

南方金砖四国指数证券投资基金

清算报告

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

报告出具日：2020 年 10 月 30 日

报告送出日：2020 年 11 月 18 日

一、基金简介

(一)、基本情况

1.基本信息

基金简称	南方金砖四国指数 (QDII)
基金主代码	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
最后运作日基金份额总额	25,385,952.75
投资目标	本基金采用被动式指数化投资，以实现对标的指数的有效跟踪。
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%。
业绩比较基准	人民币计价的金砖四国指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×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。
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
境外资产托管人	英文名称：Brown Brothers Harriman & Co.
	中文名称：布朗兄弟哈里曼银行

2.基金运作情况

南方金砖四国指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]592号《关于核准南方金砖四国指数证券投资基金募集的批复》核准，由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于2018年1月4日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币636,361,305.76元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第379号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，

《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 636,543,203.98 份基金份额，其中认购资金利息折合 181,898.22 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》的有关规定，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)、备选成份股、新股(一级市场首次发行或增发)。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。本基金投资组合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。本基金的业绩比较基准为：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)。

根据《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》以及南方基金管理股份有限公司于 2020 年 9 月 18 日发布的《南方金砖四国指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2020 年 9 月 19 日起进入基金财产清算程序。

（二）、清算原因

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《基金合同》应当终止。本基金管理人于 2020 年 7 月 20 日发布《南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方金砖四国指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议终止本基金基金合同有关事项的议案，审议议案于 2020 年 9 月 17 日通过，大会决议自通过之日起生效，本基金管理人于 2020 年 9 月 18 日发布《南方金砖四国指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

（三）、最后运作日及清算期间

本基金最后运作日为 2020 年 9 月 18 日，清算期为 2020 年 9 月 19 日至 2020 年 10 月 30 日。

二、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的数据列示。

三、财务报告

资产负债表

会计主体：南方金砖四国指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 9 月 18 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2020 年 9 月 18 日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	3,588,486.89
交易性金融资产	29,020,180.66
其中：股票投资	29,020,180.66
应收证券清算款	295,537.09
应收利息	1,897.56
应收股利	66,101.77
应收申购款	-
资产总计	32,972,203.97
负债和所有者权益	
负 债：	
应付证券清算款	-
应付赎回款	435,377.83
应付管理人报酬	13,970.71
应付托管费	4,365.84
应付交易费用	74,181.95
其他负债	144,348.62
负债合计	672,244.95
所有者权益：	
实收基金	25,385,952.75
未分配利润	6,914,006.27
所有者权益合计	32,299,959.02
负债和所有者权益总计	32,972,203.97

注：报告截止日 2020 年 9 月 18 日(基金最后运作日)，基金份额总额 25,385,952.75 份，基金份额净值

1.272 元。

四、清算情况

自 2020 年 9 月 19 日至 2020 年 10 月 30 日止为本基金清算报告期，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

（一）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。根据本基金的基金合同，本基金的清算费用由基金财产承担。其中包括：公证费 10,000.00 元，律师费 40,000.00 元，审计费 28,000.00 元。

（二）最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日应收利息 1,897.56 元，其中应收活期存款利息为 1,766.23 元，应收结算备付金利息为 131.33 元。上述款项已于 2020 年 9 月 21 日季度结息日划入基金托管户。

2、本基金最后运作日，港股通证券清算款为 0.71 元，该款项已于 2020 年 9 月 24 日划入托管户；美元证券清算款为 43,724.22 美元（折合人民币 295,536.38 元），该款项已于 2020 年 9 月 22 日划入托管户。

3、本基金最后运作日应收股利为 66,101.77 元，部分款项共 52,230.71 元已于 2020 年 10 月 23 日划至基金托管户，剩余未到账款项由基金管理人以自有资金先行垫付，待相关款项划到基金托管账户后返还给基金管理人。应收股利无法兑现带来的损失及应收股利的尾差由管理人承担。若实际到账金额与预计金额的盈余大于二次清算费用，再另行向投资者分配。

4、本基金最后运作日共计持有指数成分股 51 只，截止运作终止日证券市值合计人民币 29,020,180.66 元。所有证券已于 2020 年 9 月 21 日至 2020 年 9 月 23 日期间全部卖出，实际清算金额（含交易费用）合计人民币 28,566,475.06 元。所有卖出所得清算款已于 2020 年 9 月 25 日全部划入基金托管户。

证券清算明细如下：

股票代码	股票名称	交易市场	运作终止日 (2020 年 9 月 18 日) 证券数量	运作终止日 (2020 年 9 月 18 日) 市 值 (人民币)	卖出数量	卖出日期	卖出清算金额 (人民币)
ABEV UN	AMBEV 有 限公司	美国证券 交易所	14,405.00	232,701.96	14,405.00	2020-09-21	226,868.35
BABA US	阿里巴巴	美国证券 交易所	2,220.00	4,087,567.08	2,220.00	2020-09-21	4,108,426.53

BIDU US	百度	美国证券 交易所	1,159.00	976,561.12	1,159.00	2020-09-22	975,407.65
BSBR UN	巴西桑坦 德银行股 份公司	美国证券 交易所	1,220.00	41,642.82	1,220.00	2020-09-21	41,232.00
IBN UN	ICICI 银行 有限公司	美国证券 交易所	1,067.00	72,408.08	1,067.00	2020-09-21	69,814.35
ITUB UN	Banco Itau Holding Financeir	美国证券 交易所	15,875.00	454,955.02	15,875.00	2020-09-21	444,241.30
JD UQ	京东	美国证券 交易所	2,852.00	1,436,133.01	2,852.00	2020-09-22	1,451,169.26
LKOD LI	卢克石油 公司	伦敦证券 交易所 (国际)	1,268.00	528,288.01	1,268.00	2020-09-21	498,600.12
MNOD LI	诺里尔斯 克镍业公 司	伦敦证券 交易所 (国际)	1,585.00	272,864.53	1,585.00	2020-09-21	258,350.32
NTES US	网易	美国证券 交易所	339.00	1,067,922.46	339.00	2020-09-21	1,099,560.70
NVTK LI	诺瓦泰克 公司	伦敦证券 交易所 (国际)	326.00	325,452.02	326.00	2020-09-21	310,901.17
OGZD LI	俄罗斯天 然气工业 公司	伦敦证券 交易所 (国际)	16,070.00	520,500.99	16,070.00	2020-09-21	493,720.03
PBR UN	巴西石油 公司	美国证券 交易所	6,142.00	340,833.16	6,142.00	2020-09-21	326,315.13
PDD US	拼多多	美国证券 交易所	1,650.00	890,082.22	1,650.00	2020-09-22	896,002.57
PLZL LI	POLYUS 公开合股 公司	伦敦证券 交易所 (国际)	166.00	125,889.59	166.00	2020-09-21	117,193.17
ROSN LI	俄罗斯石 油公司	伦敦证券 交易所 (国际)	3,483.00	116,979.95	3,483.00	2020-09-21	111,145.92
SBER LI	俄罗斯联 邦商业储 蓄银行公 开股份公 司	伦敦证券 交易所 (国际)	7,615.00	622,793.61	7,615.00	2020-09-21	600,309.78

SGGD LI	苏尔古特石油天然气公司	伦敦证券交易所 (国际)	2,121.00	67,121.38	2,121.00	2020-09-21	64,991.92
TAL US	好未来教育集团	美国证券交易所	1,730.00	884,827.70	1,730.00	2020-09-22	865,120.81
VALE UN	淡水河谷公司	美国证券交易所	10,880.00	846,433.98	10,880.00	2020-09-21	816,313.18
267 HK	中国中信股份有限公司	中国香港联合交易所	18,000.00	99,684.46	18,000.00	2020-09-21	99,300.82
688 HK	中国海外发展有限公司	中国香港联合交易所	12,000.00	212,974.15	12,000.00	2020-09-21	209,348.63
728 HK	中国电信股份有限公司	中国香港联合交易所	90,000.00	197,014.17	90,000.00	2020-09-21	191,080.19
762 HK	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	中国香港联合交易所	18,000.00	89,951.49	18,000.00	2020-09-21	86,451.44
1109 HK	华润置地有限公司	中国香港联合交易所	8,000.00	251,522.29	8,000.00	2020-09-21	247,123.41
1398 HK	中国工商银行股份有限公司	中国香港联合交易所	272,000.00	1,008,182.28	272,000.00	2020-09-23	978,624.88
1810 HK	小米公司	中国香港联合交易所	40,200.00	773,064.75	40,200.00	2020-09-22	718,457.40
1918 HK	融创中国控股有限公司	中国香港联合交易所	9,000.00	250,780.98	9,000.00	2020-09-23	244,113.68
2007 HK	碧桂园控股有限公司	中国香港联合交易所	25,000.00	204,950.55	25,000.00	2020-09-23	208,021.37
2020 HK	安踏体育用品有限公司	中国香港联合交易所	6,000.00	422,023.71	6,000.00	2020-09-23	420,767.89
2269 HK	药名生物	中国香港联合交易所	3,000.00	499,992.13	3,000.00	2020-09-23	502,663.74
2313 HK	申洲国际集团控股有限公司	中国香港联合交易所	2,300.00	259,563.33	2,300.00	2020-09-23	256,782.64

2318 HK	中国平安 保险(集团) 股份有限 公司	中国香港 联合交易 所	13,500.00	985,463.29	13,500.00	2020-09-23	963,156.01
2328 HK	中国人民 财产保险 股份有限 公司	中国香港 联合交易 所	44,233.00	224,903.48	44,233.00	2020-09-23	208,696.64
241 HK	阿里健康 信息技术 有限公司	中国香港 联合交易 所	14,000.00	234,184.35	14,000.00	2020-09-21	230,545.75
2669 HK	中海物业 集团有限 公司	中国香港 联合交易 所	1.00	5.76	1.00	2020-09-21	4.71
291 HK	华润啤酒 (控股)有 限公司	中国香港 联合交易 所	6,000.00	261,377.36	6,000.00	2020-09-21	258,936.99
3328 HK	交通银行 股份有限 公司	中国香港 联合交易 所	48,200.00	163,943.00	48,200.00	2020-09-23	156,953.32
3333 HK	中国恒大 集团	中国香港 联合交易 所	15,000.00	215,852.18	15,000.00	2020-09-23	211,565.01
3690 HK	美团点评	中国香港 联合交易 所	7,100.00	1,496,016.92	7,100.00	2020-09-22	1,505,328.02
3692 HK	翰森制药	中国香港 联合交易 所	6,000.00	201,723.67	6,000.00	2020-09-23	196,865.86
384 HK	中国燃气 控股有限 公司	中国香港 联合交易 所	8,200.00	155,901.96	8,200.00	2020-09-21	154,440.45
3968 HK	招商银行 股份有限 公司	中国香港 联合交易 所	11,500.00	395,663.58	11,500.00	2020-09-23	383,051.91
3988 HK	中国银行 股份有限 公司	中国香港 联合交易 所	267,000.00	584,475.36	267,000.00	2020-09-23	574,978.77
6862 HK	海底捞国 际控股有 限公司	中国香港 联合交易 所	2,000.00	104,830.03	2,000.00	2020-09-21	100,477.90
700 HK	腾讯控股 有限公司	中国香港 联合交易 所	6,900.00	3,159,290.93	6,900.00	2020-09-22	3,084,443.26

788 HK	中国铁塔	中国香港联合交易所	260,000.00	324,257.93	260,000.00	2020-09-23	316,209.80
883 HK	中国海洋石油有限公司	中国香港联合交易所	56,000.00	404,877.63	56,000.00	2020-09-23	381,882.96
939 HK	中国建设银行股份有限公司	中国香港联合交易所	185,000.00	858,350.35	185,000.00	2020-09-23	838,893.30
941 HK	中国移动有限公司	中国香港联合交易所	17,000.00	777,634.71	17,000.00	2020-09-21	771,247.00
960 HK	龙湖地产有限公司	中国香港联合交易所	7,500.00	289,765.19	7,500.00	2020-09-23	290,377.05

(三) 最后运作日负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付管理费为 13,970.71 元，应付托管费为 4,365.84 元，该款项已于 2020 年 10 月 13 日支付。
- 2、本基金最后运作日应付赎回款为 435,377.83 元，该款项已于 2020 年 9 月 25 日支付。
- 3、本基金最后运作日应付赎回费为 1,848.62 元，该款项已于 2020 年 9 月 25 日支付。
- 4、本基金最后运作日应付交易费用为 74,181.95 元，该款项已于 2020 年 9 月 28 日支付。
- 5、本基金最后运作日应付信息披露费为 60,000.00 元，该款项已于 2020 年 9 月 28 日支付。
- 6、本基金最后运作日应付审计费为 28,000.00 元，该款项已于 2020 年 10 月 22 日支付。
- 7、本基金最后运作日应付律师费为 40,000.00 元，该款项已于 2020 年 9 月 28 日支付。
- 8、本基金最后运作日应付公证费为 10,000.00 元，该款项已于 2020 年 9 月 28 日支付。
- 9、本基金最后运作日账户维护费为 4,500.00 元，该款项已于 2020 年 9 月 30 日支付。

(四) 停止运作后的清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	清算报告期间：2020 年 9 月 19 日至 2020 年 10 月 30 日
一、收入	-200,171.91
1、利息收入	14,992.45
其中：存款利息收入	14,992.45
债券利息收入	
资产支持证券利息收入	
买入返售金融资产收入	
其他利息收入	

2、投资收益（损失以“-”填列）	3,889,170.60
其中：股票投资收益	3,890,312.01
基金投资收益	
债券投资收益	
资产支持证券投资收益	
衍生工具收益	
理财产品投资收益	
港股通股利收入	
股利收益（注1）	-1,141.41
其他投资收益	
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-4,296,152.91
4、汇兑收益（损失以“-”填列）（注2）	189,852.33
5、其他收入（损失以“-”填列）（注3）	1,965.62
二、费用	48,970.15
1、管理人报酬	
2、托管费	
3、销售服务费	
4、受托费	
5、投资顾问费	
6、交易费用	48,602.14
7、利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
8、其他费用（注4）	368.01
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	-249,142.06
减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”填列）	-249,142.06

注：

- 1、股利收益为清算期间因汇率波动、分红税率等原因产生的实际到账金额与计提金额的差额。
- 2、汇兑损益为清算期间持有外币资产由于汇率变动而产生的损益。
- 3、其他收入为清算期间归入基金资产的基金赎回费收入。
- 4、其他费用为清算期间的银行汇划费、境外存托费。

（五）停止运作后的清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2020 年 9 月 18 日基金净资产	32,299,959.02
加：清算报告期间净收益	-249,142.06
减：赎回金额（含费用）	3,679,879.94
二、2020 年 10 月 30 日基金净资产	28,370,937.02

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日2020年10月30日，本基金剩余财产为

28,370,937.02元。自本次清算期结束日次日(2020年10月31日)至清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有,为保护基金份额持有人利益,加快清盘速度,基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项(该金额可能与实际结息金额存在略微差异),供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

剩余未到账应收股利款项由基金管理人以自有资金先行垫付,待相关款项划到基金托管账户后返还给基金管理人。应收股利无法兑现带来的损失及应收股利的尾差由管理人承担。若实际到账金额与预计金额的盈余大于二次清算费用,再另行向投资者分配。

(六) 基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核,将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后,基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分析。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

(1) 南方金砖四国指数证券投资基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 9 月 18 日(最后运作日)止期间的财务报表及审计报告;

(2) 《南方金砖四国指数证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

南方金砖四国指数证券投资基金基金财产清算小组

2020 年 10 月 30 日