



信息披露

2014年10月24日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B114

南方金砖四国指数证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30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
报告送出日期:2014年10月24日

5.1 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2014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。

本报告以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2014年7月1日起至9月30日止。

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 南方金砖四国指数 (qin) |
| 基金代码 | 160121 |
| 前次交易代码 | 160121 |
| 后次交易代码 | 160122 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年12月19日 |
| 报告期末基金份额总额 | 139,593,420.00份 |
| 投资目标 | 本基金为被动式指数化投资,以实现跟踪标的指数的有限跟踪误差。 |
| 投资策略 | 本基金为被动式指数基金,采用指数复制法,本基金按照标的指数在黄金四国指数中的基准权重和指数化投资组合,并依据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,在保持基金资产净值波动率不超过0.5%的前提下,力争跟踪误差控制在0.5%以内。 |
| 业绩比较基准 | 人民币计价的金砖四国指数收益率*95%+人民币活期存款利率*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,主要跟踪金砖四国指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场的类似风险收益特征。 |
| 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”。

| | |
|------|---------------------------------|
| 项目 | 境外资产托管人 |
| 名称 | Brown Brothers Harriman & Co. |
| 中文 | 布朗兄弟哈里曼公司 |
| 注册地址 | 100 Broadway New York, NY 10005 |
| 办公地址 | 100 Broadway New York, NY 10005 |
| 邮政编码 | 10005 |

| | |
|----------------|------------------------------|
| 3.1 主要财务指标 | 单位:人民币元 |
| 主要财务指标 | 报告期 (2014年7月1日 - 2014年9月30日) |
| 1.本期已实现收益 | 287,229.31 |
| 2.本期利润 | -3,296,811.71 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0227 |
| 4.期末基金净值 | 111,084,529.96 |

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本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。

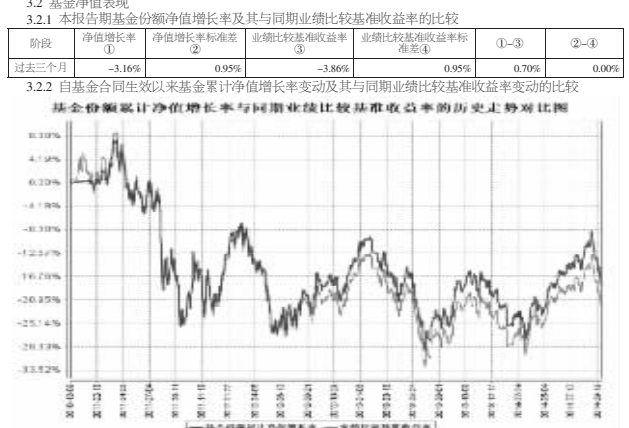
3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的对比

| 期间 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益③ | 业绩比较基准收益标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|-----------|--------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -3.16% | 0.95% | -3.86% | 0.95% | 0.70% | 0.00% |

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变动的对比

基金业绩比较基准:净值增长率与同期业绩比较基准收益变动的历史走势对比图



注:本报告按法律法规规定和基金合同,本基金建仓期自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 基金管理人

| | | | | |
|----|----------|-------------------|--------|--|
| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理期间 | 证券从业年限 | 说明 |
| 黄亮 | 本基金的基金经理 | 2010年12月19日 - 13年 | 13年 | 北京大学工商管理硕士,具有基金从业资格,曾任南方证券基金部基金经理,2005年加入南方基金管理有限公司,历任“007001”产品基金经理,2007年加入南方基金管理有限公司,2009年6月加入南方基金管理有限公司,2010年12月至今,任南方金砖四国指数证券投资基金基金经理。 |

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》等有关法律法规,中国证监会和《南方金砖四国指数证券投资基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》完善相应制度及流程,通过系统控制和工作流程等方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.1 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有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2次,是由于指数型基金根据标的指数的成份股构成调整所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2014年3季度,全球股票市场出现了震荡下行的态势,尤其是9月份,在美元走强和资金回流美国的影响下,新兴市场除美国外的发达市场出现了一定幅度的回调。本季度,美元计价的MSCI发达市场指数下跌2.16%,MSCI新兴市场指数下跌3.49%,新兴市场四国指数下跌2.75%。

4.5 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人不存在买卖本基金的情况。

5.0 投资组合报告

5.0.1 基金投资组合

5.0.2 基金投资组合

5.0.3 基金投资组合

5.0.4 基金投资组合

5.0.5 基金投资组合

5.0.6 基金投资组合

5.0.7 基金投资组合

5.0.8 基金投资组合

5.0.9 基金投资组合

5.0.10 基金投资组合

5.0.11 基金投资组合

5.0.12 基金投资组合

5.0.13 基金投资组合

5.0.14 基金投资组合

5.0.15 基金投资组合

5.0.16 基金投资组合

5.0.17 基金投资组合

5.0.18 基金投资组合

5.0.19 基金投资组合

5.0.20 基金投资组合

5.0.21 基金投资组合

5.0.22 基金投资组合

5.0.23 基金投资组合

5.0.24 基金投资组合

5.0.25 基金投资组合

5.0.26 基金投资组合

5.0.27 基金投资组合

5.0.28 基金投资组合

5.0.29 基金投资组合

5.0.30 基金投资组合

5.0.31 基金投资组合

5.0.32 基金投资组合

5.0.33 基金投资组合

5.0.34 基金投资组合

5.0.35 基金投资组合

5.0.36 基金投资组合

5.0.37 基金投资组合

5.0.38 基金投资组合

5.0.39 基金投资组合

5.0.40 基金投资组合

5.0.41 基金投资组合

5.0.42 基金投资组合

5.0.43 基金投资组合

5.0.44 基金投资组合

5.0.45 基金投资组合

5.0.46 基金投资组合

5.0.47 基金投资组合

5.0.48 基金投资组合

5.0.49 基金投资组合

5.0.50 基金投资组合

5.0.51 基金投资组合

5.0.52 基金投资组合

5.0.53 基金投资组合

5.0.54 基金投资组合

5.0.55 基金投资组合

5.0.56 基金投资组合

5.0.57 基金投资组合

5.0.58 基金投资组合

5.0.59 基金投资组合

5.0.60 基金投资组合

5.0.61 基金投资组合

5.0.62 基金投资组合

5.0.63 基金投资组合

5.0.64 基金投资组合

5.0.65 基金投资组合

5.0.66 基金投资组合

5.0.67 基金投资组合

5.0.68 基金投资组合

5.0.69 基金投资组合

5.0.70 基金投资组合

5.0.71 基金投资组合

5.0.72 基金投资组合

5.0.73 基金投资组合

5.0.74 基金投资组合

5.0.75 基金投资组合

5.0.76 基金投资组合

5.0.77 基金投资组合

5.0.78 基金投资组合

5.0.79 基金投资组合

5.0.80 基金投资组合

5.0.81 基金投资组合

5.0.82 基金投资组合

5.0.83 基金投资组合

5.0.84 基金投资组合

5.0.85 基金投资组合

5.0.86 基金投资组合

5.0.87 基金投资组合

5.0.88 基金投资组合

5.0.89 基金投资组合

5.0.90 基金投资组合

5.0.91 基金投资组合

5.0.92 基金投资组合

5.0.93 基金投资组合

5.0.94 基金投资组合

5.0.95 基金投资组合

5.0.96 基金投资组合

5.0.97 基金投资组合

5.0.98 基金投资组合

5.0.99 基金投资组合

5.0.100 基金投资组合

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2014年3季度,全球股票市场出现了震荡下行的态势,尤其是9月份,在美元走强和资金回流美国的影响下,新兴市场除美国外的发达市场出现了一定幅度的回调。本季度,美元计价的MSCI发达市场指数下跌2.16%,MSCI新兴市场指数下跌3.49%,新兴市场四国指数下跌2.75%。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》完善相应制度及流程,通过系统控制和工作流程等方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待下管理的所有基金和投资组合。

4.3.1 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有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2次,是由于指数型基金根据标的指数的成份股构成调整所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2014年3季度,全球股票市场出现了震荡下行的态势,尤其是9月份,在美元走强和资金回流美国的影响下,新兴市场除美国外的发达市场出现了一定幅度的回调。本季度,美元计价的MSCI发达市场指数下跌2.16%,MSCI新兴市场指数下跌3.49%,新兴市场四国指数下跌2.75%。

4.5 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人不存在买卖本基金的情况。

5.0 投资组合报告

5.0.1 基金投资组合

5.0.2 基金投资组合

5.0.3 基金投资组合

5.0.4 基金投资组合

5.0.5 基金投资组合

5.0.6 基金投资组合

5.0.7 基金投资组合

5.0.8 基金投资组合

5.0.9 基金投资组合

5.0.10 基金投资组合

5.0.11 基金投资组合

5.0.12 基金投资组合

5.0.13 基金投资组合

5.0.14 基金投资组合

5.0.15 基金投资组合

5.0.16 基金投资组合

5.0.17 基金投资组合

5.0.18 基金投资组合

5.0.19 基金投资组合

5.0.20 基金投资组合

5.0.21 基金投资组合

5.0.22 基金投资组合

5.0.23 基金投资组合

5.0.24 基金投资组合

5.0.25 基金投资组合

5.0.26 基金投资组合

5.0.27 基金投资组合

5.0.28 基金投资组合

5.0.29 基金投资组合

5.0.30 基金投资组合

5.0.31 基金投资组合

5.0.32 基金投资组合

5.0.33 基金投资组合

5.0.34 基金投资组合

5.0.35 基金投资组合

5.0.36 基金投资组合

5.0.37 基金投资组合

5.0.38 基金投资组合

5.0.39 基金投资组合

5.0.40 基金投资组合

5.0.41 基金投资组合

5.0.42 基金投资组合

5.0.43 基金投资组合

5.0.44 基金投资组合

5.0.45 基金投资组合

5.0.46 基金投资组合

5.0.47 基金投资组合

5.0.48 基金投资组合

5.0.49 基金投资组合

5.0.50 基金投资组合

5.0.51 基金投资组合

5.0.52 基金投资组合

5.0.53 基金投资组合

5.0.54 基金投资组合

5.0.55 基金投资组合

5.0.56 基金投资组合

5.0.57 基金投资组合

5.0.58 基金投资组合

5.0.59 基金投资组合

5.0.60 基金投资组合

5.0.61 基金投资组合

5.0.62 基金投资组合

5.0.63 基金投资组合

5.0.64 基金投资组合

5.0.65 基金投资组合

5.0.66 基金投资组合

5.0.67 基金投资组合

5.0.68 基金投资组合

5.0.69 基金投资组合

5.0.70 基金投资组合

5.0.71 基金投资组合

5.0.72 基金投资组合

5.0.73 基金投资组合

5.0.74 基金投资组合

5.0.75 基金投资组合

5.0.76 基金投资组合

5.0.77 基金投资组合

5.0.78 基金投资组合

5.0.79 基金投资组合

5.0.80 基金投资组合

5.0.81 基金投资组合

5.0.82 基金投资组合

5.0.83 基金投资组合

5.0.84 基金投资组合

5.0.85 基金投资组合

5.0.86 基金投资组合

5.0.87 基金投资组合

5.0.88 基金投资组合

5.0.89 基金投资组合

5.0.90 基金投资组合

5.0.91 基金投资组合

5.0.92 基金投资组合

5.0.93 基金投资组合

5.0.94 基金投资组合

5.0.95 基金投资组合

5.0.96 基金投资组合

5.0.97 基金投资组合

5.0.98 基金投资组合

5.0.99 基金投资组合

5.0.100 基金投资组合

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 南方小康ETF |
| 基金代码 | 510160 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年7月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 542,057,400.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,在保持基金资产净值波动率不超过0.5%的前提下,力争跟踪误差控制在0.5%以内。 |
| 业绩比较基准 | 中证500指数收益率*95%+人民币活期存款利率*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,主要跟踪中证500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的类似风险收益特征。 |
| 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“南方小康ETF”。

| | |
|----------------|------------------------------|
| 3.1 主要财务指标 | 单位:人民币元 |
| 主要财务指标 | 报告期 (2014年7月1日 - 2014年9月30日) |
| 1.本期已实现收益 | 7,473,794.90 |
| 2.本期利润 | 27,424,371.18 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0075 |
| 4.期末基金净值 | 183,189,645.65 |
| 5.期末基金净值 | 0.8380 |

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本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。

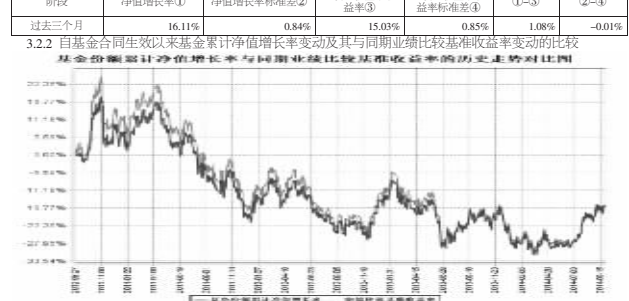
3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的对比

| 期间 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益③ | 业绩比较基准收益标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|-----------|--------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 16.11% | 0.86% | 15.00% | 0.85% | 1.09% | -0.01% |

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变动的对比

基金业绩比较基准:净值增长率与同期业绩比较基准收益变动的历史走势对比图



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吸引资金重新回流新兴市场,金砖四国的股票市场也会面临新的投资机会。尤其是巴西大选结束和南美“政改”实施,将会对巴西股市和中国经济形成重要的支撑。

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

5.5 投资组合报告

| | | | |
|-----|--------------|----------------|---------------|
| 序号 | 项目 | 金额 (人民币元) | 占基金资产净值比例 (%) |
| 1 | 权益投资 | 105,587,739.38 | 93.90 |
| 1.1 | 其中:普通股 | 53,042,803.52 | 47.17 |
| 1.2 | 优先股 | - | - |
| 1.3 | 存托凭证 | 52,544,935.86 | 46.73 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| 2.1 | 其中:债券 | - | - |
| 2.2 | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 其他投资 | 6,609,559.95 | 5.96 |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 155,985.24 | 0.14 |
| 7 | 其他资产 | 112,443,284.37 | 100.00 |

| 国家/地区 | 公允价值 (人民币元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|-------|----------------|---------------|
| 中国 | 53,042,803.52 | 47.75 |
| 美国 | 31,077,715.90 | 27.98 |
| 英国 | 21,467,219.96 | 19.33 |
| 合计 | 105,587,739.38 | 95.05 |

| | | | |
|---------------------------------|----------------|---------------|-------|
| 3.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合 | | 占基金资产净值比例 (%) | |
| 5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合 | | | |
| 行业类别 | 公允价值 (人民币元) | | |
| 消费品 | 19,200,452.07 | | 17.28 |
| 非必需消费品 | 1,254,347.68 | | 1.40 |
| 必需消费品 | 8,966,392.01 | | 8.07 |
| 金融 | 23,291,497.63 | | 20.97 |
| 医药 | 43,589,827.35 | | 39.24 |
| 材料 | 3,515,796.91 | | 3.16 |
| 科技 | 4,972,595.08 | | 4.48 |
| 公用事业 | 497,030.91 | | 0.45 |
| 合计 | 105,287,739.38 | | 95.05 |
| 注：1、上表基金资产净值均按照公允价值计量。 | | | |