

南方大数据 300 指数证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

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 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	11
2.1 基金基本情况	11
2.2 基金产品说明	11
2.3 基金管理人和基金托管人	11
2.4 信息披露方式	11
2.5 其他相关资料	11
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	11
3.1 主要会计数据和财务指标	11
3.2 基金净值表现	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	22
7.1 期末基金资产组合情况	22
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	22
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	22
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	22
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	22
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	22
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	22

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.....	22
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.....	23
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	23
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	23
7.12	投资组合报告附注.....	23
§ 8	基金份额持有人信息.....	24
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	24
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	24
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	24
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情况.....	24
§ 9	开放式基金份额变动.....	24
§ 10	重大事件揭示.....	24
10.1	基金份额持有人大会决议.....	24
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.....	24
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	25
10.4	基金投资策略的改变.....	25
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	25
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.....	25
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	25
10.8	其他重大事件.....	25
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	25
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.....	25
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	25
§ 12	备查文件目录.....	25
12.1	备查文件目录.....	25
12.2	存放地点.....	26
12.3	查阅方式.....	26

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	南方基金管理股份有限公司	
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	542,464,756.29 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	476,728,844.87 份	65,735,911.42 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		南方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	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
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	田国立

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	南方基金管理股份有限公司	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	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	大数据 300A 级	大数据 300C 级
本期已实现收益	-37,310,185.73	-4,990,559.58
本期利润	-79,683,504.30	-10,885,031.37
加权平均基金份额本期利润	-0.1480	-0.1524
本期加权平均净	-13.42%	-13.94%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	-13.92%	-14.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-5,181,957.31	-1,351,951.96
期末可供分配基金份额利润	-0.0109	-0.0206
期末基金资产净值	471,546,887.56	64,383,959.46
期末基金份额净值	0.9891	0.9794
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-1.09%	-2.06%

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	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	-6.57%	1.37%	-7.50%	1.32%	0.93%	0.05%
过去三个月	-8.48%	1.13%	-9.14%	1.10%	0.66%	0.03%
过去六个月	-13.92%	1.13%	-14.32%	1.10%	0.40%	0.03%
过去一年	-10.92%	0.93%	-12.04%	0.91%	1.12%	0.02%
过去三年	-1.09%	1.34%	-14.19%	1.45%	13.10%	-0.11%

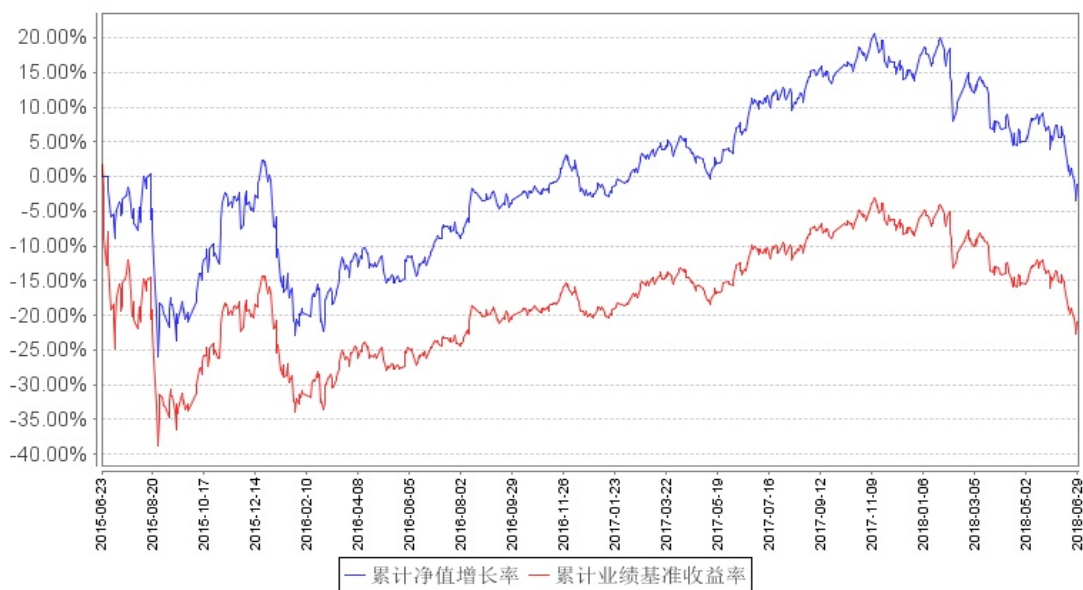
自基金合同	-1.09%	1.33%	-20.93%	1.50%	19.84%	-0.17%
-------	--------	-------	---------	-------	--------	--------

大数据 300C 级

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	-6.61%	1.37%	-7.50%	1.32%	0.89%	0.05%
过去三个月	-8.57%	1.13%	-9.14%	1.10%	0.57%	0.03%
过去六个月	-14.09%	1.13%	-14.32%	1.10%	0.23%	0.03%
过去一年	-11.27%	0.93%	-12.04%	0.91%	0.77%	0.02%
过去三年	-2.06%	1.34%	-14.19%	1.45%	12.13%	-0.11%
自基金合同	-2.06%	1.33%	-20.93%	1.50%	18.87%	-0.17%

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



§ 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。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：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%及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，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超8,200亿元，旗下管理168只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、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		
李佳亮	本基金基金经理	2017年11月9日	-	5	美国南加州大学金融工程硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。

					2012 年 8 月加入南方基金，任量化投资部研究员； 2015 年 5 月至 2016 年 8 月，任量化投资经理助理； 2016 年 8 月至今，任南方消费基金经理 2016 年 11 月至今，任南方中证 500 增强基金经理；2016 年 12 月至今，任南方绝对收益基金经理； 2017 年 4 月至今，任南方荣优基金经理 2017 年 11 月至今，任大数据 100、大数据 300、南方量化成长基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 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，两两组合间单日、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均未超过该证券当日成交量的 5%。

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

2018 年上半年，i300 指数下跌 15.06%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“跟踪误差归因分析系统”、将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金 A 级净值增长率为-13.92%，同期业绩比较基准收益率为-14.32%。本报告期基金 C 级净值增长率为-14.09%，同期业绩比较基准收益率为 1-14.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年上半年，受到海外主要经济体货币政策逐渐收紧、中美贸易战等诸多不确定因素影响，中国经济增速面临较大压力。权益市场缺乏赚钱效应，同时市场情绪较弱，市场仍处于探底震荡过程中。权益市场年初至今经历了三波下跌，风险得到较为充分的释放，目前权益市场体估值水平已经有相当的吸引力，投资价值凸显。权益市场短期虽存在不确定性风险，但长期持有获利机会较大，未来收益可期。

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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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同一类别的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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	33,356,336.44	63,697,470.43
结算备付金		12,064,697.35	15,269,463.90
存出保证金		4,780,717.97	6,639,663.44
交易性金融资产	6.4.7.2	487,255,288.32	712,491,462.60
其中：股票投资		487,255,288.32	712,292,562.60
基金投资		-	-
债券投资		-	198,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	13,044.26	22,800.17
应收股利		-	-
应收申购款		307,063.05	223,364.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		537,777,147.39	798,344,225.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	903.64
应付赎回款		553,257.77	1,955,664.94
应付管理人报酬		237,157.97	342,679.40
应付托管费		71,147.40	102,803.83
应付销售服务费		22,242.50	31,962.25
应付交易费用	6.4.7.7	132,815.55	276,523.01
应交税费		0.39	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	829,678.79	966,755.64
负债合计		1,846,300.37	3,677,292.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	542,464,756.29	692,266,416.56
未分配利润	6.4.7.10	-6,533,909.27	102,400,516.26
所有者权益合计		535,930,847.02	794,666,932.82
负债和所有者权益总计		537,777,147.39	798,344,225.53

注：注：报告截止日 2018 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 0.9891 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 0.9794 元；基金份额总额 912,589,967.53 份，其中 A 类份额 476,728,844.87 份，C 类份额 65,735,911.42 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-86,674,101.82	150,004,837.14
1. 利息收入		298,328.82	1,074,267.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	298,277.54	852,668.10
债券利息收入		51.28	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
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-38,876,553.59	71,305,942.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-42,985,256.11	56,477,978.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,125.57	60,859.55
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-1,101,294.47	3,718,116.00
股利收益	6.4.7.16	5,202,871.42	11,048,988.36
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-48,267,790.36	77,309,421.71

4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	171,913.31	315,206.36
减: 二、费用		3,894,433.85	6,065,857.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,664,807.23	2,715,923.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	499,442.13	814,777.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	154,873.09	215,099.88
4. 交易费用	6.4.7.19	1,273,004.91	2,002,271.91
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		8,689.91	-
7. 其他费用	6.4.7.20	293,616.58	317,784.64
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-90,568,535.67	143,938,979.66
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-90,568,535.67	143,938,979.66

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: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	692,266,416.56	102,400,516.26	794,666,932.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-90,568,535.67	-90,568,535.67
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)	-149,801,660.27	-18,365,889.86	-168,167,550.13
其中: 1. 基金申购款	47,944,267.50	4,642,826.61	52,587,094.11
2. 基金赎回款	-197,745,927.77	-23,008,716.47	-220,754,644.24
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)	542,464,756.29	-6,533,909.27	535,930,847.02
项目	上年度可比期间 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 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

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 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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018年6月30日
活期存款	33,356,336.44
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月及以上	-
其他存款	-
合计	33,356,336.44

注：-

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	534,414,841.11	487,255,288.32	-47,159,552.79
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	534,414,841.11	487,255,288.32	-47,159,552.79

注：-

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生 工具	-	-	-	-

	-	-	-	-
权益衍生工具	33,983,760.00	-	-	-
	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,983,760.00	-	-	-

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	6,589.07
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	6,417.79
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	37.40
合计	13,044.26

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
----	-----

	2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	132,815.55
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	132,815.55

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	604.96
预提费用	388,935.04
应付指数使用费	440,138.79
合计	829,678.79

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	611,590,952.55	611,590,952.55
本期申购	33,404,367.44	33,404,367.44
本期赎回（以“-”号填列）	-168,266,475.12	-168,266,475.12
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	476,728,844.87	476,728,844.87

大数据 300C 级

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	80,675,464.01	80,675,464.01
本期申购	14,539,900.06	14,539,900.06
本期赎回（以“-”号填列）	-29,479,452.65	-29,479,452.65
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	65,735,911.42	65,735,911.42
-----	---------------	---------------

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	109,243,234.84	-18,135,273.72	91,107,961.12
本期利润	-37,310,185.73	-42,373,318.57	-79,683,504.30
本期基金份额 交易产生的变 动数	-19,489,714.40	2,883,300.27	-16,606,414.13
其中:基金申 购款	4,665,848.86	-1,351,436.60	3,314,412.26
基金赎 回款	-24,155,563.26	4,234,736.87	-19,920,826.39
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	52,443,334.71	-57,625,292.02	-5,181,957.31
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	13,661,070.02	-2,368,514.88	11,292,555.14
本期利润	-4,990,559.58	-5,894,471.79	-10,885,031.37
本期基金份额 交易产生的变 动数	-2,153,177.45	393,701.72	-1,759,475.73
其中:基金申 购款	1,918,642.61	-590,228.26	1,328,414.35
基金赎 回款	-4,071,820.06	983,929.98	-3,087,890.08
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	6,517,332.99	-7,869,284.95	-1,351,951.96

6.4.4.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	169,449.23
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	127,824.70
其他	1,003.61
合计	298,277.54

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	807,302,617.94
减：卖出股票成本总额	850,287,874.05
买卖股票差价收入	-42,985,256.11

6.4.4.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	258,889.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	251,700.00
减：应收利息总额	63.89
买卖债券差价收入	7,125.57

6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.4.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018年1月1日至2018年6月30日
股指期货-投资收益	-1,101,294.47

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,202,871.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,202,871.42

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-45,538,330.36
股票投资	-45,538,330.36

债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-2,729,460.00
权证投资	-
期货	-2,729,460.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-48,267,790.36

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	160,598.32
补差费归资产	11,314.99
合计	171,913.31

注：本基金场内部分的赎回费率为 0.50%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	1,273,004.91
银行间市场交易费用	-
-	-
合计	1,273,004.91

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	40,167.52
信息披露费	148,767.52
指数使用费	100,000.00
银行费用	4,681.54
合计	293,616.58

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
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、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：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于2018年1月4日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

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 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	919,287,075.30	62.28	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 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	0.00	0.00	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 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 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 2018年1月1日至2018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	91,929.15	28.64	50,320.18	37.89
关联方名称	上年度可比期间 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

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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,664,807.23	2,715,923.92
其中：支付销售机构的客户维护费	488,744.60	821,645.09

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	499,442.13	814,777.13

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。

6.4.7.2.3 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		
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 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
南方基金	-	16,825.56	16,825.56
华泰证券	-	1238.01	1238.01
兴业证券	-	415.82	415.82
合计	-	18,479.39	18,479.39
获得销售服务费的各关	上年度可比期间		

关联方名称	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
南方基金	-	52,083.63	52,083.63
华泰证券	-	3,656.79	3,656.79
兴业证券	-	1,329.68	1,329.68
合计	-	57,070.10	57,070.10

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。

6.4.7.3 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固有资金投资本基金的情况

注:无。

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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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	33,356,336.44	169,449.23	23,036,189.58	105,937.20

注:本基金由基金托管人中国建设银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

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

注:无。

6.4.9 期末(2018年06月30日)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:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

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
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项	4.41	2018-08-07	4.46	245,500	1,385,013.08	1,082,655.00	-
000038	深大通	2018-02-26	重大事项	18.10	-	-	20	444.62	362.00	-
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大资产重组	7.25	2018-08-06	6.53	66,500	526,837.74	482,125.00	-
000723	美锦能源	2018-03-27	重大资产重组	5.43	2018-07-31	4.89	182,400	1,399,686.23	990,432.00	-

000825	太钢不锈	2018-04-16	重大资产重组	6.00	-	-	405,000	2,123,561.52	2,430,000.00	-
002082	万邦德	2017-12-18	重大资产重组	13.97	2018-07-19	15.37	57,600	835,079.99	804,672.00	-
002121	科陆电子	2018-06-07	拟披露重大事项	6.49	2018-08-06	5.84	97,100	804,429.19	630,179.00	-
002426	胜利精密	2018-06-18	拟披露重大事项	3.60	2018-07-03	3.26	269,400	1,182,512.73	969,840.00	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产重组	9.49	-	-	136,229	1,462,157.06	1,292,813.21	-
300350	华鹏飞	2018-05-10	重大资产重组	8.13	2018-07-16	7.32	35,100	229,981.35	285,363.00	-
600293	三峡新材	2018-04-30	重要事项未	5.68	2018-08-07	5.11	62,700	450,042.31	356,136.00	-

			公告								
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	10.64	-	-	380,000	6,325,165.27	4,043,200.00	-	
600701	*ST 工新	2018-03-14	拟筹划重大资产重组	7.54	2018-08-17	8.76	132,900	982,724.13	1,002,066.00	-	
600896	*ST 海投	2018-05-07	重大资产重组	5.12	2018-07-13	4.86	77,100	459,739.61	394,752.00	-	
601727	上海电气	2018-06-06	拟筹划重大资产重组	6.34	2018-08-07	5.71	480,800	2,847,523.32	3,048,272.00	-	
603456	九州药业	2018-06-05	重大资产重组	9.60	2018-07-05	8.64	65,500	704,332.14	628,800.00	-	
002270	华明装备	2018-05-03	拟筹划重大资	5.81	2018-7-3	5.23	60,150.00	405,671.58	349,471.50	-	

			产 重 组						
--	--	--	-------------	--	--	--	--	--	--

注:本基金截至 2018 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

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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2017 年 12 月 31 日：持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03%）。

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。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于 2018 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。

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》

及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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、存出保证金及债券投资等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	33,356,336.44	-	-	-	33,356,336.44
结算备付金	12,064,697.35	-	-	-	12,064,697.35
存出保证金	82,987.97	-	-	4,697,730.00	4,780,717.97
交易性金融资产	-	-	-	487,255,288.32	487,255,288.32
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	13,044.26	13,044.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	73,210.54	-	-	233,852.51	307,063.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	45,577,232.30	-	-	492,199,915.09	537,777,147.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	553,257.77	553,257.77
应付管理人报酬	-	-	-	237,157.97	237,157.97
应付托管费	-	-	-	71,147.40	71,147.40
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	22,242.50	22,242.50
应付交易费用	-	-	-	132,815.55	132,815.55
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.39	0.39

其他负债	-	-	-	829,678.79	829,678.79
负债总计	-	-	-	1,846,300.37	1,846,300.37
利率敏感度缺口	45,577,232.30	-	-	-490,353,614.72	535,930,847.02
上年度末 2017 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	63,697,470.43	-	-	-	63,697,470.43
结算备付金	15,269,463.90	-	-	-	15,269,463.90
存出保证金	99,075.44	-	-	6,540,588.00	6,639,663.44
交易性金融资产	-	-	198,900.00	712,292,562.60	712,491,462.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	22,800.17	22,800.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	73,705.47	-	-	149,659.52	223,364.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	79,139,715.24	-	198,900.00	719,005,610.29	798,344,225.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,955,664.94	1,955,664.94
应付管理人报酬	-	-	-	342,679.40	342,679.40
应付托管费	-	-	-	102,803.83	102,803.83
应付证券清算款	-	-	-	903.64	903.64
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	31,962.25	31,962.25
应付交易费用	-	-	-	276,523.01	276,523.01
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	966,755.64	966,755.64
负债总计	-	-	-	3,677,292.71	3,677,292.71
利率敏感度缺口	79,139,715.24	-	198,900.00	715,328,317.58	794,666,932.82

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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 2018 年 6 月 30 日本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017 年 12 月 31 日：同）。

6.4.10.4.2 外汇风险

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

6.4.10.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017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	487,255,288.32	90.92	712,292,562.60	89.63
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	487,255,288.32	90.92	712,292,562.60	89.63

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
	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 (2018 年 6 月 30 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
分析	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 上升 5%	24,761,941.63	41,675,920.90
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 下降 5%	-24,761,941.63	-41,675,920.90

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	487,255,288.32	90.61
	其中：股票	487,255,288.32	90.61
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	-	-
	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	45,421,033.79	8.45
-	-	-	-
8	其他各项资产	5,100,825.28	0.95
9	合计	537,777,147.39	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	248,626.70	0.05
B	采矿业	13,454,886.12	2.51
C	制造业	217,860,544.47	40.65

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,894,123.85	1.85
E	建筑业	16,462,566.20	3.07
F	批发和零售业	33,945,653.84	6.33
G	交通运输、仓储和邮政业	26,839,798.60	5.01
H	住宿和餐饮业	652,248.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,835,897.77	1.28
J	金融业	134,869,267.90	25.17
K	房地产业	19,147,455.40	3.57
L	租赁和商务服务业	1,213,282.23	0.23
M	科学研究和技术服务业	952,042.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	764,874.14	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	394,752.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	1,708,461.10	0.32
S	综合	2,010,808.00	0.38
	合计	487,255,288.32	90.92

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	600519	贵州茅台	36,800	26,917,728.00	5.02
2	601318	中国平安	415,800	24,357,564.00	4.54
3	600030	中信证券	1,195,500	19,809,435.00	3.70
4	000858	五粮液	255,100	19,387,600.00	3.62
5	600016	民生银行	2,720,700	19,044,900.00	3.55
6	600309	万华化学	409,400	18,594,948.00	3.47
7	601601	中国太保	430,744	13,719,196.40	2.56
8	601169	北京银行	1,746,500	10,531,395.00	1.97
9	002304	洋河股份	77,300	10,172,680.00	1.90
10	600518	康美药业	440,400	10,076,352.00	1.88
11	600028	中国石化	1,493,831	9,694,963.19	1.81
12	601211	国泰君安	630,800	9,297,992.00	1.73
13	600585	海螺水泥	276,600	9,260,568.00	1.73

14	601818	光大银行	2,322,500	8,500,350.00	1.59
15	601006	大秦铁路	871,200	7,152,552.00	1.33
16	002024	苏宁易购	478,100	6,731,648.00	1.26
17	000568	泸州老窖	100,200	6,098,172.00	1.14
18	600031	三一重工	646,800	5,801,796.00	1.08
19	600919	江苏银行	904,200	5,795,922.00	1.08
20	002466	天齐锂业	111,270	5,517,879.30	1.03
21	601186	中国铁建	602,100	5,190,102.00	0.97
22	001979	招商蛇口	270,200	5,147,310.00	0.96
23	603799	华友钴业	49,200	4,795,524.00	0.89
24	600352	浙江龙盛	364,900	4,360,555.00	0.81
25	601933	永辉超市	541,400	4,136,296.00	0.77
26	002460	赣锋锂业	105,100	4,054,758.00	0.76
27	600485	信威集团	380,000	4,043,200.00	0.75
28	000166	申万宏源	917,800	4,010,786.00	0.75
29	600029	南方航空	456,400	3,856,580.00	0.72
30	601607	上海医药	150,600	3,599,340.00	0.67
31	000069	华侨城 A	459,300	3,320,739.00	0.62
32	600115	东方航空	483,500	3,200,770.00	0.60
33	000783	长江证券	573,600	3,114,648.00	0.58
34	600705	中航资本	655,100	3,059,317.00	0.57
35	601727	上海电气	480,800	3,048,272.00	0.57
36	600606	绿地控股	456,000	2,982,240.00	0.56
37	600893	航发动力	128,126	2,859,772.32	0.53
38	600332	白云山	74,500	2,834,725.00	0.53
39	601998	中信银行	453,800	2,818,098.00	0.53
40	603589	口子窖	44,900	2,759,105.00	0.51
41	601788	光大证券	250,200	2,747,196.00	0.51
42	000157	中联重科	651,700	2,678,487.00	0.50
43	000425	徐工机械	613,600	2,601,664.00	0.49
44	600023	浙能电力	548,800	2,557,408.00	0.48
45	600739	辽宁成大	163,900	2,488,002.00	0.46
46	601800	中国交建	217,500	2,477,325.00	0.46
47	000825	太钢不锈	405,000	2,430,000.00	0.45
48	600256	广汇能源	574,500	2,349,705.00	0.44
49	600926	杭州银行	211,400	2,344,426.00	0.44
50	601919	中远海控	470,900	2,316,828.00	0.43
51	601997	贵阳银行	184,700	2,282,892.00	0.43
52	002001	新和成	119,420	2,264,203.20	0.42
53	000786	北新建材	118,500	2,195,805.00	0.41
54	600208	新潮中宝	564,300	2,155,626.00	0.40
55	603858	步长制药	50,200	2,148,058.00	0.40

56	600153	建发股份	234,700	2,109,953.00	0.39
57	000860	顺鑫农业	54,600	2,047,500.00	0.38
58	601618	中国中冶	607,900	2,024,307.00	0.38
59	601333	广深铁路	462,400	1,965,200.00	0.37
60	600879	航天电子	253,300	1,780,699.00	0.33
61	600170	上海建工	575,300	1,748,912.00	0.33
62	002078	太阳纸业	179,500	1,739,355.00	0.32
63	600346	恒力股份	110,000	1,612,600.00	0.30
64	002589	瑞康医药	116,700	1,591,788.00	0.30
65	600643	爱建集团	155,700	1,463,580.00	0.27
66	600998	九州通	82,900	1,405,984.00	0.26
67	002013	中航机电	184,150	1,394,015.50	0.26
68	000671	阳光城	227,800	1,359,966.00	0.25
69	600376	首开股份	191,200	1,344,136.00	0.25
70	000040	东旭蓝天	130,500	1,318,050.00	0.25
71	000009	中国宝安	266,800	1,307,320.00	0.24
72	600525	长园集团	123,200	1,302,224.00	0.24
73	300324	旋极信息	136,229	1,292,813.21	0.24
74	000528	柳工	111,900	1,198,449.00	0.22
75	601866	中远海发	462,300	1,151,127.00	0.21
76	601898	中煤能源	236,611	1,142,831.13	0.21
77	600270	外运发展	54,100	1,133,936.00	0.21
78	600216	浙江医药	88,400	1,128,868.00	0.21
79	600511	国药股份	41,000	1,104,950.00	0.21
80	600061	国投资本	119,000	1,104,320.00	0.21
81	000883	湖北能源	267,400	1,099,014.00	0.21
82	000898	鞍钢股份	195,900	1,091,163.00	0.20
83	000008	神州高铁	245,500	1,082,655.00	0.20
84	600827	百联股份	105,800	1,079,160.00	0.20
85	601021	春秋航空	30,600	1,071,918.00	0.20
86	002366	台海核电	74,800	1,066,648.00	0.20
87	002727	一心堂	32,800	1,064,360.00	0.20
88	600649	城投控股	171,400	1,048,968.00	0.20
89	600701	*ST 工新	132,900	1,002,066.00	0.19
90	000591	太阳能	271,600	994,056.00	0.19
91	000723	美锦能源	182,400	990,432.00	0.18
92	600500	中化国际	142,300	970,486.00	0.18
93	002426	胜利精密	269,400	969,840.00	0.18
94	601966	玲珑轮胎	60,300	950,931.00	0.18
95	600801	华新水泥	62,800	943,884.00	0.18
96	000028	国药一致	18,800	938,120.00	0.18
97	601991	大唐发电	308,500	934,755.00	0.17

98	300199	翰宇药业	64,800	925,344.00	0.17
99	600881	亚泰集团	244,700	912,731.00	0.17
100	600064	南京高科	123,360	905,462.40	0.17
101	600094	大名城	153,300	883,008.00	0.16
102	002511	中顺洁柔	92,510	871,444.20	0.16
103	600372	中航电子	66,500	868,490.00	0.16
104	601128	常熟银行	151,500	866,580.00	0.16
105	601636	旗滨集团	194,200	864,190.00	0.16
106	002025	航天电器	35,400	817,740.00	0.15
107	603678	火炬电子	32,800	817,376.00	0.15
108	603833	欧派家居	6,400	816,192.00	0.15
109	002082	万邦德	57,600	804,672.00	0.15
110	600529	山东药玻	31,600	768,828.00	0.14
111	600026	中远海能	180,700	766,168.00	0.14
112	600337	美克家居	129,000	755,940.00	0.14
113	600057	厦门象屿	149,977	748,385.23	0.14
114	600179	安通控股	73,520	744,757.60	0.14
115	002233	塔牌集团	64,200	734,448.00	0.14
116	600557	康缘药业	58,500	722,475.00	0.13
117	000910	大亚圣象	42,300	714,870.00	0.13
118	603368	柳药股份	20,300	685,734.00	0.13
119	600789	鲁抗医药	67,100	675,697.00	0.13
120	601567	三星医疗	91,600	666,848.00	0.12
121	600233	圆通速递	50,500	666,600.00	0.12
122	600114	东睦股份	66,200	646,774.00	0.12
123	002468	申通快递	37,100	636,265.00	0.12
124	002121	科陆电子	97,100	630,179.00	0.12
125	603456	九洲药业	65,500	628,800.00	0.12
126	300038	梅泰诺	57,620	614,229.20	0.11
127	600351	亚宝药业	83,100	603,306.00	0.11
128	000553	沙隆达 A	37,400	591,294.00	0.11
129	600059	古越龙山	72,500	590,875.00	0.11
130	601908	京运通	129,000	590,820.00	0.11
131	000789	万年青	53,900	589,666.00	0.11
132	603008	喜临门	29,700	587,466.00	0.11
133	600864	哈投股份	130,400	586,800.00	0.11
134	600546	山煤国际	129,100	575,786.00	0.11
135	002608	江苏国信	80,400	554,760.00	0.10
136	600691	阳煤化工	180,800	553,248.00	0.10
137	300349	金卡智能	28,100	540,644.00	0.10
138	600668	尖峰集团	44,100	538,020.00	0.10
139	600420	现代制药	51,400	534,560.00	0.10

140	600316	洪都航空	56,900	530,308.00	0.10
141	002094	青岛金王	58,790	529,697.90	0.10
142	000539	粤电力A	124,700	528,728.00	0.10
143	000546	金圆股份	39,500	528,115.00	0.10
144	603708	家家悦	24,000	527,760.00	0.10
145	300339	润和软件	48,500	526,710.00	0.10
146	002649	博彦科技	57,200	521,664.00	0.10
147	002375	亚厦股份	96,100	513,174.00	0.10
148	001696	宗申动力	104,300	511,070.00	0.10
149	300075	数字政通	37,000	499,130.00	0.09
150	601886	江河集团	60,100	494,623.00	0.09
151	002472	双环传动	57,478	492,586.46	0.09
152	600586	金晶科技	149,300	488,211.00	0.09
153	002832	比音勒芬	13,150	486,550.00	0.09
154	603111	康尼机电	73,400	485,174.00	0.09
155	600845	宝信软件	18,300	482,205.00	0.09
156	000669	金鸿控股	66,500	482,125.00	0.09
157	000652	泰达股份	151,100	471,432.00	0.09
158	600805	悦达投资	92,300	470,730.00	0.09
159	002482	广田集团	77,700	463,869.00	0.09
160	600479	千金药业	43,320	454,426.80	0.08
161	600428	中远海特	126,200	448,010.00	0.08
162	600439	瑞贝卡	117,200	447,704.00	0.08
163	603167	渤海轮渡	46,400	446,832.00	0.08
164	600090	同济堂	78,100	444,389.00	0.08
165	600382	广东明珠	40,400	426,220.00	0.08
166	600681	百川能源	32,800	425,088.00	0.08
167	600826	兰生股份	31,300	424,741.00	0.08
168	600387	海越能源	45,800	420,444.00	0.08
169	000802	北京文化	40,100	418,644.00	0.08
170	300388	国祯环保	21,700	418,159.00	0.08
171	002484	江海股份	63,800	417,252.00	0.08
172	300395	菲利华	30,600	416,160.00	0.08
173	600713	南京医药	83,800	409,782.00	0.08
174	600530	交大昂立	73,900	408,667.00	0.08
175	600896	*ST海投	77,100	394,752.00	0.07
176	000096	广聚能源	35,900	389,156.00	0.07
177	002521	齐峰新材	58,700	382,724.00	0.07
178	002374	丽鹏股份	78,500	382,295.00	0.07
179	002228	合兴包装	79,500	379,215.00	0.07
180	600697	欧亚集团	17,800	378,962.00	0.07
181	300138	晨光生物	53,200	375,060.00	0.07

182	300032	金龙机电	63,900	358,479.00	0.07
183	600293	三峡新材	62,700	356,136.00	0.07
184	002412	汉森制药	22,400	350,560.00	0.07
185	002270	华明装备	60,150	349,471.50	0.07
186	601126	四方股份	68,300	347,647.00	0.06
187	300384	三联虹普	8,600	346,322.00	0.06
188	002275	桂林三金	23,700	346,020.00	0.06
189	002661	克明面业	26,700	344,430.00	0.06
190	002392	北京利尔	101,100	343,740.00	0.06
191	600894	广日股份	57,200	339,196.00	0.06
192	600548	深高速	42,800	335,980.00	0.06
193	000407	胜利股份	80,500	332,465.00	0.06
194	601515	东风股份	43,000	331,960.00	0.06
195	600831	广电网络	55,100	331,702.00	0.06
196	600136	当代明诚	26,783	324,074.30	0.06
197	002370	亚太药业	23,700	321,846.00	0.06
198	600488	天药股份	77,600	318,936.00	0.06
199	002766	索菱股份	26,500	314,820.00	0.06
200	600781	辅仁药业	19,800	310,860.00	0.06
201	002775	文科园林	23,200	305,776.00	0.06
202	300351	永贵电器	24,200	303,226.00	0.06
203	002541	鸿路钢构	39,000	302,640.00	0.06
204	600070	浙江富润	39,100	302,634.00	0.06
205	601007	金陵饭店	27,400	302,222.00	0.06
206	600483	福能股份	43,200	296,784.00	0.06
207	600723	首商股份	42,400	296,376.00	0.06
208	000662	天夏智慧	45,892	295,085.56	0.06
209	300064	豫金刚石	54,900	294,813.00	0.06
210	002406	远东传动	53,000	290,970.00	0.05
211	000850	华茂股份	77,300	290,648.00	0.05
212	600892	大晟文化	25,900	286,195.00	0.05
213	300350	华鹏飞	35,100	285,363.00	0.05
214	300233	金城医药	20,300	283,591.00	0.05
215	600035	楚天高速	91,800	282,744.00	0.05
216	002565	顺灏股份	56,200	280,438.00	0.05
217	603012	创力集团	41,600	279,552.00	0.05
218	600780	通宝能源	74,100	276,393.00	0.05
219	603839	安正时尚	15,260	276,358.60	0.05
220	603117	万林股份	39,000	276,120.00	0.05
221	000665	湖北广电	31,300	272,936.00	0.05
222	601500	通用股份	26,800	270,680.00	0.05
223	002124	天邦股份	62,050	268,056.00	0.05

224	002828	贝肯能源	14,850	267,300.00	0.05
225	300209	天泽信息	17,300	266,766.00	0.05
226	603869	新智认知	16,100	265,489.00	0.05
227	603567	珍宝岛	19,800	265,320.00	0.05
228	002435	长江润发	30,010	264,388.10	0.05
229	603030	全筑股份	37,000	254,930.00	0.05
230	002441	众业达	33,400	253,840.00	0.05
231	601579	会稽山	25,400	248,666.00	0.05
232	002696	百洋股份	20,230	248,626.70	0.05
233	002612	朗姿股份	21,700	246,512.00	0.05
234	300448	浩云科技	21,504	246,220.80	0.05
235	600858	银座股份	37,800	244,944.00	0.05
236	300195	长荣股份	21,700	242,823.00	0.05
237	002682	龙洲股份	29,300	241,139.00	0.04
238	601368	绿城水务	35,700	240,975.00	0.04
239	603100	川仪股份	28,400	239,980.00	0.04
240	000719	中原传媒	35,820	239,635.80	0.04
241	300528	幸福蓝海	21,300	239,625.00	0.04
242	002062	宏润建设	66,900	238,164.00	0.04
243	600592	龙溪股份	38,000	233,700.00	0.04
244	000551	创元科技	40,200	232,758.00	0.04
245	600475	华光股份	21,500	229,835.00	0.04
246	603919	金徽酒	13,900	229,767.00	0.04
247	002713	东易日盛	11,000	226,050.00	0.04
248	603889	新澳股份	21,700	225,897.00	0.04
249	002850	科达利	8,000	225,280.00	0.04
250	600101	明星电力	31,500	224,595.00	0.04
251	002743	富煌钢构	31,200	220,896.00	0.04
252	603017	中衡设计	23,300	219,020.00	0.04
253	002380	科远股份	16,800	218,400.00	0.04
254	002788	鹭燕医药	12,900	216,075.00	0.04
255	600012	皖通高速	36,200	215,752.00	0.04
256	600051	宁波联合	33,700	210,288.00	0.04
257	002620	瑞和股份	28,700	208,362.00	0.04
258	601188	龙江交通	63,000	206,640.00	0.04
259	603987	康德莱	19,600	202,664.00	0.04
260	002187	广百股份	24,500	201,880.00	0.04
261	600629	华建集团	16,800	200,424.00	0.04
262	000716	黑芝麻	55,200	199,824.00	0.04
263	002671	龙泉股份	44,800	199,808.00	0.04
264	300505	川金诺	5,800	197,780.00	0.04
265	000421	南京公用	40,000	194,400.00	0.04

266	600356	恒丰纸业	31,100	193,442.00	0.04
267	600513	联环药业	27,500	192,775.00	0.04
268	300057	万顺股份	31,100	190,954.00	0.04
269	300071	华谊嘉信	47,700	188,415.00	0.04
270	002781	奇信股份	11,900	188,020.00	0.04
271	002776	柏堡龙	11,400	186,276.00	0.03
272	002238	天威视讯	27,600	185,748.00	0.03
273	600248	延长化建	41,100	184,539.00	0.03
274	603123	翠微股份	30,000	183,000.00	0.03
275	002403	爱仕达	20,308	182,975.08	0.03
276	000524	岭南控股	20,000	182,800.00	0.03
277	300120	经纬辉开	27,282	182,789.40	0.03
278	600287	江苏舜天	33,400	178,356.00	0.03
279	002740	爱迪尔	22,900	175,185.00	0.03
280	300329	海伦钢琴	21,200	172,568.00	0.03
281	603518	维格娜丝	8,500	167,365.00	0.03
282	000428	华天酒店	59,300	167,226.00	0.03
283	002084	海鸥住工	34,700	165,172.00	0.03
284	603385	惠达卫浴	14,170	158,845.70	0.03
285	600613	神奇制药	25,500	156,315.00	0.03
286	601999	出版传媒	27,400	152,070.00	0.03
287	002791	坚朗五金	12,300	149,937.00	0.03
288	603667	五洲新春	14,980	147,553.00	0.03
289	603689	皖天然气	12,900	142,674.00	0.03
290	300004	南风股份	35,800	140,336.00	0.03
291	002718	友邦吊顶	4,000	138,400.00	0.03
292	603828	柯利达	21,580	137,896.20	0.03
293	603633	徕木股份	8,200	132,758.00	0.02
294	300421	力星股份	9,300	131,130.00	0.02
295	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.02
296	002724	海洋王	22,080	123,427.20	0.02
297	603577	汇金通	10,500	117,600.00	0.02
298	603600	永艺股份	12,100	114,224.00	0.02
299	603615	茶花股份	9,200	112,608.00	0.02
300	603388	元成股份	7,600	106,172.00	0.02
301	603208	江山欧派	3,100	83,359.00	0.02
302	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.02
303	603139	康惠制药	3,800	80,750.00	0.02
304	603038	华立股份	3,580	75,502.20	0.01
305	300592	华凯创意	4,700	61,476.00	0.01
306	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
307	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00

308	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
309	600019	宝钢股份	88	685.52	0.00
310	600015	华夏银行	90	670.50	0.00
311	300119	瑞普生物	72	615.60	0.00
312	000906	浙商中拓	116	596.24	0.00
313	002247	帝龙文化	54	442.80	0.00
314	000038	深大通	20	362.00	0.00
315	000541	佛山照明	60	359.40	0.00
316	600297	广汇汽车	60	351.60	0.00
317	300282	三盛教育	15	247.95	0.00
318	600758	红阳能源	20	86.80	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	600519	贵州茅台	31,665,744.00	3.98
2	601288	农业银行	29,762,054.00	3.75
3	601318	中国平安	29,255,896.10	3.68
4	600030	中信证券	26,014,418.10	3.27
5	000858	五粮液	25,352,505.69	3.19
6	600000	浦发银行	24,442,975.06	3.08
7	600016	民生银行	23,783,177.00	2.99
8	601169	北京银行	16,992,039.63	2.14
9	002304	洋河股份	13,014,630.30	1.64
10	601211	国泰君安	12,316,405.46	1.55
11	600518	康美药业	11,827,950.88	1.49
12	600028	中国石化	11,686,754.10	1.47
13	601818	光大银行	10,524,181.00	1.32
14	600015	华夏银行	10,020,217.07	1.26
15	600919	江苏银行	9,070,771.00	1.14
16	601186	中国铁建	8,302,181.00	1.04
17	002142	宁波银行	7,975,725.44	1.00
18	000568	泸州老窖	7,282,657.74	0.92
19	002024	苏宁易购	7,277,891.43	0.92
20	001979	招商蛇口	6,847,660.69	0.86

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	601328	交通银行	38,172,792.00	4.80
2	601288	农业银行	28,656,497.00	3.61
3	600019	宝钢股份	21,796,030.51	2.74
4	600000	浦发银行	21,655,470.27	2.73
5	601601	中国太保	16,595,379.96	2.09
6	600703	三安光电	15,231,693.35	1.92
7	601390	中国中铁	15,048,706.00	1.89
8	601088	中国神华	13,624,425.27	1.71
9	600999	招商证券	12,371,004.15	1.56
10	601628	中国人寿	12,118,595.56	1.52
11	002008	大族激光	11,837,570.81	1.49
12	600958	东方证券	11,184,892.75	1.41
13	600741	华域汽车	10,371,185.82	1.31
14	600015	华夏银行	9,372,263.02	1.18
15	002475	立讯精密	8,869,189.89	1.12
16	600585	海螺水泥	8,807,674.00	1.11
17	601006	大秦铁路	8,129,680.00	1.02
18	300072	三聚环保	7,941,531.50	1.00
19	002142	宁波银行	7,679,774.97	0.97
20	002241	歌尔股份	7,438,527.12	0.94

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	670,788,930.13
卖出股票收入（成交）总额	807,302,617.94

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/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1807	IF1807	30	31,318,200.00	-2,665,560.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-2,665,560.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,101,294.47
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-2,729,460.00

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

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

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	4,780,717.97

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,044.26
5	应收申购款	307,063.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,100,825.28

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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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级	34,533	13,805.02	228,701.66	0.05	476,500,143.21	99.95
大数据300C级	21,096	3,116.04	-	-	65,735,911.42	100.00
合计	55,629	9,751.47	228,701.66	0.04	542,236,054.63	99.96

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	大数据300A级	21,403.49	0.0045

理人所有从业人员持有本基金	大数据 300C 级	150.00	0.0002
	合计	21,553.49	0.0040

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开放式基金。本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 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	611,590,952.55	80,675,464.01
本报告期基金总申购份额	33,404,367.44	14,539,900.06
减:本报告期基金总赎回份额	168,266,475.12	29,479,452.65
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	476,728,844.87	65,735,911.42

§ 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、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、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	919,287,075.30	62.28%	91,929.15	28.64%	
申万宏源	1	542,688,899.86	36.77%	223,210.75	69.55%	
银河证券	1	14,118,291.29	0.96%	5,805.68	1.81%	
中金公司	1	—	—	—	—	
中信证券	2	—	—	—	—	

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	
	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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	258,889.46	83.06%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
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东海期货有限责任公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月05日
2	南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月26日
3	南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月26日
4	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	2018年01月06日
5	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
6	南方基金关于旗下部分基金增加和	中国证券报、上海证	2018年02月08日

	耕传承为代销机构及开通相关业务的公告	券报、证券时报	
7	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	2018 年 01 月 06 日
8	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金赎回费调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 27 日
10	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	2018 年 03 月 30 日
11	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	2018 年 03 月 31 日
12	南方基金关于旗下部分基金增加大连网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	2018 年 04 月 27 日
13	南方基金关于旗下部分基金增加紫金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	2018 年 05 月 08 日
14	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	2018 年 01 月 06 日
15	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
16	南方基金关于旗下部分基金增加中民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	2018 年 06 月 25 日
17	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	2018 年 03 月 31 日

§ 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

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方大数据 300 指数证券投资基金的文件。
- 2、《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《南方大数据 300 指数证券投资基金托管协议》
- 4、《南方大数据 300 指数证券投资基金 2018 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。

12.2 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。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>