

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
报告送出日期:2017年10月25日

南方恒生中国企业精明指数证券投资基金(QDII-LOF)

2017年第三季度报告

基金管理人的董事会及监察稽核部不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日向本基金的基金份额持有人送达了《南方恒生中国企业精明指数证券投资基金(LOF)2017年第三季度报告》。报告全文于同日登载在指定信息披露媒体和基金管理公司网站，供基金份额持有人查阅。

本报告期财务资源未发生审计。

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监察稽核部不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日向本基金的基金份额持有人送达了《南方恒生中国企业精明指数证券投资基金(LOF)2017年第三季度报告》。报告全文于同日登载在指定信息披露媒体和基金管理公司网站，供基金份额持有人查阅。

本报告期财务资源未发生审计。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称 南方恒生中国企业精明指数证券投资基金(LOF)

基金简称 南方恒生企业精明指数

基金代码 160311

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2017年1月20日

报告期末基金资产净值 1,000,000,000.00

报告期基金份额净值 1.0000

报告期基金份额累计净值 1.0000

基金投资目标 通过投资于恒生中国企业精明指数成份股，力争实现基金资产的长期稳定增值。

基金投资范围 本基金主要投资于恒生中国企业精明指数成份股，同时可少量投资于其他股票、债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金业绩比较基准 恒生中国企业精明指数

风险收益特征 风险收益特征：本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益品种。

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

下属分级基金的基金简称 旗下分级基金的交易代码

南方恒生企业精明指数 A 160311A

南方恒生企业精明指数 C 160311C

报告期末下属分级基金的份额 441,140,304.05

报告期末下属分级基金的净值 1.0000

报告期末下属分级基金的资产净值 441,140,304.05

注:本基金在交易所进行系统净值偏离等其他信息披露场合下,可简称为“国企精明”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2017年07月01日至 2017年09月30日)

报告期初基金资产净值 1,000,000,000.00

报告期基金净值收益率 -0.00%

报告期净值收益率标准差 0.00%

报告期期间实际收益率 -0.00%

报告期期末基金资产净值 1,000,000,000.00

报告期期末基金份额净值 1.0000

报告期期末基金份额总份额 441,140,304.05

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,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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

报告期 表现形式 累计净值增长率 业绩比较基准收益率

过去三个月 4.00% 0.00%

过去六个月 6.00% 0.00%

过去一年 13.00% 0.00%

过去三年 30.00% 0.00%

注:1.本基金自成立以来以基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动为统计对象。

2. 本基金在交易所进行系统净值偏离等其他信息披露场合下,可简称为“南方恒生企业精明”。

3. 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2017年07月01日至 2017年09月30日)

报告期初基金资产净值 1,000,000,000.00

报告期基金净值收益率 -0.00%

报告期净值收益率标准差 0.00%

报告期期间实际收益率 -0.00%

报告期期末基金资产净值 1,000,000,000.00

报告期期末基金份额净值 1.0000

报告期期末基金份额总份额 441,140,304.05

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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 自基金合同生效以来以基金累计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

报告期 表现形式 累计净值增长率 业绩比较基准收益率

过去三个月 3.27% 0.00%

过去六个月 6.00% 0.00%

过去一年 19.34% 0.00%

过去三年 34.26% 0.00%

注:本基金的第一个保本期为三年,自2008年11月12日至2011年11月14日止,第一个保本期的年增长率为19.34%;第二个保本期为三年,自2011年12月止,第二个保本期的年增长率为34.26%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 从事业务时间 说明

陈立伟 基金经理 2014年9月 陈立伟先生,经济学学士,具有基金从业资格,2009年9月加入南方基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理、基金经理,2016年1月至今任南方恒生企业精明指数证券投资基金(LOF)基金经理。

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”为根据公司决定确定的解聘日期;对之后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.2.3 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.4 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.5 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.6 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.7 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.8 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.9 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.10 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.11 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.12 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.13 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.14 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.15 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.16 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.17 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.18 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.19 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.20 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.21 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.22 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.23 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.24 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.25 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.26 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.27 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.28 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.29 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.30 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.31 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.32 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.33 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.34 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.35 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.36 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.37 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.38 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.39 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.40 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.41 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.42 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.43 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.44 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.45 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.46 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.47 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.48 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.49 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.50 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.51 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.52 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.53 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.54 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.55 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.56 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.57 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.58 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.59 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.60 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.61 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.62 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.63 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.64 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.65 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.66 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.67 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.68 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.69 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.70 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.71 本报告期基金管理人未发生变更。

3.2.72 本报告期基金管理人未发生变更。</p