

# 南方金砖四国指数证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2020年8月21日

送出日期：2020年8月26日

**本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。**

## 一、产品概况

|          |  |                |                               |
|----------|--|----------------|-------------------------------|
| 基金简称     | 南方金砖四国指数(QDII)   | 基金代码           | 160121                        |
| 基金管理人    | 南方基金管理股份有限公司   | 基金托管人          | 中国工商银行股份有限公司                  |
| 境外托管人中文名 | 布朗兄弟哈里曼银行  | 境外托管人英文名       | Brown Brothers Harriman & Co. |
| 基金合同生效日  | 2010年12月9日   |                |                               |
| 基金类型     | 股票型  | 交易币种           | 人民币                           |
| 运作方式     | 普通开放式  |                |                               |
| 开放频率     | 每个开放日  |                |                               |
| 基金经理     | 黄亮   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2010年12月9日                    |
|          |  | 证券从业日期         | 2001年2月2日                     |
| 其他       | <p>若将来条件许可，基金管理人将根据情况决定是否将其转型为上市型开放式基金（LOF）或交易型开放式指数基金（ETF）联接基金。</p> <p>本基金管理人将在条件成熟时另行安排在证券交易所场内接受基金份额的申购赎回和上市交易，使本基金转型为上市型开放式基金（LOF），其场内申购赎回、上市交易、注册登记、收益分配等场内业务规则遵循本基金上市交易的证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定，届时无须召开基金份额持有人大会但须报中国证监会核准或备案并提前公告。</p> |                |                               |

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

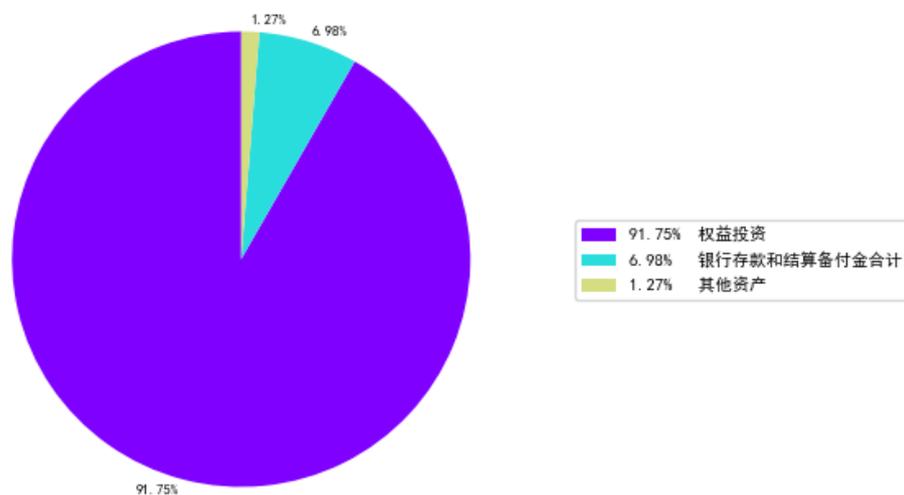
详见《南方金砖四国指数证券投资基金招募说明书》第四部分“基金的投资”。

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资，以实现对标的有效跟踪。  |
|      | 本基金的标的指数为富时金砖四国 50 指数（FTSE BRIC 50 Index），简称金砖四国指数。  |
| 投资范围 | 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（包括股票和/或存托凭证，下同）、备选成份股、新股（一级市场首次发行或增发），其中金砖四国指数成份股及备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产 |

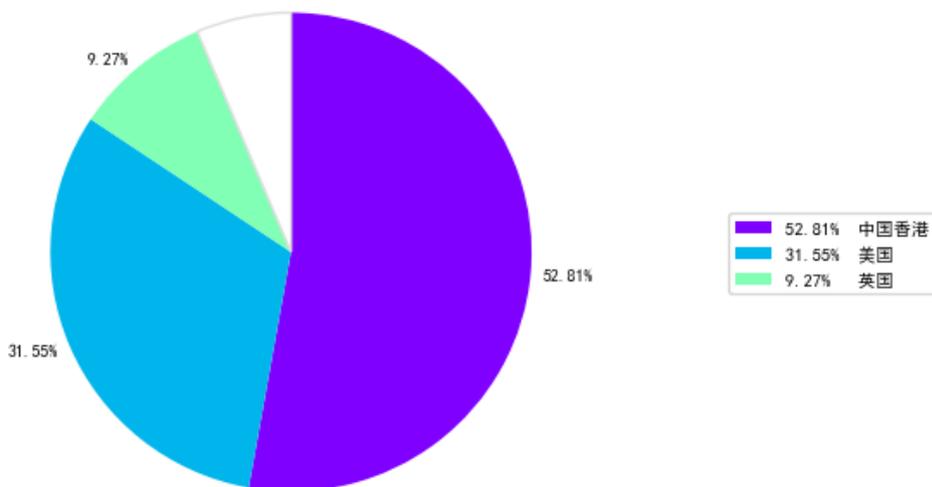
|        |  |
|--------|--|
|        | <p>净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、ETF基金、权证、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。</p> |
| 主要投资策略 | <p>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成份股及其权重的变化进行相应调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.4%，年跟踪误差不超过5%。</p>  |
| 业绩比较基准 | <p>人民币计价的金砖四国指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）。</p>  |
| 风险收益特征 | <p>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，主要采用综合指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>  |

## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图（2020年6月30日）



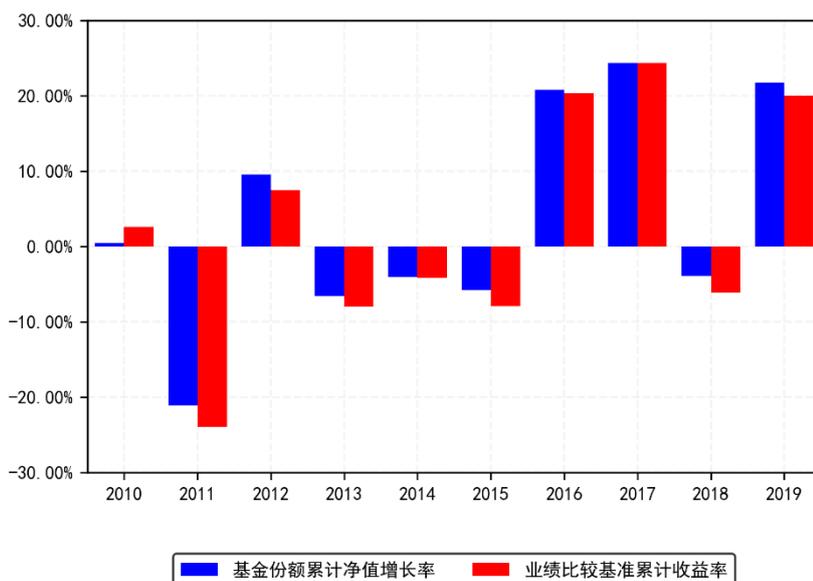
各个国家（地区）证券市场的权益投资分布比例情况图（2020年6月30日）



投资组合区域配置饼状图空白部分为除权益投资外的资产占基金资产净值比例。

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

南方金砖四国指数（QDII）每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2019年12月31日）



1. 基金合同生效当年按实际期限计算，不按整个自然年度进行折算。
2. 基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注  |
|------|---------------------------|---------|-----|
| 认购费  | M < 100 万元                | 1.1%    | 前收费 |
|      | 100 万元 ≤ M < 500          | 0.6%    | 前收费 |

|          |                   |           |     |
|----------|-------------------|-----------|-----|
|          | 万元                |           |     |
|          | 500 万元 ≤ M < 1000 | 0.2%      | 前收费 |
|          | 万元                |           |     |
|          | 1000 万元 ≤ M       | 每笔 1000 元 | 前收费 |
| 认购费      | N < 365 天         | 1.2%      | 后收费 |
|          | 1 年 ≤ N < 2 年     | 1%        | 后收费 |
|          | 2 年 ≤ N < 3 年     | 0.8%      | 后收费 |
|          | 3 年 ≤ N < 4 年     | 0.5%      | 后收费 |
|          | 4 年 ≤ N < 5 年     | 0.2%      | 后收费 |
|          | 5 年 ≤ N           | 0%        | 后收费 |
| 申购费（前收费） | M < 100 万元        | 1.3%      | -   |
|          | 100 万元 ≤ M < 500  | 0.7%      | -   |
|          | 万元                |           |     |
|          | 500 万元 ≤ M < 1000 | 0.2%      | -   |
|          | 万元                |           |     |
|          | 1000 万元 ≤ M       | 每笔 1000 元 | -   |
| 申购费（后收费） | N < 365 天         | 1.4%      | -   |
|          | 1 年 ≤ N < 2 年     | 1.2%      | -   |
|          | 2 年 ≤ N < 3 年     | 1%        | -   |
|          | 3 年 ≤ N < 4 年     | 0.7%      | -   |
|          | 4 年 ≤ N < 5 年     | 0.4%      | -   |
|          | 5 年 ≤ N           | 0%        | -   |
| 赎回费      | N < 7 天           | 1.5%      | -   |
|          | 7 天 ≤ N < 365 天   | 0.5%      | -   |
|          | 1 年 ≤ N < 2 年     | 0.3%      | -   |
|          | 2 年 ≤ N           | 0%        | -   |

## （二）基金运作相关费用

| 费用类别  | 收费方式  | 年费率     |
|-------|---|---------|
| 管理费   |   | - 0.80% |
| 托管费   |   | - 0.25% |
| 销售服务费 |   | - -     |
| 其他费用  | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；基金上市费及年费（若今后本基金上市交易）；基金的指数使用费；基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees）；基金份额持有人大会费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费，税务顾问费等根据有关法规、《基金合同》及相应协议的规定，由基金管理人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用；基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金 |         |

及费用) (简称“税收”); 代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用; 基金的银行汇划费用; 与基金有关的诉讼、追索费用; 按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用, 按实际支出额从基金财产总值中扣除。

注: 本基金交易证券、基金等产生的费用和税负, 按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险, 投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金投资中出现的风险包括三类, 一是境外投资风险, 包括海外市场风险、汇率风险、政治风险、新兴市场投资风险等; 二是开放式基金风险, 包括流动性风险、管理风险、会计核算风险、税务风险、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等。

本基金特有的风险包括:

#### 1、标的指数的风险

标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异。因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大, 增加基金投资成本, 并有可能因此而增加跟踪误差, 影响投资收益。如果标的指数被停止编制及发布, 或编制者或所有者停止对本基金的指数使用授权, 或标的指数由其他指数替代(单纯更名除外), 或由于指数编制方法等重大变更而不宜继续作为标的指数, 导致本基金变更标的指数。

#### 2、跟踪偏离风险

基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的净值表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性, 可能包括:

(1) 基金在跟踪指数过程中由于买入和卖出证券时均存在交易成本, 导致本基金在跟踪指数时可能产生收益上的偏离;

(2) 受市场流动性风险的影响, 本基金在实际管理过程中由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为标的指数的成份股, 或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将股票及时地转化为现金, 使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险;

(3) 在本基金实行指数化投资过程中, 管理人对指数基金的管理能力, 例如跟踪指数的技术手段、买入卖出的时机选择等, 会对本基金的收益产生影响, 从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

#### 3、金砖四国风险

金砖四国中的巴西、印度、俄罗斯和中国目前均属于新兴市场, 面临新兴市场投资的一般性风险。同时由于金砖四国政治体制、经济发展模式和速度差异使各国上市公司盈利和收益出现差异, 导致各个市场的风险收益特征发生显著变化, 从而存在使标的指数和成份股的风险收益特征发生显著变化的风险。

#### 4、指数成份股上市地、代表性风险

根据标的指数编制方法, 如果同一只股票有多个H股或者存托凭证, 则以最近12个月总成交量为标准, 选取流动性最好的作为成份股。虽然上述方法选取的成份股具有较好的流动性, 但是仍然存在着入选成份股无法完全代表上市公司股票走势的风险。同时由于标的指数成份股数量的限制, 存在着标的指数走势无法完全反映金砖四国上市公司整体状况

的风险。根据指数编制方法，如果金砖四国的整体市值和流动性持续增强，富时指数公司将在每年 12 月的定期调整中决定是否相应增加指数的成份股数量。

#### 5、投资于股指期货风险：

- （1）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。
- （2）流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。
- （3）基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险。
- （4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。
- （5）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。
- （6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险：

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和代销机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值以及中国证监会认定的其他措施。同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按基金合同约定的时限支付赎回款项。

## （二）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]592 号文核准募集。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁地点为北京市。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[[www.nffund.com](http://www.nffund.com)][客服电话：400-889-8899]

- 《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》、
- 《南方金砖四国指数证券投资基金基金托管协议》、
- 《南方金砖四国指数证券投资基金基金招募说明书》
- 定期报告、包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

## 六、其他情况说明

暂无。