

# 南方大数据 300 指数证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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

报告送出日期：2019 年 8 月 23 日

## § 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 2019 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 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	
基金主代码	001420	
交易代码	001420	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日	
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	502,821,081.08 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	440,827,940.55 份	61,993,140.53 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方大数据 300”。

### 2.2 基金产品说明

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

### 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
	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	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码	518017	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	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金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	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

## § 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

#### 1、大数据 300A 级

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,020,046.96
本期利润	91,746,140.69
加权平均基金份额本期利润	0.1977
本期加权平均净值利润率	20.10%

本期基金份额净值增长率	21.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	4,413,825.09
期末可供分配基金份额利润	0.0100
期末基金资产净值	456,290,794.77
期末基金份额净值	1.0351
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.51%

## 2、大数据 300C 级

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	2,327,231.75
本期利润	12,723,093.81
加权平均基金份额本期利润	0.1950
本期加权平均净值利润率	20.07%
本期基金份额净值增长率	21.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-227,919.33
期末可供分配基金份额利润	-0.0037
期末基金资产净值	63,284,902.11
期末基金份额净值	1.0208
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.08%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

2、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；

3、对期末可供分配利润，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。

## 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

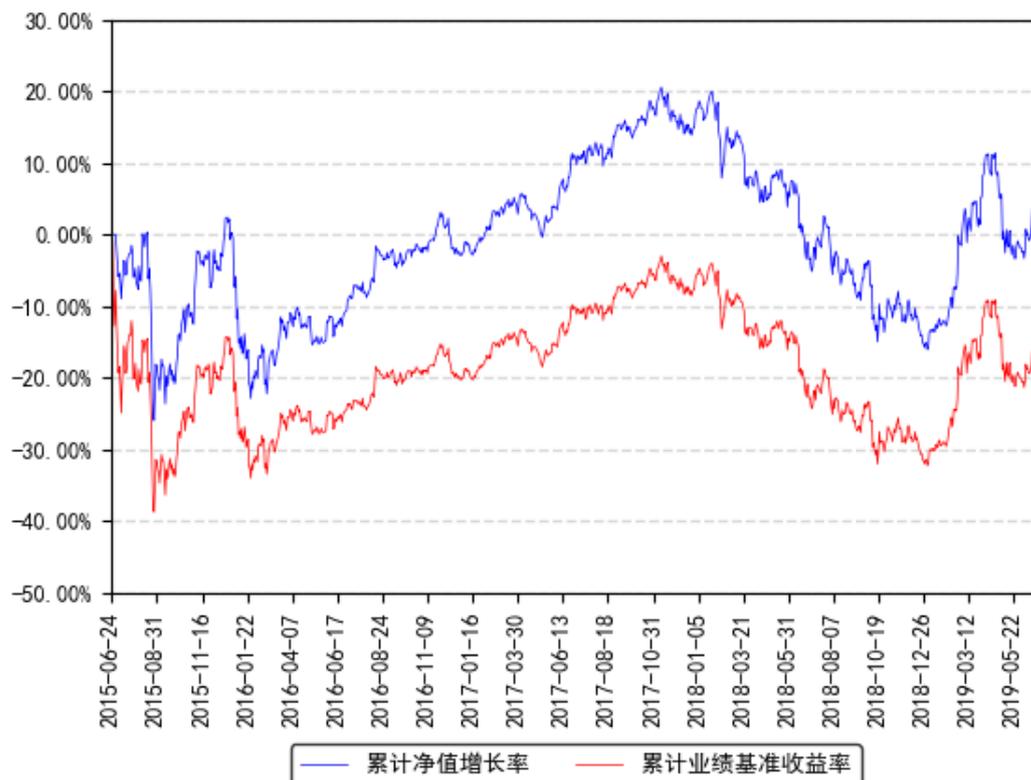
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.47%	1.15%	4.59%	1.12%	0.88%	0.03%
过去三个月	-1.63%	1.51%	-2.74%	1.50%	1.11%	0.01%
过去六个月	21.98%	1.49%	21.93%	1.50%	0.05%	-0.01%
过去一年	4.65%	1.42%	5.66%	1.41%	-1.01%	0.01%
过去三年	15.96%	1.05%	10.82%	1.04%	5.14%	0.01%
自基金合同 生效起至今	3.51%	1.35%	-16.45%	1.48%	19.96%	-0.13%

大数据 300C 级

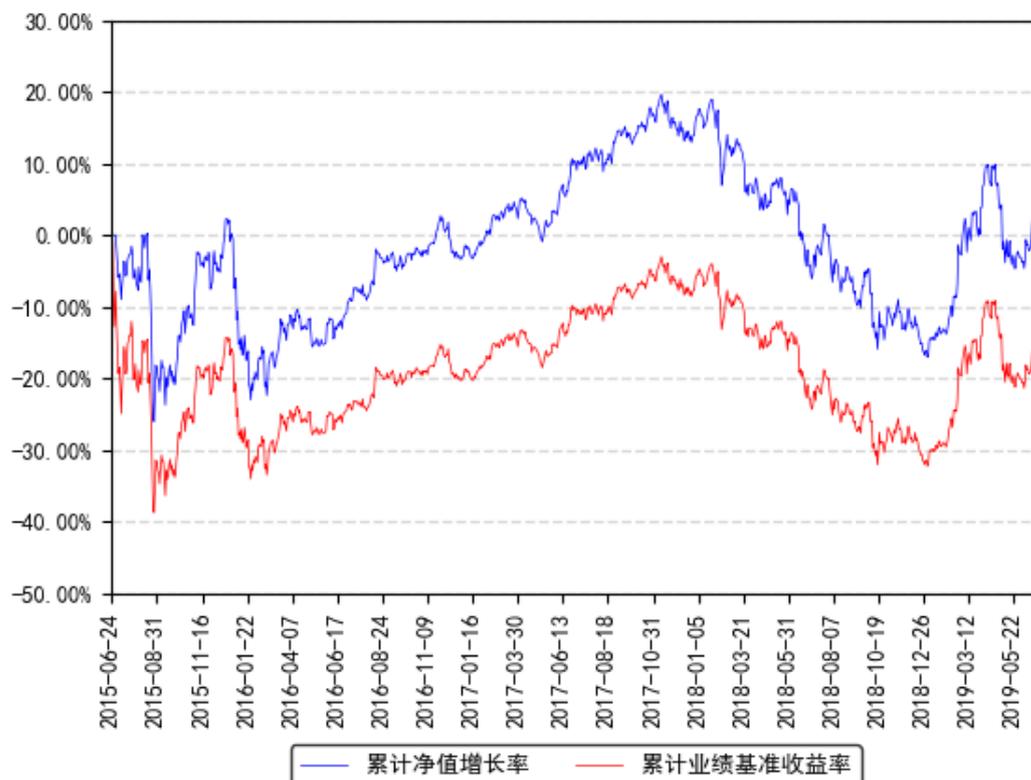
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.42%	1.15%	4.59%	1.12%	0.83%	0.03%
过去三个月	-1.73%	1.51%	-2.74%	1.50%	1.01%	0.01%
过去六个月	21.73%	1.49%	21.93%	1.50%	-0.20%	-0.01%
过去一年	4.23%	1.42%	5.66%	1.41%	-1.43%	0.01%
过去三年	14.67%	1.05%	10.82%	1.04%	3.85%	0.01%
自基金合同 生效起至今	2.08%	1.35%	-16.45%	1.48%	18.53%	-0.13%

### 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。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.20%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司，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）管理资产规模超过 8800 亿元，旗下管理 191 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职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		
崔蕾	本基金基金经理	2019 年 6 月 28 日	-	4 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险经理师（FRM），特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2018 年 11 月至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 年 6 月至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）、大数据 300 基金经理。
李佳亮	本基金基金经理（已离任）	2017 年 11 月 9 日	2019 年 6 月 28 日	6 年	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，任数量化投资部研究员；2015 年 5 月至 2016 年 8 月，任量化投资经理助理；2017 年 4 月至 2018 年 9 月，任南方荣优基金经理；2016 年 8 月至 2019 年 1 月，任南方消费基金经理；2017 年 11 月至

					2019 年 6 月，任大数据 100、大数据 300 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 11 月至今，任南方量化成长基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

## 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、中国证监会和本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超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 5 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成分股调整所致。

## 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

本报告期内 i300 指数上涨 23.11%。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

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.0351 元，报告期内，份额净值增长率为 21.98%，同期业绩基准增长率为 21.93%；本基金 C 份额净值为 1.0208 元，报告期内，份额净值增长率为 21.73%，同期业绩基准增长率为 21.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 A 股国际化的不断推进，外资持续流入国内，A 股市场相继被纳入 MSCI 和富时罗素指数。长远来看，市场风格在向外资偏好的蓝筹风格靠拢的基础上，也有可能追寻高科技真成长个股。预计 2019 年下半年，基本面、成长性较好的个股仍存在机会。大数据 300 注重基本面与市场交易行为的结合，力求在经济下行的情况下挖掘出优质股。在国内经济大力推动经济结构转型以应对经济下行压力的背景下，大数据 300 有望继续紧跟国家产业结构调整方向和经济发展的方向，分享相应的产业成长红利。

#### 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企业会计准则、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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	41,578,407.49	33,232,290.47
结算备付金		7,938,058.18	3,598,391.86
存出保证金		2,608,184.56	569,515.28
交易性金融资产	6.4.3.2	469,252,991.96	433,418,121.25
其中：股票投资		469,232,091.96	433,418,121.25
基金投资		-	-
债券投资		20,900.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	38,340.20
应收利息	6.4.3.5	11,719.32	9,289.21
应收股利		-	-
应收申购款		304,957.14	139,028.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		521,694,318.65	471,004,977.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,519.76	-
应付赎回款		993,203.00	148,569.35
应付管理人报酬		207,728.06	205,332.76

应付托管费		62,318.44	61,599.84
应付销售服务费		20,182.10	19,798.07
应付交易费用	6.4.3.7	114,255.52	80,628.43
应交税费		0.13	0.39
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	714,414.76	1,062,054.92
负债合计		2,118,621.77	1,577,983.76
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	502,821,081.08	553,969,535.10
未分配利润	6.4.3.10	16,754,615.80	-84,542,541.84
所有者权益合计		519,575,696.88	469,426,993.26
负债和所有者权益总计		521,694,318.65	471,004,977.02

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，大数据 300A 级份额净值 1.0351 元，基金份额总额 440,827,940.55 份；大数据 300C 级份额净值 1.0208 元，基金份额总额 61,993,140.53 份；总份额合计 502,821,081.08 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		107,506,078.42	-86,674,101.82
1. 利息收入		187,481.32	298,328.82
其中：存款利息收入	6.4.3.11	187,478.14	298,277.54
债券利息收入		3.18	51.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,111,826.51	-38,876,553.59
其中：股票投资收益	6.4.3.12	17,590,751.95	-42,985,256.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	7,125.57
资产支持证券投资 收益	6.4.3.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-185,580.00	-1,101,294.47
股利收益	6.4.3.17	5,706,654.56	5,202,871.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	84,121,955.79	-48,267,790.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	84,814.80	171,913.31
减：二、费用		3,036,843.92	3,894,433.85
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,286,166.46	1,664,807.23
2. 托管费	6.4.6.2.2	385,849.93	499,442.13
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	125,442.99	154,873.09
4. 交易费用	6.4.3.20	1,047,016.92	1,273,004.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		0.01	8,689.91
7. 其他费用	6.4.3.21	192,367.61	293,616.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		104,469,234.50	-90,568,535.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		104,469,234.50	-90,568,535.67

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	553,969,535.10	-84,542,541.84	469,426,993.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	104,469,234.50	104,469,234.50
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)	-51,148,454.02	-3,172,076.86	-54,320,530.88
其中：1. 基金申购款	44,833,757.77	-273,416.51	44,560,341.26
2. 基金赎回款	-95,982,211.79	-2,898,660.35	-98,880,872.14
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)	502,821,081.08	16,754,615.80	519,575,696.88
项目	上年度可比期间 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

“—”号填列)			
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

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相一致。

### 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 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 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	41,578,407.49
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 个月以上	-
其他存款	-
合计	41,578,407.49

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	434,965,692.13	469,232,091.96	34,266,399.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	20,900.00	20,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	20,900.00	20,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	434,986,592.13	469,252,991.96	34,266,399.83

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 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	23,799,180.00	-	-	-
一股指期货	23,799,180.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,799,180.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资/国债期货投资，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。

### 6.4.3.4 买入返售金融资产

#### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,589.78
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	4,078.74
应收债券利息	3.30
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	47.50
合计	11,719.32

#### 6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	114,255.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	114,255.52

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,274.36
应退退补款	-
预提费用	139,668.25
应付指数使用费	573,472.15
可退退补款	-
其他	-
合计	714,414.76

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大数据 300A 级		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	486,325,406.93	486,325,406.93
本期申购	33,744,976.79	33,744,976.79
本期赎回（以“-”号填列）	-79,242,443.17	-79,242,443.17
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	440,827,940.55	440,827,940.55

金额单位：人民币元

大数据 300C 级		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,644,128.17	67,644,128.17
本期申购	11,088,780.98	11,088,780.98
本期赎回（以“-”号填列）	-16,739,768.62	-16,739,768.62
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	61,993,140.53	61,993,140.53

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.10 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	-15,889,200.14	-57,735,436.94	-73,624,637.08
本期利润	18,020,046.96	73,726,093.73	91,746,140.69
本期基金份额交易产生的变动数	2,282,978.27	-4,941,627.66	-2,658,649.39
其中：基金申购款	-1,423,869.31	1,373,868.82	-50,000.49
基金赎回款	3,706,847.58	-6,315,496.48	-2,608,648.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,413,825.09	11,049,029.13	15,462,854.22

单位：人民币元

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	-2,965,855.68	-7,952,049.08	-10,917,904.76
本期利润	2,327,231.75	10,395,862.06	12,723,093.81
本期基金份额交易产生的变动数	410,704.60	-924,132.07	-513,427.47
其中：基金申购款	-592,579.10	369,163.08	-223,416.02
基金赎回款	1,003,283.70	-1,293,295.15	-290,011.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-227,919.33	1,519,680.91	1,291,761.58

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

活期存款利息收入	136,118.19
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	50,706.58
其他	653.37
合计	187,478.14

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	668,447,844.07
减：卖出股票成本总额	650,857,092.12
买卖股票差价收入	17,590,751.95

#### 6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 6.4.3.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.3.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.3.16 衍生工具收益

##### 6.4.3.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.3.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-185,580.00

#### 6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,706,654.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,706,654.56

#### 6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	82,594,835.79
——股票投资	82,594,835.79
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,527,120.00
——权证投资	-
——期货投资	1,527,120.00
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	84,121,955.79

#### 6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	82,012.93
基金转换费收入	2,801.87
合计	84,814.80

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

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

#### 6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,047,016.92
银行间市场交易费用	-
合计	1,047,016.92

#### 6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,915.47
指数使用费	100,000.00
银行费用	2,699.36
合计	192,367.61

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

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司新增厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）四名股东，股权结构发生变更。基金管理人已于 2019 年 8 月 1 日发布相关公告。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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(“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

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。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	827,393,021.41	65.13%	919,287,075.30	62.28%

###### 6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	82,739.31	31.23%	35,523.43	31.09%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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。

### 6.4.6.2 关联方报酬

#### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,286,166.46	1,664,807.23
其中：支付销售机构的客户维护费	210,215.31	488,744.60

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	385,849.93	499,442.13

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	1,023.30	1,023.30
南方基金	-	13,002.29	13,002.29
兴业证券	-	362.13	362.13
合计	-	14,387.72	14,387.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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	-	1,238.01	1,238.01
兴业证券	-	415.82	415.82
合计	-	18,479.39	18,479.39

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 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。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.6.4.2 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

无。

#### 6.4.6.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
建设银行	41,578,407.49	136,118.19	33,356,336.44	169,449.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2019 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 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
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123028	清水转债	2019年6月19日	2019年7月15日	新债未上市	100.00	100.00	209	20,900.00	20,900.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

##### 6.4.8.2 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
600485	*ST	2016年	重大	6.28	2019	13.86	441,341	6,325,165.27	2,771,621.48	-

信威	12 月 26 日	事项 停牌		年 7 月 12 日					
----	--------------	----------	--	---------------------	--	--	--	--	--

本基金截至 2019 年 06 月 30 日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。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、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 0.004%(2018 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、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 0.000%)。

### 6.4.9.3 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。

于 2019 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.3.1 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时间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。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%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.01%。

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。于 2019 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### **6.4.9.4 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。

##### **6.4.9.4.1 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。

#### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	41,578,407.49	-	-	-	41,578,407.49
结算备付金	7,938,058.18	-	-	-	7,938,058.18
存出保证金	105,596.56	-	-	2,502,588.00	2,608,184.56
交易性金融资产	-	-	20,900.00	469,232,091.96	469,252,991.96
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	11,719.32	11,719.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	12,953.00	-	-	292,004.14	304,957.14
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	49,635,015.23	-	20,900.00	472,038,403.42	521,694,318.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	993,203.00	993,203.00
应付管理人报酬	-	-	-	207,728.06	207,728.06
应付托管费	-	-	-	62,318.44	62,318.44
应付证券清算款	-	-	-	6,519.76	6,519.76
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	20,182.10	20,182.10
应付交易费用	-	-	-	114,255.52	114,255.52
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.13	0.13

其他负债	-	-	-	714,414.76	714,414.76
负债总计	-	-	-	2,118,621.77	2,118,621.77
利率敏感度缺口	49,635,015.23	-	20,900.00	469,919,781.65	519,575,696.88
上年度末 2018 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	33,232,290.47	-	-	-	33,232,290.47
结算备付金	3,598,391.86	-	-	-	3,598,391.86
存出保证金	28,867.28	-	-	540,648.00	569,515.28
交易性金融资产	-	-	-	433,418,121.25	433,418,121.25
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,289.21	9,289.21
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	20,523.98	-	-	118,504.77	139,028.75
应收证券清算款	-	-	-	38,340.20	38,340.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	36,880,073.59	-	-	434,124,903.43	471,004,977.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	148,569.35	148,569.35
应付管理人报酬	-	-	-	205,332.76	205,332.76
应付托管费	-	-	-	61,599.84	61,599.84
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	19,798.07	19,798.07
应付交易费用	-	-	-	80,628.43	80,628.43
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.39	0.39
其他负债	-	-	-	1,062,054.92	1,062,054.92
负债总计	-	-	-	1,577,983.76	1,577,983.76
利率敏感度	36,880,073.5	-	-	432,546,919.	469,426,993.

缺口	9		67	26
----	---	--	----	----

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。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 06 月 30 日，本基金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 0.004% (2018 年 12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.9.4.2 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。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末无外汇风险的敏感性分析。

#### 6.4.9.4.3 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。

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	469,232,091.96	90.31	433,418,121.25	92.33
交易性金融资产-	-	-	-	-

基金投资				
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	469,232,091.96	90.31	433,418,121.25	92.33

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	25,599,494.59	23,823,419.91
	2.组合自身基准下降 5%	-25,599,494.59	-23,823,419.91

## § 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	469,232,091.96	89.94
	其中：股票	469,232,091.96	89.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,900.00	0.00
	其中：债券	20,900.00	0.00
	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	49,516,465.67	9.49
8	其他资产	2,924,861.02	0.56
9	合计	521,694,318.65	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	15,154,895.40	2.92
B	采矿业	15,290,217.72	2.94
C	制造业	138,910,890.62	26.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,782,557.40	1.50
E	建筑业	24,953,574.60	4.80
F	批发和零售业	10,423,907.95	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	14,211,672.00	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,080,316.65	1.56
J	金融业	198,975,654.78	38.30
K	房地产业	23,609,356.09	4.54
L	租赁和商务服务业	7,736,247.25	1.49
M	科学研究和技术服务业	62,733.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	690,256.90	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,247,021.60	0.43
S	综合	1,102,790.00	0.21
	合计	469,232,091.96	90.31

### 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投资股票。

### 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	288,100	25,528,541.00	4.91
2	600036	招商银行	681,200	24,509,576.00	4.72
3	601166	兴业银行	1,225,580	22,415,858.20	4.31
4	600030	中信证券	687,600	16,371,756.00	3.15
5	601328	交通银行	2,120,600	12,978,072.00	2.50
6	601288	农业银行	3,117,400	11,222,640.00	2.16
7	300498	温氏股份	303,300	10,876,338.00	2.09
8	600016	民生银行	1,712,140	10,872,089.00	2.09
9	600837	海通证券	712,000	10,103,280.00	1.94
10	600000	浦发银行	838,600	9,794,848.00	1.89
11	601601	中国太保	242,144	8,840,677.44	1.70
12	600585	海螺水泥	182,200	7,561,300.00	1.46
13	600048	保利地产	564,800	7,206,848.00	1.39
14	601211	国泰君安	380,400	6,980,340.00	1.34

15	601668	中国建筑	1,213,500	6,977,625.00	1.34
16	601888	中国国旅	76,700	6,799,455.00	1.31
17	600009	上海机场	79,300	6,643,754.00	1.28
18	000063	中兴通讯	190,400	6,193,712.00	1.19
19	601766	中国中车	739,400	5,981,746.00	1.15
20	600031	三一重工	428,500	5,604,780.00	1.08
21	002304	洋河股份	44,900	5,458,044.00	1.05
22	002475	立讯精密	191,080	4,736,873.20	0.91
23	000338	潍柴动力	370,500	4,553,445.00	0.88
24	600019	宝钢股份	687,900	4,471,350.00	0.86
25	601390	中国中铁	635,700	4,144,764.00	0.80
26	601006	大秦铁路	501,100	4,053,899.00	0.78
27	601186	中国铁建	401,300	3,992,935.00	0.77
28	000661	长春高新	11,600	3,920,800.00	0.75
29	600570	恒生电子	56,080	3,821,852.00	0.74
30	600919	江苏银行	523,500	3,800,610.00	0.73
31	601628	中国人寿	131,900	3,735,408.00	0.72
32	601899	紫金矿业	985,800	3,716,466.00	0.72
33	601088	中国神华	172,500	3,515,550.00	0.68
34	600999	招商证券	205,000	3,503,450.00	0.67
35	600352	浙江龙盛	221,500	3,493,055.00	0.67
36	002594	比亚迪	67,100	3,403,312.00	0.66
37	601336	新华保险	61,800	3,400,854.00	0.65
38	600958	东方证券	310,200	3,312,936.00	0.64
39	000776	广发证券	240,200	3,300,348.00	0.64
40	601225	陕西煤业	324,300	2,996,532.00	0.58
41	000100	TCL 集团	864,100	2,877,453.00	0.55
42	000876	新希望	164,400	2,855,628.00	0.55
43	002714	牧原股份	47,500	2,792,525.00	0.54
44	600485	*ST 信威	441,341	2,771,621.48	0.53
45	601669	中国电建	520,400	2,752,916.00	0.53
46	000166	申万宏源	528,100	2,645,781.00	0.51
47	002202	金风科技	208,600	2,592,898.00	0.50
48	000783	长江证券	329,000	2,569,490.00	0.49
49	600741	华域汽车	115,700	2,499,120.00	0.48
50	600436	片仔癀	21,500	2,476,800.00	0.48
51	600438	通威股份	162,300	2,281,938.00	0.44
52	601111	中国国航	235,500	2,253,735.00	0.43
53	000157	中联重科	374,801	2,252,554.01	0.43
54	000069	华侨城 A	312,000	2,168,400.00	0.42
55	601800	中国交建	181,000	2,048,920.00	0.39
56	603589	口子窖	31,400	2,022,788.00	0.39
57	600383	金地集团	166,600	1,987,538.00	0.38

58	600271	航天信息	85,900	1,979,995.00	0.38
59	601555	东吴证券	191,500	1,962,875.00	0.38
60	000895	双汇发展	77,600	1,931,464.00	0.37
61	600109	国金证券	193,100	1,876,932.00	0.36
62	300003	乐普医疗	81,200	1,869,224.00	0.36
63	601099	太平洋	522,400	1,859,744.00	0.36
64	600606	绿地控股	262,200	1,790,826.00	0.34
65	601788	光大证券	152,000	1,735,840.00	0.33
66	601877	正泰电器	73,200	1,690,188.00	0.33
67	300136	信维通信	66,900	1,635,705.00	0.31
68	600061	国投资本	113,100	1,584,531.00	0.30
69	300122	智飞生物	36,600	1,577,460.00	0.30
70	000425	徐工机械	353,000	1,574,380.00	0.30
71	601607	上海医药	85,200	1,546,380.00	0.30
72	600739	辽宁成大	102,000	1,483,080.00	0.29
73	600068	葛洲坝	233,600	1,455,328.00	0.28
74	603369	今世缘	51,100	1,425,179.00	0.27
75	002129	中环股份	143,100	1,396,656.00	0.27
76	600023	浙能电力	315,600	1,394,952.00	0.27
77	601198	东兴证券	114,700	1,362,636.00	0.26
78	601233	桐昆股份	87,600	1,358,676.00	0.26
79	002195	二三四五	343,450	1,336,020.50	0.26
80	002146	荣盛发展	141,000	1,323,990.00	0.25
81	000703	恒逸石化	96,100	1,312,726.00	0.25
82	002456	欧菲光	161,200	1,263,808.00	0.24
83	300014	亿纬锂能	41,300	1,257,998.00	0.24
84	600170	上海建工	330,900	1,244,184.00	0.24
85	600642	申能股份	201,000	1,208,010.00	0.23
86	600153	建发股份	135,000	1,198,800.00	0.23
87	300146	汤臣倍健	61,500	1,193,100.00	0.23
88	600256	广汇能源	330,400	1,176,224.00	0.23
89	000596	古井贡酒	9,900	1,173,249.00	0.23
90	002384	东山精密	79,500	1,158,315.00	0.22
91	000623	吉林敖东	69,700	1,142,383.00	0.22
92	600699	均胜电子	52,600	1,123,536.00	0.22
93	000686	东北证券	118,200	1,041,342.00	0.20
94	600325	华发股份	132,000	1,030,920.00	0.20
95	300296	利亚德	127,700	999,891.00	0.19
96	600673	东阳光	126,200	990,670.00	0.19
97	000627	天茂集团	150,200	974,798.00	0.19
98	600027	华电国际	247,300	932,321.00	0.18
99	600755	厦门国贸	107,400	926,862.00	0.18
100	000999	华润三九	31,300	918,342.00	0.18

101	600567	山鹰纸业	268,900	906,193.00	0.17
102	600728	佳都科技	91,400	900,290.00	0.17
103	000671	阳光城	131,900	854,712.00	0.16
104	600260	凯乐科技	42,100	841,158.00	0.16
105	000581	威孚高科	43,014	798,339.84	0.15
106	600873	梅花生物	165,100	790,829.00	0.15
107	600704	物产中大	145,300	787,526.00	0.15
108	600266	北京城建	97,580	786,494.80	0.15
109	300088	长信科技	154,100	779,746.00	0.15
110	002221	东华能源	90,000	774,900.00	0.15
111	002110	三钢闽光	82,100	763,530.00	0.15
112	600064	南京高科	70,989	760,292.19	0.15
113	600282	南钢股份	213,100	745,850.00	0.14
114	000046	泛海控股	132,500	739,350.00	0.14
115	600171	上海贝岭	43,600	708,500.00	0.14
116	601872	招商轮船	162,200	707,192.00	0.14
117	601100	恒立液压	22,500	706,050.00	0.14
118	000932	华菱钢铁	147,340	702,811.80	0.14
119	600675	中华企业	130,160	675,530.40	0.13
120	600039	四川路桥	185,500	675,220.00	0.13
121	000732	泰禾集团	40,900	674,850.00	0.13
122	600188	兖州煤业	61,000	663,070.00	0.13
123	002601	龙蟠佰利	44,700	662,901.00	0.13
124	600466	蓝光发展	105,900	658,698.00	0.13
125	002174	游族网络	38,800	654,944.00	0.13
126	002299	圣农发展	25,500	645,660.00	0.12
127	600782	新钢股份	124,700	623,500.00	0.12
128	600167	联美控股	58,580	619,776.40	0.12
129	600373	中文传媒	48,300	606,648.00	0.12
130	300182	捷成股份	136,700	602,847.00	0.12
131	600729	重庆百货	19,600	592,704.00	0.11
132	600970	中材国际	91,500	588,345.00	0.11
133	002399	海普瑞	28,000	587,720.00	0.11
134	000027	深圳能源	94,200	584,040.00	0.11
135	000877	天山股份	50,000	581,000.00	0.11
136	000902	新洋丰	52,400	562,252.00	0.11
137	002449	国星光电	42,300	561,744.00	0.11
138	002099	海翔药业	78,900	560,190.00	0.11
139	000415	渤海租赁	142,900	560,168.00	0.11
140	000528	柳工	83,700	557,442.00	0.11
141	603444	吉比特	2,600	545,896.00	0.11
142	600120	浙江东方	42,820	545,526.80	0.10
143	000031	大悦城	84,100	539,922.00	0.10

144	600578	京能电力	163,200	528,768.00	0.10
145	002812	恩捷股份	11,200	523,600.00	0.10
146	600348	阳泉煤业	88,100	511,861.00	0.10
147	000021	深 科 技	62,400	507,312.00	0.10
148	300630	普利制药	8,800	507,056.00	0.10
149	601928	凤凰传媒	60,900	491,463.00	0.09
150	002701	奥 瑞 金	104,600	488,482.00	0.09
151	601717	郑 煤 机	84,700	483,637.00	0.09
152	000059	华锦股份	73,400	469,760.00	0.09
153	601588	北辰实业	120,900	453,375.00	0.09
154	300118	东方日升	44,300	450,974.00	0.09
155	000036	华联控股	86,710	443,088.10	0.09
156	000685	中山公用	51,100	436,394.00	0.08
157	002128	露天煤业	50,400	435,960.00	0.08
158	000926	福星股份	62,700	433,884.00	0.08
159	600269	赣粤高速	97,400	432,456.00	0.08
160	002234	民和股份	15,300	428,247.00	0.08
161	601058	赛轮轮胎	143,300	425,601.00	0.08
162	600740	山西焦化	50,100	425,349.00	0.08
163	603588	高能环境	39,800	424,666.00	0.08
164	600390	五矿资本	44,500	419,635.00	0.08
165	600123	兰花科创	55,200	404,064.00	0.08
166	000789	万 年 青	40,320	404,006.40	0.08
167	601666	平煤股份	95,000	397,100.00	0.08
168	600580	卧龙电驱	46,700	392,747.00	0.08
169	601222	林洋能源	83,700	392,553.00	0.08
170	600546	山煤国际	72,100	387,898.00	0.07
171	601677	明泰铝业	37,500	386,625.00	0.07
172	002608	江苏国信	45,100	384,703.00	0.07
173	600057	厦门象屿	84,577	376,367.65	0.07
174	600694	大商股份	13,400	373,994.00	0.07
175	300572	安车检测	7,840	363,776.00	0.07
176	000600	建投能源	54,200	363,140.00	0.07
177	300232	洲明科技	35,262	341,336.16	0.07
178	002048	宁波华翔	31,500	340,830.00	0.07
179	600491	龙元建设	49,200	339,480.00	0.07
180	000951	中国重汽	20,900	335,445.00	0.06
181	600968	海油发展	93,437	331,701.35	0.06
182	000501	鄂武商 A	30,600	328,950.00	0.06
183	300725	药石科技	5,200	324,116.00	0.06
184	600496	精工钢构	100,400	318,268.00	0.06
185	600757	长江传媒	46,500	316,665.00	0.06
186	300349	金卡智能	17,800	316,484.00	0.06

187	000034	神州数码	24,400	314,760.00	0.06
188	000603	盛达矿业	27,500	307,450.00	0.06
189	603118	共进股份	33,200	307,432.00	0.06
190	002080	中材科技	33,400	302,604.00	0.06
191	601567	三星医疗	52,100	302,180.00	0.06
192	002083	孚日股份	52,900	298,885.00	0.06
193	002832	比音勒芬	6,200	295,554.00	0.06
194	600308	华泰股份	66,100	294,806.00	0.06
195	601002	晋亿实业	40,900	288,754.00	0.06
196	000966	长源电力	50,500	286,335.00	0.06
197	300205	天喻信息	19,100	285,736.00	0.05
198	002746	仙坛股份	18,250	282,327.50	0.05
199	000910	大亚圣象	25,200	280,728.00	0.05
200	300502	新易盛	11,400	279,528.00	0.05
201	600971	恒源煤电	47,520	277,992.00	0.05
202	000155	川能动力	64,100	272,425.00	0.05
203	000811	冰轮环境	30,000	264,900.00	0.05
204	300190	维尔利	34,200	264,366.00	0.05
205	002462	嘉事堂	17,200	258,000.00	0.05
206	603393	新天然气	10,820	253,188.00	0.05
207	603638	艾迪精密	11,100	249,750.00	0.05
208	000676	智度股份	27,600	248,952.00	0.05
209	600681	百川能源	33,400	248,496.00	0.05
210	002478	常宝股份	39,300	237,765.00	0.05
211	600053	九鼎投资	10,100	235,330.00	0.05
212	300438	鹏辉能源	14,300	231,374.00	0.04
213	000906	浙商中拓	35,600	229,264.00	0.04
214	000863	三湘印象	42,000	220,920.00	0.04
215	600866	星湖科技	37,200	219,108.00	0.04
216	300571	平治信息	5,200	216,060.00	0.04
217	000925	众合科技	30,400	215,840.00	0.04
218	000589	贵州轮胎	51,000	213,690.00	0.04
219	002655	共达电声	26,900	213,586.00	0.04
220	600070	浙江富润	26,300	213,556.00	0.04
221	601137	博威合金	21,700	213,311.00	0.04
222	600483	福能股份	24,800	212,288.00	0.04
223	300132	青松股份	19,500	212,160.00	0.04
224	002088	鲁阳节能	17,000	208,250.00	0.04
225	601900	南方传媒	21,700	206,150.00	0.04
226	600461	洪城水业	32,700	206,010.00	0.04
227	002087	新野纺织	52,100	202,148.00	0.04
228	002406	远东传动	32,700	196,200.00	0.04
229	000498	山东路桥	36,100	191,691.00	0.04

230	300219	鸿利智汇	25,900	191,142.00	0.04
231	603979	金诚信	22,600	190,292.00	0.04
232	000919	金陵药业	24,200	189,002.00	0.04
233	603505	金石资源	9,900	185,427.00	0.04
234	600985	淮北矿业	15,900	180,306.00	0.03
235	600533	栖霞建设	49,400	178,828.00	0.03
236	002734	利民股份	11,800	176,528.00	0.03
237	002541	鸿路钢构	22,100	174,811.00	0.03
238	300735	光弘科技	10,170	173,703.60	0.03
239	002616	长青集团	23,600	171,100.00	0.03
240	603808	歌力思	11,000	167,970.00	0.03
241	600976	健民集团	10,000	164,900.00	0.03
242	300607	拓斯达	4,600	162,748.00	0.03
243	300531	优博讯	9,200	161,552.00	0.03
244	300420	五洋停车	29,200	160,308.00	0.03
245	002454	松芝股份	30,800	159,852.00	0.03
246	300638	广和通	2,800	153,832.00	0.03
247	002441	众业达	19,300	153,242.00	0.03
248	603100	川仪股份	16,500	151,635.00	0.03
249	002208	合肥城建	18,840	150,531.60	0.03
250	603538	美诺华	7,000	150,010.00	0.03
251	000573	粤宏远 A	43,700	146,395.00	0.03
252	603218	日月股份	7,470	144,918.00	0.03
253	603010	万盛股份	13,060	144,835.40	0.03
254	600173	卧龙地产	33,100	141,668.00	0.03
255	300702	天宇股份	3,900	140,556.00	0.03
256	603181	皇马科技	9,460	140,481.00	0.03
257	300443	金雷股份	9,700	140,456.00	0.03
258	600731	湖南海利	19,500	139,425.00	0.03
259	603313	梦百合	7,990	138,147.10	0.03
260	603030	全筑股份	22,100	138,125.00	0.03
261	002637	赞宇科技	19,700	138,097.00	0.03
262	300590	移为通信	3,900	133,380.00	0.03
263	300511	雪榕生物	16,100	129,605.00	0.02
264	600665	天地源	32,800	128,904.00	0.02
265	600287	江苏舜天	19,200	126,720.00	0.02
266	603639	海利尔	4,800	124,944.00	0.02
267	000899	赣能股份	23,600	124,136.00	0.02
268	000666	经纬纺机	9,900	123,255.00	0.02
269	300657	弘信电子	5,400	123,120.00	0.02
270	002803	吉宏股份	6,000	122,460.00	0.02
271	002605	姚记扑克	11,600	121,800.00	0.02
272	300569	天能重工	10,400	121,264.00	0.02

273	002810	山东赫达	8,600	121,260.00	0.02
274	000885	城发环境	10,800	120,636.00	0.02
275	600781	辅仁药业	10,900	120,227.00	0.02
276	603586	金麒麟	7,500	120,000.00	0.02
277	600865	百大集团	19,600	119,560.00	0.02
278	002053	云南能投	14,800	116,920.00	0.02
279	300393	中来股份	10,986	116,561.46	0.02
280	603890	春秋电子	10,200	114,444.00	0.02
281	600724	宁波富达	29,300	113,391.00	0.02
282	600455	博通股份	4,000	112,120.00	0.02
283	600647	同达创业	7,300	110,376.00	0.02
284	300437	清水源	9,200	109,112.00	0.02
285	603129	春风动力	4,900	102,067.00	0.02
286	603878	武进不锈	9,140	98,255.00	0.02
287	603086	先达股份	3,400	97,274.00	0.02
288	603936	博敏电子	6,900	93,702.00	0.02
289	002882	金龙羽	7,400	89,318.00	0.02
290	603388	元成股份	10,260	85,773.60	0.02
291	603037	凯众股份	4,500	85,635.00	0.02
292	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
293	603985	恒润股份	5,080	79,400.40	0.02
294	300092	科新机电	10,400	78,728.00	0.02
295	300543	朗科智能	3,700	78,255.00	0.02
296	300690	双一科技	3,300	73,920.00	0.01
297	300586	美联新材	5,400	73,548.00	0.01
298	300575	中旗股份	2,500	71,400.00	0.01
299	603033	三维股份	3,920	67,698.40	0.01
300	300710	万隆光电	2,200	63,470.00	0.01
301	300668	杰恩设计	3,300	62,733.00	0.01
302	603396	金辰股份	2,660	58,493.40	0.01
303	603089	正裕工业	3,960	57,538.80	0.01
304	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
305	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
306	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
307	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
308	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
309	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
310	603866	桃李面包	60	2,499.00	0.00
311	600529	山东药玻	56	1,275.68	0.00
312	601200	上海环境	90	1,224.90	0.00
313	603811	诚意药业	60	1,200.00	0.00
314	603225	新凤鸣	80	999.20	0.00
315	002831	裕同科技	40	766.80	0.00

316	603839	安正时尚	60	738.00	0.00
317	600015	华夏银行	90	693.00	0.00
318	603385	惠达卫浴	70	633.50	0.00
319	600893	航发动力	26	590.46	0.00
320	002050	三花智控	50	527.50	0.00
321	300120	经纬辉开	82	519.88	0.00
322	600926	杭州银行	60	499.80	0.00
323	002724	海洋王	80	467.20	0.00
324	000062	深圳华强	35	465.15	0.00
325	002807	江阴银行	80	374.40	0.00
326	002818	富森美	20	256.60	0.00
327	002696	百洋股份	30	192.90	0.00
328	600028	中国石化	31	169.57	0.00
329	300324	旋极信息	29	167.91	0.00
330	000008	神州高铁	40	150.80	0.00
331	000719	中原传媒	20	142.00	0.00
332	600881	亚泰集团	43	139.75	0.00
333	002511	中顺洁柔	10	122.80	0.00
334	002403	爱仕达	8	68.32	0.00
335	601898	中煤能源	11	52.80	0.00
336	300448	浩云科技	7	46.48	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	601166	兴业银行	23,160,394.30	4.93
2	601318	中国平安	22,797,384.68	4.86
3	600036	招商银行	22,708,550.98	4.84
4	601288	农业银行	16,084,065.00	3.43
5	600030	中信证券	14,024,839.70	2.99
6	601328	交通银行	12,920,234.00	2.75
7	300498	温氏股份	11,010,309.04	2.35
8	600016	民生银行	10,666,156.80	2.27
9	000001	平安银行	10,382,473.18	2.21
10	600000	浦发银行	9,629,180.62	2.05
11	601988	中国银行	9,217,456.00	1.96
12	600837	海通证券	8,994,987.00	1.92
13	600048	保利地产	7,314,579.54	1.56
14	601211	国泰君安	6,561,243.00	1.40
15	002304	洋河股份	6,404,963.00	1.36

16	601766	中国中车	6,089,211.52	1.30
17	601888	中国国旅	6,031,734.86	1.28
18	000063	中兴通讯	5,819,345.10	1.24
19	603288	海天味业	5,782,045.04	1.23
20	600009	上海机场	5,706,267.04	1.22

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	23,787,529.96	5.07
2	600016	民生银行	21,720,400.00	4.63
3	601211	国泰君安	16,095,119.92	3.43
4	601169	北京银行	14,818,811.68	3.16
5	601818	光大银行	13,440,042.00	2.86
6	601229	上海银行	13,026,946.59	2.78
7	600028	中国石化	11,989,044.00	2.55
8	000001	平安银行	11,555,147.80	2.46
9	601601	中国太保	11,535,336.39	2.46
10	601857	中国石油	10,963,558.00	2.34
11	601668	中国建筑	10,693,978.00	2.28
12	601988	中国银行	9,376,334.00	2.00
13	600015	华夏银行	8,758,175.00	1.87
14	600585	海螺水泥	7,570,077.86	1.61
15	603288	海天味业	6,876,197.05	1.46
16	600031	三一重工	6,274,888.88	1.34
17	002142	宁波银行	5,856,957.40	1.25
18	601009	南京银行	5,438,750.00	1.16
19	601318	中国平安	5,228,484.00	1.11
20	601669	中国电建	5,160,330.00	1.10

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	604,076,227.04
卖出股票收入（成交）总额	668,447,844.07

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	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）	20,900.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,900.00	0.00

## 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（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123028	清水转债	209	20,900.00	0.00

## 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

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

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

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

金额单位：人民币元

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
----	----	----------	---------	-----------	------

IF1909	IF1909	22	25,025,880.0 0	1,226,700.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,226,700.00
股指期货投资本期收益（元）					-185,580.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,527,120.00

### 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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除交通银行（证券代码 601328）、民生银行（证券代码 600016）、农业银行（证券代码 601288）、浦发银行（证券代码 600000）、招商银行（证券代码 600036）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 1、交通银行（证券代码 601328）

2018 年 11 月 9 日，交通银行公告，交通银行存在涉嫌违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会根据相关法律法规对公司进行处罚决定。2018 年 10 月 18 日，交通银行公告，交通银行存在涉嫌违法违规行为，中国保险监督管理委员会上海监管局根据相关法律法规对公司进行处罚决定。

#### 2、民生银行（证券代码 600016）

2018 年 11 月 9 日，民生银行公告，民生银行存在涉嫌违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会根据相关法律法规对公司进行处罚决定。

### 3、农业银行（证券代码 601288）

2018 年 7 月 25 日, 农业银行公告, 农业银行存在涉嫌违法违规行为, 中国银行业监督管理委员会宁波银监局根据相关法律法规对公司进行处罚决定。

### 4、浦发银行（证券代码 600000）

2018 年 12 月 28 日浦发银行公告, 浦发银行存在涉嫌违法违规行为, 中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局根据相关法律法规对公司处罚决定。2018 年 9 月 30 日浦发银行公告, 浦发银行存在涉嫌违法违规行为, 中国银行业监督管理委员会盐城监管分局根据《中华人民共和国银行业监督管理法》对公司公开处罚, 罚款人民币 25 万元。2018 年 8 月 31 日浦发银行公告, 浦发银行存在涉嫌违法违规行为, 中国银行业监督管理委员会温州监管分局根据相关法律法规对公司处罚决定。

### 5、招商银行（证券代码 600036）

2018 年 7 月 5 日, 招商银行公告, 招商银行存在涉嫌违法违规行为, 中国保险监督管理委员会深圳监管局根据相关法律法规对公司进行处罚决定。

对上述证券的投资决策程序的说明: 本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

## 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是, 还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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, 本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

## 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 (元)
1	存出保证金	2,608,184.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,719.32
5	应收申购款	304,957.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,924,861.02

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资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	37,284	11,823.52	199,928.37	0.05%	440,628,012.18	99.95%
大数据 300C 级	25,715	2,410.78	-	-	61,993,140.53	100.00%
合计	62,999	7,981.41	199,928.37	0.04%	502,621,152.71	99.96%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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）。

### 8.2 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	12,988.41	0.0029%
	大数据 300C 级	150.00	0.0002%
	合计	13,138.41	0.0026%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 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	486,325,406.93	67,644,128.17
本报告期基金总申购份额	33,744,976.79	11,088,780.98
减: 报告期基金总赎回份额	79,242,443.17	16,739,768.62
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以 "-" 填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	440,827,940.55	61,993,140.53

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 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，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，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	827,393,021.41	65.13%	82,739.31	31.23%	-
申万宏源	1	443,029,517.42	34.87%	182,222.11	68.77%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 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	南方基金关于旗下部分基金增加阳光人寿为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报	2019-01-03
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	上海证券报	2019-02-01
3	南方基金关于旗下部分基金增加腾安基金为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报	2019-02-20
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	上海证券报	2019-04-01
5	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	上海证券报	2019-04-02
6	南方基金关于旗下部分基金增加汇林保大为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报	2019-06-06
7	南方基金管理股份有限公司关于浙江金观诚基金销售有限公司暂停部分业务的公告	上海证券报	2019-06-25
8	南方基金管理股份有限公司关于深圳富济基金销售有限公司暂停部分业务的公告	上海证券报	2019-06-25
9	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	上海证券报	2019-06-25
10	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金定投申购费率优惠标准的公告	上海证券报	2019-06-27
11	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司暂停部分业务的公告	上海证券报	2019-06-28
12	南方基金管理股份有限公司关于北京加和基金销售有限公司暂停部分业务的公告	上海证券报	2019-06-28

## § 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方大数据 300 指数证券投资基金 2019 年半年度报告》原文。

## 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

## 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>