

# 南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年 半年度报告摘要

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

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 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。本半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 08 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金简称            | 南方大数据 300 指数       |                  |
| 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      | 1,485,571,336.90 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 | 1,341,221,889.49 份 | 144,349,447.41 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。</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 | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 |      | 400-889-8899             | 010-67595096         |
| 传真     |      | 0755-82763889            | 010-66275853         |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.nffund.com |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公地址      |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 大数据 300A                              | 大数据 300C                              |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | -85,725,610.91                        | -9,741,066.04                         |
| 本期利润          | -144,187,915.64                       | -15,685,209.22                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1039                               | -0.1033                               |
| 本期基金份额净值增长率   | -10.17%                               | -10.32%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1183                               | -0.1206                               |
| 期末基金资产净值      | 1,197,203,662.10                      | 128,495,554.74                        |
| 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、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 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|

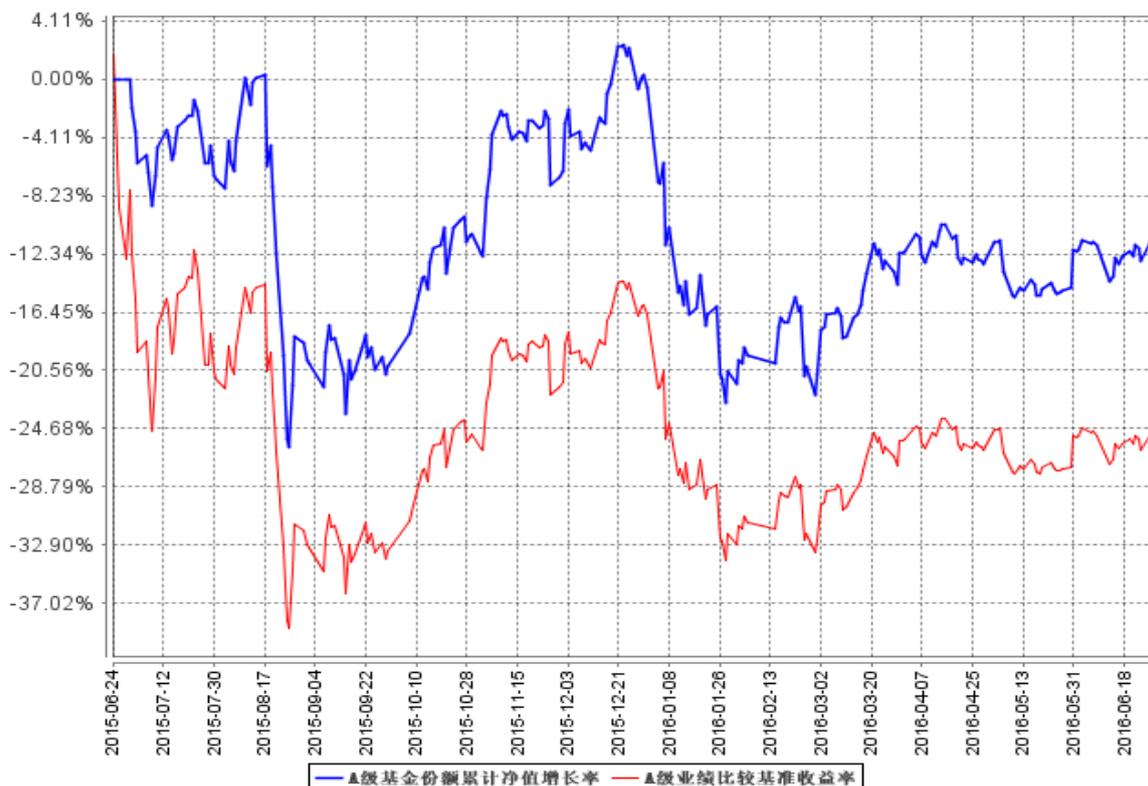
|            | 长率①     | 增长率标准差② | 基准收益率③  | 收益率标准差④ |        |        |
|------------|---------|---------|---------|---------|--------|--------|
| 过去一个月      | 1.51%   | 0.93%   | 0.79%   | 0.91%   | 0.72%  | 0.02%  |
| 过去三个月      | 1.76%   | 0.98%   | 1.24%   | 0.94%   | 0.52%  | 0.04%  |
| 过去六个月      | -10.17% | 1.75%   | -9.56%  | 1.66%   | -0.61% | 0.09%  |
| 过去一年       | -10.74% | 2.02%   | -18.19% | 2.25%   | 7.45%  | -0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.74% | 2.00%   | -24.61% | 2.33%   | 13.87% | -0.33% |

大数据 300C

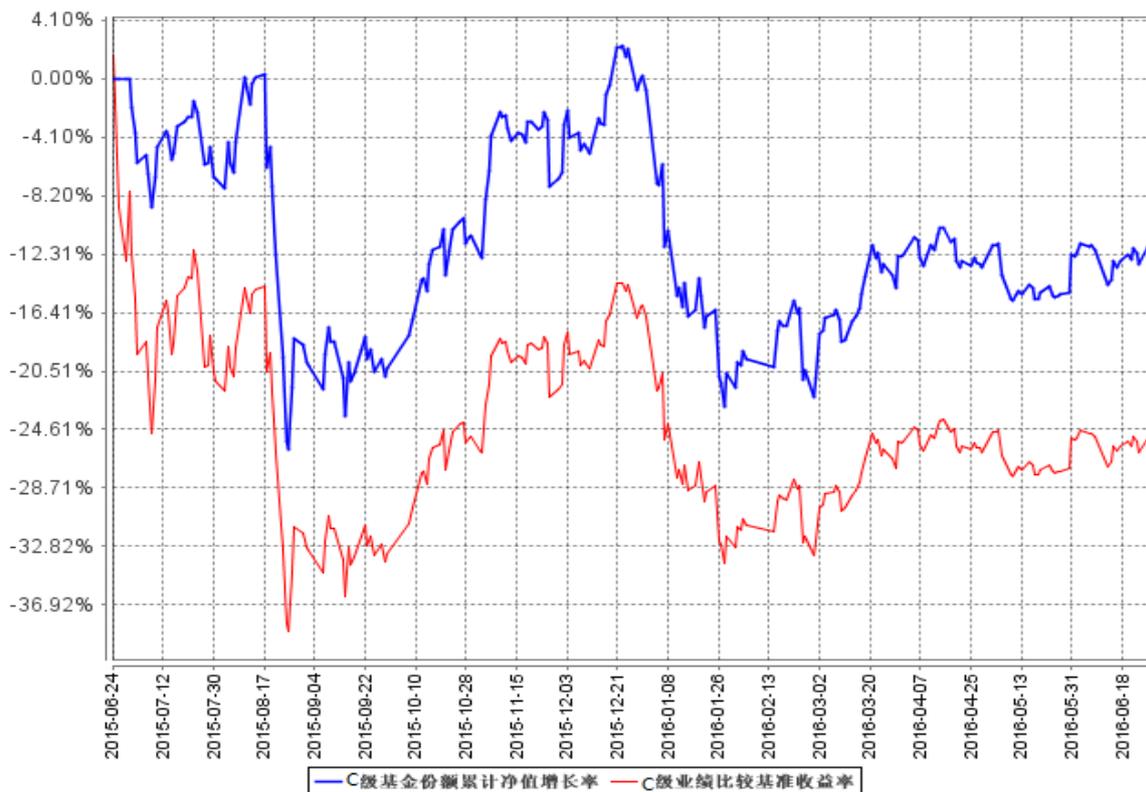
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 1.49%    | 0.93%       | 0.79%      | 0.91%         | 0.70%  | 0.02%  |
| 过去三个月      | 1.67%    | 0.98%       | 1.24%      | 0.94%         | 0.43%  | 0.04%  |
| 过去六个月      | -10.32%  | 1.75%       | -9.56%     | 1.66%         | -0.76% | 0.09%  |
| 过去一年       | -10.98%  | 2.02%       | -18.19%    | 2.25%         | 7.21%  | -0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.98%  | 2.00%       | -24.61%    | 2.33%         | 13.63% | -0.33% |

### 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：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。

## § 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 5,600 亿元，旗下管理 96 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      | -    | 8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、量化投资部高级研究员，现任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6月至2016年7月，任改革基金、高铁基金、南方500信息基金经理；2015年4月至今，任大数据100基金经理；2015年6月至今，任南方策略优化、大数据300、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，两两组间单日、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。

### 4.3.2 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 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

A 股上半年在开年大幅下跌一个月后，市场开始止跌反弹，之后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。

### 4.4.2 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 0.8926 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-10.17%，同期业绩基准增长率为-9.56%；C 级份额净值增长率为-10.32%，同期业绩基准增长率为-9.56%。

## 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，上半年万亿级的理财领域收益率降低非常明显；二是宽松货币政策逻辑未改变，在房地产高企、国内投资工具有限的情况下，部分高风险收益偏好的投资者会在大类资产配置上逐渐倾向于权益类资产。展望下半年，A 股将有不错的投资机会。

## 4.6 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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>      |                        |                          |
| 银行存款            | 15,893,347.13          | 30,396,479.19            |
| 结算备付金           | 74,292,832.75          | 139,000,495.12           |
| 存出保证金           | 24,085,053.38          | 29,786,641.02            |
| 交易性金融资产         | 1,136,309,874.97       | 1,360,498,012.84         |
| 其中：股票投资         | 1,136,309,874.97       | 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          |                        | -                        |
| 买入返售金融资产        | 80,000,000.00          | -                        |
| 应收证券清算款         | 1,755,769.80           | -                        |
| 应收利息            | 71,262.54              | 61,029.35                |
| 应收股利            | -                      | -                        |
| 应收申购款           | 279,483.00             | 1,834,241.56             |
| 递延所得税资产         | -                      | -                        |
| 其他资产            | -                      | -                        |
| 资产总计            | 1,332,687,623.57       | 1,561,576,899.08         |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>              |
|                 | <b>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>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          | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款       | -                      | -                        |
| 应付证券清算款         | -                      | -                        |
| 应付赎回款           | 4,984,025.61           | 4,908,647.96             |
| 应付管理人报酬         | 541,148.27             | 705,325.46               |
| 应付托管费           | 162,344.47             | 211,597.67               |
| 应付销售服务费         | 41,835.38              | 56,088.13                |
| 应付交易费用          | 633,651.64             | 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          | 625,401.36       | 442,590.73       |
| 负债合计          | 6,988,406.73     | 6,765,729.04     |
| <b>所有者权益：</b> |                  |                  |
| 实收基金          | 1,485,571,336.90 | 1,564,781,947.88 |
| 未分配利润         | -159,872,120.06  | -9,970,777.84    |
| 所有者权益合计       | 1,325,699,216.84 | 1,554,811,170.04 |
| 负债和所有者权益总计    | 1,332,687,623.57 | 1,561,576,899.08 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 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 0.8926 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 0.8902 元；基金份额总额 1,485,571,336.90 份，其中 A 类份额 1,341,221,889.49 份，C 类份额 144,349,447.41 份。

## 6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 本期                              | 上年度可比期间                                   |
|-----------------------|---------------------------------|---|
|                       | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日 |
| <b>一、收入</b>           | -153,606,416.06                 | 296,100.00                                |
| 1.利息收入                | 1,256,141.82                    | 296,100.00                                |
| 其中：存款利息收入             | 1,210,627.38                    | 296,100.00                                |
| 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            | 45,514.44                       | -   |
| 其他利息收入                | -                               | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | -90,648,168.97                  | -   |
| 其中：股票投资收益             | -81,711,931.54                  | -   |
| 基金投资收益                | -                               | -   |
| 债券投资收益                | -                               | -   |
| 资产支持证券投资收益            | -                               | -   |
| 贵金属投资收益               | -                               | -   |
| 衍生工具收益                | -18,659,020.00                  | -   |
| 股利收益                  | 9,722,782.57                    | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -64,406,447.91                  | -   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                               | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 192,059.00                      | -   |

|                     |                 |            |
|---------------------|-----------------|------------|
| 减：二、费用              | 6,266,708.80    | 254,816.67 |
| 1. 管理人报酬            | 3,279,653.62    | 173,839.02 |
| 2. 托管费              | 983,896.08      | 52,151.70  |
| 3. 销售服务费            | 258,229.76      | 15,817.50  |
| 4. 交易费用             | 1,402,607.28    | -          |
| 5. 利息支出             | -               | -          |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | -               | -          |
| 6. 其他费用             | 342,322.06      | 13,008.45  |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -159,873,124.86 | 41,283.33  |
| 减：所得税费用             | -               | -          |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | -159,873,124.86 | 41,283.33  |

### 6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）                        | 1,564,781,947.88                      | -9,970,777.84   | 1,554,811,170.04 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | -159,873,124.86 | -159,873,124.86  |
| 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）      | -79,210,610.98                        | 9,971,782.64    | -69,238,828.34   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 74,937,428.34                         | -11,246,382.88  | 63,691,045.46    |
| 2. 基金赎回款                               | -154,148,039.32                       | 21,218,165.52   | -132,929,873.80  |
| 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）                        | 1,485,571,336.90                      | -159,872,120.06 | 1,325,699,216.84 |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 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<br>(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)               | -  | 41,283.33 | 41,283.33        |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  |  | -         |                  |
| 其中：1.基金申购款                             |  | -         |                  |
| 2.基金赎回款                                | -  | -         | -                |
| 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<br>(基金净值)                    | 2,115,000,092.74                                     | 41,283.33 | 2,115,041,376.07 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

基金管理人负责人

徐超

主管会计工作负责人

徐超

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.2.2 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。

### 6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.3 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

### 6.4.4 关联方关系

#### 6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 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 |

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。

**6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.5.1.1 股票交易**

注：无。

**6.4.5.2 关联方报酬****6.4.5.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,279,653.62               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,193,910.64               |

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。

**6.4.5.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 983,896.08                 |

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。

**6.4.5.2.3 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<br>2016年1月1日至2016年6月30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 |
|                |                            |          |    |

|      |   |           |           |
|------|---|-----------|-----------|
| 华泰证券 | - | 1,851.14  | 1,851.14  |
| 兴业证券 | - | 634.01    | 634.01    |
| 南方基金 | - | 26,318.01 | 26,318.01 |
| 合计   | - | 28,803.16 | 28,803.16 |

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% 的年费率计提，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。

#### 6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.5.4.2 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：无。

#### 6.4.5.5 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                              |            |
|--------|---------------------------------|------------|
|        | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |            |
|        | 期末余额                            | 当期利息收入     |
| 中国建设银行 | 15,893,347.13                   | 152,922.33 |

#### 6.4.5.6 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。

#### 6.4.5.7 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。

### 6.4.6 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.6.1 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

| 6.4.12.1.1 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<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 601966               | 玲珑   | 2016 年 6 | 2016 年 | 新股流    | 12.98 | 12.98  | 10,957       | 142,221.86 | 142,221.86 | -  |

|        |      |                 |                |        |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|----------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        | 轮胎   | 月 24 日          | 7 月 6 日        | 通受限    |       |       |       |           |           |   |
| 603016 | 新宏泰  | 2016 年 6 月 23 日 | 2016 年 7 月 1 日 | 新股流通受限 | 8.49  | 8.49  | 1,602 | 13,600.98 | 13,600.98 | - |
| 300520 | 科大国创 | 2016 年 6 月 30 日 | 2016 年 7 月 8 日 | 新股流通受限 | 10.05 | 10.05 | 926   | 9,306.30  | 9,306.30  | - |
| 002805 | 丰元股份 | 2016 年 6 月 29 日 | 2016 年 7 月 7 日 | 新股流通受限 | 5.80  | 5.80  | 971   | 5,631.80  | 5,631.80  | - |

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。

#### 6.4.6.2 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            | 复牌开盘单价 | 数量(股)     | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|------------------|------|--------|-----------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 000002 | 万科 A | 2015 年 12 月 21 日 | 重大事项 | 18.20  | 2016 年 2 月 1 日  | 21.99  | 2,386,879 | 32,634,577.24 | 43,441,197.80 | -  |
| 000415 | 渤海金控 | 2016 年 2 月 1 日   | 重大事项 | 6.82   | 2016 年 8 月 11 日 | 7.50   | 460,900   | 3,135,653.22  | 3,143,338.00  | -  |
| 600751 | 天海投资 | 2016 年 2 月 15 日  | 重大事项 | 6.11   | 2016 年 7 月 26 日 | 6.72   | 472,300   | 2,607,582.75  | 2,885,753.00  | -  |
| 300300 | 汉鼎股份 | 2016 年 5 月 10 日  | 重大事项 | 30.56  | -               | -      | 65,500    | 1,840,145.00  | 2,001,680.00  | -  |
| 300284 | 苏交科  | 2016 年 5 月 20 日  | 重大事项 | 19.49  | 2016 年 8 月 10 日 | 21.44  | 100,700   | 1,966,235.97  | 1,962,643.00  | -  |
| 002127 | 南极电商 | 2016 年 5 月 16 日  | 重大事项 | 9.63   | -               | -      | 173,200   | 1,806,399.00  | 1,667,916.00  | -  |
| 000975 | 银泰资源 | 2016 年 4 月 19 日  | 重大事项 | 14.39  | -               | -      | 110,100   | 930,012.69    | 1,584,339.00  | -  |
| 002071 | 长城影视 | 2016 年 6 月 16 日  | 重大事项 | 13.64  | -               | -      | 96,100    | 1,355,423.96  | 1,310,804.00  | -  |
| 300332 | 天壕环境 | 2016 年 4 月 11 日  | 重大事项 | 9.37   | 2016 年 7 月 29 日 | 9.91   | 130,600   | 1,095,563.53  | 1,223,722.00  | -  |
| 300061 | 康耐特  | 2016 年 5 月 5 日   | 重大事项 | 28.84  | 2016 年 7 月 21 日 | 31.56  | 36,200    | 1,024,751.18  | 1,044,008.00  | -  |
| 300242 | 明家联合 | 2016 年 5 月 9 日   | 重大事项 | 34.99  | 2016 年 8 月 12 日 | 36.69  | 29,300    | 1,038,835.78  | 1,025,207.00  | -  |
| 600203 | 福日电子 | 2016 年 6 月 30 日  | 重大事项 | 13.80  | 2016 年 7 月 1 日  | 13.25  | 71,100    | 858,196.16    | 981,180.00    | -  |
| 300173 | 智慧松德 | 2016 年 4 月 11 日  | 重大事项 | 16.25  | 2016 年 8 月 24 日 | 17.88  | 52,400    | 650,341.50    | 851,500.00    | -  |
| 600848 | 上海临港 | 2016 年 3 月 16 日  | 重大事项 | 15.42  | 2016 年 7 月 6 日  | 16.96  | 52,300    | 729,760.71    | 806,466.00    | -  |
| 002712 | 思美传媒 | 2016 年 4 月 11 日  | 重大事项 | 35.76  | 2016 年 8 月 17 日 | 41.82  | 20,100    | 550,648.35    | 718,776.00    | -  |
| 002349 | 精华制药 | 2016 年 1 月 4 日   | 重大事项 | 21.51  | 2016 年 7 月 18 日 | 23.16  | 33,061    | 707,478.82    | 711,142.11    | -  |
| 601611 | 中国核建 | 2016 年 6 月 30 日  | 重大事项 | 20.92  | 2016 年 7 月 1 日  | 23.01  | 33,278    | 115,474.66    | 696,175.76    | -  |
| 300265 | 通光线缆 | 2016 年 3 月 24 日  | 重大事项 | 12.38  | 2016 年 7 月 21 日 | 12.55  | 31,300    | 392,092.88    | 387,494.00    | -  |

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 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。

### 6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

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 投资组合报告

### 7.1 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              | 1,136,309,874.97 | 85.26         |
|    | 其中：股票             | 1,136,309,874.97 | 85.26         |
| 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          | 80,000,000.00    | 6.00          |
|    | 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      | 90,186,179.88    | 6.77          |
| 7  | 其他各项资产            | 26,191,568.72    | 1.97          |
| 8  | 合计                | 1,332,687,623.57 | 100.00        |

### 7.2 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 (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 |

### 7.3 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

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  | 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         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.nffund.com> 的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601328 | 交通银行 | 23,702,538.56 | 1.52           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 2  | 600104 | 上汽集团 | 21,862,584.43 | 1.41 |
| 3  | 601668 | 中国建筑 | 20,053,673.27 | 1.29 |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 18,484,785.88 | 1.19 |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 15,214,307.92 | 0.98 |
| 6  | 601288 | 农业银行 | 14,935,960.00 | 0.96 |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 13,808,260.10 | 0.89 |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药 | 13,356,966.11 | 0.86 |
| 9  | 601166 | 兴业银行 | 13,140,927.79 | 0.85 |
| 10 | 601169 | 北京银行 | 13,001,424.91 | 0.84 |
| 11 | 002304 | 洋河股份 | 12,968,058.79 | 0.83 |
| 12 | 601390 | 中国中铁 | 12,000,984.00 | 0.77 |
| 13 | 601398 | 工商银行 | 11,763,523.00 | 0.76 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 10,990,490.83 | 0.71 |
| 15 | 600703 | 三安光电 | 9,596,928.95  | 0.62 |
| 16 | 601318 | 中国平安 | 9,279,319.57  | 0.60 |
| 17 | 601988 | 中国银行 | 8,804,768.00  | 0.57 |
| 18 | 000423 | 东阿阿胶 | 8,748,633.62  | 0.56 |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 8,624,500.04  | 0.55 |
| 20 | 601186 | 中国铁建 | 8,149,030.26  | 0.52 |

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 600016 | 民生银行  | 69,107,099.11 | 4.44           |
| 2  | 600036 | 招商银行  | 59,101,359.06 | 3.80           |
| 3  | 600030 | 中信证券  | 36,817,541.69 | 2.37           |
| 4  | 600837 | 海通证券  | 36,479,212.74 | 2.35           |
| 5  | 600000 | 浦发银行  | 22,089,709.15 | 1.42           |
| 6  | 601668 | 中国建筑  | 21,494,944.28 | 1.38           |
| 7  | 000725 | 京东方 A | 16,076,938.80 | 1.03           |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药  | 14,119,671.18 | 0.91           |
| 9  | 600048 | 保利地产  | 14,062,682.91 | 0.90           |
| 10 | 600104 | 上汽集团  | 13,667,307.39 | 0.88           |
| 11 | 601166 | 兴业银行  | 12,340,488.02 | 0.79           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 601390 | 中国中铁 | 11,544,934.62 | 0.74 |
| 13 | 002024 | 苏宁云商 | 11,015,567.09 | 0.71 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 10,642,035.08 | 0.68 |
| 15 | 600383 | 金地集团 | 9,748,922.67  | 0.63 |
| 16 | 600518 | 康美药业 | 9,350,965.78  | 0.60 |
| 17 | 002594 | 比亚迪  | 9,212,637.95  | 0.59 |
| 18 | 000783 | 长江证券 | 8,980,115.15  | 0.58 |
| 19 | 601186 | 中国铁建 | 8,438,168.10  | 0.54 |
| 20 | 600705 | 中航资本 | 7,450,615.00  | 0.48 |

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。

### 7.4.3 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 | 924,500,441.42 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 999,048,477.44 |

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。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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/ | 合约市值（元） | 公允价值变动 | 风险说明 |
|----|----|--------|---------|--------|------|
|----|----|--------|---------|--------|------|

|                    |        | 卖)  |                | (元)          |                |
|--------------------|--------|-----|----------------|--------------|----------------|
| 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)     |        |     |                |              | -18,659,020.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 (元) |        |     |                |              | 4,118,460.00   |

### 7.10.2 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。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

#### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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   | 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 |

### 7.12.4 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。

**7.12.5 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 | 43,441,197.80 | 3.28          | 重大事项     |

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 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 | 35,521   | 37,758.56 | 6,520,624.13 | 0.49%  | 1,334,701,265.36 | 99.51%  |
| 大数据 300C | 6,962    | 20,733.91 | -            | -      | 144,349,447.41   | 100.00% |
| 合计       | 42,483   | 34,968.61 | 6,520,624.13 | 0.44%  | 1,479,050,712.77 | 99.56%  |

**8.2 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 | 12,005.34  | 0.0009%  |
|                  | 大数据 300C | 267.86     | 0.0002%  |
|                  | 合计       | 12,273.20  | 0.0008%  |

**8.3 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**

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额，本基金基金经理未持有本基金基础份额。

## § 9 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 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 1,411,621,918.89 | 153,160,028.99 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 57,717,961.93    | 17,219,466.41  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 128,117,991.33   | 26,030,047.99  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -                | -              |
| 本报告期末基金份额总额                    | 1,341,221,889.49 | 144,349,447.41 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 申万宏源 | 1      | 762,555,118.19   | 39.68%       | 76,265.94  | 39.69%     | -  |
| 银河证券 | 1      | 1,159,063,589.85 | 60.32%       | 115,906.61 | 60.31%     | -  |
| 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。