

# 南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年 第 2 季度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 7 月 21 日

## § 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。

基金托管人中国建银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 7 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 南方大数据 300 指数   |
| 场内简称       | 大数据 300  |
| 交易代码       | 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,485,571,336.90 份   |
| 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       | 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。<br>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等，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。 |
| 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。 |                  |
| 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   |                  |
| 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 | 1,341,221,889.49 份   | 144,349,447.41 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2016年4月1日—2016年6月30日） |                |
|-----------------|---------------------------|----------------|
|                 | 大数据 300A                  | 大数据 300C       |
| 1. 本期已实现收益      | -14,859,789.20            | -1,724,880.55  |
| 2. 本期利润         | 20,602,805.44             | 2,142,739.70   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0150                    | 0.0145         |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,197,203,662.10          | 128,495,554.74 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.8926                    | 0.8902         |

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 本报告期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

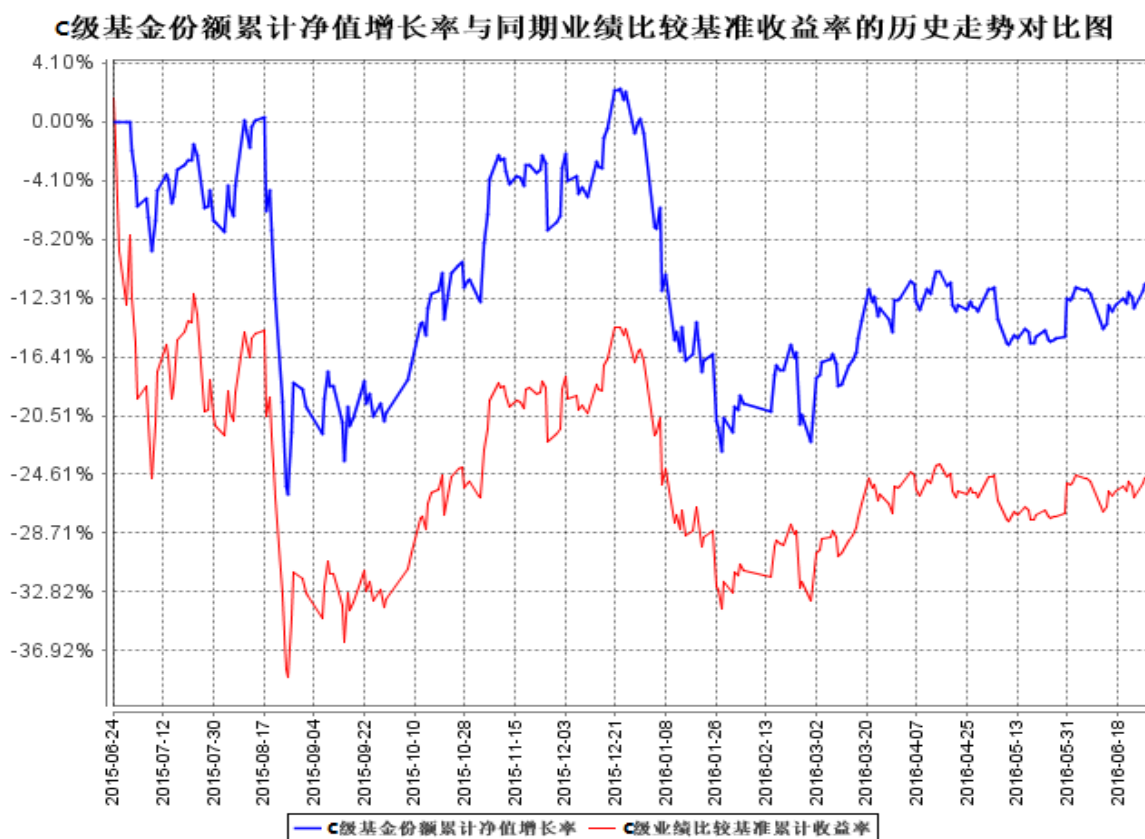
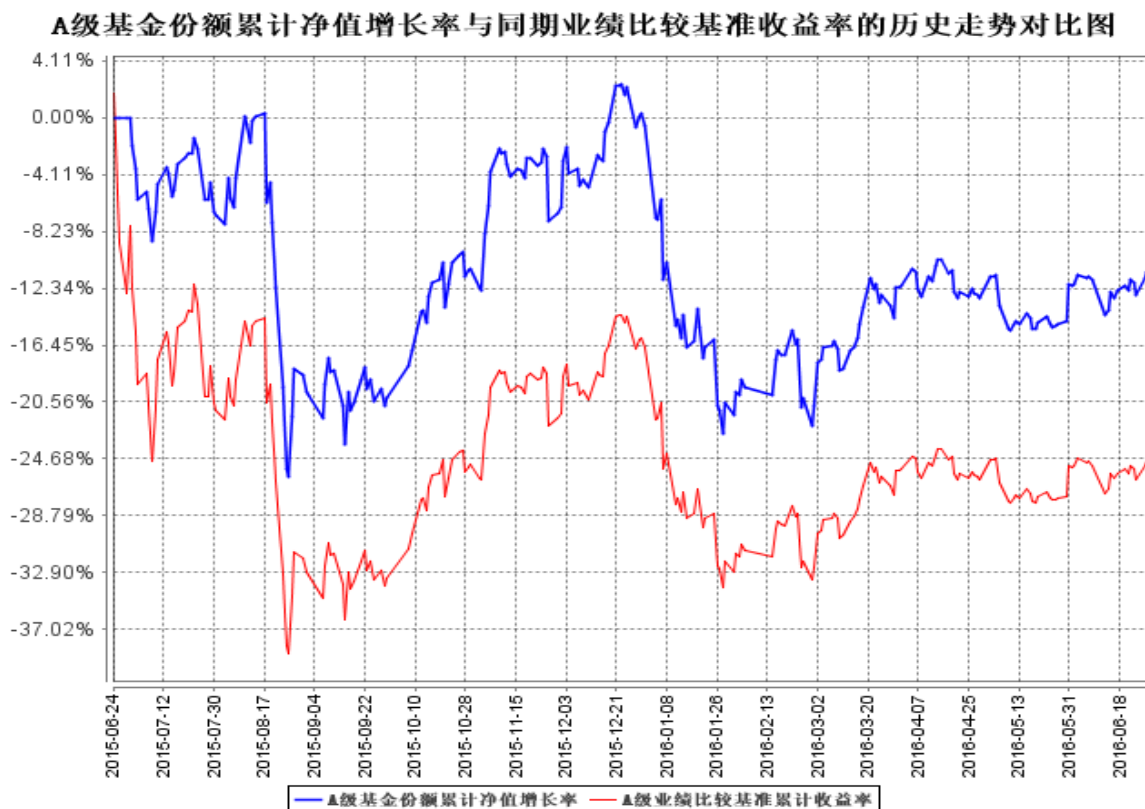
大数据 300A

| 阶段    | 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 | 1.76%  | 0.98%     | 1.24%      | 0.94%         | 0.52% | 0.04% |

大数据 300C

| 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 | 1.67%  | 0.98%     | 1.24%      | 0.94%         | 0.43% | 0.04% |

### 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：报告期末距建仓结束不满一年，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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  |
|----|---------|-----------------|------|--------|---|
|    |         | 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    | 北京大学智能科学系硕士，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、数量化投资部高级研究员，现任数量化投资部总监助理；2014 年 12 月至 2016 年 4 月，任南方恒生 ETF 基金经理；2015 年 4 月至 2016 年 4 月，任南方中证 500 工业 ETF、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，任改革基金、高铁基金、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，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“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遵规守信情况的说明

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 指数证券投资基金基金合同》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。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 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。

### 4.3.2 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 1 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。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度，市场在一个窄区间内反复震荡，市场资金存量博弈明显。

作为指数型基金，为保证对指数的有效跟踪，本基金一直处于较高仓位运作。本基金的整体投资风格偏蓝筹，同时结合大数据的优势开展研究与投资。报告内本基金在实际运作时采用指令批量交易、算法交易多种交易手段，在一定程度上尽可能的降低交易成本和跟踪误差。

### 4.5 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 0.8926 元；C 级份额净值为 0.8902 元。

报告期内，本基金 A 级份额净值增长率为 1.76%，同期业绩基准增长率为 1.24%；C 级份额净值增长率为 1.67%，同期业绩基准增长率为 1.24%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,136,309,874.97 | 85.26        |
|    | 其中：股票             | 1,136,309,874.97 | 85.26        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -                | -            |
|    | 其中：债券             | -                | -            |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 80,000,000.00    | 6.00         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 90,186,179.88    | 6.77         |
| 8  | 其他资产              | 26,191,568.72    | 1.97         |
| 9  | 合计                | 1,332,687,623.57 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 12,670,227.00    | 0.96         |
| B  | 采矿业              | 3,493,155.00     | 0.26         |
| C  | 制造业              | 402,281,067.83   | 30.34        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,655,581.15     | 0.65         |
| E  | 建筑业              | 14,098,809.86    | 1.06         |
| F  | 批发和零售业           | 28,058,128.85    | 2.12         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 8,427,670.00     | 0.64         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 984,801.00       | 0.07         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 33,162,656.07    | 2.50         |
| J  | 金融业              | 508,735,216.00   | 38.37        |
| K  | 房地产业             | 65,351,102.80    | 4.93         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 7,532,021.00     | 0.57         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 6,045,011.10     | 0.46         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 12,050,524.00    | 0.91         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,070,352.00     | 0.16         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 22,693,551.31    | 1.71         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 1,136,309,874.97 | 85.71        |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 1,733,253  | 55,533,426.12 | 4.19         |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 3,448,233  | 52,551,070.92 | 3.96         |
| 3  | 601328 | 交通银行 | 8,497,600  | 47,841,488.00 | 3.61         |
| 4  | 000002 | 万科 A | 2,386,879  | 43,441,197.80 | 3.28         |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 2,591,296  | 40,346,478.72 | 3.04         |
| 6  | 601288 | 农业银行 | 12,492,477 | 39,975,926.40 | 3.02         |
| 7  | 601398 | 工商银行 | 7,602,700  | 33,755,988.00 | 2.55         |
| 8  | 601169 | 北京银行 | 3,236,641  | 33,563,967.17 | 2.53         |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 1,016,957  | 27,498,517.28 | 2.07         |
| 10 | 601988 | 中国银行 | 7,225,500  | 23,193,855.00 | 1.75         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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         |
|-------------------|--------|----------|----------------|--------------|--------------|
| IF1607            | IF1607 | 128      | 119,554,560.00 | 2,865,300.00 | -            |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |          |                |              | 2,865,300.00 |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |          |                |              | 107,000.00   |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |          |                |              | 2,157,540.00 |

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1

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。



### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 24,085,053.38 |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,755,769.80  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 71,262.54     |
| 5  | 应收申购款   | 279,483.00    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 26,191,568.72 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 000002 | 万科 A | 43,441,197.80  | 3.28         | 重大事项     |

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 大数据 300A         | 大数据 300C       |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,391,260,546.19 | 152,807,818.58 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 15,011,373.68    | 4,304,050.97   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 65,050,030.38    | 12,762,422.14  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 1,341,221,889.49 | 144,349,447.41 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》
- 2、《南方大数据 300 指数证券投资基金托管协议》
- 3、南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年第 2 季度报告原文。

### 8.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

### 8.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>