

南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
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.....	11
§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.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息	44

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§11 备查文件目录.....	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	51
11.3 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	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1, 485, 571, 336. 90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	大数据 300A	大数据 300C
下属分级基金的交易代码:	001420	001426
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 341, 221, 889. 49 份	144, 349, 447. 41 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
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楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		吴万善	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	大数据 300A	大数据 300C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-85,725,610.91	-9,741,066.04
本期利润	-144,187,915.64	-15,685,209.22
加权平均基金份额本期利润	-0.1039	-0.1033
本期加权平均净值利润率	-12.13%	-12.09%
本期基金份额净值增长率	-10.17%	-10.32%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-158,702,585.02	-17,412,848.31
期末可供分配基金份额利润	-0.1183	-0.1206
期末基金资产净值	1,197,203,662.10	128,495,554.74
期末基金份额净值	0.8926	0.8902
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-10.74%	-10.98%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大数据 300A

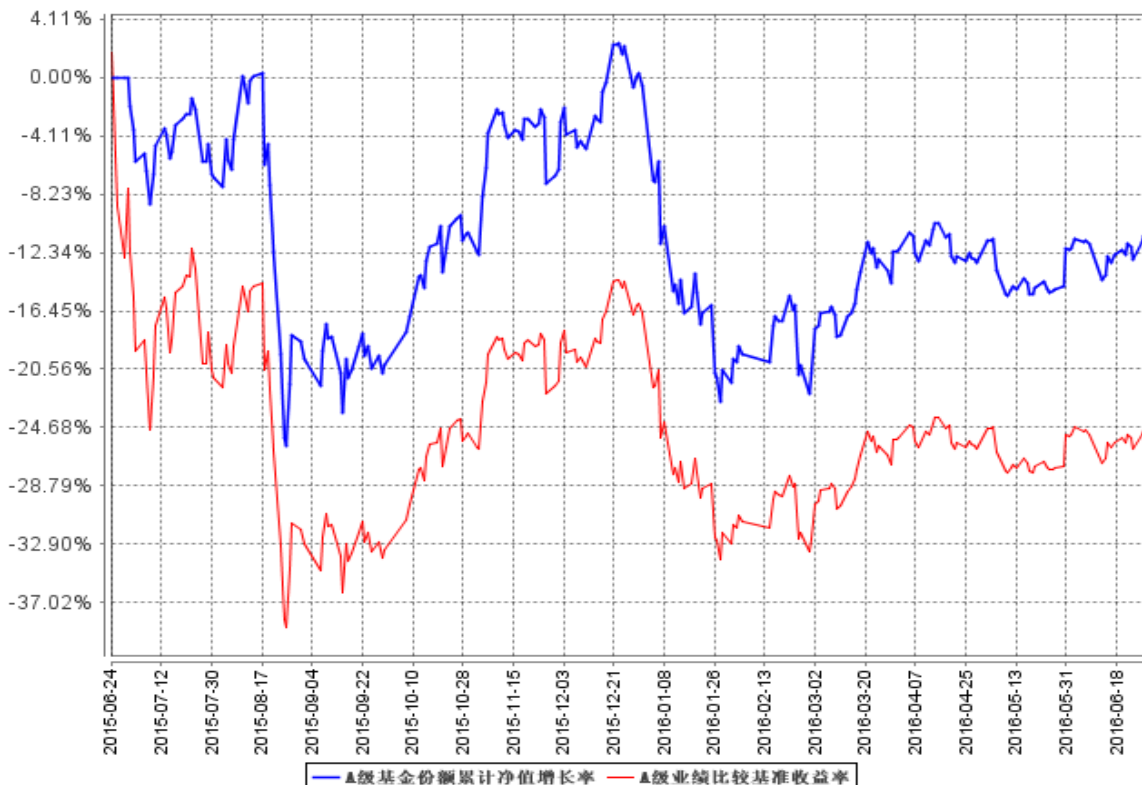
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.51%	0.93%	0.79%	0.91%	0.72%	0.02%
过去三个月	1.76%	0.98%	1.24%	0.94%	0.52%	0.04%
过去六个月	-10.17%	1.75%	-9.56%	1.66%	-0.61%	0.09%
过去一年	-10.74%	2.02%	-18.19%	2.25%	7.45%	-0.23%
自基金合同生效起至今	-10.74%	2.00%	-24.61%	2.33%	13.87%	-0.33%

大数据 300C

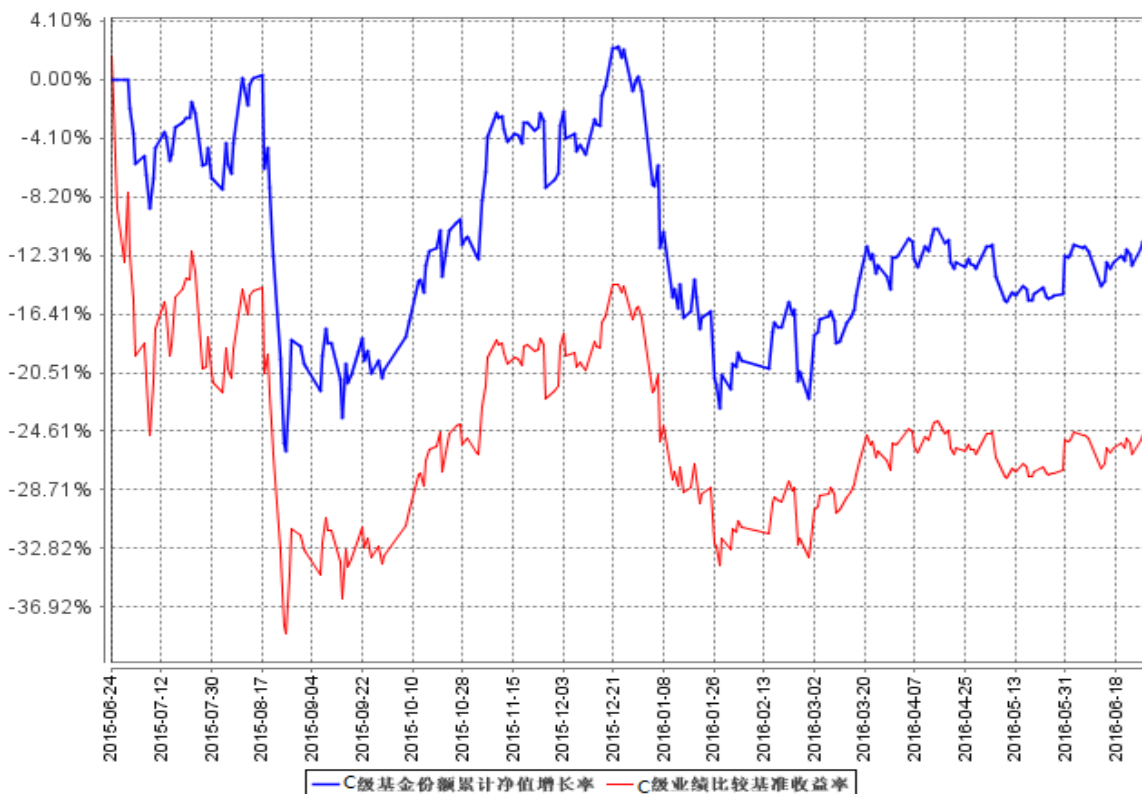
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.49%	0.93%	0.79%	0.91%	0.70%	0.02%
过去三个月	1.67%	0.98%	1.24%	0.94%	0.43%	0.04%
过去六个月	-10.32%	1.75%	-9.56%	1.66%	-0.76%	0.09%
过去一年	-10.98%	2.02%	-18.19%	2.25%	7.21%	-0.23%
自基金合同生效起至今	-10.98%	2.00%	-24.61%	2.33%	13.63%	-0.33%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本 3 亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 5,600 亿元，旗下管理 96 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
雷俊	本基金基金经理	2015 年 6 月 24 日	-	8 年	北京大学智能科学系硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员，现任数量化投资部总监助理；2014 年 12 月至 2016 年 4 月，任南方恒生 ETF 基金经理；2015 年 4 月至 2016 年 4 月，任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 6 月至 2016 年 7 月，任改革基金、高铁基金、南方 500 信息基金经理；2015 年 4 月至今，任大数据 100 基金经理；2015 年 6 月至今，任南方策略优化、大数据 300、南方量化成长的基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方大数据 300 指数基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、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 1 次，是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A 股上半年在开年大幅下跌一个月后，市场开始止跌反弹，之后市场在一个窄区间内反复震荡，市场资金存量博弈明显。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 级份额净值为 0.8926 元；C 级份额净值为 0.8902 元。

报告期内，本基金 A 级份额净值增长率为-10.17%，同期业绩基准增长率为-9.56%；C 级份额净值增长率为-10.32%，同期业绩基准增长率为-9.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，未来 A 股市场结构性牛市的动力仍在，上涨逻辑是利率不断下行和资产配置荒。一是整个经济中利率水平仍在下降，上半年万亿级的理财领域收益率降低非常明显；二是宽松货币政策逻辑未改变，在房地产高企、国内投资工具有限的情况下，部分高风险收益偏好的投资者会在大类资产配置上逐渐倾向于权益类资产。展望下半年，A 股将有不错的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方大数据 300 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	15,893,347.13	30,396,479.19
结算备付金		74,292,832.75	139,000,495.12
存出保证金		24,085,053.38	29,786,641.02
交易性金融资产	6.4.4.2	1,136,309,874.97	1,360,498,012.84
其中：股票投资		1,136,309,874.97	1,360,498,012.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3		-
买入返售金融资产	6.4.4.4	80,000,000.00	-
应收证券清算款		1,755,769.80	-
应收利息	6.4.4.5	71,262.54	61,029.35
应收股利		-	-
应收申购款		279,483.00	1,834,241.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		1,332,687,623.57	1,561,576,899.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,984,025.61	4,908,647.96
应付管理人报酬		541,148.27	705,325.46
应付托管费		162,344.47	211,597.67
应付销售服务费		41,835.38	56,088.13
应付交易费用	6.4.4.7	633,651.64	441,479.09
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	625,401.36	442,590.73
负债合计		6,988,406.73	6,765,729.04
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	1,485,571,336.90	1,564,781,947.88
未分配利润	6.4.4.10	-159,872,120.06	-9,970,777.84
所有者权益合计		1,325,699,216.84	1,554,811,170.04
负债和所有者权益总计		1,332,687,623.57	1,561,576,899.08

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，南方大数据 300 指数证券投资基金之 A 类份额（以下简称“A 类份额”）的份额净值 0.8926 元，南方大数据 300 指数证券投资基金之 C 类份额（以下简称“C 类份额”）的份额净值 0.8902 元；基金份额总额 1,485,571,336.90 份，其中 A 类份额 1,341,221,889.49 份，C 类份额 144,349,447.41 份。

6.2 利润表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 24 日(基金 合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-153,606,416.06	296,100.00
1.利息收入		1,256,141.82	296,100.00
其中：存款利息收入	6.4.4.11	1,210,627.38	296,100.00
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		45,514.44	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-90,648,168.97	-
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-81,711,931.54	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-18,659,020.00	-
股利收益	6.4.4.16	9,722,782.57	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-64,406,447.91	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	192,059.00	-
减：二、费用		6,266,708.80	254,816.67
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	3,279,653.62	173,839.02
2. 托管费	6.4.7.2.2	983,896.08	52,151.70
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	258,229.76	15,817.50
4. 交易费用	6.4.4.19	1,402,607.28	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.20	342,322.06	13,008.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-159,873,124.86	41,283.33
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-159,873,124.86	41,283.33
-------------------	--	-----------------	-----------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,564,781,947.88	-9,970,777.84	1,554,811,170.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-159,873,124.86	-159,873,124.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-79,210,610.98	9,971,782.64	-69,238,828.34
其中：1.基金申购款	74,937,428.34	-11,246,382.88	63,691,045.46
2.基金赎回款	-154,148,039.32	21,218,165.52	-132,929,873.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,485,571,336.90	-159,872,120.06	1,325,699,216.84
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 24 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,115,000,092.74	-	2,115,000,092.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,283.33	41,283.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）		-	
其中：1.基金申购款		-	
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,115,000,092.74	41,283.33	2,115,041,376.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.4 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	15,893,347.13
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	15,893,347.13

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

7 项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,141,882,353.66	1,136,309,874.97	-5,572,478.69
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	1,141,882,353.66	1,136,309,874.97	-5,572,478.69

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016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	21,086,840.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	21,086,840.00	-	-	

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	80,000,000.00	-
合计	80,000,000.00	-

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无余额。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	9,750.37
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	61,433.87
应收债券利息	-
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	78.30
合计	71,262.54

6.4.4.6 其他资产

注：无余额。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	633,651.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	633,651.64

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,199.53
预提费用	298,905.98
指数使用费	314,295.85
合计	625,401.36

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

大数据 300A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,411,621,918.89	1,411,621,918.89
本期申购	57,717,961.93	57,717,961.93
本期赎回(以“-”号填列)	-128,117,991.33	-128,117,991.33
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,341,221,889.49	1,341,221,889.49

金额单位：人民币元

大数据 300C	
项目	本期

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	153,160,028.99	153,160,028.99
本期申购	17,219,466.41	17,219,466.41
本期赎回(以“-”号填列)	-26,030,047.99	-26,030,047.99
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	144,349,447.41	144,349,447.41

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

大数据 300A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-80,898,935.70	72,054,940.02	-8,843,995.68
本期利润	-85,725,610.91	-58,462,304.73	-144,187,915.64
本期基金份额交易产生的变动数	7,921,961.59	1,091,722.34	9,013,683.93
其中：基金申购款	-5,323,263.91	-3,298,822.26	-8,622,086.17
基金赎回款	13,245,225.50	4,390,544.60	17,635,770.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-158,702,585.02	14,684,357.63	-144,018,227.39

单位：人民币元

大数据 300C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,927,647.39	7,800,865.23	-1,126,782.16
本期利润	-9,741,066.04	-5,944,143.18	-15,685,209.22
本期基金份额交易产生的变动数	1,255,865.12	-297,766.41	958,098.71
其中：基金申购款	-1,576,104.93	-1,048,191.78	-2,624,296.71
基金赎回款	2,831,970.05	750,425.37	3,582,395.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,412,848.31	1,558,955.64	-15,853,892.67

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	152,922.33
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	1,055,951.21
其他	1,753.84
合计	1,210,627.38

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	999,048,477.44
减：卖出股票成本总额	1,080,760,408.98
买卖股票差价收入	-81,711,931.54

6.4.4.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.4.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.4.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	-18,659,020.00

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,722,782.57
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,722,782.57

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-68,524,907.91
——股票投资	-68,524,907.91
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	4,118,460.00
合计	-64,406,447.91

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	192,059.00
合计	192,059.00

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

6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,402,607.28
银行间市场交易费用	-
合计	1,402,607.28

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
其他	400.00
银行费用	11,829.95
指数使用费	131,186.13
合计	342,322.06

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

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“南方基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注：无。

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

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

6.4.7.2.3 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大数据 300A	大数据 300C	合计
华泰证券	-	1,851.14	1,851.14
兴业证券	-	634.01	634.01
南方基金	-	26,318.01	26,318.01
合计	-	28,803.16	28,803.16

注：支付销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 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：本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	15,893,347.13	152,922.33

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末（2016 年 6 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
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	10,957	142,221.86	142,221.86	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.9.2 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	复牌日期	复牌开盘	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	------	-----------	--------	--------	----

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

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据

标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能按照本基金的基金管理人的持有意图，以合理价格适时变现。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.10.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.10.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	15,893,347.13	-	-	-	15,893,347.13
结算备付金	74,292,832.75	-	-	-	74,292,832.75
存出保证金	174,141.38	-	-	23,910,912.00	24,085,053.38
交易性金融资产	-	-	-	1,136,309,874.97	1,136,309,874.97
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	80,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,755,769.80	1,755,769.80
应收利息	-	-	-	71,262.54	71,262.54
应收申购款	-	-	-	279,483.00	279,483.00
资产总计	170,360,321.26	-	-	1,162,327,302.31	1,332,687,623.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,984,025.61	4,984,025.61
应付管理人报酬	-	-	-	541,148.27	541,148.27
应付托管费	-	-	-	162,344.47	162,344.47
应付销售服务费	-	-	-	41,835.38	41,835.38
应付交易费用	-	-	-	633,651.64	633,651.64
其他负债	-	-	-	625,401.36	625,401.36
负债总计	-	-	-	6,988,406.73	6,988,406.73
利率敏感度缺口	170,360,321.26	-	-	1,155,338,895.58	1,325,699,216.84
上年度末 2015 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	30,396,479.19	-	-	-	30,396,479.19
结算备付金	139,000,495.12	-	-	-	139,000,495.12
存出保证金	698,065.02	-	-	29,088,576.00	29,786,641.02
交易性金融资产	-	-	-	1,360,498,012.84	1,360,498,012.84
应收利息	-	-	-	61,029.35	61,029.35
应收申购款	285,185.14	-	-	1,549,056.42	1,834,241.56
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	170,380,224.47	-	-	1,391,196,674.61	1,561,576,899.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,908,647.96	4,908,647.96
应付管理人报酬	-	-	-	705,325.46	705,325.46
应付托管费	-	-	-	211,597.67	211,597.67
应付销售服务费	-	-	-	56,088.13	56,088.13
应付交易费用	-	-	-	441,479.09	441,479.09
其他负债	-	-	-	442,590.73	442,590.73
负债总计	-	-	-	6,765,729.04	6,765,729.04

利率敏感度缺口	170,380,224.47	-	-1,384,430,945.57	1,554,811,170.04
---------	----------------	---	-------------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.10.4.2 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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	1,136,309,874.97	85.71	1,360,498,012.84	87.50
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	1,136,309,874.97	85.71	1,360,498,012.84	87.50

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：人民币万元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	6,635.00	6,058.00
	业绩比较基准下降 5%	-6,635.00	-6,058.00

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,136,309,874.97	85.26
	其中：股票	1,136,309,874.97	85.26
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	80,000,000.00	6.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	90,186,179.88	6.77
7	其他各项资产	26,191,568.72	1.97
8	合计	1,332,687,623.57	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,670,227.00	0.96
B	采矿业	3,493,155.00	0.26

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

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,733,253	55,533,426.12	4.19
2	601166	兴业银行	3,448,233	52,551,070.92	3.96
3	601328	交通银行	8,497,600	47,841,488.00	3.61
4	000002	万科 A	2,386,879	43,441,197.80	3.28
5	600000	浦发银行	2,591,296	40,346,478.72	3.04
6	601288	农业银行	12,492,477	39,975,926.40	3.02
7	601398	工商银行	7,602,700	33,755,988.00	2.55
8	601169	北京银行	3,236,641	33,563,967.17	2.53
9	601601	中国太保	1,016,957	27,498,517.28	2.07
10	601988	中国银行	7,225,500	23,193,855.00	1.75
11	000001	平安银行	2,518,752	21,913,142.40	1.65

12	601818	光大银行	5,470,700	20,569,832.00	1.55
13	600104	上汽集团	999,200	20,273,768.00	1.53
14	000858	五粮液	587,830	19,122,109.90	1.44
15	000776	广发证券	965,182	16,176,450.32	1.22
16	600015	华夏银行	1,563,312	15,461,155.68	1.17
17	600999	招商证券	843,000	13,909,500.00	1.05
18	002415	海康威视	628,450	13,486,537.00	1.02
19	002304	洋河股份	176,095	12,664,752.40	0.96
20	601009	南京银行	1,203,969	11,305,268.91	0.85
21	601628	中国人寿	528,800	11,009,616.00	0.83
22	000063	中兴通讯	737,767	10,579,578.78	0.80
23	601901	方正证券	1,367,308	10,473,579.28	0.79
24	600637	东方明珠	391,881	9,510,951.87	0.72
25	000423	东阿阿胶	177,100	9,356,193.00	0.71
26	600703	三安光电	438,444	8,755,726.68	0.66
27	601336	新华保险	214,500	8,665,800.00	0.65
28	600100	同方股份	562,500	8,415,000.00	0.63
29	002142	宁波银行	568,120	8,396,813.60	0.63
30	600271	航天信息	349,800	8,325,240.00	0.63
31	000069	华侨城 A	1,097,300	7,022,720.00	0.53
32	600196	复星医药	347,800	6,615,156.00	0.50
33	601669	中国电建	1,101,540	6,289,793.40	0.47
34	601607	上海医药	347,437	6,271,237.85	0.47
35	002008	大族激光	271,500	6,201,060.00	0.47
36	000686	东北证券	474,220	6,122,180.20	0.46
37	300408	三环集团	340,800	6,120,768.00	0.46
38	002236	大华股份	463,000	6,065,300.00	0.46
39	601998	中信银行	1,047,300	5,938,191.00	0.45
40	000623	吉林敖东	236,100	5,890,695.00	0.44
41	000413	东旭光电	683,900	5,874,701.00	0.44
42	002475	立讯精密	278,500	5,472,525.00	0.41
43	600068	XD 葛洲坝	937,500	5,456,250.00	0.41
44	000793	华闻传媒	547,300	5,407,324.00	0.41
45	000963	华东医药	71,700	4,832,580.00	0.36
46	600816	安信信托	268,700	4,532,969.00	0.34
47	600521	华海药业	186,022	4,524,055.04	0.34
48	600060	海信电器	255,000	4,508,400.00	0.34
49	002572	索菲亚	78,400	4,391,968.00	0.33
50	601238	广汽集团	182,400	4,284,576.00	0.32

51	600332	白云山	172,000	4,238,080.00	0.32
52	601333	广深铁路	1,067,300	4,173,143.00	0.31
53	600525	长园集团	301,300	4,173,005.00	0.31
54	002179	中航光电	94,300	4,085,076.00	0.31
55	601098	中南传媒	223,939	4,055,535.29	0.31
56	603019	中科曙光	96,400	3,838,648.00	0.29
57	600487	亨通光电	304,300	3,828,094.00	0.29
58	000046	泛海控股	374,700	3,788,217.00	0.29
59	002299	圣农发展	134,700	3,488,730.00	0.26
60	002131	利欧股份	203,500	3,477,815.00	0.26
61	600884	杉杉股份	195,800	3,369,718.00	0.25
62	002311	海大集团	213,600	3,368,472.00	0.25
63	300296	利亚德	106,100	3,359,126.00	0.25
64	600373	中文传媒	151,850	3,150,887.50	0.24
65	000415	渤海金控	460,900	3,143,338.00	0.24
66	002138	顺络电子	167,600	3,038,588.00	0.23
67	000999	华润三九	125,400	3,037,188.00	0.23
68	002294	信立泰	107,700	2,929,440.00	0.22
69	603288	海天味业	95,100	2,891,040.00	0.22
70	600240	华业资本	288,500	2,890,770.00	0.22
71	600751	天海投资	472,300	2,885,753.00	0.22
72	300115	长盈精密	139,404	2,871,722.40	0.22
73	600366	宁波韵升	119,900	2,862,013.00	0.22
74	000028	国药一致	43,400	2,825,340.00	0.21
75	002219	恒康医疗	251,250	2,776,312.50	0.21
76	002185	华天科技	216,030	2,750,061.90	0.21
77	300266	兴源环境	63,800	2,669,392.00	0.20
78	300207	欣旺达	102,600	2,633,742.00	0.20
79	300182	捷成股份	153,600	2,628,096.00	0.20
80	002477	雏鹰农牧	438,100	2,615,457.00	0.20
81	600298	安琪酵母	145,850	2,601,964.00	0.20
82	601928	凤凰传媒	246,078	2,593,662.12	0.20
83	300203	聚光科技	97,900	2,584,560.00	0.19
84	002714	牧原股份	50,700	2,561,871.00	0.19
85	600666	奥瑞德	71,200	2,474,912.00	0.19
86	300026	红日药业	140,300	2,439,817.00	0.18
87	300310	宜通世纪	63,780	2,435,758.20	0.18
88	600325	华发股份	216,700	2,398,869.00	0.18
89	000733	振华科技	105,800	2,380,500.00	0.18

90	300012	华测检测	189,500	2,346,010.00	0.18
91	600183	生益科技	251,700	2,333,259.00	0.18
92	600422	昆药集团	170,518	2,325,865.52	0.18
93	000488	晨鸣纸业	286,700	2,276,398.00	0.17
94	002462	嘉事堂	60,500	2,253,625.00	0.17
95	600557	康缘药业	136,340	2,226,432.20	0.17
96	002056	横店东磁	128,400	2,182,800.00	0.16
97	002019	亿帆鑫富	141,300	2,173,194.00	0.16
98	600587	新华医疗	93,600	2,161,224.00	0.16
99	002643	万润股份	41,500	2,111,520.00	0.16
100	002589	瑞康医药	68,700	2,109,777.00	0.16
101	300285	国瓷材料	52,700	2,102,203.00	0.16
102	600517	置信电气	220,000	2,092,200.00	0.16
103	600763	通策医疗	66,400	2,070,352.00	0.16
104	002366	台海核电	38,600	2,057,766.00	0.16
105	600998	九州通	116,000	2,031,160.00	0.15
106	600107	美尔雅	101,000	2,021,010.00	0.15
107	300300	汉鼎股份	65,500	2,001,680.00	0.15
108	000513	丽珠集团	43,200	1,991,952.00	0.15
109	600809	山西汾酒	89,700	1,989,546.00	0.15
110	000989	九芝堂	86,944	1,979,714.88	0.15
111	300284	苏交科	100,700	1,962,643.00	0.15
112	300202	聚龙股份	80,400	1,946,484.00	0.15
113	000732	泰禾集团	99,800	1,940,112.00	0.15
114	000937	冀中能源	358,800	1,908,816.00	0.14
115	002010	传化股份	96,300	1,905,777.00	0.14
116	600559	老白干酒	79,000	1,892,840.00	0.14
117	600850	华东电脑	65,900	1,890,671.00	0.14
118	600563	法拉电子	41,300	1,879,976.00	0.14
119	600062	华润双鹤	102,200	1,862,084.00	0.14
120	002376	新北洋	137,700	1,839,672.00	0.14
121	300183	东软载波	68,700	1,820,550.00	0.14
122	002234	民和股份	61,200	1,799,892.00	0.14
123	002329	皇氏集团	120,000	1,798,800.00	0.14
124	601231	环旭电子	167,400	1,791,180.00	0.14
125	000801	四川九洲	145,100	1,787,632.00	0.13
126	300339	润和软件	49,200	1,763,328.00	0.13
127	002309	中利科技	97,800	1,751,598.00	0.13
128	000815	美利纸业	83,900	1,743,442.00	0.13

129	002399	海普瑞	98,100	1,712,826.00	0.13
130	002519	银河电子	75,600	1,694,952.00	0.13
131	002127	南极电商	173,200	1,667,916.00	0.13
132	002020	京新药业	133,100	1,646,447.00	0.12
133	300379	东方通	20,700	1,645,236.00	0.12
134	002433	太安堂	163,000	1,633,260.00	0.12
135	300322	硕贝德	75,700	1,627,550.00	0.12
136	600713	南京医药	193,200	1,626,744.00	0.12
137	002157	正邦科技	69,000	1,618,740.00	0.12
138	002458	益生股份	36,900	1,616,589.00	0.12
139	600236	桂冠电力	240,500	1,616,160.00	0.12
140	000620	新华联	173,800	1,590,270.00	0.12
141	600757	长江传媒	189,200	1,587,388.00	0.12
142	000975	银泰资源	110,100	1,584,339.00	0.12
143	300048	合康变频	134,100	1,577,016.00	0.12
144	002649	博彦科技	39,400	1,559,058.00	0.12
145	600129	太极集团	87,900	1,556,709.00	0.12
146	600566	济川药业	60,137	1,547,926.38	0.12
147	000869	张裕 A	38,300	1,538,894.00	0.12
148	600823	世茂股份	226,000	1,534,540.00	0.12
149	600285	羚锐制药	142,200	1,534,338.00	0.12
150	300219	鸿利光电	97,600	1,520,608.00	0.11
151	002169	智光电气	66,400	1,510,600.00	0.11
152	000910	大亚科技	97,200	1,501,740.00	0.11
153	000971	高升控股	60,200	1,500,184.00	0.11
154	600071	凤凰光学	50,500	1,498,335.00	0.11
155	002449	国星光电	111,700	1,482,259.00	0.11
156	300025	华星创业	103,200	1,479,888.00	0.11
157	002425	凯撒股份	67,000	1,474,000.00	0.11
158	300232	洲明科技	91,350	1,447,897.50	0.11
159	603368	柳州医药	15,500	1,345,710.00	0.10
160	000739	普洛药业	214,300	1,330,803.00	0.10
161	002039	黔源电力	69,100	1,328,793.00	0.10
162	600551	时代出版	66,400	1,325,344.00	0.10
163	000967	盈峰环境	59,700	1,324,743.00	0.10
164	600529	山东药玻	74,500	1,311,945.00	0.10
165	002071	长城影视	96,100	1,310,804.00	0.10
166	002141	蓉胜超微	43,400	1,310,680.00	0.10
167	002596	海南瑞泽	46,000	1,308,700.00	0.10

168	300198	纳川股份	80,800	1,300,072.00	0.10
169	002103	广博股份	63,600	1,285,356.00	0.10
170	000919	金陵药业	97,700	1,278,893.00	0.10
171	002671	龙泉股份	102,400	1,264,640.00	0.10
172	002597	金禾实业	92,600	1,247,322.00	0.09
173	300332	天壕环境	130,600	1,223,722.00	0.09
174	300343	联创股份	54,900	1,191,879.00	0.09
175	002530	丰东股份	41,700	1,180,110.00	0.09
176	300097	智云股份	23,400	1,171,170.00	0.09
177	600197	伊力特	77,500	1,165,600.00	0.09
178	000576	广东甘化	79,700	1,163,620.00	0.09
179	600299	安迪苏	84,100	1,158,898.00	0.09
180	002557	洽洽食品	61,600	1,148,224.00	0.09
181	002147	新光圆成	73,900	1,144,711.00	0.09
182	002196	方正电机	33,100	1,131,689.00	0.09
183	002464	金利科技	18,500	1,130,350.00	0.09
184	000590	启迪古汉	51,000	1,130,160.00	0.09
185	000567	海德股份	35,700	1,129,905.00	0.09
186	603678	火炬电子	14,800	1,128,056.00	0.09
187	603806	福斯特	21,200	1,106,428.00	0.08
188	600191	华资实业	78,600	1,091,754.00	0.08
189	600657	信达地产	218,900	1,090,122.00	0.08
190	300373	扬杰科技	45,100	1,087,361.00	0.08
191	600093	禾嘉股份	85,900	1,066,019.00	0.08
192	300018	中元华电	83,100	1,056,201.00	0.08
193	002124	天邦股份	98,860	1,052,859.00	0.08
194	300061	康耐特	36,200	1,044,008.00	0.08
195	300317	珈伟股份	31,300	1,032,900.00	0.08
196	603328	依顿电子	34,800	1,027,992.00	0.08
197	300255	常山药业	123,600	1,025,880.00	0.08
198	300242	明家联合	29,300	1,025,207.00	0.08
199	002113	天润控股	33,000	1,016,070.00	0.08
200	600054	黄山旅游	62,700	1,008,843.00	0.08
201	600997	开滦股份	189,700	986,440.00	0.07
202	300395	菲利华	36,800	985,504.00	0.07
203	000613	大东海 A	70,900	984,801.00	0.07
204	600203	福日电子	71,100	981,180.00	0.07
205	002459	天业通联	59,400	977,724.00	0.07
206	300063	天龙集团	32,800	976,784.00	0.07

207	002290	禾盛新材	35,000	974,050.00	0.07
208	300148	天舟文化	63,920	972,223.20	0.07
209	300406	九强生物	45,300	971,685.00	0.07
210	000030	富奥股份	134,900	967,233.00	0.07
211	600979	广安爱众	163,600	965,240.00	0.07
212	002524	光正集团	122,690	960,662.70	0.07
213	300138	晨光生物	56,120	937,204.00	0.07
214	002419	天虹商场	78,300	936,468.00	0.07
215	000711	京蓝科技	41,900	930,180.00	0.07
216	002238	天威视讯	64,080	927,237.60	0.07
217	300215	电科院	70,800	911,904.00	0.07
218	300204	舒泰神	49,345	909,921.80	0.07
219	600367	红星发展	65,000	902,850.00	0.07
220	300190	维尔利	51,400	892,818.00	0.07
221	002159	三特索道	34,900	886,111.00	0.07
222	600483	福能股份	78,049	885,856.15	0.07
223	000719	大地传媒	83,020	876,691.20	0.07
224	300119	瑞普生物	54,500	874,725.00	0.07
225	002548	金新农	49,700	872,732.00	0.07
226	002438	江苏神通	39,800	871,222.00	0.07
227	600156	华升股份	85,300	862,383.00	0.07
228	300173	智慧松德	52,400	851,500.00	0.06
229	601113	华鼎股份	86,200	849,932.00	0.06
230	000609	绵世股份	65,900	845,497.00	0.06
231	600163	中闽能源	150,700	845,427.00	0.06
232	002380	科远股份	24,600	844,518.00	0.06
233	300230	永利股份	28,900	840,412.00	0.06
234	000716	黑芝麻	120,600	815,256.00	0.06
235	002370	亚太药业	27,600	814,200.00	0.06
236	603898	好莱客	26,100	811,449.00	0.06
237	000665	湖北广电	54,600	809,172.00	0.06
238	600848	上海临港	52,300	806,466.00	0.06
239	603017	中衡设计	42,400	804,328.00	0.06
240	600781	辅仁药业	46,000	801,780.00	0.06
241	002705	新宝股份	50,410	787,404.20	0.06
242	300194	福安药业	35,300	764,245.00	0.06
243	603899	晨光文具	42,600	754,020.00	0.06
244	300241	瑞丰光电	45,500	751,205.00	0.06
245	000906	物产中拓	63,200	750,184.00	0.06

246	603306	华懋科技	21,750	748,852.50	0.06
247	300350	华鹏飞	20,900	746,130.00	0.06
248	002473	圣莱达	31,900	744,865.00	0.06
249	600981	汇鸿集团	85,900	724,137.00	0.05
250	600658	电子城	70,100	724,133.00	0.05
251	002712	思美传媒	20,100	718,776.00	0.05
252	002543	万和电气	38,800	717,412.00	0.05
253	002349	精华制药	33,061	711,142.11	0.05
254	300403	地尔汉宇	12,600	700,182.00	0.05
255	002243	通产丽星	54,900	699,975.00	0.05
256	601611	中国核建	33,278	696,175.76	0.05
257	600681	百川能源	64,200	695,928.00	0.05
258	300249	依米康	69,700	688,636.00	0.05
259	000430	张家界	59,400	674,190.00	0.05
260	600243	青海华鼎	65,600	669,120.00	0.05
261	300200	高盟新材	41,000	668,300.00	0.05
262	300393	中来股份	18,150	665,742.00	0.05
263	300158	振东制药	41,200	665,380.00	0.05
264	002648	卫星石化	73,500	664,440.00	0.05
265	600644	乐山电力	79,000	646,220.00	0.05
266	300319	麦捷科技	22,000	634,040.00	0.05
267	000544	中原环保	44,300	633,047.00	0.05
268	300240	飞力达	58,300	622,644.00	0.05
269	002098	浔兴股份	53,500	621,670.00	0.05
270	002016	世荣兆业	74,400	614,544.00	0.05
271	600791	京能置业	87,800	610,210.00	0.05
272	000908	景峰医药	50,262	607,164.96	0.05
273	601999	出版传媒	63,500	604,520.00	0.05
274	002461	珠江啤酒	52,000	604,240.00	0.05
275	300069	金利华电	18,800	603,480.00	0.05
276	002746	仙坛股份	14,100	587,688.00	0.04
277	300092	科新机电	38,300	585,990.00	0.04
278	601579	会稽山	41,200	582,568.00	0.04
279	002034	美欣达	16,000	575,680.00	0.04
280	300103	达刚路机	30,000	561,000.00	0.04
281	002549	凯美特气	57,800	557,770.00	0.04
282	600706	曲江文旅	30,400	543,552.00	0.04
283	600613	神奇制药	37,900	541,970.00	0.04
284	300381	溢多利	7,500	541,125.00	0.04

285	002160	常铝股份	61,500	538,740.00	0.04
286	603006	黎明股份	21,400	531,362.00	0.04
287	600099	林海股份	45,000	529,650.00	0.04
288	002201	九鼎新材	36,700	522,241.00	0.04
289	300192	科斯伍德	40,300	513,019.00	0.04
290	600505	西昌电力	57,300	511,116.00	0.04
291	600753	东方银星	18,200	510,510.00	0.04
292	300121	阳谷华泰	36,200	495,578.00	0.04
293	300280	南通锻压	17,000	482,460.00	0.04
294	603199	九华旅游	9,800	464,520.00	0.04
295	300277	海联讯	31,500	451,710.00	0.03
296	300420	五洋科技	7,100	446,164.00	0.03
297	600774	汉商集团	23,800	432,208.00	0.03
298	603003	龙宇燃油	22,300	427,268.00	0.03
299	300265	通光线缆	31,300	387,494.00	0.03
300	002734	利民股份	11,500	386,285.00	0.03
301	300412	迦南科技	10,500	373,800.00	0.03
302	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
303	601966	玲珑轮胎	10,957	142,221.86	0.01
304	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
305	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
306	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
307	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
308	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
309	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
310	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
311	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
312	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
313	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	601328	交通银行	23,702,538.56	1.52
2	600104	上汽集团	21,862,584.43	1.41

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

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	69,107,099.11	4.44
2	600036	招商银行	59,101,359.06	3.80
3	600030	中信证券	36,817,541.69	2.37
4	600837	海通证券	36,479,212.74	2.35
5	600000	浦发银行	22,089,709.15	1.42
6	601668	中国建筑	21,494,944.28	1.38
7	000725	京东方 A	16,076,938.80	1.03
8	600276	恒瑞医药	14,119,671.18	0.91
9	600048	保利地产	14,062,682.91	0.90
10	600104	上汽集团	13,667,307.39	0.88
11	601166	兴业银行	12,340,488.02	0.79
12	601390	中国中铁	11,544,934.62	0.74

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

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	924,500,441.42
卖出股票收入（成交）总额	999,048,477.44

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1607	IF1607	128	119,554,560.00	2,865,300.00	-

公允价值变动总额合计（元）	2,865,300.00
股指期货投资本期收益（元）	-18,659,020.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）	4,118,460.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

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

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大数据 300A	35,521	37,758.56	6,520,624.13	0.49%	1,334,701,265.36	99.51%
大数据 300C	6,962	20,733.91	-	-	144,349,447.41	100.00%
合计	42,483	34,968.61	6,520,624.13	0.44%	1,479,050,712.77	99.56%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大数据 300A	12,005.34	0.0009%
	大数据 300C	267.86	0.0002%
	合计	12,273.20	0.0008%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大数据 300A	大数据 300C
基金合同生效日（2015 年 6 月 24 日）基金 份额总额	1,874,441,043.18	240,559,049.56
本报告期期初基金份额总额	1,411,621,918.89	153,160,028.99
本报告期基金总申购份额	57,717,961.93	17,219,466.41
减：本报告期基金总赎回份额	128,117,991.33	26,030,047.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	1,341,221,889.49	144,349,447.41

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	762,555,118.19	39.68%	76,265.94	39.69%	-
银河证券	1	1,159,063,589.85	60.32%	115,906.61	60.31%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序：

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

A：选择标准

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

B：选择流程

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

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

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参加交通银行网上银行、手机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	2016年6月13日
2	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月13日
3	南方基金关于旗下部分基金增加广发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	2016年6月12日
4	南方基金关于旗下部分基金增加广发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	2016年6月12日

5	南方基金关于旗下部分基金增加余杭农村商业银行作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	2016 年 6 月 12 日
6	南方基金关于旗下部分基金增加余杭农村商业银行作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	2016 年 6 月 12 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加泰隆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	2016 年 6 月 10 日
8	南方基金关于旗下部分基金增加泰隆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	2016 年 6 月 10 日
9	南方基金关于旗下部分基金增加宁波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	2016 年 6 月 10 日
10	南方基金关于旗下部分基金增加宁波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	2016 年 6 月 10 日
11	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行和南充市商业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	2016 年 5 月 12 日
12	南方基金关于旗下部分基金增加潍坊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	2016 年 5 月 12 日
13	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	2016 年 5 月 11 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	2016 年 5 月 11 日
15	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 11 日
16	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 11 日
17	南方基金关于旗下部分基金增加天津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	2016 年 5 月 11 日
18	南方基金关于旗下部分基金增加天津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	2016 年 5 月 11 日
19	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	2016 年 5 月 11 日
20	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	2016 年 5 月 11 日

21	南方基金关于旗下部分基金增加徽商银行和广东南粤银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
22	南方基金关于旗下部分基金增加徽商银行和广东南粤银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
23	南方基金关于旗下部分基金增加德州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	2016 年 4 月 11 日
24	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 11 日
25	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 11 日
26	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	2016 年 3 月 13 日
27	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 12 日
28	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 12 日
29	南方基金关于旗下部分基金增加泉州银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 12 日
30	南方基金关于旗下部分基金增加泉州银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 12 日
31	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇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	2016 年 3 月 10 日
32	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇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	2016 年 3 月 10 日
33	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	2016 年 2 月 11 日
34	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	2016 年 2 月 11 日
35	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 11 日
36	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 11 日
37	南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2015 年	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 10 日

	第 1 号)		
38	南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2015 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 10 日
39	南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书(更新)(2015 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 10 日
40	南方大数据 300 指数证券投资基金招募说明书(更新)(2015 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 10 日
41	南方基金关于旗下部分基金增加中经北证为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
42	南方基金关于旗下部分基金增加中经北证为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
43	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	2016 年 1 月 12 日
44	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	2016 年 1 月 12 日
45	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛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	2016 年 1 月 12 日
46	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛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	2016 年 1 月 12 日
47	南方基金关于旗下部分基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
48	南方基金关于旗下部分基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
49	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 11 日
50	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 11 日
51	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	2016 年 1 月 11 日
52	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	2016 年 1 月 11 日
53	南方基金关于旗下部分基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日

	换业务并参与其费率优惠活动的公告		
54	南方基金关于旗下部分基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
55	南方基金关于旗下部分基金增加天风证券为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
56	南方基金关于旗下部分基金增加天风证券为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
57	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	2016 年 1 月 10 日
58	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	2016 年 1 月 10 日
59	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
60	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
61	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
62	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
63	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
64	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
65	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
66	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 10 日
67	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	2016 年 1 月 10 日
68	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	2016 年 1 月 10 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方大数据 300 指数证券投资基金的文件。
- 2、《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《南方大数据 300 指数证券投资基金托管协议》
- 4、《南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年半年度报告》原文
- 5、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>