

南方金砖四国指数证券投资基金招募说明书(更新)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

本招募说明书(更新)摘要日期:2014年12月9日

重要提示

南方金砖四国指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2010年5月4日证监许可[2010]652号文核准募集,基金合同于2010年12月9日正式生效。

基金管理人承诺招募说明书中内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或认可,也不表示投资于本基金是安全的。

本基金投资于境外证券市场,基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前,投资者应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对于购买基金的时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,也承担基金投资中出现的各类风险。本基金主要投资于境外证券市场,国家风险仍处于不断变化发展的初级阶段,难以预测的投资可能影响基金的投资收益。二是开放型基金,包括流动性风险、管理风险、会计核算风险、政策风险、交易结算风险、法律风险、衍生品风险等。三是本基金特有的风险,如汇率风险、投资品种的流动性风险和规模风险等使基金收益率存在显著变化的风险。投资者有风险,投资有损失(申购或赎回)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金经理的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人承诺本基金的合同当事人之间的权利义务,基金管理人自己依法承担的合同义务,基金管理人将对基金持有人的合同权利和义务,以及对基金持有人的合同义务和责任,并不存在任何享有权利和承担义务,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书经本基金管理人复核。本招募说明书所载内容截止日为2014年12月9日,有关财务数据和净值信息请见截止日2014年9月30日(未经审计)。

一、基金名称

南方金砖四国指数证券投资基金

二、基金的类别

股票型证券投资基金

三、投资目标

本基金主要投资于全球证券市场中的金砖四国指数的成份股(包括股票/或存托凭证,下同),备选成份股、新股(一级市场首次公开发行股票,以下简称“新股”,以下统称“股票”)、债券、货币市场工具、权证、ETF基金、期权、结构性产品、衍生品、银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构今后允许基金投资其他的品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将该纳入投资范围。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的限制比例,基金管理人与基金托管人一致同意并履行相关程序后,可相应调整本基金的投资品种的比例,不需要基金份额持有人大会审议。

五、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及其权重的变化进行定期的调整,以实现对标的指数的跟踪效果。

本基金主要投资于金砖四国指数成份股(包括股票/或存托凭证,下同),备选成份股、新股(一级市场首次公开发行股票,以下简称“新股”,以下统称“股票”)、债券、货币市场工具、权证、ETF基金、期权、结构性产品、衍生品、银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金在投资于金砖四国指数成份股的同时,将根据指数成份股的基准权重将其逐步买入,并在力求跟踪误差最小化的情况下,通过定期调整和跟踪误差的计算方法如下:

1. 跟踪偏离度(Tracking Difference)采用基金份额净值增长率与业绩基准收益率之差来衡量,计算公式如下:

2. 跟踪误差(Tracking Error)采用基金净值增长率标准差与业绩基准收益率标准差之比来衡量,计算公式如下:

3. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

(一)资产配置策略

为实现有效分散投资的指数的投资目标,本基金将主要投资于金砖四国指数成份股及备选成份股,该部分的投资成份股在金砖四国指数中的基准权重构成指数化投资组合。因投资者的申购和赎回等对本基金跟踪效果可能带来影响时,或因基金规模等原因导致流动性不足时,或其他原因导致无法对复制和跟踪标的的数据,基金管理人将利用优化方法,对成份股进行部分替代,以实现对标的指数的有效跟踪。

4. 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照金砖四国指数成份股的基准权重将其逐步买入,并在力求跟踪误差最小化的情况下,通过定期调整和跟踪误差的计算方法如下:

5. 资产配置比例

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及其权重的变化进行定期的调整,以实现对标的指数的跟踪效果。

本基金主要投资于金砖四国指数成份股(包括股票/或存托凭证,下同),备选成份股、新股(一级市场首次公开发行股票,以下简称“新股”,以下统称“股票”)、债券、货币市场工具、权证、ETF基金、期权、结构性产品、衍生品、银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金在投资于金砖四国指数成份股的同时,将根据指数成份股的基准权重将其逐步买入,并在力求跟踪误差最小化的情况下,通过定期调整和跟踪误差的计算方法如下:

6. 跟踪偏离度(Tracking Difference)采用基金净值增长率标准差与业绩基准收益率标准差之比来衡量,计算公式如下:

7. 跟踪误差(Tracking Error)采用基金净值增长率标准差与业绩基准收益率标准差之比来衡量,计算公式如下:

8. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

9. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

10. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

11. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

12. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

13. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

14. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

15. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

16. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

17. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

18. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

19. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

20. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

21. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

22. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

23. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

24. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

25. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

26. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

27. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

28. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

29. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

30. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

31. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

32. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

33. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

34. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

35. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

36. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

37. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

38. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

39. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

40. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

41. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

42. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

43. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

44. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

45. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

46. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

47. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

48. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

49. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

50. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

51. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

52. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

53. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

54. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

55. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

56. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

57. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

58. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

59. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

60. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

61. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

62. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

63. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

64. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

65. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

66. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

67. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

68. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

69. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

70. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

71. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

72. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

73. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

74. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

75. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

76. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

77. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

78. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

79. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

80. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

81. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

82. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

83. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

84. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

85. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

86. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

87. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

88. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

89. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

90. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

91. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

92. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

93. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

94. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

95. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

96. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

97. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。

98. 基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法,并予以公告。