

南方大数据 300 指数证券投资基金 2017 年 半年度报告

2017-06-30

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：2017-08-28

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。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 2017 年 8 月 22 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,投资者在做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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录

[1.1 重要提示](#)

[1.2 目录](#)

§2 基金简介

[2.1 基金基本情况](#)

[2.2 基金产品说明](#)

[2.3 基金管理人和基金托管人](#)

[2.4 信息披露方式](#)

[2.5 其他相关资料](#)

§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](#)

[3.2 基金净值表现](#)

[3.3 其他指标](#)

§4 管理人报告

[4.1 基金管理人及基金经理情况](#)

[4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

[4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明](#)

[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](#)

[4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明](#)

[4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明](#)

[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](#)

§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](#)

[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](#)

[5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见](#)

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

[6.1 资产负债表](#)

[6.2 利润表](#)

[6.3 所有者权益（基金净值）变动表](#)

[6.4 报表附注](#)

§7 投资组合报告

[7.1 期末基金资产组合情况](#)

[7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合](#)

[7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细](#)

[7.4 报告期内股票投资组合的重大变动](#)

- [7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合](#)
- [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](#)
- [7.7 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](#)
- [7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细](#)
- [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](#)
- [7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#)
- [7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明](#)
- [7.12 投资组合报告附注](#)

§ 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](#)
- [8.2 期末上市基金前十名持有人](#)
- [8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况](#)
- [8.4 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](#)
- [8.5 发起式基金发起资金持有份额情况](#)

§ 9 开放式基金份额变动

§ 10 重大事件揭示

- [10.1 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](#)
- [10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼](#)
- [10.4 基金投资策略的改变](#)
- [10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况](#)
- [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](#)
- [10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况](#)
- [10.8 其他重大事件](#)

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

- [11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况](#)
- [11.2 影响投资者决策的其他重要信息](#)

§ 12 备查文件目录

- [12.1 备查文件目录](#)
- [12.2 存放地点](#)
- [12.3 查阅方式](#)

§ 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	912,589,967.53 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 级	大数据 300C 级
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	814,689,751.69 份	97,900,215.84 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 \times 95% + 银行人民币活期存款利率 (税后) \times 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
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	010-67595096
传真	0755-82763889	010-66275853
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	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	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	张海波	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理有限公司	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

§ 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

3.1.1 期间数 据和指标	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日
	大数据 300A 级	大数据 300C 级
本期已实现收 益	60,163,859.37	6,465,698.58

本期利润	129,828,342.26	14,110,637.40
加权平均基金份额本期利润	0.1354	0.1331
本期加权平均净值利润率	13.19%	13.02%
本期基金份额净值增长率	13.96%	13.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	23,299,807.47	2,212,424.96
期末可供分配基金份额利润	0.0286	0.0226
期末基金资产净值	904,521,392.93	108,061,302.71
期末基金份额净值	1.1103	1.1038
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.03%	10.38%

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 级

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 (%)
过去一个月	6.74	0.71	5.95	0.75	0.79	-0.04

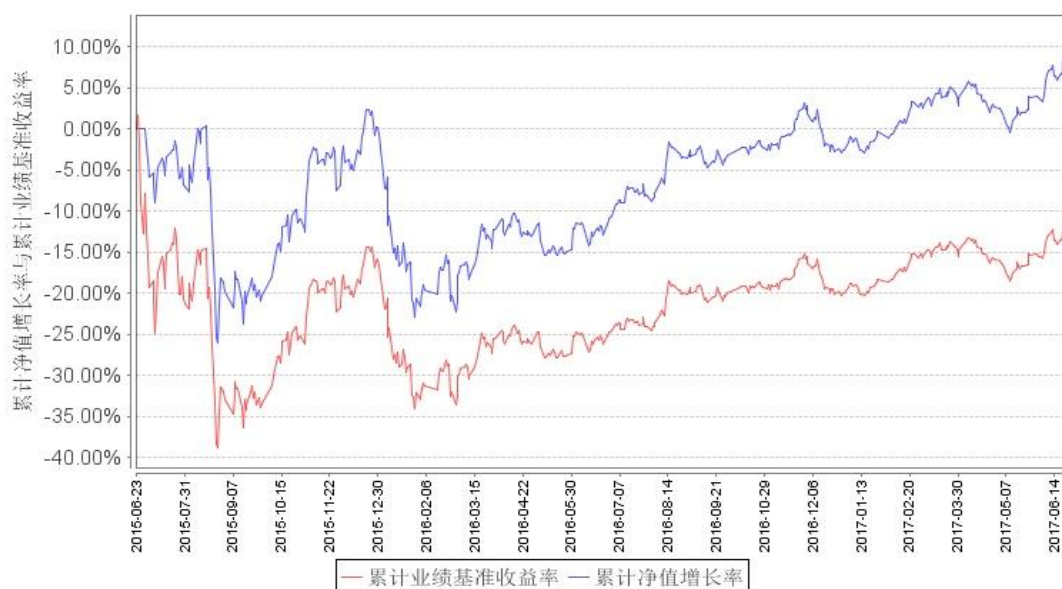
过去三个月	6.98	0.66	5.48	0.67	1.50	-0.01
过去六个月	13.96	0.60	12.34	0.61	1.62	-0.01
过去一年	24.39	0.65	19.24	0.65	5.15	0.00
自基金合同生效起至今	11.03	1.50	-10.11	1.72	21.14	-0.22

大数据 300C 级

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 (%)
过去一个月	6.71	0.72	5.95	0.75	0.76	-0.03
过去三个月	6.90	0.66	5.48	0.67	1.42	-0.01
过去六个月	13.79	0.60	12.34	0.61	1.45	-0.01
过去一年	23.99	0.65	19.24	0.65	4.75	0.00
自基金合同生效起至今	10.38	1.50	-10.11	1.72	20.49	-0.22

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

大数据300A级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



大数据300C级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 6,500 亿元，旗下管理 134 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		9	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 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 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。公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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 2 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

2017 年上半年 A 股整体表现结构化明显，以消费为代表的蓝筹龙头股获得较多资金青睐，而中小市值的新兴行业股票则表现低迷，市场分化严重。大数据 300 指数投资偏向蓝筹价值风格，报告期整体加大了家电等消费行业的权重，对指数的涨幅贡献较大。

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。本基金充分发挥大数据研究的优势，尽可能的将大数据与市场热点、基本面选股结合，量化筛选具有增长潜质的股票进行投资，报告期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 1.1103 元；C 级份额净值为 1.1038 元。报告期内，本基金 A 级份额净值增长率为 13.96%，同期业绩基准增长率为 12.34%；C 级份额净值增长率为 13.79%，同期业绩基准增长率为 12.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济角度看，物价上行压力舒缓，经济下行压力不大，出于对资产泡沫的抑制和监管政策的持续推进，货币政策将持续处于偏紧态势，去杠杆所带来的资金动向会扩散到 A 股市场，预计下半年证券市场仍旧是以存量博弈为主。

从基本面看 A 股大小市值股票的估值对比，大股票的优势在缩小，龙头行业的趋势可能会改变；预计有更多的行业和板块迎来结构性行情，一些基本面良好、业绩增速好和低估值的个股和子行业会有不错的投资机会。

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、权益研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。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，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利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；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；同一类别每一基金份额享有同等分配权；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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	23,036,189.58	11,529,782.64
结算备付金		40,627,916.17	121,313,117.80
存出保证金		1,774,250.16	19,052,769.44
交易性金融资产	6.4.4.2	956,778,178.37	1,030,974,851.54
其中：股票投资		956,694,641.83	1,030,974,851.54
基金投资		-	-
债券投资		83,536.54	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		2,661,555.95	-
应收利息	6.4.4.5	28,092.51	17,546.98
应收股利		-	-
应收申购款		746,825.30	231,048.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		1,025,653,008.04	1,183,119,117.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	540.00
应付赎回款		11,163,468.51	803,449.11
应付管理人报酬		416,297.37	516,572.25
应付托管费		124,889.20	154,971.69
应付销售服务费		34,845.05	38,454.84
应付交易费用	6.4.4.7	540,176.29	884,545.18
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	790,635.98	835,401.67
负债合计		13,070,312.40	3,233,934.74
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	912,589,967.53	1,211,560,351.21
未分配利润	6.4.4.10	99,992,728.11	-31,675,168.68
所有者权益合计		1,012,582,695.64	1,179,885,182.53
负债和所有者权益总计		1,025,653,008.04	1,183,119,117.27

注：报告截止日 2017 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 1.1103 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 1.1038 元；基金份额总额 912,589,967.53 份，其中 A 类份额 814,689,751.69 份，C 类份额 97,900,215.84 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：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		150,004,837.14	-153,606,416.06
1. 利息收入		1,074,267.05	1,256,141.82
其中：存款利息收入	6.4.4.11	852,668.10	1,210,627.38
债券利息收入		368.45	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		221,230.50	45,514.44
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		71,305,942.02	-90,648,168.97
其中：股票投资收益	6.4.4.12	56,477,978.11	-81,711,931.54
基金投资收益	6.4.4.13	-	-
债券投资收益	6.4.4.14	60,859.55	-
资产支持证券投资	6.4.4.14.2	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	3,718,116.00	-18,659,020.00
股利收益	6.4.4.17	11,048,988.36	9,722,782.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	77,309,421.71	-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）	6.4.4.19	315,206.36	192,059.00
减：二、费用		6,065,857.48	6,266,708.80
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	2,715,923.92	3,279,653.62
2. 托管费	6.4.7.2.2	814,777.13	983,896.08
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	215,099.88	258,229.76
4. 交易费用	6.4.4.20	2,002,271.91	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	6.4.4.21	317,784.64	342,322.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		143,938,979.66	-159,873,124.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		143,938,979.66	-159,873,124.86

号填列)			
------	--	--	--

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,211,560,351.21	-31,675,168.68	1,179,885,182.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	143,938,979.66	143,938,979.66
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）	-298,970,383.68	-12,271,082.87	-311,241,466.55
其中：1. 基金申购款	107,454,603.00	3,766,578.12	111,221,181.12
2. 基金赎回款	-406,424,986.68	-16,037,660.99	-422,462,647.67
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）	912,589,967.53	99,992,728.11	1,012,582,695.64
项目	上年度可比期间 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（本期净利润）	-	-159,873,124.86	-159,873,124.86
三、本期基金份额	-79,210,610	9,971,782.64	-69,238,828.34

交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	.98		
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

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

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

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[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政策的补充通知》、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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	23,036,189.58
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 1 个月以内	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	23,036,189.58

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	872,644,935.34	956,694,641.83	84,049,706.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	73,400.00	83,536.54
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	73,400.00	83,536.54
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	872,718,335.34	956,778,178.37	84,059,843.03

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30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	7,324,716.00	-	-	-
-	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,324,716.00	-	-	-

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。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,322.62
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	26,649.69
应收债券利息	11.10
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	109.10
合计	28,092.51

6.4.4.6 其他资产

注：无。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	540,176.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	540,176.29

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,503.38
预提费用	398,356.09
应付指数使用费	387,776.51
合计	790,635.98

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

大数据 300A 级

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,097,115,301.22	1,097,115,301.22

本期申购	78,902,377.09	78,902,377.09
本期赎回（以“-”号填列）	-361,327,926.62	-361,327,926.62
-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	814,689,751.69	814,689,751.69

大数据 300C 级

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,445,049.99	114,445,049.99
本期申购	28,552,225.91	28,552,225.91
本期赎回（以“-”号填列）	-45,097,060.06	-45,097,060.06
-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	97,900,215.84	97,900,215.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

大数据 300A 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-37,826,894.19	9,581,314.03	-28,245,580.16
本期利润	60,163,859.37	69,664,482.89	129,828,342.26
本期基金份额交易产生的变动数	962,842.29	-12,713,963.15	-11,751,120.86
其中：基金申购款	-121,399.05	3,053,683.55	2,932,284.50
基金赎回款	1,084,241.34	-15,767,646.70	-14,683,405.36
本期已分配利	-	-	-

润			
本期末	23,299,807.47	66,531,833.77	89,831,641.24

大数据 300C 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,419,475.12	989,886.60	-3,429,588.52
本期利润	6,465,698.58	7,644,938.82	14,110,637.40
本期基金份额 交易产生的变 动数	166,201.50	-686,163.51	-519,962.01
其中：基金申 购款	-210,248.00	1,044,541.62	834,293.62
基金赎 回款	376,449.50	-1,730,705.13	-1,354,255.63
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	2,212,424.96	7,948,661.91	10,161,086.87

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	105,937.20
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	744,072.74
其他	2,658.16
合计	852,668.10

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,465,222,895.47
减：卖出股票成本总额	1,408,744,917.36
买卖股票差价收入	56,477,978.11

6.4.4.13 基金投资收益

注：无。

6.4.4.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月 30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,137,216.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,076,000.00
减：应收利息总额	357.35
买卖债券差价收入	60,859.55

6.4.4.14.1 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至 2017年6月30日
股指期货-投资收益	3,718,116.00

6.4.4.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,048,988.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,048,988.36

6.4.4.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日
1. 交易性金融资产	74,423,217.71
股票投资	74,413,081.17
债券投资	10,136.54
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	2,886,204.00
权证投资	-

期货	2,886,204.00
其他	-
合计	77,309,421.71

6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	306,332.92
补差费归资产	8,873.44
合计	315,206.36

注：：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类份额随持有时间递减，将不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.4.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	2,002,271.91
银行间市场交易费用	-
合计	2,002,271.91

6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
指数使用费	108,636.92
银行费用	10,791.63
合计	317,784.64

注：：指数使用费为支付标的指数供应商的指数许可使用费，按前一日资产净值的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。

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
华泰证券	1,459,719,589.59	53.67	-	-

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	8,212,770.22	99.11	-	-

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	1,410,000,000.00	100.00	-	-

6.4.7.1.4 权证交易

注：无。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	145,972.49	53.66	63,393.82	11.74
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 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	2,715,923.92	3,279,653.62
其中：支付销售机构的客户维护费	821,645.09	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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 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	814,777.13	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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.7.2.3 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 2017年1月1日至2017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 级	大数据 300C 级	合计
华泰证券	-	1,613.28	1,613.28
兴业证券	-	593.51	593.51
南方基金	-	22,487.11	22,487.11
合计	-	24,693.90	24,693.90
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 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 级	大数据 300C 级	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

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	23,036,189.58	105,937.20	15,893,347.13	152,922.33

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况

注：： 本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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(单位：)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年06月05日	2017-07-07	新股认购	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
00288	金龙羽	2017年	2017-0	新股认	6.20	6.20	2,966	18,389.2	18,389.2	-

2		06月15日	7-17	购				0	0	
300671	富满电子	2017年06月27日	2017-07-05	新股认购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603305	旭升股份	2017年06月30日	2017-07-10	新股认购	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年06月27日	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年06月23日	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017年06月28日	2017-07-06	新股认购	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

6.4.9.2 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
601088	中国神华	2017-06-05	重要事项未公告	22.29	-	-	497,800	9,674,507.07	11,095,962.00	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	2,463,000	8,503,720.84	8,448,090.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	-	-	380,000	6,325,165.27	5,544,200.00	-
000034	神州数码	2017-03-21	重大资产重组	24.45	2017-07-18	22.01	98,468	2,724,025.86	2,407,542.60	-
002638	勤上光电	2017-04-26	重大资产重组	8.14	-	-	294,200	2,939,586.00	2,394,788.00	-
601717	XD郑煤机	2017-04-24	重大资产重组	7.79	-	-	285,200	2,236,295.11	2,221,708.00	-
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23	-	-	103,500	1,910,319.20	2,093,805.00	-
300271	华宇软件	2017-06-22	拟披露重	16.59	2017-07-04	16.80	114,100	1,903,839.37	1,892,919.00	-

			大事项							
002260	德奥通航	2016-12-05	重大资产重组	23.10	-	-	69,900	1,787,989.07	1,614,690.00	-
300252	金信诺	2017-04-27	重大资产重组	21.65	-	-	56,400	1,722,173.06	1,221,060.00	-
600136	当代明诚	2017-02-13	重大资产重组	16.79	-	-	70,883	1,088,278.56	1,190,125.57	-
300089	文化长城	2017-04-19	重大资产重组	14.93	-	-	74,700	1,146,143.45	1,115,271.00	-
300440	运达科技	2017-02-20	重大资产重组	13.12	-	-	72,200	949,618.39	947,264.00	-
300462	华铭智能	2017-04-21	重大资产重组	36.83	-	-	18,325	589,130.28	674,909.75	-
300092	科新机电	2017-04-14	重大资产重组	12.70	-	-	39,100	538,186.01	496,570.00	-
600603	广汇物流	2017-06-15	拟筹划重大资产重组	11.81	2017-07-27	11.71	41,400	600,433.45	488,934.00	-
300108	双龙股份	2017-05-12	拟披露重大资产重组	7.75	2017-08-04	8.35	59,800	495,182.23	463,450.00	-
000038	深大通	2017-05-12	重大资产重组	31.74	-	-	9,700	336,839.00	307,878.00	-

注：： 本基金截至 2017 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 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具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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 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 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,036,189.58	-	-	-	23,036,189.58
结算备付金	40,627,916.17	-	-	-	40,627,916.17
存出保证金	242,342.16	-	-	-1,531,908.00	1,774,250.16
交易性金融资产	83,536.54	-	-	-956,694,641.83	956,778,178.37
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	28,092.51	28,092.51
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	108,261.25	-	-	638,564.05	746,825.30
应收证券清算款	-	-	-	-2,661,555.95	2,661,555.95
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	64,098,245.70	-	-	-961,554,762.34	1,025,653,008.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	-11,163,468.51	11,163,468.51
应付管理人报酬	-	-	-	416,297.37	416,297.37
应付托管费	-	-	-	124,889.20	124,889.20
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	34,845.05	34,845.05
应付交易费用	-	-	-	540,176.29	540,176.29
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	790,635.98	790,635.98
负债总计	-	-	-	-13,070,312.40	13,070,312.40
利率敏感度缺口	64,098,245.70	-	-	-948,484,449.94	1,012,582,695.64
上年度末 2016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	11,529,782.6	-	-	-	11,529,782.64

	4				
结算备付金	121,313,117.80				121,313,117.80
存出保证金	90,849.44			18,961,920.00	19,052,769.44
交易性金融资产				1,030,974,851.54	1,030,974,851.54
应收利息				17,546.98	17,546.98
应收申购款	23,803.48			207,245.39	231,048.87
资产总计	132,957,553.36			1,050,161,563.91	1,183,119,117.27
负债					
应付证券清算款				540.00	540.00
应付赎回款				803,449.11	803,449.11
应付管理人报酬				516,572.25	516,572.25
应付托管费				154,971.69	154,971.69
应付销售服务费				38,454.84	38,454.84
应付交易费用				884,545.18	884,545.18
其他负债				835,401.67	835,401.67
负债总计				3,233,934.74	3,233,934.74
利率敏感度缺口	132,957,553.36			1,046,927,629.17	1,179,885,182.53

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。

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资市值占基金净值比例为 0.0082% (2016 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	956,694,641.83	94.48	1,030,974,851.54	87.38
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	956,694,641.83	94.48	1,030,974,851.54	87.38

6.4.10.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币元）		
	本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	49,930,000.00	44,540,000.00
	业绩比较基准下降5%	-49,930,000.00	-44,540,000.00

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	956,694,641.83	93.28
	其中：股票	956,694,641.83	93.28
2	固定收益投资	83,536.54	0.01
	其中：债券	83,536.54	0.01
	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	63,664,105.75	6.21
7	其他各项资产	5,210,723.92	0.51
	合计	1,025,653,008.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	425,298.00	0.04
B	采矿业	29,596,197.00	2.92
C	制造业	529,185,329.44	52.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,263,497.85	0.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,525,835.76	2.62
G	交通运输、仓储和邮政业	1,751,696.65	0.17
H	住宿和餐饮业	1,008,472.30	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,059,903.12	4.15
J	金融业	208,270,950.39	20.57
K	房地产业	90,252,375.07	8.91
L	租赁和商务服务业	7,270,524.08	0.72
M	科学研究和技术服务业	514,764.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	667,717.00	0.07
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,413,147.17	1.52
S	综合	488,934.00	0.05
	合计	956,694,641.83	94.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	2,350,900	56,210,019.00	5.55
2	000651	格力电器	1,113,400	45,838,678.00	4.53
3	000333	美的集团	1,042,106	44,852,242.24	4.43
4	600016	民生银行	4,961,100	40,780,242.00	4.03
5	600000	浦发银行	2,352,827	29,763,261.55	2.94
6	601601	中国太保	747,692	25,324,328.04	2.50
7	000858	五粮液	432,249	24,058,979.34	2.38
8	000002	万科 A	962,335	24,029,504.95	2.37

9	600104	上汽集团	734,700	22,812,435.00	2.25
10	601988	中国银行	5,312,500	19,656,250.00	1.94
11	600518	康美药业	793,100	17,241,994.00	1.70
12	601818	光大银行	3,909,400	15,833,070.00	1.56
13	600048	保利地产	1,546,900	15,422,593.00	1.52
14	600019	宝钢股份	1,962,628	13,169,233.88	1.30
15	600015	华夏银行	1,379,290	12,717,053.80	1.26
16	600690	青岛海尔	777,500	11,701,375.00	1.16
17	002304	洋河股份	129,100	11,207,171.00	1.11
18	601088	中国神华	497,800	11,095,962.00	1.10
19	600309	万华化学	332,980	9,536,547.20	0.94
20	601899	紫金矿业	2,626,500	9,008,895.00	0.89
21	000423	东阿阿胶	122,400	8,799,336.00	0.87
22	600660	福耀玻璃	333,900	8,694,756.00	0.86
23	000100	TCL 集团	2,463,000	8,448,090.00	0.83
24	000568	泸州老窖	166,300	8,411,454.00	0.83
25	002142	宁波银行	413,820	7,986,726.00	0.79
26	600089	特变电工	772,313	7,977,993.29	0.79
27	002241	歌尔股份	411,400	7,931,792.00	0.78
28	600196	复星医药	252,665	7,830,088.35	0.77
29	000338	潍柴动力	559,800	7,389,360.00	0.73
30	000413	东旭光电	657,200	7,373,784.00	0.73
31	601607	上海医药	255,137	7,368,356.56	0.73
32	000625	长安汽车	502,200	7,241,724.00	0.72
33	600340	华夏幸福	208,100	6,987,998.00	0.69
34	600085	同仁堂	169,015	5,908,764.40	0.58
35	600535	天士力	141,200	5,865,448.00	0.58
36	600383	金地集团	490,600	5,627,182.00	0.56
37	600485	XD 信威集	380,000	5,544,200.00	0.55
38	000895	双汇发展	228,600	5,429,250.00	0.54
39	600804	鹏博士	296,596	5,264,579.00	0.52
40	600271	航天信息	252,918	5,220,227.52	0.52
41	601992	金隅股份	770,100	4,982,547.00	0.49
42	600867	通化东宝	266,392	4,858,990.08	0.48
43	002065	东华软件	221,800	4,833,022.00	0.48
44	600208	新湖中宝	1,067,700	4,804,650.00	0.47
45	000623	吉林敖东	207,570	4,751,277.30	0.47
46	002007	华兰生物	129,695	4,733,867.50	0.47
47	600079	人福医药	227,305	4,459,724.10	0.44
48	000793	华闻传媒	435,800	4,410,296.00	0.44
49	300017	网宿科技	350,032	4,224,886.24	0.42
50	300315	掌趣科技	502,000	4,096,320.00	0.40

51	600332	白云山	126,300	3,667,752.00	0.36
52	000402	金融街	300,500	3,521,860.00	0.35
53	600297	广汇汽车	464,760	3,499,642.80	0.35
54	000581	威孚高科	134,050	3,471,895.00	0.34
55	601155	新城控股	182,700	3,387,258.00	0.33
56	600166	福田汽车	1,184,200	3,363,128.00	0.33
57	600498	烽火通信	131,736	3,339,507.60	0.33
58	600325	华发股份	396,900	3,314,115.00	0.33
59	002385	大北农	505,500	3,179,595.00	0.31
60	601633	长城汽车	236,600	3,144,414.00	0.31
61	600056	中国医药	117,900	3,059,505.00	0.30
62	600649	城投控股	290,400	3,052,104.00	0.30
63	002027	分众传媒	215,904	2,970,839.04	0.29
64	000999	华润三九	92,200	2,927,350.00	0.29
65	002185	华天科技	398,900	2,888,036.00	0.29
66	300033	同花顺	46,200	2,874,102.00	0.28
67	600060	海信电器	187,220	2,840,127.40	0.28
68	002410	广联达	149,600	2,812,480.00	0.28
69	600376	首开股份	245,800	2,811,952.00	0.28
70	000488	晨鸣纸业	210,408	2,714,263.20	0.27
71	600873	梅花生物	474,900	2,692,683.00	0.27
72	600252	中恒集团	663,997	2,682,547.88	0.26
73	000028	国药一致	31,800	2,572,620.00	0.25
74	600037	歌华有线	174,816	2,545,320.96	0.25
75	603589	口子窖	65,500	2,540,745.00	0.25
76	600633	浙数文化	130,900	2,528,988.00	0.25
77	300058	蓝色光标	321,700	2,515,694.00	0.25
78	600737	中粮糖业	257,800	2,433,632.00	0.24
79	300146	汤臣倍健	175,800	2,415,492.00	0.24
80	000034	神州数码	98,468	2,407,542.60	0.24
81	002638	勤上光电	294,200	2,394,788.00	0.24
82	601898	中煤能源	401,000	2,357,880.00	0.23
83	601699	潞安环能	290,100	2,268,582.00	0.22
84	000513	丽珠集团	33,000	2,247,300.00	0.22
85	601717	郑煤机	285,200	2,221,708.00	0.22
86	002343	慈文传媒	56,900	2,154,234.00	0.21
87	600572	康恩贝	308,000	2,131,360.00	0.21
88	600567	山鹰纸业	587,000	2,101,460.00	0.21
89	002399	海普瑞	103,500	2,093,805.00	0.21
90	002152	广电运通	250,828	2,084,380.68	0.21
91	600062	华润双鹤	75,100	2,059,993.00	0.20
92	002131	利欧股份	619,100	2,036,839.00	0.20

93	000008	神州高铁	277,700	2,021,656.00	0.20
94	600216	浙江医药	203,500	2,016,685.00	0.20
95	600064	南京高科	130,700	1,973,570.00	0.19
96	002373	千方科技	143,651	1,959,399.64	0.19
97	601231	环旭电子	122,900	1,930,759.00	0.19
98	002624	完美世界	56,049	1,922,480.70	0.19
99	300271	华宇软件	114,100	1,892,919.00	0.19
100	600282	南钢股份	509,700	1,890,987.00	0.19
101	000898	鞍钢股份	331,900	1,878,554.00	0.19
102	002462	嘉事堂	47,700	1,874,133.00	0.19
103	000027	深圳能源	276,345	1,859,801.85	0.18
104	000860	顺鑫农业	92,500	1,850,925.00	0.18
105	600565	迪马股份	331,900	1,828,769.00	0.18
106	600566	济川药业	47,700	1,814,031.00	0.18
107	600380	健康元	199,700	1,813,276.00	0.18
108	600348	阳泉煤业	259,700	1,760,766.00	0.17
109	600210	紫江企业	285,200	1,751,128.00	0.17
110	300068	南都电源	103,800	1,747,992.00	0.17
111	002262	恩华药业	111,540	1,687,600.20	0.17
112	300199	翰宇药业	109,500	1,679,730.00	0.17
113	600742	一汽富维	87,800	1,677,858.00	0.17
114	600557	康缘药业	100,100	1,662,661.00	0.16
115	002285	世联行	202,600	1,624,852.00	0.16
116	002260	德奥通航	69,900	1,614,690.00	0.16
117	300287	飞利信	174,700	1,603,746.00	0.16
118	002436	兴森科技	243,000	1,530,900.00	0.15
119	000718	苏宁环球	260,800	1,528,288.00	0.15
120	000049	德赛电池	29,100	1,507,671.00	0.15
121	000596	古井贡酒	29,100	1,482,645.00	0.15
122	002517	恺英网络	41,934	1,475,657.46	0.15
123	002396	星网锐捷	75,600	1,462,860.00	0.14
124	600422	昆药集团	128,000	1,451,520.00	0.14
125	600073	上海梅林	151,200	1,443,960.00	0.14
126	600261	阳光照明	217,500	1,428,975.00	0.14
127	000921	海信科龙	81,800	1,407,778.00	0.14
128	600273	嘉化能源	149,200	1,399,496.00	0.14
129	300463	迈克生物	54,800	1,397,400.00	0.14
130	601678	滨化股份	201,000	1,396,950.00	0.14
131	000620	新华联	190,400	1,353,744.00	0.13
132	600966	博汇纸业	257,700	1,337,463.00	0.13
133	600587	新华医疗	74,500	1,324,610.00	0.13
134	600651	飞乐音响	156,100	1,322,167.00	0.13

135	601233	桐昆股份	94,700	1,312,542.00	0.13
136	000541	佛山照明	143,100	1,303,641.00	0.13
137	600668	尖峰集团	75,000	1,288,500.00	0.13
138	600285	羚锐制药	112,200	1,260,006.00	0.12
139	600708	DR 光明地	188,955	1,254,661.20	0.12
140	000903	云内动力	269,600	1,226,680.00	0.12
141	600363	联创光电	87,300	1,223,073.00	0.12
142	300252	金信诺	56,400	1,221,060.00	0.12
143	002668	奥马电器	61,440	1,210,368.00	0.12
144	600626	申达股份	127,300	1,200,439.00	0.12
145	002511	中顺洁柔	90,450	1,196,653.50	0.12
146	000533	万家乐	109,100	1,192,463.00	0.12
147	600136	当代明诚	70,883	1,190,125.57	0.12
148	002332	仙琚制药	135,200	1,162,720.00	0.11
149	002020	京新药业	97,800	1,158,930.00	0.11
150	600641	万业企业	103,700	1,157,292.00	0.11
151	600188	兖州煤业	93,600	1,145,664.00	0.11
152	000552	靖远煤电	317,800	1,134,546.00	0.11
153	600114	东睦股份	64,800	1,134,000.00	0.11
154	002329	皇氏集团	116,500	1,119,565.00	0.11
155	300089	文化长城	74,700	1,115,271.00	0.11
156	002139	拓邦股份	103,250	1,112,002.50	0.11
157	002433	太安堂	120,200	1,111,850.00	0.11
158	600308	华泰股份	195,400	1,109,872.00	0.11
159	600197	伊力特	56,800	1,109,304.00	0.11
160	000040	东旭蓝天	84,300	1,108,545.00	0.11
161	300476	胜宏科技	46,800	1,105,884.00	0.11
162	603883	老百姓	21,852	1,063,099.80	0.10
163	600546	山煤国际	219,400	1,050,926.00	0.10
164	600757	长江传媒	137,600	1,027,872.00	0.10
165	600801	华新水泥	106,800	1,017,804.00	0.10
166	600754	锦江股份	37,213	1,008,472.30	0.10
167	600713	南京医药	142,500	1,001,775.00	0.10
168	603368	柳州医药	17,490	1,001,302.50	0.10
169	600730	中国高科	122,034	999,458.46	0.10
170	000030	富奥股份	110,900	991,446.00	0.10
171	002521	齐峰新材	99,600	984,048.00	0.10
172	002247	帝龙文化	74,654	979,460.48	0.10
173	000404	华意压缩	121,100	953,057.00	0.09
174	300440	运达科技	72,200	947,264.00	0.09
175	000951	中国重汽	61,800	944,922.00	0.09
176	300031	宝通科技	51,100	939,729.00	0.09

177	601799	星宇股份	21,200	937,464.00	0.09
178	300339	润和软件	73,600	927,360.00	0.09
179	600179	安通控股	52,760	922,772.40	0.09
180	603108	润达医疗	57,680	918,842.40	0.09
181	601567	三星医疗	87,800	914,876.00	0.09
182	002445	中南文化	69,900	898,215.00	0.09
183	600479	千金药业	62,000	897,140.00	0.09
184	601677	明泰铝业	65,600	894,784.00	0.09
185	600305	恒顺醋业	86,800	890,568.00	0.09
186	000550	江铃汽车	42,500	879,750.00	0.09
187	600129	太极集团	64,793	872,761.71	0.09
188	002551	尚荣医疗	53,800	867,794.00	0.09
189	000537	广宇发展	105,600	866,976.00	0.09
190	002737	葵花药业	28,100	865,480.00	0.09
191	603989	艾华集团	21,900	859,356.00	0.08
192	002540	亚太科技	120,900	853,554.00	0.08
193	600093	易见股份	62,928	845,123.04	0.08
194	002279	久其软件	66,950	840,222.50	0.08
195	002604	龙力生物	89,100	829,521.00	0.08
196	600676	交运股份	111,265	828,924.25	0.08
197	600508	上海能源	70,600	823,902.00	0.08
198	603198	迎驾贡酒	43,200	822,096.00	0.08
199	000952	广济药业	54,600	820,638.00	0.08
200	600782	XD 新钢股	221,200	807,380.00	0.08
201	000043	中航地产	84,400	806,864.00	0.08
202	300256	星星科技	77,400	804,960.00	0.08
203	000892	星美联合	79,800	800,394.00	0.08
204	601515	东风股份	69,669	787,259.70	0.08
205	600743	华远地产	185,500	782,810.00	0.08
206	002324	普利特	29,000	779,520.00	0.08
207	000936	华西股份	110,800	777,816.00	0.08
208	300049	福瑞股份	46,000	776,020.00	0.08
209	000919	金陵药业	71,600	774,712.00	0.08
210	600551	时代出版	48,700	768,973.00	0.08
211	000011	深物业 A	38,000	760,000.00	0.08
212	002133	广宇集团	137,149	759,805.46	0.08
213	300224	正海磁材	84,100	756,900.00	0.07
214	002662	京威股份	104,000	748,800.00	0.07
215	000908	景峰医药	88,500	746,940.00	0.07
216	002258	利尔化学	58,000	733,120.00	0.07
217	600969	郴电国际	51,400	729,880.00	0.07
218	603328	依顿电子	51,000	721,650.00	0.07

219	300395	菲利华	49,150	720,047.50	0.07
220	002446	盛路通信	58,850	716,204.50	0.07
221	002391	长青股份	48,900	715,896.00	0.07
222	600515	海航基础	69,500	713,765.00	0.07
223	002626	金达威	49,900	711,075.00	0.07
224	002071	长城影视	70,700	704,172.00	0.07
225	002275	桂林三金	39,700	703,087.00	0.07
226	002543	万和电气	28,400	697,788.00	0.07
227	002472	双环传动	63,600	697,692.00	0.07
228	002705	新宝股份	45,483	683,609.49	0.07
229	002557	洽洽食品	47,200	682,984.00	0.07
230	300462	华铭智能	18,325	674,909.75	0.07
231	600979	广安爱众	117,800	673,816.00	0.07
232	300406	九强生物	40,700	669,922.00	0.07
233	600661	新南洋	31,100	667,717.00	0.07
234	002087	新野纺织	117,700	665,005.00	0.07
235	601113	华鼎股份	78,700	663,441.00	0.07
236	600523	贵航股份	35,400	655,254.00	0.06
237	000665	湖北广电	53,200	646,380.00	0.06
238	300282	汇冠股份	30,600	645,660.00	0.06
239	000719	大地传媒	60,820	634,352.60	0.06
240	002536	西泵股份	51,100	632,618.00	0.06
241	600231	凌钢股份	191,700	632,610.00	0.06
242	000521	美菱电器	98,800	632,320.00	0.06
243	300071	华谊嘉信	77,900	630,990.00	0.06
244	603020	爱普股份	42,800	623,168.00	0.06
245	300204	舒泰神	39,800	620,482.00	0.06
246	002734	利民股份	20,400	597,924.00	0.06
247	000756	新华制药	38,900	590,502.00	0.06
248	002677	浙江美大	41,600	579,488.00	0.06
249	300363	博腾股份	38,000	576,080.00	0.06
250	300342	天银机电	37,400	570,724.00	0.06
251	600218	全柴动力	63,000	566,370.00	0.06
252	300119	瑞普生物	39,772	566,353.28	0.06
253	002452	长高集团	82,400	566,088.00	0.06
254	603567	珍宝岛	33,600	565,488.00	0.06
255	002441	众业达	48,700	562,972.00	0.06
256	002666	德联集团	88,700	561,471.00	0.06
257	002653	海思科	42,200	549,022.00	0.05
258	603866	桃李面包	15,400	547,932.00	0.05
259	601900	南方传媒	44,000	547,360.00	0.05
260	603788	宁波高发	12,700	546,354.00	0.05

261	603611	诺力股份	20,600	542,810.00	0.05
262	000906	物产中拓	60,190	535,089.10	0.05
263	002220	天宝股份	63,500	534,670.00	0.05
264	300130	新国都	27,800	525,142.00	0.05
265	600845	宝信软件	31,100	524,035.00	0.05
266	002084	海鸥卫浴	58,600	520,954.00	0.05
267	300358	楚天科技	36,300	518,001.00	0.05
268	600721	百花村	36,200	514,764.00	0.05
269	300092	科新机电	39,100	496,570.00	0.05
270	600603	广汇物流	41,400	488,934.00	0.05
271	600665	天地源	97,700	487,523.00	0.05
272	002763	汇洁股份	16,800	483,000.00	0.05
273	002615	哈尔斯	42,650	481,945.00	0.05
274	000026	飞亚达 A	38,500	478,940.00	0.05
275	002548	金新农	38,400	463,872.00	0.05
276	300108	双龙股份	59,800	463,450.00	0.05
277	601579	会稽山	38,000	462,080.00	0.05
278	002612	朗姿股份	34,100	461,714.00	0.05
279	603996	中新科技	26,850	459,135.00	0.05
280	002732	燕塘乳业	15,800	455,514.00	0.04
281	002403	爱仕达	34,408	453,497.44	0.04
282	603919	金徽酒	23,700	452,196.00	0.04
283	002109	*ST 兴化	54,600	441,168.00	0.04
284	002746	仙坛股份	14,600	425,298.00	0.04
285	002014	永新股份	33,200	418,652.00	0.04
286	000761	本钢板材	76,400	399,572.00	0.04
287	002532	新界泵业	48,880	398,372.00	0.04
288	002541	鸿路钢构	22,562	390,096.98	0.04
289	002661	克明面业	23,800	386,274.00	0.04
290	300341	麦迪电气	41,600	359,840.00	0.04
291	600081	东风科技	28,500	354,825.00	0.04
292	300389	艾比森	23,700	344,598.00	0.03
293	300469	信息发展	6,100	331,901.00	0.03
294	000004	国农科技	12,800	328,320.00	0.03
295	000038	深大通	9,700	307,878.00	0.03
296	002788	鹭燕医药	8,300	276,390.00	0.03
297	300218	安利股份	22,800	262,656.00	0.03
298	300387	富邦股份	10,851	214,849.80	0.02
299	300501	海顺新材	4,400	198,572.00	0.02
300	603801	N 志邦	1,406	47,522.80	0.00
301	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
302	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00

303	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
304	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
305	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
306	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
307	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
308	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
309	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
310	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
311	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
312	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
313	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
314	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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 名的股票投资明细

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	000333	美的集团	54,912,411.15	4.65
2	600036	招商银行	52,867,046.36	4.48
3	000651	格力电器	50,642,456.54	4.29
4	600016	民生银行	41,453,461.12	3.51
5	000858	五粮液	22,739,852.14	1.93
6	601601	中国太保	22,198,234.79	1.88
7	000002	万科 A	19,905,446.00	1.69
8	600518	康美药业	16,284,700.35	1.38
9	600048	保利地产	15,469,479.20	1.31
10	000063	中兴通讯	14,081,190.25	1.19
11	600690	青岛海尔	14,024,480.46	1.19
12	000625	长安汽车	13,674,157.39	1.16
13	600000	浦发银行	13,667,715.43	1.16
14	600019	宝钢股份	13,238,252.72	1.12
15	002304	洋河股份	12,063,713.40	1.02
16	000413	东旭光电	10,836,978.00	0.92
17	601088	中国神华	9,796,944.58	0.83
18	601899	紫金矿业	9,413,683.50	0.80
19	600104	上汽集团	9,197,570.79	0.78
20	600309	万华化学	9,025,292.70	0.76

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 名的股票投资明细

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	600036	招商银行	63,219,157.52	5.36
2	601318	中国平安	58,289,901.50	4.94
3	601166	兴业银行	58,108,301.30	4.92
4	601328	交通银行	57,403,081.92	4.87
5	601668	中国建筑	42,398,885.28	3.59
6	601398	工商银行	36,118,076.00	3.06
7	000001	平安银行	30,073,677.78	2.55
8	000333	美的集团	26,032,045.86	2.21
9	000651	格力电器	25,818,009.25	2.19
10	000858	五粮液	23,942,562.62	2.03
11	600000	浦发银行	21,936,728.69	1.86
12	600900	长江电力	21,916,967.15	1.86
13	601009	南京银行	18,373,033.16	1.56
14	000063	中兴通讯	16,072,642.60	1.36
15	600104	上汽集团	15,152,453.36	1.28
16	601988	中国银行	14,595,300.00	1.24
17	002304	洋河股份	13,689,222.27	1.16
18	600795	国电电力	12,644,378.00	1.07
19	601818	光大银行	11,886,880.00	1.01
20	600309	万华化学	10,206,665.30	0.87

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	1,254,768,357.30
卖出股票收入（成交）总额	1,465,222,895.47

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金	-	-

	融债		
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	83,536.54	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	83,536.54	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128015	久其转债	734	83,536.54	0.01

7.7 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。

7.8 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/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1707	IF1707	7	7,659,540.00	334,824.00	-
公允价值变动总额合计（元）					334,824.00
股指期货投资本期收益（元）					3,718,116.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					2,886,204.00

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

注：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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	1,774,250.16
2	应收证券清算款	2,661,555.95
3	应收股利	-
4	应收利息	28,092.51
5	应收申购款	746,825.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	5,210,723.92

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 股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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 (%)

南方 大数 据 300 指 数	33,618	24,233.74	47,547,365.78	5.84	767,142,385.91	94.16
南方 大数 据 300B	16,681	5,868.97	-	-	97,900,215.84	100.00
合计	50,299	18,143.30	47,547,365.78	5.21	865,042,601.75	94.79

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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 级	256,733.82	0.0315
	大数据 300C 级	150.97	0.0002
	合计	256,884.79	0.0281

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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

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 级	大数据 300C 级
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	1,097,115,301.22	114,445,049.99

本报告期基金总申购份额	78,902,377.09	28,552,225.91
减：本报告期基金总赎回份额	361,327,926.62	45,097,060.06
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	814,689,751.69	97,900,215.84

§ 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

南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议已于 2017 年 1 月 23 日审议通过了《公司关于聘任公司副总经理、督察长和财务负责人的议案》，秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

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

10.7.1 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	1,459,719,589.59	53.67	145,972.49	53.66	-
申万宏源	1	1,260,271,663.18	46.33	126,037.35	46.34	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华泰证券	8,212,770.22	99.11	1,410,000.00	100.00	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	73,400.00	0.89	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年6月12日
2	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	2017年5月24日
3	南方大数据 300 指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月24日
4	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月23日
5	南方基金关于旗下部分基金增加大河财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月6日
6	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年4月5日
7	南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年度报告 (摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月30日
8	南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年3月30日
9	南方基金关于旗下部分基	中国证券报、上海证券	2017年3月29日

	金增加方正证券为代销机构及开通相关业务的公告	报、证券时报	
10	南方基金关于旗下部分基金增加成都农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 27 日
11	南方基金关于旗下部分基金增加广东南粤银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 22 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	2017 年 3 月 16 日
13	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 15 日
14	南方基金关于旗下部分基金增加萧山农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 6 日
15	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	2017 年 3 月 1 日
16	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 23 日
17	南方基金关于旗下部分基金增加植信基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 15 日
18	南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 26 日
19	南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 26 日
20	南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日
21	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 11 日
22	南方基金关于旗下部分基	中国证券报、上海证券	2017 年 1 月 6 日

	金增加金斧子为代销机构 及开通相关业务的公告	报、证券时报	
--	---------------------------	--------	--

§ 11 备查文件目录

11.1 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 2017 年半年度报告》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。

11.2 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。

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>