南方金砖四国指数证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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:2014年8月26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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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2014年08月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§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
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月9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	151,677,207.39份
基金合同存续期	不定期

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"南方金砖"。

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用指数复制法。本基金按照成份股在金砖四国指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据金砖四国指数成份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,达到有效复制标的指数的目的。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.4%,年跟踪误差不超过5%。
业绩比较基准	人民币计价的金砖四国指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%(税后)。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用综合指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场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
信息披露负责人	姓名	鲍文革	赵会军
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.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	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-3,358,987.87
本期利润	3,894,662.33
加权平均基金份额本期利润	0.0243
本期基金份额净值增长率	3.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1783
期末基金资产净值	124,638,970.13
期末基金份额净值	0.822

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。

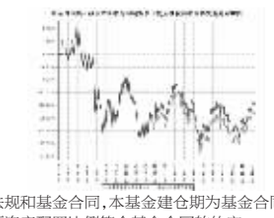
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.27%	0.59%	2.42%	0.65%	0.85%	-0.06%
过去三个月	7.87%	0.72%	6.63%	0.75%	1.24%	-0.03%
过去六个月	3.66%	0.90%	4.28%	0.91%	-0.62%	-0.01%
过去一年	14.17%	0.91%	14.37%	0.92%	-0.20%	-0.01%
过去三年	-15.08%	1.22%	-18.87%	1.22%	3.79%	0.00%
自基金合同生效起至今	-16.20%	1.16%	-19.60%	1.18%	3.40%	-0.02%

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,本基金建仓期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。

§4 管理人报告

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

1998年3月6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"新基金时代"的起始标志。

南方基金总部设在深圳,注册资本1.5亿元人民币。股东结构为:华泰证券股份有限公司(45%);深圳市投资控股有限公司(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)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近2,800亿元,旗下管理51只开放式基金,1只封闭式基金,多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄 亮	本基金的基金经理	2010年12月9日	-	13年	北京大学工商管理硕士,具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司,2005年加入南方基金国际业务部,负责QDII产品设计及国际业务开拓工作,2007年9月至2009年5月,担任南方全球基金经理助理;2009年6月至今,担任南方金砖基金经理;2010年12月至今,任南方金砖基金经理;2011年9月至今,任南方中小盘指数基金基金经理。

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,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,其中1次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,3次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年,在美国等主要经济体持续复苏的带动下,全球股票市场保持了震荡中稳步上扬的态势,此前受到资金流出影响的新兴市场也走出了企稳回升的走势。上半年,美元计价的MSCI发达市场指数上涨6.18%,MSCI新兴市场指数收益为6.14%。

美联储在2013年12月18日年内最后一次货币政策会议后正式宣布启动QE退出程序,整个上半年都在按照美联储预期的节奏缩减QE规模。上半年最后一次的美联储会议(6月18日)宣布将月度购债规模从450亿美元缩减至350亿美元。退出QE的同时,美联储也向外界传递了对于经济复苏前景信心不断增强的信息,缓解了投资者对于QE退出带来负面影响的担心。从近期公布的数据来看,美国采购经理人指数(PMI)保持了一个上涨态势,6月该数字达到了55.3的水平。美国的就业市场也在继续改善,截止到二季度末,美国的失业率下降到6.23%,已经接近了过去15年的平均水平。相对美国持续复苏的经济而言,欧元区经济体在本季度表现差强人意。欧元区PMI在一季度触及本轮高点后开始小幅回落至6月51.8的水平。总体看,欧元区PMI仍然是维持了连续12个月的扩张态势,表明整个欧元区经济虽然不及美国强劲,但依然保持在了复苏的通道中。

上半年,在投资者风险偏好提高和资金回流新兴市场国家的大背景下,金砖四国股市整体表现较好。区域危机的逐渐平息,增强了投资者对于俄罗斯的信心,该国股市也出现了较好的修复性反弹。相对而言,在中国经济增长继续放缓,企业盈利增速有所下滑的情况下,中资股的表现差强人意。

报告期内,基金在维持指数化投资策略的前提下,通过对宏观经济、行业以及汇率的判断,完成了指数成份股季度调整的操作,保障了基金的平稳运作。同时在投资管理上关注了指数成份股的流动性,有效管理了基金的交易成本。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2014年上半年基金净值增长3.66%,基金基准增长4.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年下半年,美国QE退出势必会对全球资本市场的流动性、投资者的信心等方面产生不利影响,影响到市场的短期走势。但长期来看,新兴市场仍然具有长期投资的潜力。相对较低的估值和经济增速的逐渐恢复将会吸引资金重新回流金砖四国市场,金砖四国的股票市场也将会面临新的投资机遇。

未来,本基金投资团队将密切关注市场变化趋势,谨慎勤勉、恪尽职守,实现对标的指数的有效跟踪。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,本基金的收益分配原则为:每一基金份额享有同等分配权;基金收益分配后基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值,即:基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值,基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;在符合上述基金分红条件的前提下,基金收益分配每年最多12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金未有收益分配事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对南方金砖四国指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,南方金砖四国指数证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方金砖四国指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,南方金砖四国指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方金砖四国指数证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方金砖四国指数证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		7,320,141.80	7,658,816.64
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		117,049,927.07	127,243,600.76
其中:股票投资		117,049,927.07	127,243,600.76
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		644,767.85	-
应收利息		1,039.44	858.61
应收股利		986,743.20	71,512.43
应收申购款		35,801.44	17,339.93
递延所得税资产		-	-
其他资产		85,318.22	-
资产总计		126,123,739.02	134,992,128.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,187,857.39	216,428.73
应付管理人报酬		82,393.20	92,063.97
应付托管费		25,747.90	28,770.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		188,770.40	170,813.15
负债合计		1,484,768.89	508,075.85
所有者权益:			
实收基金		151,677,207.39	169,560,128.28
未分配利润		-27,038,237.26	-35,076,075.76
所有者权益合计		124,638,970.13	134,484,052.52
负债和所有者权益总计		126,123,739.02	134,992,128.37

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.822元,基金份额总额151,677,207.39份。

6.2 利润表

会计主体:南方金砖四国指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		4,849,899.46	-24,884,258.69
1.利息收入		12,347.48	18,329.13
其中:存款利息收入		12,347.48	18,329.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,568,244.50	-2,180,075.73
其中:股票投资收益		-4,422,738.72	-5,145,656.32
基金投资收益		-	-312,121.31
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	282,085.45
股利收益		1,854,494.22	2,995,616.45
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		7,253,650.20	-22,610,895.58
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		149,191.07	-118,324.51
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2,955.21	6,708.00
减:二、费用		955,237.13	1,243,716.66
1.管理人报酬	6.4.5.2.1	488,075.00	677,054.12
2.托管费	6.4.5.2.2	152,523.49	211,579.43
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		31,134.34	72,441.30
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		283,504.30	282,641.81
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		3,894,662.33	-26,127,975.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		3,894,662.33	-26,127,975.35

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方金砖四国指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	169,560,128.28	-35,076,075.76	134,484,052.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	3,894,662.33	3,894,662.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-17,882,920.89	4,143,176.17	-13,739,744.72
其中:1.基金申购款	4,809,039.01	-1,010,552.45	3,798,486.56
2.基金赎回款	-22,691,959.90	5,153,728.62	-17,538,231.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	151,677,207.39	-27,038,237.26	124,638,970.13
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	215,103,897.39	-32,533,753.49	182,570,143.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-26,127,975.35	-26,127,975.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-15,847,252.89	2,881,995.77	-12,965,257.12
其中:1.基金申购款	7,475,492.87	-1,262,066.89	6,213,425.98
2.基金赎回款	-23,322,745.76	4,144,062.66	-19,178,683.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	199,256,644.50	-55,779,733.07	143,476,911.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____杨 小 松_____ _____邓 见 梁_____ _____邓见梁_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司("南方基金")	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行("Brown Brothers Harriman & Co.")	境外资产托管人

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

无。

6.4.5.1.2 基金交易

无。

6.4.5.1.3 权证交易

无。

6.4.5.1.4 应支付关联方的佣金

无。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	488,075.00	677,054.12
其中:支付销售机构的客户维护费	143,609.07	198,746.41

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.8% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	152,523.49	211,579.43

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
期初持有的基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.19%	10.04%

注:期间申购总份额含红利再投、转换入份额,期间赎回总份额含转换出份额。

6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,013,500.75	12,329.59	2,393,575.80	18,194.63
布朗兄弟哈里曼银行	2,306,641.05	-	4,835,763.47	-

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管,按适用利率或约定利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

6.4.5.7.1 与关联方进行的外汇远期交易

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末未结算协议余额	当期交易协议金额	期末未结算协议余额	当期交易协议金额
中国工商银行	-	-	-	2,000,000.00

注:本基金与基金托管人中国工商银行进行外汇远期交易,按合同约定汇率远期卖出美元买入人民币或卖出人民币买入美元。于2014年6月30日,因上述外汇远期交易确认的衍生金融资产余额为人民币0.00元(2013年6月30日:衍生金融资产余额0.00元)。

6.4.6 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	117,049,927.07	92.81
	其中:普通股	56,322,717.08	44.66
	存托凭证	60,727,209.99	48.15
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,320,141.80	5.80
8	其他各项资产	1,753,670.15	1.39
9	合计	126,123,739.02	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国	56,322,717.08	45.19
美国	34,059,556.58	27.33
英国	26,667,653.41	21.40
合计	117,049,927.07	93.91

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
通讯	19,681,544.53	15.79
非必需消费品	1,666,417.47	1.34
必需消费品	10,035,673.19	8.05
能源	27,411,610.56	21.99
金融	45,315,324.24	36.36
工业	3,212,389.19	2.58
材料	4,340,068.21	3.48
科技	4,778,252.18	3.83
公用事业	608,647.50	0.49
合计	117,049,927.07	93.91

注:以上行业分类采用彭博行业分类标准。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港交易所	中国	2,290,000	10,651,648.75	8.55
2	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港交易所	中国	95,700	8,978,693.63	7.20
3	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港交易所	中国	109,000	6,506,210.00	5.22
4	Open Joint Stock Company Gazprom	俄罗斯天然气工业股份公司	OGZD LI	伦敦证券交易所	英国	114,600	6,145,041.32	4.93
5	Bank Of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港交易所	中国	1,890,000	5,205,650.63	4.18
6	Itaú Unibanco Holding S.A.	巴西Itau Unibanco Banco Multiplo股份公司	ITUB UN	纽约证券交易所	美国	57,500	5,087,442.68	4.08
7	Companhia de Bebidas das Americas - Ambev	巴西安贝夫公司	ABEV UN	纽约证券交易所	美国	97,400	4,218,950.35	3.38
8	Infosys Ltd.	印孚瑟斯技术有限公司	INFY UN	纽约证券交易所	美国	11,900	3,936,949.07	3.16
9	Banco Bradesco S.A.	巴西布拉德斯科银行股份公司	BBD UN	纽约证券交易所	美国	43,800	3,913,033.13	3.14
10	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港交易所	中国	336,000	3,712,464.00	2.98

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码;

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细,应阅读登载于http://www.nffund.com的年度报告正文。

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	639,047.58	0.48
2	China Cinda Asset Management Corporation	1359 HK	240,488.29	0.18
3	OAO Novatek	NVTK LI	230,948.79	0.17
4	China Construction Bank Corporation	939 HK	212,805.05	0.16
5	Open Joint Stock Company Uralkali	URKA LI	56,682.69	0.04

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

3、买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	China Construction Bank Corporation	939 HK	1,512,144.04	1.12
2	Bank Of China Limited	3988 HK	1,473,590.57	1.10
3	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	1,311,923.46	0.98
4	Tencent Holdings Limited	700 HK	806,754.36	0.60
5	Open Joint Stock Company Gazprom	OGZD LI	791,331.38	0.59
6	China Mobile Limited	941 HK	615,166.89	0.46
7	Itaú Unibanco Holding S.A.	ITUB UN	501,225.41	0.37
8	Companhia de Bebidas das Americas - Ambev	ABEV UN	456,529.35	0.34
9	Infosys Ltd.	INFY UN	448,503.38	0.33
10	OAO Lukoil	LKOD LI	420,664.82	0.31
11	Sberbank	SBER LI	391,939.01	0.29
12	Banco Bradesco S.A.	BBD UN	386,110.07	0.29
13	CNOOC Limited	883 HK	359,459.03	0.27
14	Open Joint Stock Company Uralkali	URKA LI	351,473.94	0.26
15	Petro China Company Limited	857 HK	311,515.99	0.23
16	China Petroleum and Chemical Corporation	386 HK	297,232.99	0.22
17	Petroleo Brasileiro S.A.	PBR UN	297,028.94	0.22
18	Larsen & Toubro Ltd	LTOD LI	285,526.83	0.21
19	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	274,695.02	0.20
20	Brasil Foods S.A.	BRFS UN	274,691.49	0.20

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

3、卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	1,379,972.40
卖出收入(成交)总额	14,404,557.57

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的