基金管理人根据《证券投资基金人力资源管理方法》等相关法规,结合基金实际情况,制定了基金管理人内部管理制度,确保基金管理人内部管理制度得到有效执行。

Disclosure

会计主体:南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	-37,579,099.92	50,500,426.80
1.利息收入	113,228.14	162,879.14
2.公允价值变动收益	720,178.89	-5,944,879.05
3.其他收入	101,079.53	768,579.53
二、费用	0.00	0.00
1.基金管理费	-	-
2.基金托管费	-	-
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	-	-
三、利润总额	-37,579,099.92	44,555,547.65
四、净利润	-37,579,099.92	44,555,547.65

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

注:本基金本报告期无关联方交易。

2016年年度报告摘要

7.4.5 利润分配情况

注:本基金本报告期内无利润分配。

7.4.6 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有流通受限证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.3 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.4 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.5 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.6 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.7 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.8 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.9 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.10 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.11 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.12 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.13 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.14 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.15 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.16 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.18 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.19 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.20 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.21 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.22 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.23 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.24 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.25 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.26 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.27 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.28 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.29 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.30 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.31 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.32 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.33 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.4.6.34 期末持有的暂时停牌等流通受限股票