

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

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监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，并对内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人和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信息，保证本报告内不存在虚假记载、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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告人人民币元为单位，以人民币元为记账单位。

本报告期未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方金砖四国指数(QDII)
基金代码	16021
前端费代销	16021
后端费代销	16022
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	139,591,420.64份
投资目标	本基金主要被动地指数组合化投资，以实现标的指数的有效跟踪。

本基金主要被动地指数组合化投资，采取得复制策略。本基金主要投资于在境内四国指数中的基准权重股和备选股票，在此基础上根据指数成份股的调整情况，将部分资金集中投资于净值增长率相对较高的股票，同时保留一定比例的现金以备支付差额的申购款。本基金力争在扣除基金管理费后的净值增长率不低于标的指数同期平均净值增长率的均值加0.4%，年跟踪误差不超过1.5%。

业绩比较基准 人民币计价的QDII基金指数×95%+人民币定期存款×5%（税后）。

风险收益特征 本基金属股票型基金，风险收益高于货币市场基金，低于基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要通过投资于境外股票市场，以期获得与境外股票市场一致的收益。

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 外资资产管理人

项目	境外资产管理人
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 100005

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	287,229.33
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.期末基金份额净值	111,084,529.04

5.期末份额净值

0.796

注:1.本期已实现收益指本基金本期营业收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额。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基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数值。

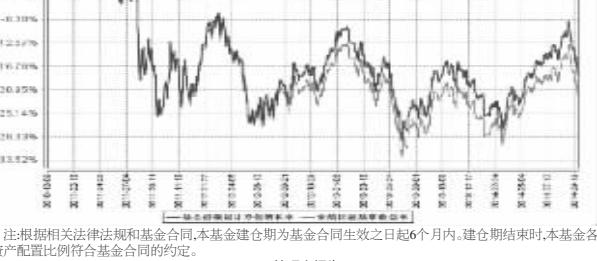
3.2 基金净值表现

3.2.1 本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① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
黄亮	本基金的基金经理	2010年12月9日 -	13年	北京大学工商管理硕士,具有基金从业资格,担任过南方基金管理有限公司基金经理,负责QDII品种设计及国际业务部相关工作。2009年1月至2010年11月任南方基金管理有限公司基金经理,负责QDII品种设计及国际业务部相关工作;2010年12月至2011年任南方基金管理有限公司基金经理,负责QDII品种设计及国际业务部相关工作;2011年9月至至今,任南方中小企债基金经理。

4.2 报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同的规定,恪守职业道德,并自觉遵守行业规范,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度执行的情况

本基金报告期内,基金管理人公平对待所管理的不同基金组合,未发生不公平交易行为。

4.3.2 公平交易制度执行的专项说明

本基金报告期内,基金管理人公平对待所管理的不同基金组合,未发生不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的报税策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金的报税策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金的报税策略和运作分析

4.4.3 异常交易行为的专项说明

4.4.4 报告期内基金的报税策略和运作分析

4.4.5 异常交易行为的专项说明

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金2014年第三季度净值增长率为-3.16%,基金基准增长-3.86%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014年第四季度,美国QE退出势必会对全球经济市场的流动性、投资者的信心等方面产生不利影响,影

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 重要提示

基金管理人的董事会及监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。

基金托管人和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信息,保证本报告内不存在虚假记载、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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 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。

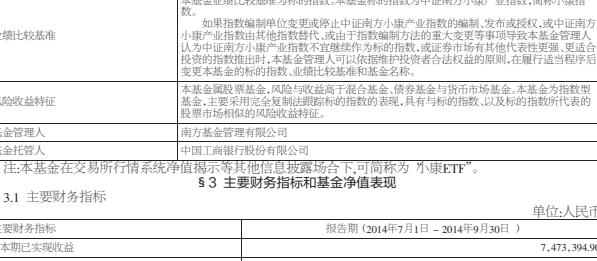
3.2 基金净值表现

3.2.1 本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① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去六个月 16.11% 0.84% 15.05% 0.85% 1.08% -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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
黄亮	本基金的基金经理	2010年12月9日 -	13年	北京大学工商管理硕士,具有基金从业资格,担任过南方基金管理有限公司基金经理,负责QDII品种设计及国际业务部相关工作。2009年1月至2010年11月任南方基金管理有限公司基金经理,负责QDII品种设计及国际业务部相关工作;2010年12月至2011年任南方基金管理有限公司基金经理,负责QDII品种设计及国际业务部相关工作;2011年9月至至今,任南方中小企债基金经理。

4.2 报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同的规定,恪守职业道德,并自觉遵守行业规范,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度执行的情况

4.3.1 公平交易制度执行的情况

本基金报告期内,基金管理人公平对待所管理的不同基金组合,未发生不公平交易行为。

4.3.2 公平交易制度执行的专项说明

本基金报告期内,基金管理人公平对待所管理的不同基金组合,未发生不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的报税策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金的报税策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金的报税策略和运作分析

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金2014年第三季度净值增长率为-3.16%,基金基准增长-3.86%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2014年第四季度,美国QE退出势必会对全球经济市场的流动性、投资者的信心等方面产生不利影响,影

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

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

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监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。

基金托管人和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信息,保证本报告内不存在虚假记载、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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 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。

3.1 主要财务指标

3.1.1 报告期各期末基金资产净值

3.1.2 报告期各期末基金资产净值增长率

3.1.3 报告期各期末基金资产净值收益率

3.1.4 报告期各期末基金资产净值收益率标准差

3.1.5 报告期各期末基金资产净值收益率

3.1.6 报告期各期末基金资产净值收益率

3.1.7 报告期各期末基金资产净值收益率

3.1.8 报告期各期末基金资产净值收益率

3.1.9 报告期各期末基金资产净值收益率

3.1.10 报告期各期末基金资产净值收益率