

# 南方大数据 300 指数证券投资基金 2015 年 年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2015 年 6 月 24 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	51
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.11 投资组合报告附注 .....	52
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	53
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
11.4 基金投资策略的改变 .....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方大数据 300 指数证券投资基金	
基金简称	南方大数据 300 指数	
场内简称	大数据 300	
基金主代码	001420	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,564,781,947.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大数据 300A	大数据 300C
下属分级基金的交易代码:	001420	001426
报告期末下属分级基金的份额总额	1,411,621,918.89 份	153,160,028.99 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理，力争控制本基金的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 0.5%，年跟踪误差不超过 6%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	大数据 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		吴万善	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦塔楼 31-33 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	大数据 300A	大数据 300C
本期已实现收益	-104,524,735.12	-13,152,951.67
本期利润	-45,819,943.45	-10,158,474.12

加权平均基金份额本期利润	-0.0262	-0.0477
本期加权平均净值利润率	-2.86%	-5.21%
本期基金份额净值增长率	-0.63%	-0.74%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	
期末可供分配利润	-80,898,935.70	-8,927,647.39
期末可供分配基金份额利润	-0.0573	-0.0583
期末基金资产净值	1,402,777,923.21	152,033,246.83
期末基金份额净值	0.9937	0.9926
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.63%	-0.74%

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、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3、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字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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

大数据 300A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	24.68%	1.65%	24.98%	1.63%	-0.30%	0.02%
过去六个月	-0.63%	2.26%	-9.55%	2.71%	8.92%	-0.45%
自基金合同生效起至今	-0.63%	2.21%	-16.65%	2.82%	16.02%	-0.61%

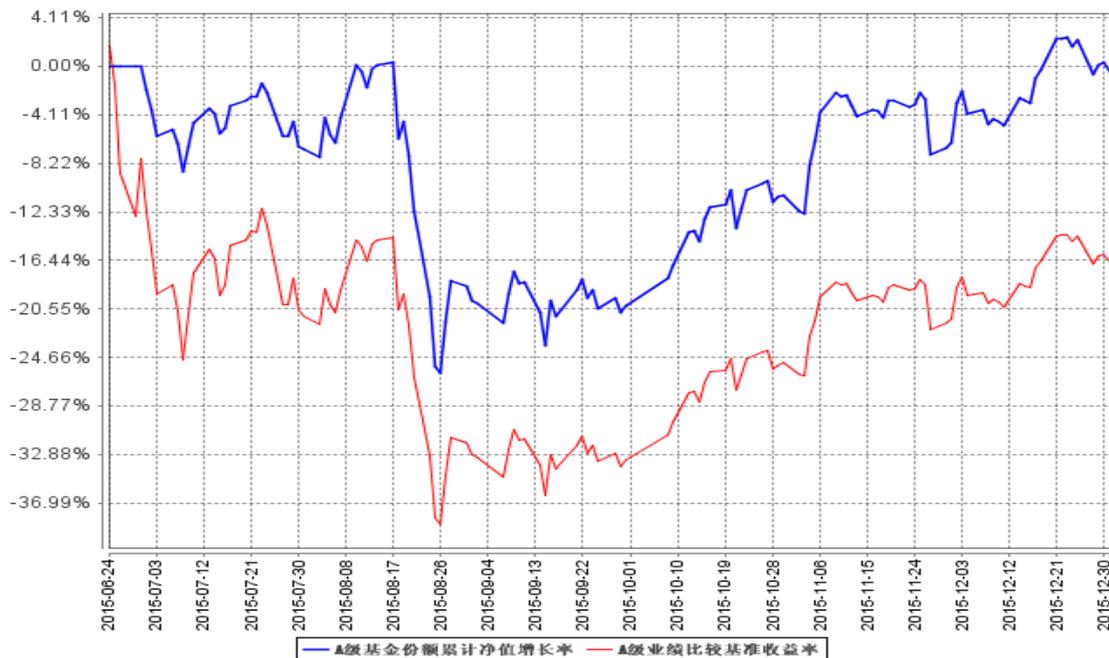
大数据 300C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	24.62%	1.65%	24.98%	1.63%	-0.36%	0.02%
过去六个月	-0.74%	2.26%	-9.55%	2.71%	8.81%	-0.45%
自基金合同生效起至今	-0.74%	2.21%	-16.65%	2.82%	15.91%	-0.61%

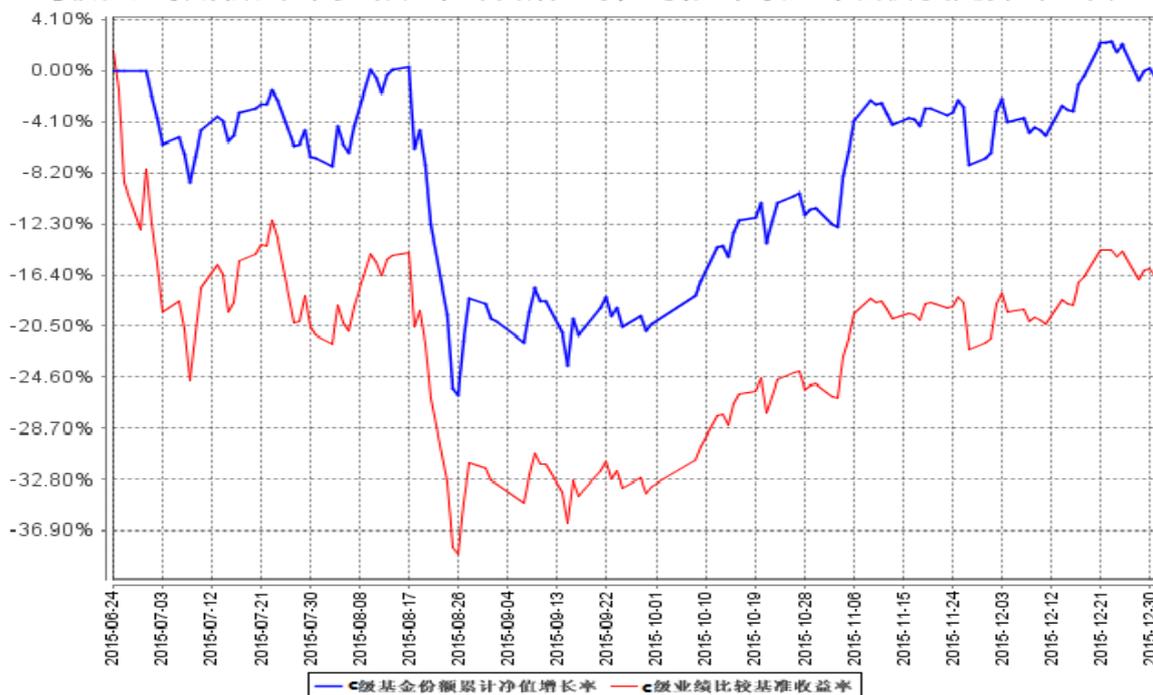
注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



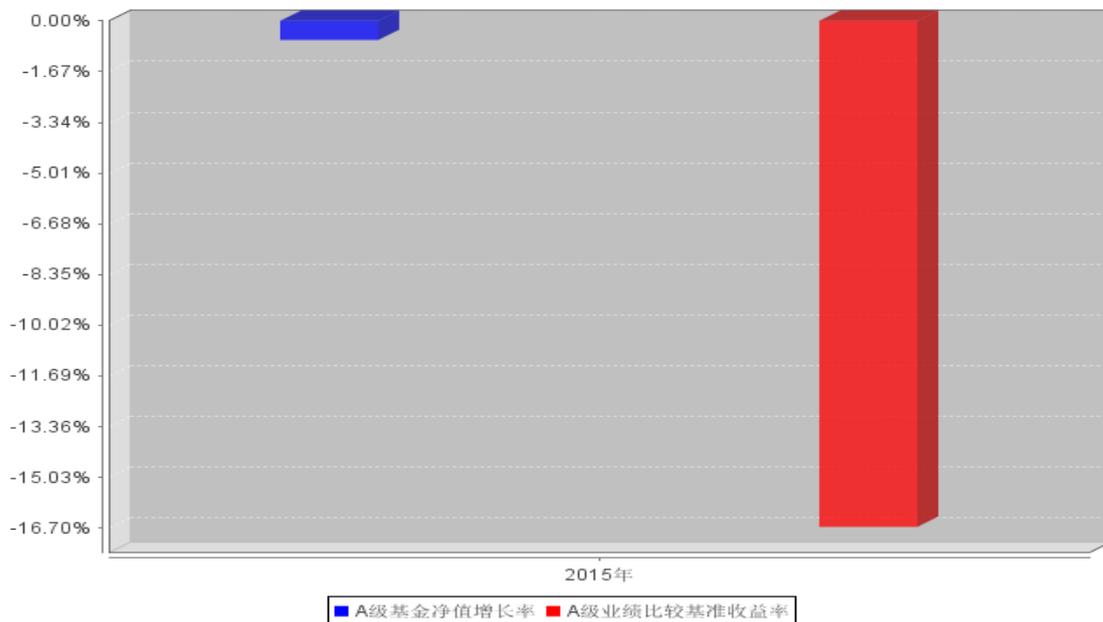
**c级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



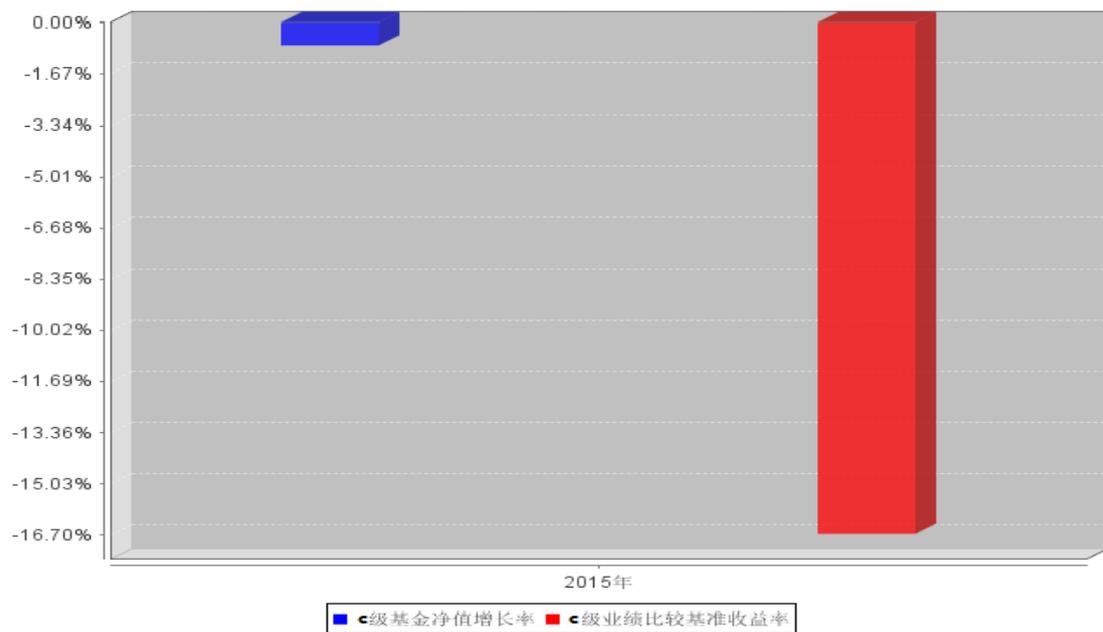
注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**A级**自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



**C级**自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本 3 亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 5,000 亿元，旗下管理 85 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
雷俊	本基金基金经理	2015 年 6 月 24 日	-	7 年	北京大学工学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、量化投资部高级研究员；2014 年 12 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任大数据 100 基金经理；2015 年 6 月至今，任南方国企改革、南方高铁、南方策略优化、大数据 300、南方 500 信息、南方量化成长的基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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《南方大数据 300 指数基金基金合同》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，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.3 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9次，其中5次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致，2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致，2次是由于投资组合的投资策略需要，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金经历 A 股市场近大半年的大起大落，作为六月份成立的新基金，在经历市场大幅波动情况下实现了稳步建仓。实际日常管理时严格按照指数投资管理流程进行运作，同时采用指令批量交易、算法交易多种交易手段，力争在申购赎回时降低交易成本和跟踪误差。同时，为了更好的管理流动性，根据基金的每期的成分股持仓情况，基金在适当条件采用部分股指期货投资替代。

本基金是基于互联网用户行为分析的一只股票指数基金，由于指数编制中有一部分互联网用户行为数据分析，其多变性某些时候会导致指数成分股的变化较大。随着时间的不断累积，越来越多的用户行为数据积累将有利于模型的优化和改善；同时随着 IPO 的放开和注册制的临近，量化大数据选股的优势将得到更多的体现。我们对未来该指数编制的数量化模型充满信心。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 级份额净值为 0.9937 元；C 级份额净值为 0.9926 元。

报告期内，本基金 A 级份额净值增长率为-0.63%，同期业绩基准增长率为-16.65%；C 级份额净值增长率为-0.74%，同期业绩基准增长率为-16.65%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，未来 A 股市场结构性牛市的动力仍在，上涨逻辑是利率不断下行和资产配置荒。一是整个经济中利率水平仍在下降，而我国居民可投资资产过百万亿元，大类资产配置会倾向于权益类资产投资；二是经济改革转型加速推进，改革红利的释放提升许多受益产业的估值水平。三是宽松货币政策逻辑为改变。展望未来一段时间，A 股仍将有很好的投资机会。

本基金为指数化产品，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作，制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度，进

一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方大数据 300 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 21295 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方大数据 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的南方大数据 300 指数证券投资基金(以下简称“南方大数据 300 指数基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月

	31 日的资产负债表、2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是南方大数据 300 指数基金 的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述南方大数据 300 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了南方大数据 300 指数基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛 竞   陈 熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2016 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	30,396,479.19
结算备付金		139,000,495.12
存出保证金		29,786,641.02
交易性金融资产	7.4.7.2	1,360,498,012.84
其中：股票投资		1,360,498,012.84
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	61,029.35
应收股利		-
应收申购款		1,834,241.56
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,561,576,899.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		4,908,647.96
应付管理人报酬		705,325.46
应付托管费		211,597.67
应付销售服务费		56,088.13
应付交易费用	7.4.7.7	441,479.09
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	442,590.73
负债合计		6,765,729.04
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,564,781,947.88
未分配利润	7.4.7.10	-9,970,777.84
所有者权益合计		1,554,811,170.04
负债和所有者权益总计		1,561,576,899.08

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，南方大数据 300 指数证券投资基金之 A 类份额(以下简称“A 类份额”)的份额净值 0.9937 元，南方大数据 300 指数证券投资基金之 C 类份额(以下简称“C 类份额”)的份额净值 0.9926 元；基金份额总额 1,564,781,947.88 份，其中 A 类份额 1,411,621,918.89 份，C 类份额 153,160,028.99 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-46,694,501.97
1.利息收入		2,469,542.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,590,839.84
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		878,702.30
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-111,681,143.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-141,569,817.12
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	23,466,240.00
股利收益	7.4.7.16	6,422,433.21
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	61,699,269.22

4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	817,830.58
<b>减:二、费用</b>		<b>9,283,915.60</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,655,426.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,396,627.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	403,464.68
4. 交易费用	7.4.7.19	2,399,782.46
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	428,613.91
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-55,978,417.57</b>
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-55,978,417.57</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方大数据 300 指数证券投资基金

本报告期: 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,115,000,092.74	-	2,115,000,092.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-55,978,417.57	-55,978,417.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-550,218,144.86	46,007,639.73	-504,210,505.13
其中: 1. 基金申购款	52,363,346.17	-3,184,263.95	49,179,082.22
2. 基金赎回款	-602,581,491.03	49,191,903.68	-553,389,587.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,564,781,947.88	-9,970,777.84	1,554,811,170.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          杨小松          </u>	<u>          徐超          </u>	<u>          徐超          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方大数据 300 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”)证监许可[2015]1051 号《关于准予南方大数据 300 指数证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方大数据 300 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 2,114,455,042.92 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 767 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,115,000,092.74 份,其中认购资金利息折合 545,049.82 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式或销售机构的不同,将基金份额分为 A 类、C 类基金份额,分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股,可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,80%以上的基金资产投资于股票;本基金投资于大数据 300 指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 85%,且不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业

绩比较基准为：大数据 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方大数据 300 指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具(主要为股指期货)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为股指期货)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市

场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	30,396,479.19
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	30,396,479.19

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,297,545,583.62	1,360,498,012.84	62,952,429.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,297,545,583.62	1,360,498,012.84	62,952,429.22

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	146,696,040.00	-	-	
IF1601	146,696,040.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	146,696,040.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	19,167.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	41,516.38
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	345.51
合计	61,029.35

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	441,479.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	441,479.09

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18,481.01
预提费用	241,000.00
指数使用费	183,109.72
合计	442,590.73

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

大数据 300A		
项目	本期 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,874,441,043.18	1,874,441,043.18

本期申购	38,666,620.06	38,666,620.06
本期赎回（以“-”号填列）	-501,485,744.35	-501,485,744.35
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,411,621,918.89	1,411,621,918.89

金额单位：人民币元

大数据 300C		
项目	本期	
	2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	240,559,049.56	240,559,049.56
本期申购	13,696,726.11	13,696,726.11
本期赎回（以“-”号填列）	-101,095,746.68	-101,095,746.68
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	153,160,028.99	153,160,028.99

注：1. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2015 年 6 月 15 日至 2015 年 6 月 19 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 2,114,455,042.92 元，根据基金份额发售面值人民币 1.00 元折合为 2,114,455,042.92 份基金份额，其中 A 类基金份额为 1,873,951,785.62 份，C 类基金份额为 240,503,257.30 份。根据《南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 545,049.82 元在本基金成立后，折算为 545,049.82 份基金份额，其中 A 类基金份额为 489,257.56 份，C 类基金份额为 55,792.26 份划入基金份额持有人账户。

3. 根据《南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 9 月 14 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2015 年 9 月 15 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

大数据 300A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-104,524,735.12	58,704,791.67	-45,819,943.45
本期基金份额交易	23,625,799.42	13,350,148.35	36,975,947.77

产生的变动数			
其中：基金申购款	-2,212,356.85	-319,130.83	-2,531,487.68
基金赎回款	25,838,156.27	13,669,279.18	39,507,435.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-80,898,935.70	72,054,940.02	-8,843,995.68

单位：人民币元

大数据 300C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-13,152,951.67	2,994,477.55	-10,158,474.12
本期基金份额交易产生的变动数	4,225,304.28	4,806,387.68	9,031,691.96
其中：基金申购款	-821,940.32	169,164.05	-652,776.27
基金赎回款	5,047,244.60	4,637,223.63	9,684,468.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,927,647.39	7,800,865.23	-1,126,782.16

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	1,098,887.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	488,275.70
其他	3,676.31
合计	1,590,839.84

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,500,951,709.61
减：卖出股票成本总额	1,642,521,526.73
买卖股票差价收入	-141,569,817.12

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益 ——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股指期货-投资收益	23,466,240.00

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,422,433.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,422,433.21

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	62,952,429.22
——股票投资	62,952,429.22
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-1,253,160.00
合计	61,699,269.22

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年
----	---------------------------------

	12 月 31 日
基金赎回费收入	743,963.82
A/B 类 001420	53,396.56
C 类 001426	20,470.20
合计	817,830.58

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A 类份额将不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；C 类份额随持有期间递减，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A 类份额将不低于转出费总额的 25% 归入基金资产；C 类份额随持有期间递减，将不低于转出费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,399,782.46
银行间市场交易费用	-
合计	2,399,782.46

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	91,000.00
信息披露费	150,000.00
银行费用	4,504.19
指数使用费	183,109.72
合计	428,613.91

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“南方基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	565,310,039.24	12.81%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
-------	---------------------------------------	--

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	56,531.02	12.80%	56,531.02	12.80%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,655,426.60
其中：支付销售机构的客户维护费	1,688,377.96

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,396,627.95

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大数据 300A	大数据 300C	合计
	南方基金	-	39,646.66

华泰证券	-	2,624.57	2,624.57
兴业证券	-	718.98	718.98
合计	-	42,990.21	42,990.21

注：支付销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及报告期内无关联方投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	30,396,479.19	1,098,887.83

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2015-12-18	重大资产重组	24.43	未知	未知	2,386,879	32,634,577.24	58,311,453.97	
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	71.47	未知	未知	197,600	12,845,529.20	14,122,472.00	
600990	四创电子	2015-08-31	重大资产重组	82.63	未知	未知	47,500	4,263,834.00	3,924,925.00	
600759	洲际油气	2015-09-21	重大资产重组	7.85	未知	未知	407,760	4,146,908.48	3,200,916.00	
002219	恒康医疗	2015-07-08	重大资产重组	14.90	未知	未知	201,250	3,695,398.00	2,998,625.00	
300326	凯利泰	2015-09-24	重大资产重组	27.92	2016-01-22	23.98	96,300	2,779,830.24	2,688,696.00	
600530	交大昂立	2015-08-04	重大资产重组	21.37	2016-01-21	23.51	119,000	2,987,019.00	2,543,030.00	
600578	京能电力	2015-11-05	重大资产重组	6.07	2016-02-24	5.49	367,987	2,860,323.49	2,233,681.09	
300336	新文化	2015-12-24	重大事项	42.00	未知	未知	45,417	1,322,018.45	1,907,514.00	
002502	骅威股份	2015-08-20	重大资产重组	25.50	2016-01-14	23.35	67,300	2,001,863.32	1,716,150.00	
002568	百润股份	2015-12-21	重大事项	42.69	2016-01-18	38.42	36,900	1,521,462.26	1,575,261.00	
002383	合众思壮	2015-12-15	重大事项	40.35	2016-03-17	36.32	34,100	1,191,061.42	1,375,935.00	
000810	创维数字	2015-10-22	重大资产重组	12.67	2016-01-22	12.5	98,400	2,023,944.36	1,246,728.00	
300242	明家科技	2015-12-18	重大资产重组	49.96	2016-01-22	44.96	24,800	882,667.83	1,239,008.00	

600568	中珠控股	2015-12-30	重要事项未公告	23.94	2016-01-08	21.55	51,200	1,090,421.19	1,225,728.00	
300025	华星创业	2015-11-26	重大资产重组	30.15	未知	未知	39,600	729,027.51	1,193,940.00	
600864	哈投股份	2015-10-09	重大资产重组	10.88	2016-01-14	11.97	109,400	1,638,711.46	1,190,272.00	
300063	天龙集团	2015-12-22	重大资产重组	43.33	未知	未知	26,900	989,081.40	1,165,577.00	
600237	铜峰电子	2015-09-29	重大资产重组	5.73	2016-01-27	6.30	182,800	1,450,530.86	1,047,444.00	
002619	巨龙管业	2015-10-19	重大资产重组	31.77	未知	未知	29,200	893,198.98	927,684.00	
600538	国发股份	2015-11-28	重大资产重组	11.85	2016-03-21	11.02	75,400	724,482.65	893,490.00	
002514	宝馨科技	2015-07-08	重大事项	14.80	2016-01-08	16.28	56,600	1,406,985.94	837,680.00	
000430	张家界	2015-12-15	重大资产重组	15.56	2016-01-14	14.00	49,700	641,671.94	773,332.00	
300365	恒华科技	2015-11-14	重大资产重组	42.87	2016-01-27	38.58	18,000	647,231.01	771,660.00	
600455	博通股份	2015-10-23	重大资产重组	46.03	2016-02-23	43.23	16,000	715,202.04	736,480.00	
002201	九鼎新材	2015-11-17	重大资产重组	16.01	未知	未知	32,200	431,164.85	515,522.00	

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

其特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况

外，其余均能按照本基金的基金管理人的持有意图，以合理价格适时变现。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	30,396,479.19	-	-	-	30,396,479.19
结算备付金	139,000,495.12	-	-	-	139,000,495.12
存出保证金	698,065.02	-	-	29,088,576.00	29,786,641.02
交易性金融资产	-	-	-	1,360,498,012.84	1,360,498,012.84
应收利息	-	-	-	61,029.35	61,029.35
应收申购款	285,185.14	-	-	1,549,056.42	1,834,241.56
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	170,380,224.47	-	-	1,391,196,674.61	1,561,576,899.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,908,647.96	4,908,647.96

应付管理人报酬	-	-	-	705,325.46	705,325.46
应付托管费	-	-	-	211,597.67	211,597.67
应付销售服务费	-	-	-	56,088.13	56,088.13
应付交易费用	-	-	-	441,479.09	441,479.09
其他负债	-	-	-	442,590.73	442,590.73
负债总计	-	-	-	6,765,729.04	6,765,729.04
利率敏感度缺口	170,380,224.47	-	-	1,384,430,945.57	1,554,811,170.04

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，大数据 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 80%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,360,498,012.84	87.50

交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,360,498,012.84	87.50

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)
		本期末(2015年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	6,058.00
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-6,058.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,250,087,208.78 元，属于第二层次的余额为 110,410,804.06 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期

间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,360,498,012.84	87.12
	其中：股票	1,360,498,012.84	87.12
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	169,396,974.31	10.85
7	其他各项资产	31,681,911.93	2.03
8	合计	1,561,576,899.08	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,077,692.00	0.20
B	采矿业	5,147,278.00	0.33
C	制造业	353,967,865.98	22.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,544,128.30	1.96
E	建筑业	8,068,360.00	0.52
F	批发和零售业	39,141,259.67	2.52
G	交通运输、仓储和邮政业	10,811,727.96	0.70
H	住宿和餐饮业	3,757,000.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,381,576.00	2.28
J	金融业	704,854,946.56	45.33
K	房地产业	126,445,879.33	8.13
L	租赁和商务服务业	5,924,015.12	0.38
M	科学研究和技术服务业	2,270,158.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	1,734,562.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,168,647.48	0.08
Q	卫生和社会工作	2,437,976.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	25,028,460.44	1.61
S	综合	736,480.00	0.05
	合计	1,360,498,012.84	87.50

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	6,916,700	66,676,988.00	4.29
2	601318	中国平安	1,777,853	64,002,708.00	4.12
3	601166	兴业银行	3,429,933	58,548,956.31	3.77
4	000002	万科 A	2,386,879	58,311,453.97	3.75

5	600036	招商银行	3,212,975	57,801,420.25	3.72
6	600000	浦发银行	2,795,087	51,066,239.49	3.28
7	600030	中信证券	1,951,500	37,761,525.00	2.43
8	601328	交通银行	5,393,100	34,731,564.00	2.23
9	600837	海通证券	2,062,714	32,632,135.48	2.10
10	601288	农业银行	9,626,577	31,093,843.71	2.00
11	601398	工商银行	6,057,500	27,743,350.00	1.78
12	601169	北京银行	2,464,264	25,948,699.92	1.67
13	601988	中国银行	5,794,600	23,236,346.00	1.49
14	601601	中国太保	755,857	21,814,033.02	1.40
15	000001	平安银行	1,598,110	19,161,338.90	1.23
16	601818	光大银行	4,288,200	18,181,968.00	1.17
17	000725	京东方 A	5,963,880	17,712,723.60	1.14
18	600048	保利地产	1,619,300	17,229,352.00	1.11
19	600015	华夏银行	1,262,012	15,320,825.68	0.99
20	000776	广发证券	734,882	14,293,454.90	0.92
21	600104	上汽集团	671,007	14,238,768.54	0.92
22	600271	航天信息	197,600	14,122,472.00	0.91
23	002024	苏宁云商	1,028,600	13,834,670.00	0.89
24	600999	招商证券	579,500	12,575,150.00	0.81
25	600518	康美药业	727,000	12,322,650.00	0.79
26	601628	中国人寿	402,700	11,400,437.00	0.73
27	600637	东方明珠	298,900	11,325,321.00	0.73
28	000783	长江证券	882,300	10,958,166.00	0.70
29	000063	中兴通讯	561,467	10,460,130.21	0.67
30	601901	方正证券	1,024,208	9,832,396.80	0.63
31	001979	招商蛇口	440,606	9,191,041.16	0.59
32	002202	金风科技	398,100	9,072,699.00	0.58
33	601336	新华保险	170,900	8,922,689.00	0.57
34	600383	金地集团	609,400	8,409,720.00	0.54
35	601009	南京银行	470,972	8,336,204.40	0.54
36	600085	同仁堂	175,100	7,811,211.00	0.50
37	600100	同方股份	428,300	7,743,664.00	0.50
38	600011	华能国际	877,500	7,660,575.00	0.49
39	600109	国金证券	468,700	7,555,444.00	0.49
40	000538	云南白药	102,800	7,465,336.00	0.48
41	600009	上海机场	241,798	7,137,876.96	0.46
42	600804	鹏博士	298,700	7,085,164.00	0.46
43	000423	东阿阿胶	134,900	7,055,270.00	0.45

44	002142	宁波银行	449,320	6,968,953.20	0.45
45	601788	光大证券	300,500	6,893,470.00	0.44
46	000402	金融街	567,500	6,543,275.00	0.42
47	601618	中国中冶	1,066,700	6,421,534.00	0.41
48	600177	雅戈尔	390,800	6,362,224.00	0.41
49	600196	复星医药	264,400	6,210,756.00	0.40
50	000728	国元证券	265,750	6,003,292.50	0.39
51	600535	天士力	146,200	5,982,504.00	0.38
52	600369	西南证券	597,800	5,918,220.00	0.38
53	000623	吉林敖东	181,700	5,623,615.00	0.36
54	601555	东吴证券	343,000	5,512,010.00	0.35
55	600079	人福医药	235,400	5,240,004.00	0.34
56	600867	通化东宝	189,941	5,160,696.97	0.33
57	600023	浙能电力	685,700	5,135,893.00	0.33
58	300058	蓝色光标	323,044	4,758,438.12	0.31
59	601607	上海医药	232,137	4,621,847.67	0.30
60	600642	申能股份	598,398	4,517,904.90	0.29
61	000963	华东医药	54,500	4,466,820.00	0.29
62	601098	中南传媒	170,239	4,068,712.10	0.26
63	600398	海澜之家	291,100	4,063,756.00	0.26
64	000792	盐湖股份	154,800	3,975,264.00	0.26
65	600332	白云山	130,700	3,956,289.00	0.25
66	600990	四创电子	47,500	3,924,925.00	0.25
67	600060	海信电器	193,300	3,802,211.00	0.24
68	002475	立讯精密	115,500	3,690,225.00	0.24
69	600498	烽火通信	129,436	3,690,220.36	0.24
70	000938	紫光股份	37,300	3,669,574.00	0.24
71	002152	广电运通	117,151	3,630,509.49	0.23
72	000046	泛海控股	287,100	3,603,105.00	0.23
73	300144	宋城演艺	124,714	3,529,406.20	0.23
74	002007	华兰生物	77,430	3,406,920.00	0.22
75	000661	长春高新	27,400	3,300,330.00	0.21
76	600522	中天科技	143,000	3,274,700.00	0.21
77	300156	神雾环保	64,300	3,214,357.00	0.21
78	600759	洲际油气	407,760	3,200,916.00	0.21
79	601928	凤凰传媒	191,078	3,043,872.54	0.20
80	300267	尔康制药	90,399	3,037,406.40	0.20
81	002219	恒康医疗	201,250	2,998,625.00	0.19
82	600061	国投安信	115,500	2,994,915.00	0.19

83	600687	刚泰控股	125,900	2,968,722.00	0.19
84	300207	欣旺达	104,400	2,933,640.00	0.19
85	002179	中航光电	72,200	2,740,712.00	0.18
86	300146	汤臣倍健	70,600	2,718,100.00	0.17
87	300287	飞利信	149,100	2,698,710.00	0.17
88	600325	华发股份	165,224	2,693,151.20	0.17
89	300326	凯利泰	96,300	2,688,696.00	0.17
90	300182	捷成股份	111,400	2,673,600.00	0.17
91	002175	东方网络	44,100	2,657,466.00	0.17
92	300136	信维通信	89,279	2,638,194.45	0.17
93	300166	东方国信	82,200	2,632,866.00	0.17
94	300271	华宇软件	55,400	2,630,392.00	0.17
95	600422	昆药集团	65,009	2,588,658.38	0.17
96	002508	老板电器	57,174	2,569,971.30	0.17
97	300291	华录百纳	71,700	2,552,520.00	0.16
98	300203	聚光科技	74,200	2,544,318.00	0.16
99	600530	交大昂立	119,000	2,543,030.00	0.16
100	600633	浙报传媒	133,200	2,508,156.00	0.16
101	002294	信立泰	81,800	2,463,816.00	0.16
102	600008	首创股份	239,800	2,443,562.00	0.16
103	300015	爱尔眼科	77,200	2,437,976.00	0.16
104	600208	新湖中宝	507,200	2,419,344.00	0.16
105	600578	京能电力	367,987	2,233,681.09	0.14
106	600351	亚宝药业	141,600	2,211,792.00	0.14
107	002343	禾欣股份	36,200	2,197,340.00	0.14
108	000671	阳光城	241,700	2,182,551.00	0.14
109	600557	康缘药业	86,800	2,171,736.00	0.14
110	002329	皇氏集团	77,200	2,153,880.00	0.14
111	300026	红日药业	102,000	2,152,200.00	0.14
112	002074	国轩高科	57,400	2,129,540.00	0.14
113	300148	天舟文化	119,836	2,109,113.60	0.14
114	002019	亿帆鑫富	52,000	2,080,000.00	0.13
115	300090	盛运环保	171,300	2,005,923.00	0.13
116	600754	锦江股份	38,600	1,980,952.00	0.13
117	300285	国瓷材料	43,000	1,956,500.00	0.13
118	002583	海能达	156,500	1,954,685.00	0.13
119	300296	利亚德	78,100	1,952,500.00	0.13
120	000089	深圳机场	237,600	1,938,816.00	0.12
121	300202	聚龙股份	60,000	1,931,400.00	0.12

122	300336	新文化	45,417	1,907,514.00	0.12
123	600826	兰生股份	55,000	1,894,200.00	0.12
124	002437	誉衡药业	61,936	1,873,564.00	0.12
125	002399	海普瑞	52,600	1,860,462.00	0.12
126	600818	中路股份	32,800	1,830,240.00	0.12
127	000958	东方能源	67,200	1,728,384.00	0.11
128	000801	四川九洲	55,700	1,722,801.00	0.11
129	002502	骅威股份	67,300	1,716,150.00	0.11
130	002099	海翔药业	70,000	1,669,500.00	0.11
131	002649	博彦科技	29,100	1,637,748.00	0.11
132	300284	苏交科	74,700	1,619,496.00	0.10
133	002094	青岛金王	51,800	1,613,570.00	0.10
134	600107	美尔雅	76,900	1,604,134.00	0.10
135	002568	百润股份	36,900	1,575,261.00	0.10
136	300302	同有科技	21,500	1,557,675.00	0.10
137	300065	海兰信	40,600	1,550,920.00	0.10
138	002384	东山精密	77,100	1,543,542.00	0.10
139	000989	九芝堂	47,800	1,540,116.00	0.10
140	600823	世茂股份	122,900	1,503,067.00	0.10
141	002418	康盛股份	42,400	1,484,424.00	0.10
142	002317	众生药业	107,400	1,421,976.00	0.09
143	601801	皖新传媒	42,700	1,395,436.00	0.09
144	600298	安琪酵母	45,660	1,388,977.20	0.09
145	002221	东华能源	58,900	1,377,082.00	0.09
146	002383	合众思壮	34,100	1,375,935.00	0.09
147	000042	中洲控股	65,100	1,361,241.00	0.09
148	600856	中天能源	50,100	1,347,690.00	0.09
149	000501	鄂武商 A	62,600	1,339,640.00	0.09
150	600483	福能股份	77,449	1,331,348.31	0.09
151	300118	东方日升	91,300	1,330,241.00	0.09
152	600697	欧亚集团	31,900	1,321,936.00	0.09
153	600392	盛和资源	105,100	1,293,781.00	0.08
154	000418	小天鹅 A	53,500	1,284,000.00	0.08
155	002643	万润股份	31,600	1,280,748.00	0.08
156	000919	金陵药业	74,100	1,274,520.00	0.08
157	600566	济川药业	45,800	1,266,828.00	0.08
158	600590	泰豪科技	80,700	1,264,569.00	0.08
159	000506	中润资源	131,900	1,263,602.00	0.08
160	000810	创维数字	98,400	1,246,728.00	0.08

161	300242	明家科技	24,800	1,239,008.00	0.08
162	600965	福成五丰	75,700	1,233,910.00	0.08
163	600568	中珠控股	51,200	1,225,728.00	0.08
164	300061	康耐特	48,600	1,214,514.00	0.08
165	000040	宝安地产	81,200	1,212,316.00	0.08
166	600329	中新药业	56,600	1,198,788.00	0.08
167	600299	安迪苏	63,800	1,195,612.00	0.08
168	300025	华星创业	39,600	1,193,940.00	0.08
169	600864	哈投股份	109,400	1,190,272.00	0.08
170	002111	威海广泰	39,200	1,189,720.00	0.08
171	300150	世纪瑞尔	81,000	1,174,500.00	0.08
172	600661	新南洋	30,268	1,168,647.48	0.08
173	300063	天龙集团	26,900	1,165,577.00	0.07
174	002042	华孚色纺	96,300	1,160,415.00	0.07
175	300368	汇金股份	20,400	1,157,088.00	0.07
176	300219	鸿利光电	72,600	1,156,518.00	0.07
177	600195	中牧股份	54,000	1,154,520.00	0.07
178	002449	国星光电	68,000	1,149,200.00	0.07
179	000838	财信发展	28,400	1,142,532.00	0.07
180	300073	当升科技	29,400	1,141,602.00	0.07
181	002519	银河电子	47,800	1,135,250.00	0.07
182	600551	时代出版	49,800	1,132,950.00	0.07
183	002172	澳洋科技	75,500	1,123,440.00	0.07
184	600657	信达地产	161,500	1,122,425.00	0.07
185	002171	楚江新材	46,600	1,117,468.00	0.07
186	002166	莱茵生物	72,300	1,098,960.00	0.07
187	300091	金通灵	28,900	1,092,709.00	0.07
188	600529	山东药玻	56,500	1,092,145.00	0.07
189	603001	奥康国际	32,200	1,082,564.00	0.07
190	600976	健民集团	32,000	1,082,560.00	0.07
191	000828	东莞控股	85,200	1,082,040.00	0.07
192	002538	司尔特	85,400	1,076,894.00	0.07
193	000428	华天酒店	104,400	1,070,100.00	0.07
194	002727	一心堂	18,200	1,052,506.00	0.07
195	600237	铜峰电子	182,800	1,047,444.00	0.07
196	600114	东睦股份	63,800	1,031,008.00	0.07
197	000591	桐君阁	44,200	1,006,876.00	0.06
198	600093	禾嘉股份	61,000	998,570.00	0.06
199	600485	信威集团	37,308	997,989.00	0.06

200	000757	浩物股份	78,100	996,556.00	0.06
201	600007	中国国贸	52,500	985,950.00	0.06
202	002133	广宇集团	102,000	984,300.00	0.06
203	300204	舒泰神	27,600	978,144.00	0.06
204	601998	中信银行	134,100	968,202.00	0.06
205	300187	永清环保	17,900	961,230.00	0.06
206	300233	金城医药	29,400	960,204.00	0.06
207	002524	光正集团	89,490	948,594.00	0.06
208	002416	爱施德	53,900	943,250.00	0.06
209	000903	云内动力	113,400	941,220.00	0.06
210	300078	思创医惠	19,100	932,080.00	0.06
211	002090	金智科技	24,100	930,742.00	0.06
212	002619	巨龙管业	29,200	927,684.00	0.06
213	000525	红太阳	53,900	913,066.00	0.06
214	002546	新联电子	27,800	908,226.00	0.06
215	002518	科士达	25,700	907,210.00	0.06
216	002539	新都化工	55,900	894,400.00	0.06
217	600538	国发股份	75,400	893,490.00	0.06
218	601199	江南水务	45,100	859,155.00	0.06
219	002295	精艺股份	36,200	853,958.00	0.05
220	002349	精华制药	22,041	852,986.70	0.05
221	600981	汇鸿集团	65,100	844,347.00	0.05
222	002514	宝馨科技	56,600	837,680.00	0.05
223	300100	双林股份	26,700	836,244.00	0.05
224	600313	农发种业	54,900	833,382.00	0.05
225	300119	瑞普生物	41,200	828,120.00	0.05
226	002623	亚玛顿	17,400	821,280.00	0.05
227	600283	钱江水利	44,000	807,840.00	0.05
228	300376	易事特	16,800	806,568.00	0.05
229	300160	秀强股份	19,900	796,995.00	0.05
230	300196	长海股份	22,300	793,657.00	0.05
231	002536	西泵股份	11,800	784,700.00	0.05
232	002102	冠福股份	52,400	779,712.00	0.05
233	002032	苏泊尔	28,000	778,960.00	0.05
234	002685	华东重机	75,000	777,750.00	0.05
235	603328	依顿电子	26,300	776,113.00	0.05
236	002145	中核钛白	50,600	774,180.00	0.05
237	000430	张家界	49,700	773,332.00	0.05
238	300365	恒华科技	18,000	771,660.00	0.05

239	000908	景峰医药	47,693	768,811.16	0.05
240	300227	光韵达	21,000	766,500.00	0.05
241	300343	联创股份	7,800	764,244.00	0.05
242	000004	国农科技	16,600	761,940.00	0.05
243	002054	德美化工	53,300	751,530.00	0.05
244	300022	吉峰农机	67,700	742,669.00	0.05
245	002370	亚太药业	20,900	740,487.00	0.05
246	600969	郴电国际	39,100	740,163.00	0.05
247	600455	博通股份	16,000	736,480.00	0.05
248	600814	杭州解百	59,000	727,470.00	0.05
249	600727	鲁北化工	65,800	713,272.00	0.05
250	000524	岭南控股	35,600	705,948.00	0.05
251	002579	中京电子	44,900	704,481.00	0.05
252	600203	福日电子	51,200	701,952.00	0.05
253	300262	巴安水务	37,600	698,232.00	0.04
254	002688	金河生物	29,602	690,022.62	0.04
255	002128	露天煤业	80,800	682,760.00	0.04
256	002077	大港股份	33,400	666,330.00	0.04
257	002548	金新农	38,600	659,288.00	0.04
258	002160	常铝股份	50,200	658,122.00	0.04
259	000429	粤高速 A	94,500	652,995.00	0.04
260	600829	人民同泰	39,200	651,112.00	0.04
261	600629	华建集团	26,300	650,662.00	0.04
262	002430	杭氧股份	56,400	648,600.00	0.04
263	600731	湖南海利	54,700	643,819.00	0.04
264	002632	道明光学	24,400	642,452.00	0.04
265	600152	维科精华	52,300	634,922.00	0.04
266	600605	汇通能源	24,400	625,128.00	0.04
267	002377	国创高新	59,100	610,503.00	0.04
268	002300	太阳电缆	50,645	607,740.00	0.04
269	000546	金圆股份	45,400	604,728.00	0.04
270	600753	东方银星	17,400	595,080.00	0.04
271	300301	长方照明	54,800	588,552.00	0.04
272	000719	大地传媒	28,600	583,440.00	0.04
273	002692	远程电缆	28,400	565,160.00	0.04
274	000862	银星能源	55,600	547,660.00	0.04
275	300341	麦迪电气	19,900	545,459.00	0.04
276	300108	双龙股份	33,300	539,460.00	0.03
277	002719	麦趣尔	9,200	531,300.00	0.03

278	002034	美欣达	12,100	527,681.00	0.03
279	000020	深华发 A	17,600	526,592.00	0.03
280	600359	新农开发	44,000	526,240.00	0.03
281	600393	东华实业	41,700	522,501.00	0.03
282	002201	九鼎新材	32,200	515,522.00	0.03
283	603333	明星电缆	53,100	510,822.00	0.03
284	600774	汉商集团	19,100	508,060.00	0.03
285	000617	石油济柴	31,400	488,270.00	0.03
286	000798	中水渔业	35,600	484,160.00	0.03
287	002125	湘潭电化	20,200	471,670.00	0.03
288	300261	雅本化学	30,850	465,835.00	0.03
289	002287	奇正藏药	11,100	461,538.00	0.03
290	002333	罗普斯金	21,300	460,932.00	0.03
291	002695	煌上煌	12,200	453,718.00	0.03
292	300265	通光线缆	28,800	447,840.00	0.03
293	600419	天润乳业	12,700	447,167.00	0.03
294	300121	阳谷华泰	27,300	439,530.00	0.03
295	002661	克明面业	8,000	429,600.00	0.03
296	300174	元力股份	12,900	412,800.00	0.03
297	603123	翠微股份	37,500	411,375.00	0.03
298	002523	天桥起重	41,900	395,955.00	0.03
299	002336	人人乐	27,100	392,679.00	0.03
300	002592	八菱科技	7,648	338,041.60	0.02
301	002778	高科石化	5,600	47,600.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	95,131,944.17	6.12
2	600030	中信证券	76,305,985.38	4.91
3	601166	兴业银行	75,672,076.89	4.87
4	601328	交通银行	72,085,455.59	4.64
5	600016	民生银行	71,782,250.10	4.62
6	600036	招商银行	69,724,007.90	4.48
7	600000	浦发银行	67,122,792.37	4.32

8	600837	海通证券	64,374,356.78	4.14
9	601288	农业银行	44,807,142.33	2.88
10	601668	中国建筑	43,388,932.46	2.79
11	601169	北京银行	39,313,498.38	2.53
12	000002	万科 A	35,675,338.82	2.29
13	601601	中国太保	34,625,630.53	2.23
14	000776	广发证券	34,351,076.26	2.21
15	601398	工商银行	33,405,075.12	2.15
16	000725	京东方 A	29,849,456.00	1.92
17	601390	中国中铁	29,426,551.36	1.89
18	000001	平安银行	28,730,296.01	1.85
19	600104	上汽集团	27,491,653.73	1.77
20	601988	中国银行	27,204,112.67	1.75

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601668	中国建筑	38,299,969.96	2.46
2	601328	交通银行	32,957,111.55	2.12
3	601390	中国中铁	27,743,692.32	1.78
4	600000	浦发银行	27,370,774.02	1.76
5	601318	中国平安	27,192,023.92	1.75
6	601166	兴业银行	22,751,886.08	1.46
7	601186	中国铁建	21,639,934.79	1.39
8	601006	大秦铁路	21,612,822.82	1.39
9	600030	中信证券	20,697,927.45	1.33
10	600837	海通证券	17,623,333.40	1.13
11	000776	广发证券	15,729,830.77	1.01
12	601788	光大证券	15,465,845.32	0.99
13	601169	北京银行	15,326,009.05	0.99
14	601669	中国电建	14,425,104.01	0.93
15	000100	TCL 集团	13,813,593.21	0.89
16	000625	长安汽车	13,481,230.42	0.87
17	601899	紫金矿业	13,364,587.50	0.86

18	600703	三安光电	13,161,139.89	0.85
19	600016	民生银行	13,008,431.24	0.84
20	600104	上汽集团	12,884,101.90	0.83

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,940,067,110.35
卖出股票收入（成交）总额	1,500,951,709.61

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1601	IF1601	132	145,442,880.00	-1,253,160.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-1,253,160.00
股指期货投资本期收益（元）					23,466,240.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,253,160.00

#### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻

求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	29,786,641.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	61,029.35
5	应收申购款	1,834,241.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,681,911.93

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	58,311,453.97	3.75	重大资产重组

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
大 数 据 300A	35,499	39,765.12	6,619,634.03	0.47%	1,405,002,285.00	99.53%
大 数 据 300C	7,321	20,920.64	0.00	0.00%	153,160,029.00	100.00%
合计	42,820	36,543.25	6,619,634.03	0.42%	1,558,162,314.00	99.58%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	大数据 300A	4,628.29	0.0003%
	大数据 300C	1,150.31	0.0008%
	合计	5,778.60	0.0004%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	大数据 300A	0
	大数据 300C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	大数据 300A	0
	大数据 300C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大数据 300A	大数据 300C
基金合同生效日（2015 年 6 月 24 日）基金份额总额	1,874,441,043.18	240,559,049.56
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	38,666,620.06	13,696,726.11
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	501,485,744.35	101,095,746.68
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	1,411,621,918.89	153,160,028.99

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于 2015 年 5 月 29 日发布公告，聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 91,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	565,310,039.24	12.81%	56,531.02	12.80%	-
申万宏源	1	1,676,839,454.42	37.98%	167,701.38	37.99%	-
银河证券	1	2,172,466,404.30	49.21%	217,246.69	49.21%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序：

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

#### A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

#### B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日
2	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 29 日
3	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 18 日
4	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 4 日
5	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 3 日
6	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 26 日
7	关于电子直销业务调整银联支付申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 23 日
8	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 10 日
9	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
10	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 6 日
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 21 日
12	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 20 日
13	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 15 日
14	南方大数据 300 指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 11 日
15	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 26 日
16	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 25 日
17	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 22 日

18	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 11 日
19	关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 7 日
20	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 4 日
21	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 28 日
22	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 24 日
23	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 21 日
24	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 15 日
25	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 14 日
26	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 10 日
27	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 9 日
28	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 8 日
29	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 4 日
30	南方大数据 300 指数证券投资基金基金份额发售时间的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 17 日
31	南方基金关于网上直销汇款交易认购南方大数据 300 基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 9 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方大数据 300 指数证券投资基金的文件。
- 2、《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《南方大数据 300 指数证券投资基金托管协议》
- 4、《南方大数据 300 指数证券投资基金 2015 年年度报告》原文

5、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。

6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

## **12.2 存放地点**

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

## **12.3 查阅方式**

网站：<http://www.nffund.com>