

南方金砖四国指数证券投资基金

[2015] 第一季度报告

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:2015年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人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。

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。

基金管理人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。

本基金以人民币为记账单位，以人民币元为记账单位。

基金净值的计算方法及公式详见基金合同。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称:南方金砖四国指数(QDII)

交易代码:160121

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

报告期末基金份额总额:107,913,479.99

投资目标:本基金主要通过被动指数化投资，以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金为被动型指数基金，采样指数复制。本基金按照成份股在金砖四国指数中的

权重构建股票投资组合，并根据金砖四国指数成份股及其权重的变动进行相应

调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到与复制标的指数的拟合度。本基金力

争控制基金净值增长率与业绩比较基准之差的日常跟踪偏离度不超过0.4%，年跟踪

误差不超过5%。

业绩比较基准:人民币价值的金砖四国指数收益*95%+人民币现金存款收益*5%。

本基金投资股票、权证、债券等金融工具，投资于基金资产的80%。

本基金指数基金，主要采用指数复制法，通过定期调整和不定期的指数的表示，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格收益特征。

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

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 境外资产投资:境外资产托管人

境外资产托管人:境外资产托管人

名称:Brown Brothers Harriman & Co.

英文:Brown Brothers Harriman & Co.

地址:140 Broadway New York, NY 10005

办公地址:140 Broadway New York, NY 10005

邮政编码:10005

§ 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(2015年1月1日~2015年3月31日)

1.本期已实现收益 -3,121,651.64

2.本期利润 4,502,713.47

3.期初平均基金份额净值 0.9585

4.期末基金份额净值 0.9794

5.期末基金份额净值 -0.7994

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.所列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指标。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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

阶段 净值增长率(%) 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(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.99% 1.02% 5.29% 1.03% -0.30% -0.01%

3.2.2 基金合同生效以来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

图:基金合同生效以来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

注:根据相关法律法规和基金合同，本基金将在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。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

黄亮 基金经理 2010年12月9日 - 14年 北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任银行间债券市场交易员，具有丰富的交易经验，2005年加入南方基金管理有限公司，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，担任国际业务部基金经理，2009年6月至至今，担任国际业务部基金经理，2010年12月至至今，担任国际业务部基金经理，2011年9月至至今，任南方中国区域基金经理。

4.2 报告期内本基金运作合规、审慎经营情况说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，确保公平交易、防范利益冲突、采用各种方式在各业务环节严格执行交易公平执行、公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3 基金买卖股票的专项说明

本基金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，未出现同日反向交易且成交金额较大的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度流程，确保公平交易、防范利益冲突、采用各种方式在各业务环节严格执行交易公平执行、公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.2 公平交易制度的执行结果

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.3 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.4 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.5 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.6 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.7 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.8 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.9 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.10 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.11 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.12 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.13 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.14 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.15 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.16 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.17 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.18 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.19 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.20 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.21 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.22 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.23 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.24 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.25 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.26 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.27 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.28 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.29 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.30 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.31 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.32 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.33 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.34 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.35 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.36 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.37 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.38 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.39 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.40 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.41 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.42 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.43 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.44 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.45 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.46 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.47 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.48 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.49 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.50 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.51 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.52 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.53 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.54 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。

4.4.55 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送行为。