

南方金砖四国指数证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

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2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

报告书内容以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30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	81,310,780.73份
投资目标	本基金采用被动指数化投资策略，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将通过在南方金砖四国指数成分股中选择权重较大的优质蓝筹股，按照基金持有的指数成分股及其权重的变化进行定期调整，在保持基金资产的流动性和变现能力的前提下，适时调整所持有的指数的头寸，使基金力争净值增长率不超过标的指数收益率不超过5%。
业绩比较基准	人民币计价的南方金砖四国指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金，主要采用指数化投资策略跟踪标的指数的走势，具有与标的指数相似的风险特征。
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 境外资产托管人

项目	境外资产托管人
名称	Brown Brothers Harriman & Co.
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

		报告期(2015年7月1日~2015年9月30日)
1.本期已实现收益		-860,006.69
2.本期利润		-11,177,821.69
3.期初至报告期基金份额累计净值		50,573.53
4.期末基金份额净值		57,263,264.22
5.期末基金资产净值		5,704

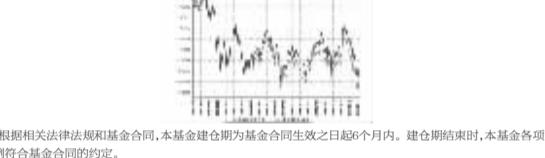
注:1.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用, 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

本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较						
阶段	净值增长(%)	净值增长标准差(%)	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	-16.29%	1.63%	-17.12%	1.65%	0.83%	-0.02%

3.2.2 自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 基金经理(基金经理小组)简介	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
黄亮 本基金基金经理 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。曾任华夏基金管理有限公司研究员,2005年加入南方基金管理有限公司,负责QDII产品的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月至今,担任南方基金管理有限公司基金经理,2010年12月至今,任南方基金管理有限公司基金经理。

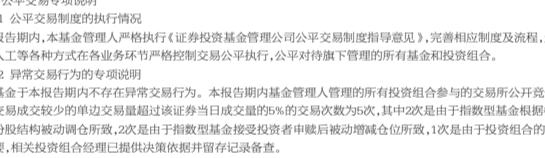
注:1.对本基金的首任基金经理,其“任职日期”即为基金合同生效日,“离任日期”即为公司决定确定的解聘日期,对非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义是指从行业协会、证券公司、人员资格管理机构的相关规定。

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金报告期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(%)	净值增长标准差(%)	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	-16.29%	1.63%	-17.12%	1.65%	0.83%	-0.02%

3.2.2 自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。

§ 5 管理人报告

5.1 基金产品概况	报告期(2015年7月1日~2015年9月30日)
1.基金基本情况	-3,860,006.69
2.本期利润	1,665,758.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0098
4.期末基金资产净值	1,392,337.92
5.期末基金份额净值	1.119

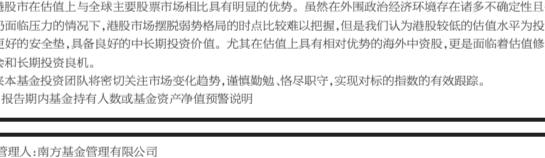
注:1.本期实现收入扣减基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金报告期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(%)	净值增长标准差(%)	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	0.09%	0.10%	0.96%	0.01%	-0.87%	-0.09%

3.2.2 自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。

§ 6 管理人报告

6.1 主要财务指标	报告期(2015年7月1日~2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,860,006.69
2.本期利润	1,665,758.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0098
4.期末基金资产净值	1,392,337.92
5.期末基金份额净值	1.119

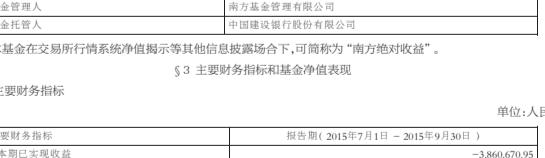
注:1.本期实现收入扣减基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金报告期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(%)	净值增长标准差(%)	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	0.09%	0.10%	0.96%	0.01%	-0.87%	-0.09%

3.2.2 自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。

§ 7 管理人报告

7.1 基金管理人	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
宋卫华 本基金基金经理 2014年12月1日	- 6年		清华大学计算机科学与技术专业硕士,具有基金从业资格,2006年加入南方基金管理有限公司,2014年12月1日起任本基金基金经理。

注:1.对本基金