

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：2013年3月29日

§ 1 重要提示

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、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确认，并由董事长签发。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金经理过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读该基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要自年度报告正文、投资决策了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本基金报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 南方金砖四国指数(QDII)

基金主代码 160121

前端交易代码 160121

后端交易代码 160122

契约型开放式

基金合同生效日 2010年12月05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

报告期末基金份额总额 215,103,897.39份

基金合同存续期 不定期

注：本基金在交易所有息情况净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方金砖”。

2.2 基金产品说明

本基金采用被动式指数化投资，以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金按照成份股在金砖四国指数中的基准权重构建股票投资组合，并根据金砖四国指数成分股及其权重的变化进行相应调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到有恢复复标的指数的目的。本基金力争在净值增长率不超过5%的情况下，跟踪标的指数的收益率。

本基金的风险收益特征与业绩比较基准的预期收益和风险水平相似。

本基金主要采用指数化复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及与之相类似的风

险收益特征。

2.3 基金管理人员和基金托管人

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

姓名 鲍文革 赵会军

信息披露义务人联系人 0755-22763888 010-66105799

电子邮箱 manager@southfund.com custody@icbc.com.cn

客户服务电话 400-889-8899 95588

传真 0755-82763889 010-66105798

2.4 境外资产托管人

项目 境外资产托管人

名称 Brown Brothers Harriman & Co.

英文 中文 布朗兄弟哈里曼银行

注册地址 140 Broadway New York, NY 10005

办公地址 140 Broadway New York, NY 10005

邮政编码 10005

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 http://www.nffund.com

基金年度报告备置地点 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2012年 2011年 2010年1月1日至2010年12月31日

本期已实现收益 -11,200,523.79 1,791,996.44 965,245.77

本期利润 15,976,115.94 -48,542,125.90 965,245.77

加权平均基金份额本期利润 0.0664 -0.1568 0.0015

本期基金份额净值增长率为 93.5% -21.15% 0.20%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末 2010年末

期末可供基金份额利润 -0.1512 -0.2247 0.0015

期末基金份额净值 182,570,143.90 200,669,619.40 637,509,447.95

期末基金资产净值 0.849 0.775 1.002

注：1.本期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；扣除非费用后的利润，即为本期利润；2.所列数据不包括持有人认购或交易基金所产生的申购赎回费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；3.2.1 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

阶段 份额净值增长 累计净值增长 现金分红比例 业绩比较基准收益率(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 6.39% 0.80% 6.48% 0.81% -0.09% -0.01%

过去六个月 12.60% 0.98% 10.85% 1.00% 1.75% -0.02%

过去一年 9.55% 1.11% 7.44% 1.11% 2.11%

自基金合同生效之日起至今 -13.44% 1.27% -16.20% 1.31% 2.76% -0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

注：根据相关法律法规和基金合同，本基金基金合同期限为基金合同生效之日起6个月内，建仓期结束时，本

基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

3.2.3 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

3.2.4 基金利润表

3.2.5 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

3.2.6 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南方基金管理有限公司是中国证监会证监基金字[1998]14号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、山西长治市商业银行股份有限公司、深圳中行国际信托投资有限公司共同发起设立的全国性基金管理公司。

注册资本人民币1亿元，2010年经证监会证监基金字[2000]201号文批准增加注册资本至人民币5亿元。

截至报告期末，注册资本为人民币5亿元，2010年经证监会证监基金字[2005]16号文批准增加注册资本至人民币5亿元。

截至报告期末，公司管理资产规模近2,300亿元，旗下管理37只开放式基金、2只封闭式基金，多个全国性基金产品和专户理财投资产品。

4.1.2 基金经理的基金从业经验

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

黄亮 本基金的基金经理 (助理) /助理 2010年12月9日 11年

北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格，曾任职于深圳证券交易所，现为南方基金管理有限公司国际业务部、债券ODI产品设计及国际业务开拓工作，2007年9月至2009年5月，担任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2009年5月至2010年12月，担任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2010年12月至今，担任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2011年1月至今，担任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2012年7月起兼任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2013年1月起兼任南方基金管理有限公司国际业务部总监，负责QFII/RQFII ETF的投资运作管理。

4.1.3 基金经理助理的基金从业经验

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

王军 本基金的基金经理助理 (助理) /助理 2010年12月9日 11年

北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格，曾任职于深圳证券交易所，现为南方基金管理有限公司国际业务部、债券ODI产品设计及国际业务开拓工作，2007年9月至2009年5月，担任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2009年5月至2010年12月，担任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2010年12月至今，担任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2011年1月至今，担任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2012年7月起兼任南方基金管理有限公司国际业务部总监，2013年1月起兼任南方基金管理有限公司国际业务部总监，负责QFII/RQFII ETF的投资运作管理。

4.2 管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.1 公司管理人严格执行《证券投资基金利润分配原则》。

4.2.2 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.3 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.4 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.5 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.6 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.7 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.8 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.9 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.10 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.11 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.12 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.13 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.14 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.15 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.16 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.17 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.18 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.19 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.20 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.21 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.22 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.23 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.24 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.25 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.26 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.27 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.28 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.29 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.30 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.31 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.32 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.33 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.34 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.35 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.36 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.37 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.38 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.39 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.40 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.41 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.42 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.43 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.44 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.45 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.46 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.47 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.48 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.49 公司管理人对报告期内基金的利润分配政策的说明

4.2.50 公司管理