

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:2016年3月30日

§ 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、完整性承担责任。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2016年3月25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摘要。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

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，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

基金简称	南方金砖四国指数证券投资基金
基金代码	160211
基金合同生效日	2004年1月1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
报告期末基金资产净值	60,008,300.459
报告期末基金份额净值	0.717
基金合同终止日	2015年12月31日
报告期管理人报酬	南方基金管理有限公司
报告期托管人报酬	中国工商银行股份有限公司
报告期卖出回购基金产生的费用	0.00
报告期交易费用	0.00
报告期利息收入	0.00
报告期投资收益	0.00
报告期公允价值变动收益	0.00
报告期净利得	0.00
报告期手续费	0.00
报告期其他收入	0.00
报告期投资收益减去费用后的净值	0.00
报告期基金份额净值	0.717
报告期基金份额累计净值	80,838,530.14

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	本基金紧密跟踪标的指数,力争在扣除相关费用后,取得与标的指数相似的收益。
投资策略	本基金将全部资产投资于标的指数成份股、备选成份股、以及与标的指数风格相似的A股,并根据标的指数成份股的调整和变化进行相应调整,同时可少量投资于现金类资产,以保证本基金的流动性。
投资范围	本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、以及与标的指数风格相似的A股,同时可少量投资于现金类资产,以保证本基金的流动性。
投资比例	本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、以及与标的指数风格相似的A股的比例不低于基金资产的95%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险收益特征与标的指数相似,即风险收益特征与业绩比较基准相似。

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
法定代表人	戴文华	洪川
信息披露负责人	陈皓	0512-62026790
基金名称	南方金砖四国指数证券投资基金	南方金砖四国指数证券投资基金
基金简称	南方金砖	南方金砖
基金代码	160211	160211
基金托管费计提标准	0.0005%	0.0005%
基金托管费支付日	每月月末	每月月末
基金托管费费率	0.0005%	0.0005%
基金管理费计提标准	0.50%	0.50%
基金管理费支付日	每月月末	每月月末
基金管理费费率	0.50%	0.50%

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”。

2.4 境外资产托管人

项目	境外资产托管人
名称	Brown Brothers Harriman & Co.
地址	140 Broadway New York, NY 10006
邮政编码	10000
境外资产托管人电话	070-62026790

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”。

2.5 信息披露方式

信息披露方式	披露方式	披露网站
信息披露公告/临时报告/季度报告/半年度报告/年度报告	电子邮件	http://www.sifm.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“南方金砖”。

§ 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

主要财务指标和数据	2016年	2014年	2013年
本期利润	-4,306,034.00	-9,000,520.00	-8,211,052.10
本期利润	-347,003,050.00	-3,063,050.00	-12,302,140.00
当期基金总利润	-6,000.00	-	-9,000.00
期末基金净值增长率为%	-5.75%	-0.4%	-6.0%
3.1.1 本期利润和利润	2015年1月	2014年末	2013年末
3.1.2 期末可供分配利润	-42,028.00	6,232,897.00	-2,000.00
3.1.3 期末可供分配利润	67,341,162.00	83,303,406.00	134,062,652.00
3.1.4 期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)	0.717	0.80	0.91

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现金部分之和计算。

3.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	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月	1.8%	1.3%	2.2%	1.8%
3月	14.7%	1.6%	-12.7%	1.0%
6月	-5.7%	1.3%	-7.0%	1.3%
1年	-15.6%	1.3%	-16.8%	1.4%
3年	-27.0%	1.3%	-31.7%	1.2%
5年	-36.0%	1.3%	-31.0%	1.2%

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”。

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:1.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.期初可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中现金部分之和计算。

3.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。

3.2.3 过去五年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:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.717元,基金份额总额80,838,530.14元。

7.2 利润表

会计主体:南方金砖四国指数证券投资基金

本期报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
营业收入	1,000,000.00	-1,061,450.00
投资收益	1,000,000.00	-1,061,450.00
利息收入	0.00	0.00
公允价值变动收益	0.00	0.00
手续费	0.00	0.00
营业收入	1,000,000.00	-1,061,450.00
投资收益	1,000,000.00	-1,061,450.00
利息收入	0.00	0.00
公允价值变动收益	0.00	0.00
手续费	0.00	0.00
营业收入	1,000,000.00	-1,061,450.00
投资收益	1,000,000.00	-1,061,450.00
利息收入	0.00	0.00
公允价值变动收益	0.00	0.00
手续费	0.00	0.00
营业收入	1,000,000.00	-1,061,450.00
投资收益	1,000,000.00	-1,061,450.00
利息收入	0.00	0.00
公允价值变动收益	0.00	0.00
手续费	0.00	0.00
营业收入	1,000,000.00	-1,061,450.00
投资收益	1,000,000.00	-1,061,450.00
利息收入	0.00	0.00
公允价值变动收益	0.00	0.00
手续费	0.00	0.00
营业收入	1,000,000.00	-1,061,450.00
投资收益	1,000,000.00	-1,061,450.00
利息收入	0.00	0.00
公允价值变动收益	0.00	0.00
手续费	0.00	0.00
营业收入	1,000,000.00	-1,061,450.00
投资收益	1,000,000.00	-1,061,450.00
利息收入	0.00	0.00
公允价值变动收益	0.00	0.00
手续费	0.00	0.00
营业收入	1,000,000.00	-1,061,450.00
投资收益	1,000,000.00	-1,061,450.00
利息收入	0.00	0.00
公允价值变动收益	0.00	0.00
手续费	0.00	0.00
营业收入		