

# 南方大数据 300 指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 30 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §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, 211, 560, 351. 21 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, 097, 115, 301. 22 份	114, 445, 049. 99 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	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院一号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张海波	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日) -2015 年 12 月 31 日
---------------	--------	---

	大数据 300A	大数据 300C	大数据 300A	大数据 300C
本期已实现收益	17,834,599.09	1,194,045.74	-104,524,735.12	-13,152,951.67
本期利润	-31,966,904.65	-3,618,474.42	-45,819,943.45	-10,158,474.12
加权平均基金份额 本期利润	-0.0244	-0.0255	-0.0262	-0.0477
本期加权平均净值 利润率	-2.68%	-2.81%	-2.86%	-5.21%
本期基金份额净值 增长率	-1.95%	-2.28%	-0.63%	-0.74%
<b>3.1.2 期末数据和 指标</b>	<b>2016 年末</b>		<b>2015 年末</b>	
期末可供分配利润	-37,826,894.19	-4,419,475.12	-80,898,935.70	-8,927,647.39
期末可供分配基金 份额利润	-0.0345	-0.0386	-0.0573	-0.0583
期末基金资产净值	1,068,869,721. 06	111,015,461.4 7	1,402,777,923.2 1	152,033,246.83
期末基金份额净值	0.9743	0.9700	0.9937	0.9926
<b>3.1.3 累计期末 指标</b>	<b>2016 年末</b>		<b>2015 年末</b>	
基金份额累计净值 增长率	-2.57%	-3.00%	-0.63%	-0.74%

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

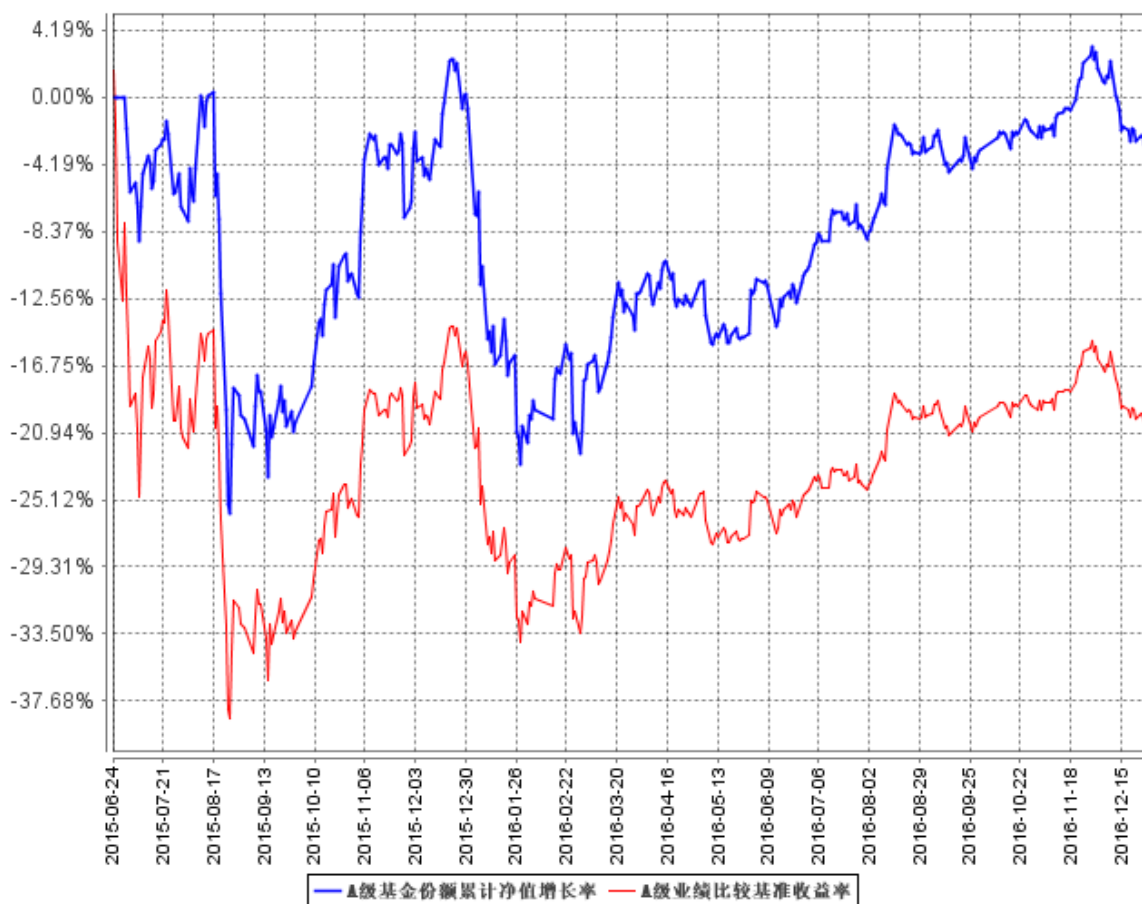
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.74%	0.61%	-0.02%	0.60%	0.76%	0.01%
过去六个月	9.15%	0.69%	6.14%	0.69%	3.01%	0.00%
过去一年	-1.95%	1.32%	-4.00%	1.26%	2.05%	0.06%
自基金合同 生效起至今	-2.57%	1.68%	-19.98%	1.94%	17.41%	-0.26%

## 大数据 300C

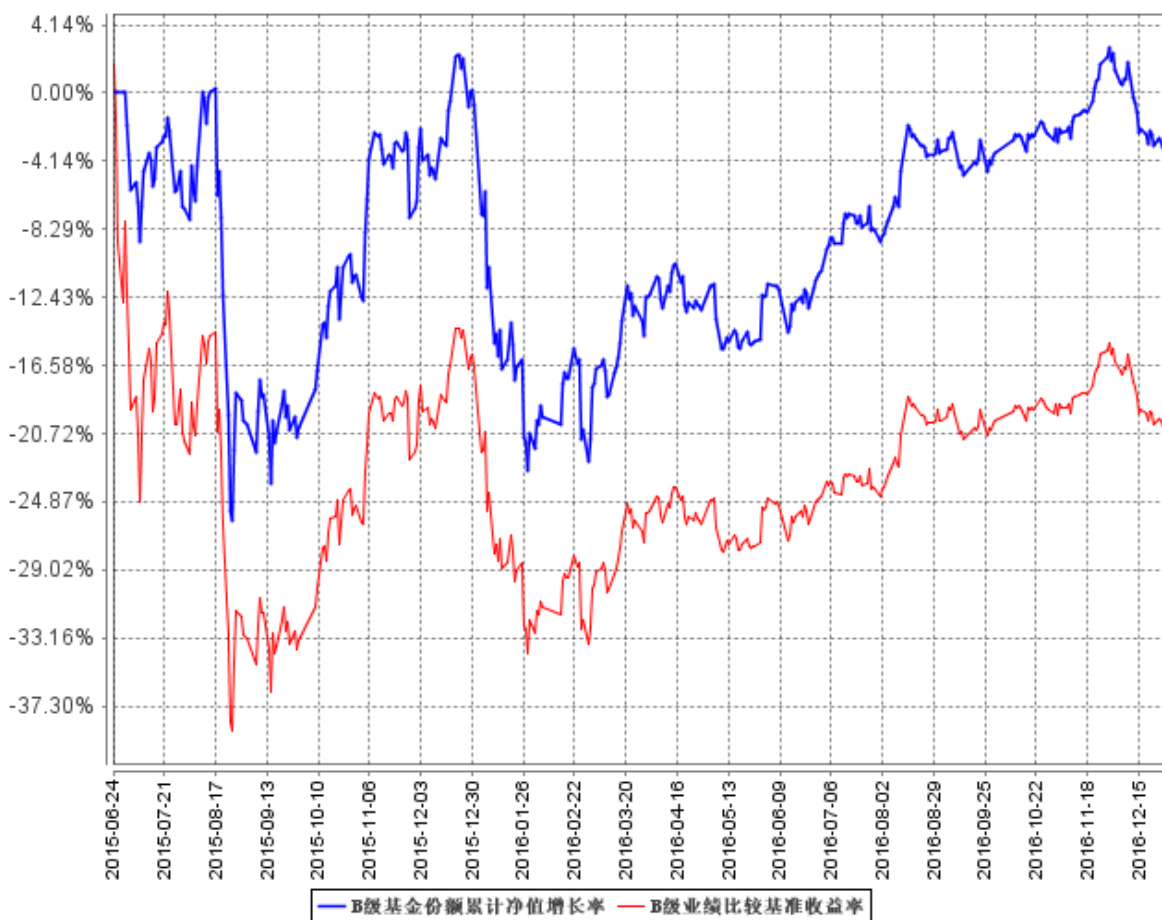
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.65%	0.61%	-0.02%	0.60%	0.67%	0.01%
过去六个月	8.96%	0.69%	6.14%	0.69%	2.82%	0.00%
过去一年	-2.28%	1.32%	-4.00%	1.26%	1.72%	0.06%
自基金合同生效起至今	-3.00%	1.68%	-19.98%	1.94%	16.98%	-0.26%

### 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

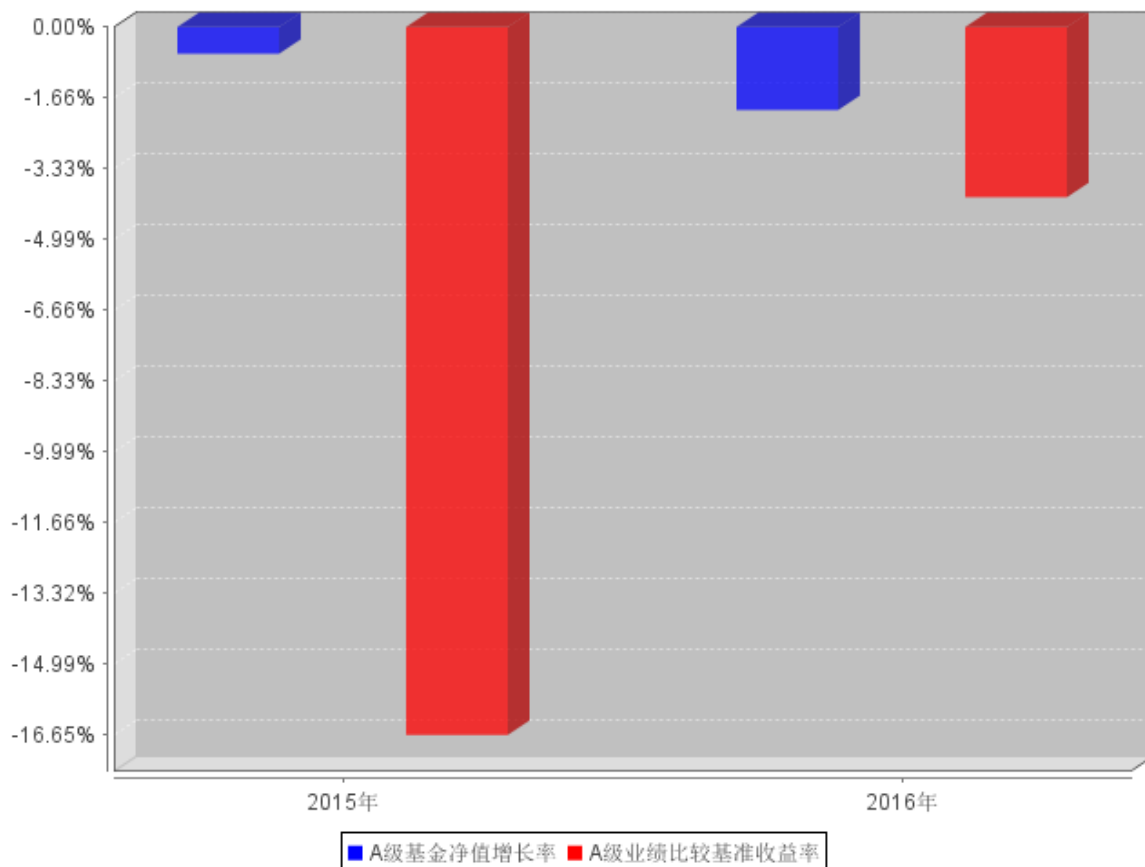


C 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

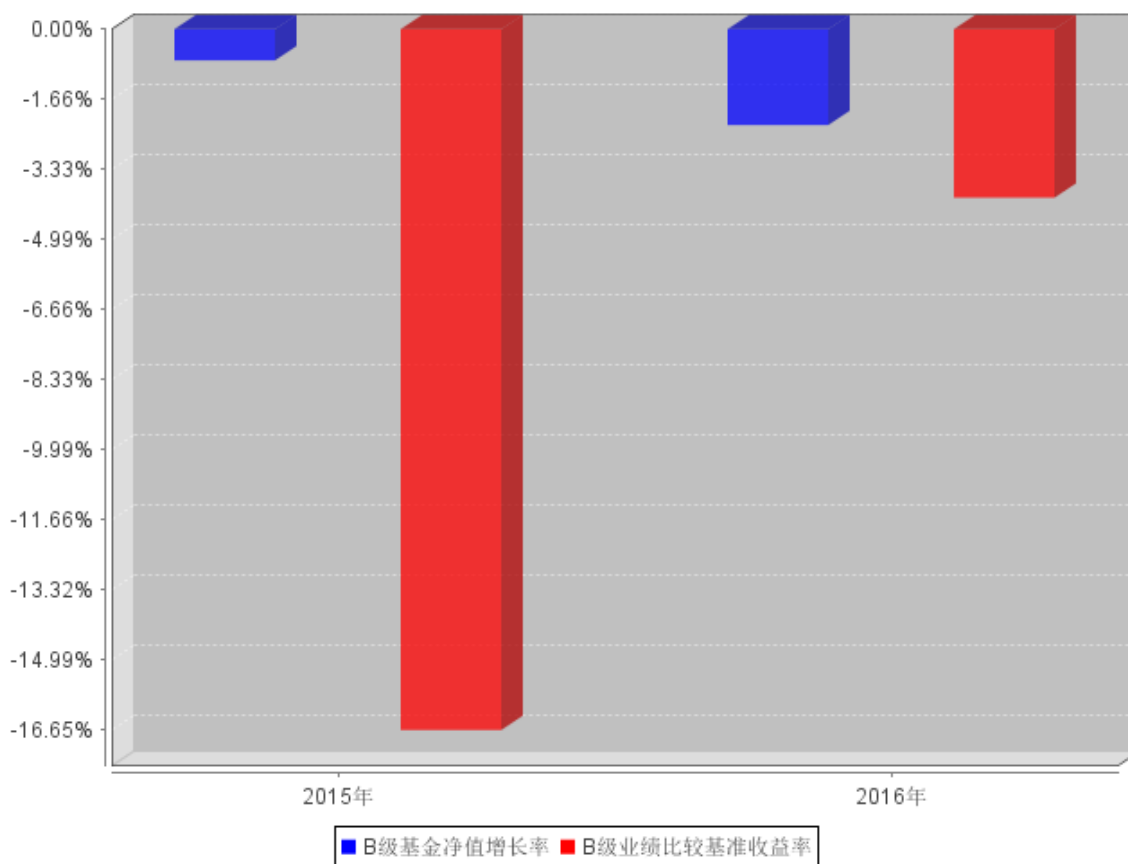


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



**C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过6,500亿元，旗下管理116只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。



#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方大数据 300 指数基金基金合同》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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.3 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，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

## 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

四季度A股略有回升，整体上看是先涨后跌，下跌时大盘略优于小盘股，市场总体仍在一个较窄的区间内震荡。

作为指数型基金，为保证对指数的有效跟踪，本基金一直处于较高仓位运作。本基金充分发挥大数据研究的优势，尽可能的将大数据与市场热点、基本面选股结合，量化筛选具有增长潜质的股票进行投资，报告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0.9743元；C级份额净值为0.9700元。

报告期内，本基金A级份额净值增长率为-1.95%，同期业绩基准增长率为-4.00%；C级份额净值增长率为-2.28%，同期业绩基准增长率为-4.00%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观上看，国内经济阶段企稳、通胀压力有所回升，货币政策将更加中性，无风险利率的回升将对冲掉部分企业盈利改善的利好，人民币汇率转强又有助于修复风险偏好，对冲险资举牌监管的影响；从估值、盈利和跨境比较角度看，权益类资产经历三轮大幅下跌后，投资性价比已经大幅提高，部分板块和个股的投资价值凸显。增量资金依然可期，只是以低风险偏好的机构资金为主，入市节奏较为缓慢；综合以上，权益市场的慢牛表现逻辑逐渐加强。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，围绕重合规守底线、抓规范促发展，坚持从保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，推动公司合规、内控体系的健全完善；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，有效确保投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实销售适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，积极推进符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，健全创新业务洗钱风险评估机制，各项反洗钱工作进一步完善；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.9 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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21460 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	南方大数据 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的南方大数据 300 指数证券投资基金(以下简称“南方大数据 300 指数基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是南方大数据 300 指数基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述南方大数据 300 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方大数据 300 指数基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	11,529,782.64	30,396,479.19
结算备付金		121,313,117.80	139,000,495.12
存出保证金		19,052,769.44	29,786,641.02
交易性金融资产	7.4.7.2	1,030,974,851.54	1,360,498,012.84
其中：股票投资		1,030,974,851.54	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	17,546.98	61,029.35
应收股利		-	-
应收申购款		231,048.87	1,834,241.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,183,119,117.27	1,561,576,899.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		540.00	-
应付赎回款		803,449.11	4,908,647.96
应付管理人报酬		516,572.25	705,325.46
应付托管费		154,971.69	211,597.67
应付销售服务费		38,454.84	56,088.13
应付交易费用	7.4.7.7	884,545.18	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	7.4.7.8	835,401.67	442,590.73
负债合计		3,233,934.74	6,765,729.04
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,211,560,351.21	1,564,781,947.88
未分配利润	7.4.7.10	-31,675,168.68	-9,970,777.84
所有者权益合计		1,179,885,182.53	1,554,811,170.04
负债和所有者权益总计		1,183,119,117.27	1,561,576,899.08

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 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 0.9743 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 0.9700 元；基金份额总额 1,211,560,351.21 份，其中 A 类份额 1,097,115,301.22 份，C 类份额 114,445,049.99 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 24 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-22,518,452.59	-46,694,501.97
1.利息收入		2,639,500.25	2,469,542.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,399,065.84	1,590,839.84
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		240,434.41	878,702.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,962,303.57	-111,681,143.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,972,253.54	-141,569,817.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	2,354,360.00	23,466,240.00
股利收益	7.4.7.15	23,635,690.03	6,422,433.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-54,614,023.90	61,699,269.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	493,767.49	817,830.58
<b>减：二、费用</b>		13,066,926.48	9,283,915.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,609,346.06	4,655,426.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,982,803.80	1,396,627.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	515,870.35	403,464.68
4. 交易费用	7.4.7.18	3,281,262.35	2,399,782.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	677,643.92	428,613.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-35,585,379.07	-55,978,417.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-35,585,379.07	-55,978,417.57

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	-35,585,379.07	-35,585,379.07
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）	-353,221,596.67	13,880,988.23	-339,340,608.44
其中：1. 基金申购款	181,734,988.90	-13,578,828.46	168,156,160.44
2. 基金赎回款	-534,956,585.57	27,459,816.69	-507,496,768.88
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）	1,211,560,351.21	-31,675,168.68	1,179,885,182.53



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 12 月 31 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-55,978,417.57	-55,978,417.57
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)	1,564,781,947.88	46,007,639.73	1,610,789,587.61
其中：1. 基金申购款	2,167,363,438.91	-3,184,263.95	2,164,179,174.96
2. 基金赎回款	-602,581,491.03	49,191,903.68	-553,389,587.35
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)	1,564,781,947.88	-9,970,777.84	1,554,811,170.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方大数据 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1051 号《关于准予南方大数据 300 指数证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,114,455,042.92 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 767 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,115,000,092.74 份,其中认购资金利息折合 545,049.82 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式或销售机构的不同,将基金份

额分为 A 类、C 类基金份额，分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，80%以上的基金资产投资于股票；本基金投资于大数据 300 指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 85%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：大数据 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具(主要为股指期货)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为股指期货)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的

个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

## 7.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.7.1 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。

### 7.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## 7.4.8 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

## 7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年6月24日(基金合同生效日)至 2015年12月31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	103,994,200.30	2.35%	565,310,039.24	12.81%

#### 7.4.9.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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	10,399.56	2.35%	66,930.58	7.57%
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年12月31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	56,531.02	12.80%	56,531.02	12.80%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.9.2 关联方报酬

#### 7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月24日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,609,346.06	4,655,426.60
其中：支付销售机构的客户维护	2,322,860.08	1,688,377.96



费		
---	--	--

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。

#### 7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,982,803.80	1,396,627.95

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。

#### 7.4.9.2.3 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 12 月 31 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
南方基金	-	52,083.63	52,083.63
华泰证券	-	3,656.79	3,656.79
兴业证券	-	1,329.68	1,329.68
合计	-	57,070.10	57,070.10
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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
南方基金	-	39,646.66	39,646.66
华泰证券	-	2,624.57	2,624.57
兴业证券	-	718.98	718.98
合计	-	42,990.21	42,990.21

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。

**7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

**7.4.9.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年6月24日(基金合同生效日) 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	11,529,782.64	358,922.42	30,396,479.19	1,098,887.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.9.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.10 利润分配情况**

注：本基金本报告期内无利润分配

**7.4.11 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.11.1 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

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天	2016年	2017年	新股未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

	燃气	12月30日	1月10日	上市						
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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。

#### 7.4.11.2 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	信威集团	2016年12月26日	重大事项未公告	14.60	-	-	380,000	6,325,165.27	5,548,000.00	-
600161	天坛生物	2016年12月6日	重大资产重组	39.40	2017年3月24日	43.34	75,400	3,080,955.67	2,970,760.00	-
002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大事项未公告	19.70	2017年2月	18.35	113,800	2,095,452.11	2,241,860.00	-

					21 日						
002260	德奥通航	2016 年 12 月 5 日	重大资 产重组	23.10	-	-	69,900	1,787,989.07	1,614,690.00	-	
002239	奥特佳	2016 年 10 月 18 日	重大资 产重组	15.69	2017 年 2 月 7 日	14.12	91,400	1,441,757.56	1,434,066.00	-	
600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	重大资 产重组	20.32	-	-	67,400	1,295,376.43	1,369,568.00	-	
000560	昆百大 A	2016 年 9 月 2 日	重大资 产重组	10.40	2017 年 3 月 24 日	11.44	127,300	1,174,572.55	1,323,920.00	-	
002071	长城影 视	2016 年 6 月 15 日	重大资 产重组	13.64	2017 年 1 月 3 日	15.00	96,100	1,355,423.96	1,310,804.00	-	
002335	科华恒 盛	2016 年 12 月 16 日	重大资 产重组	42.90	-	-	25,500	1,083,033.26	1,093,950.00	-	
600090	同济堂	2016 年 12 月 26 日	重大事 项未公 告	11.75	2017 年 1 月 10 日	12.93	87,100	1,109,095.15	1,023,425.00	-	
002567	唐人神	2016 年 12 月 22 日	重大事 项	12.64	2017 年 1 月 3 日	12.75	67,700	898,315.42	855,728.00	-	
300420	五洋科 技	2016 年 12 月 13 日	重大资 产重组	24.98	2017 年 3 月 23 日	27.48	30,200	734,785.86	754,396.00	-	
002724	海洋王	2016 年 12 月 29 日	重大事 项未公 告	25.84	-	-	20,500	474,687.47	529,720.00	-	

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

**7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

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。

**§8 投资组合报告****8.1 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	1,030,974,851.54	87.14
	其中：股票	1,030,974,851.54	87.14
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	-	-
	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	132,842,900.44	11.23
7	其他各项资产	19,301,365.29	1.63
8	合计	1,183,119,117.27	100.00

**8.2 期末按行业分类的股票投资组合****8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,154,010.00	0.35
B	采矿业	5,923,182.00	0.50
C	制造业	348,170,652.27	29.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,200,380.56	4.59
E	建筑业	48,682,520.23	4.13
F	批发和零售业	47,725,957.72	4.04
G	交通运输、仓储和邮政业	22,514,421.68	1.91
H	住宿和餐饮业	713,232.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,461,628.40	2.58
J	金融业	392,455,389.36	33.26
K	房地产业	32,975,929.00	2.79
L	租赁和商务服务业	8,460,248.00	0.72

M	科学研究和技术服务业	689,040.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	9,244,611.00	0.78
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	23,624,319.32	2.00
S	综合	979,330.00	0.08
	合计	1,030,974,851.54	87.38

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 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	1,498,700	53,098,941.00	4.50
2	601166	兴业银行	3,180,733	51,337,030.62	4.35
3	600036	招商银行	2,891,100	50,883,360.00	4.31
4	601328	交通银行	8,150,100	47,026,077.00	3.99
5	601668	中国建筑	4,403,200	39,012,352.00	3.31
6	600000	浦发银行	2,360,898	38,270,156.58	3.24
7	601398	工商银行	7,291,800	32,156,838.00	2.73
8	601988	中国银行	6,930,000	23,839,200.00	2.02
9	000001	平安银行	2,573,452	23,418,413.20	1.98
10	600104	上汽集团	958,400	22,474,480.00	1.90
11	601818	光大银行	5,247,000	20,515,770.00	1.74
12	600900	长江电力	1,551,915	19,647,243.90	1.67
13	000858	五粮液	563,800	19,439,824.00	1.65
14	600015	华夏银行	1,499,412	16,268,620.20	1.38
15	601009	南京银行	1,296,669	14,055,891.96	1.19
16	002304	洋河股份	168,900	11,924,340.00	1.01
17	600795	国电电力	3,588,300	11,374,911.00	0.96
18	600383	金地集团	701,200	9,087,552.00	0.77
19	002142	宁波银行	539,020	8,969,292.80	0.76
20	600066	宇通客车	440,700	8,633,313.00	0.73
21	002594	比亚迪	168,000	8,346,240.00	0.71
22	000100	TCL 集团	2,499,600	8,248,680.00	0.70
23	600009	上海机场	304,600	8,077,992.00	0.68

24	600309	万华化学	362,000	7,793,860.00	0.66
25	600100	同方股份	539,500	7,472,075.00	0.63
26	000338	潍柴动力	745,900	7,429,164.00	0.63
27	601800	中国交建	480,900	7,304,871.00	0.62
28	000069	华侨城 A	1,020,100	7,089,695.00	0.60
29	600019	宝钢股份	1,113,900	7,073,265.00	0.60
30	002241	歌尔股份	266,700	7,072,884.00	0.60
31	601607	上海医药	332,737	6,508,335.72	0.55
32	601998	中信银行	1,003,000	6,429,230.00	0.54
33	000895	双汇发展	298,200	6,241,326.00	0.53
34	600816	安信信托	257,400	6,079,788.00	0.52
35	600153	建发股份	525,500	5,622,850.00	0.48
36	600741	华域汽车	348,500	5,558,575.00	0.47
37	600485	信威集团	380,000	5,548,000.00	0.47
38	601333	广深铁路	1,022,200	5,182,554.00	0.44
39	000963	华东医药	68,700	4,951,209.00	0.42
40	002385	大北农	659,400	4,681,740.00	0.40
41	300315	掌趣科技	492,200	4,547,928.00	0.39
42	002572	索菲亚	75,100	4,067,416.00	0.34
43	600297	广汇汽车	466,400	3,992,384.00	0.34
44	600332	白云山	164,800	3,951,904.00	0.33
45	000415	渤海金控	551,200	3,941,080.00	0.33
46	600376	首开股份	320,600	3,786,286.00	0.32
47	601098	中南传媒	214,451	3,572,753.66	0.30
48	600037	歌华有线	228,000	3,492,960.00	0.30
49	000778	新兴铸管	672,800	3,478,376.00	0.29
50	002422	科伦药业	214,600	3,459,352.00	0.29
51	600373	中文传媒	170,904	3,452,260.80	0.29
52	600525	长园集团	245,100	3,419,145.00	0.29
53	601633	长城汽车	308,600	3,413,116.00	0.29
54	000046	泛海控股	359,000	3,335,110.00	0.28
55	002311	海大集团	207,100	3,116,855.00	0.26
56	600704	物产中大	301,600	3,115,528.00	0.26
57	601992	金隅股份	693,600	3,093,456.00	0.26
58	601872	招商轮船	623,300	3,079,102.00	0.26
59	300002	神州泰岳	329,500	3,044,580.00	0.26
60	002001	新和成	155,300	3,043,880.00	0.26
61	600161	天坛生物	75,400	2,970,760.00	0.25
62	000999	华润三九	120,100	2,970,073.00	0.25

63	002146	荣盛发展	376,100	2,952,385.00	0.25
64	000883	湖北能源	643,400	2,946,772.00	0.25
65	002152	广电运通	218,100	2,896,368.00	0.25
66	601225	陕西煤业	596,600	2,893,510.00	0.25
67	600856	中天能源	207,300	2,860,740.00	0.24
68	601929	吉视传媒	682,200	2,858,418.00	0.24
69	002410	广联达	195,200	2,849,920.00	0.24
70	600568	中珠医疗	112,100	2,802,500.00	0.24
71	002048	宁波华翔	126,100	2,791,854.00	0.24
72	601058	赛轮金宇	683,400	2,781,438.00	0.24
73	000028	国药一致	41,500	2,776,350.00	0.24
74	600511	国药股份	90,700	2,730,070.00	0.23
75	600026	中远海能	399,500	2,720,595.00	0.23
76	002583	海能达	202,100	2,669,741.00	0.23
77	002343	慈文传媒	58,200	2,628,894.00	0.22
78	300145	中金环境	100,700	2,628,270.00	0.22
79	000860	顺鑫农业	117,300	2,580,600.00	0.22
80	002195	二三四五	220,400	2,494,928.00	0.21
81	600098	广州发展	221,700	2,487,474.00	0.21
82	600298	安琪酵母	138,000	2,459,160.00	0.21
83	600597	光明乳业	187,800	2,452,668.00	0.21
84	601928	凤凰传媒	234,078	2,450,796.66	0.21
85	600872	中炬高新	173,400	2,441,472.00	0.21
86	300133	华策影视	213,000	2,417,550.00	0.20
87	300182	捷成股份	233,300	2,405,323.00	0.20
88	603369	今世缘	180,700	2,370,784.00	0.20
89	600808	马钢股份	832,300	2,355,409.00	0.20
90	600587	新华医疗	92,300	2,317,653.00	0.20
91	002217	合力泰	126,900	2,271,510.00	0.19
92	000926	福星股份	177,600	2,262,624.00	0.19
93	002396	星网锐捷	113,800	2,241,860.00	0.19
94	000898	鞍钢股份	433,000	2,182,320.00	0.18
95	000975	银泰资源	139,400	2,180,216.00	0.18
96	000156	华数传媒	118,300	2,118,753.00	0.18
97	600004	白云机场	147,900	2,083,911.00	0.18
98	600282	南钢股份	664,900	2,061,190.00	0.17
99	002589	瑞康医药	62,500	2,028,125.00	0.17
100	000915	山大华特	47,500	2,001,175.00	0.17
101	000034	神州数码	88,500	1,975,320.00	0.17



102	000587	金洲慈航	132,000	1,964,160.00	0.17
103	000685	中山公用	173,900	1,935,507.00	0.16
104	600323	瀚蓝环境	134,700	1,934,292.00	0.16
105	300054	鼎龙股份	88,420	1,931,977.00	0.16
106	601801	皖新传媒	108,600	1,908,102.00	0.16
107	002035	华帝股份	73,200	1,899,540.00	0.16
108	000989	九芝堂	83,244	1,807,227.24	0.15
109	600566	济川药业	57,700	1,803,702.00	0.15
110	000910	大亚圣象	93,300	1,782,030.00	0.15
111	002480	新筑股份	156,700	1,778,545.00	0.15
112	002247	帝龙文化	95,800	1,733,022.00	0.15
113	300252	金信诺	57,600	1,711,296.00	0.15
114	000662	天夏智慧	79,600	1,694,684.00	0.14
115	600382	广东明珠	92,500	1,683,500.00	0.14
116	002126	银轮股份	173,500	1,681,215.00	0.14
117	002519	银河电子	74,500	1,668,800.00	0.14
118	600621	华鑫股份	112,300	1,648,564.00	0.14
119	002563	森马服饰	160,300	1,646,281.00	0.14
120	600668	尖峰集团	97,600	1,633,824.00	0.14
121	002503	搜于特	113,300	1,630,387.00	0.14
122	002260	德奥通航	69,900	1,614,690.00	0.14
123	002425	凯撒文化	69,400	1,578,850.00	0.13
124	002206	海利得	81,700	1,563,738.00	0.13
125	002511	中顺洁柔	78,400	1,560,160.00	0.13
126	600438	通威股份	235,700	1,501,409.00	0.13
127	600757	长江传媒	178,600	1,484,166.00	0.13
128	002670	国盛金控	43,600	1,464,960.00	0.12
129	000732	泰禾集团	82,200	1,454,118.00	0.12
130	300310	宜通世纪	59,480	1,447,743.20	0.12
131	600509	天富能源	192,300	1,436,481.00	0.12
132	002239	奥特佳	91,400	1,434,066.00	0.12
133	002143	印纪传媒	43,100	1,388,251.00	0.12
134	600211	西藏药业	25,500	1,380,570.00	0.12
135	601908	京运通	193,300	1,376,296.00	0.12
136	002100	天康生物	152,900	1,371,513.00	0.12
137	600551	时代出版	67,400	1,369,568.00	0.12
138	002597	金禾实业	87,300	1,364,499.00	0.12
139	000560	昆百大 A	127,300	1,323,920.00	0.11
140	601126	四方股份	135,000	1,313,550.00	0.11

141	002071	长城影视	96,100	1,310,804.00	0.11
142	002596	海南瑞泽	43,500	1,304,130.00	0.11
143	000536	华映科技	84,800	1,294,896.00	0.11
144	300300	汉鼎宇佑	61,700	1,293,232.00	0.11
145	603108	润达医疗	41,700	1,274,352.00	0.11
146	600969	郴电国际	66,800	1,273,208.00	0.11
147	000919	金陵药业	93,100	1,259,643.00	0.11
148	002182	云海金属	67,100	1,248,731.00	0.11
149	000537	广宇发展	137,300	1,246,684.00	0.11
150	600071	凤凰光学	50,500	1,201,900.00	0.10
151	600864	哈投股份	104,200	1,189,964.00	0.10
152	600093	禾嘉股份	81,900	1,187,550.00	0.10
153	300219	鸿利智汇	109,000	1,182,650.00	0.10
154	002569	步森股份	24,200	1,179,024.00	0.10
155	600748	上实发展	143,100	1,171,989.00	0.10
156	002493	荣盛石化	75,500	1,164,210.00	0.10
157	000056	皇庭国际	87,300	1,156,725.00	0.10
158	002458	益生股份	33,400	1,148,960.00	0.10
159	001896	豫能控股	114,200	1,143,142.00	0.10
160	603609	禾丰牧业	87,500	1,131,375.00	0.10
161	002419	天虹商场	74,600	1,120,492.00	0.09
162	002006	精功科技	99,200	1,111,040.00	0.09
163	603020	爱普股份	54,600	1,110,564.00	0.09
164	000591	太阳能	81,600	1,106,496.00	0.09
165	000965	天保基建	165,600	1,104,552.00	0.09
166	002335	科华恒盛	25,500	1,093,950.00	0.09
167	002692	远程电缆	92,200	1,086,116.00	0.09
168	300304	云意电气	23,600	1,083,240.00	0.09
169	002372	伟星新材	69,900	1,078,557.00	0.09
170	002003	伟星股份	75,200	1,077,616.00	0.09
171	300160	秀强股份	89,200	1,072,184.00	0.09
172	300429	强力新材	33,500	1,072,000.00	0.09
173	002087	新野纺织	153,090	1,071,630.00	0.09
174	300363	博腾股份	53,100	1,064,655.00	0.09
175	000863	三湘印象	125,100	1,062,099.00	0.09
176	002279	久其软件	61,700	1,058,155.00	0.09
177	600515	海航基础	90,700	1,052,120.00	0.09
178	300196	长海股份	27,900	1,049,598.00	0.09
179	300205	天喻信息	72,900	1,045,386.00	0.09

180	601139	深圳燃气	114,900	1,044,441.00	0.09
181	600449	宁夏建材	84,800	1,032,016.00	0.09
182	002662	京威股份	62,700	1,031,415.00	0.09
183	000796	凯撒旅游	67,900	1,028,685.00	0.09
184	002507	涪陵榨菜	76,800	1,027,584.00	0.09
185	002394	联发股份	58,000	1,025,440.00	0.09
186	002646	青青稞酒	53,200	1,024,100.00	0.09
187	600090	同济堂	87,100	1,023,425.00	0.09
188	603611	诺力股份	26,500	1,011,770.00	0.09
189	300138	晨光生物	55,020	1,003,014.60	0.09
190	300109	新开源	20,500	1,002,860.00	0.08
191	000921	海信科龙	98,000	1,000,580.00	0.08
192	600461	洪城水业	131,100	997,671.00	0.08
193	600822	上海物贸	53,300	996,710.00	0.08
194	000723	美锦能源	65,900	996,408.00	0.08
195	000609	绵石投资	61,400	979,330.00	0.08
196	002026	山东威达	84,300	973,665.00	0.08
197	300041	回天新材	77,700	970,473.00	0.08
198	300167	迪威视讯	60,900	956,130.00	0.08
199	600708	光明地产	107,000	955,510.00	0.08
200	600051	宁波联合	72,800	951,496.00	0.08
201	000498	山东路桥	119,800	950,014.00	0.08
202	600475	华光股份	47,500	947,625.00	0.08
203	603898	好莱客	29,200	945,204.00	0.08
204	600379	宝光股份	44,700	943,617.00	0.08
205	002557	洽洽食品	58,700	942,722.00	0.08
206	002746	仙坛股份	19,000	935,750.00	0.08
207	002338	奥普光电	19,200	929,280.00	0.08
208	600327	大东方	98,400	915,120.00	0.08
209	300063	天龙集团	31,400	914,682.00	0.08
210	002472	双环传动	80,400	911,736.00	0.08
211	000719	大地传媒	79,120	910,671.20	0.08
212	002238	天威视讯	61,080	894,822.00	0.08
213	600393	粤泰股份	56,800	891,760.00	0.08
214	300410	正业科技	16,500	890,670.00	0.08
215	300403	地尔汉宇	14,300	890,461.00	0.08
216	002066	瑞泰科技	46,800	887,328.00	0.08
217	000906	物产中拓	60,200	882,532.00	0.07
218	600854	春兰股份	119,100	881,340.00	0.07

219	002171	楚江新材	55,100	873,335.00	0.07
220	600429	三元股份	111,100	872,135.00	0.07
221	601113	华鼎股份	82,100	868,618.00	0.07
222	002442	龙星化工	62,000	865,520.00	0.07
223	600658	电子城	65,100	859,971.00	0.07
224	002620	瑞和股份	15,700	858,476.00	0.07
225	002567	唐人神	67,700	855,728.00	0.07
226	002200	云投生态	36,500	854,830.00	0.07
227	002485	希努尔	40,500	854,550.00	0.07
228	300258	精锻科技	58,000	850,280.00	0.07
229	000546	金圆股份	75,100	850,132.00	0.07
230	601969	海南矿业	69,400	849,456.00	0.07
231	000429	粤高速 A	123,500	844,740.00	0.07
232	300373	扬杰科技	42,900	844,272.00	0.07
233	300204	舒泰神	47,400	840,402.00	0.07
234	601677	明泰铝业	56,200	831,760.00	0.07
235	600618	氯碱化工	56,900	830,171.00	0.07
236	002088	鲁阳节能	42,600	828,570.00	0.07
237	300365	恒华科技	19,900	825,850.00	0.07
238	002149	西部材料	29,300	821,865.00	0.07
239	600385	山东金泰	34,500	821,445.00	0.07
240	603338	浙江鼎力	15,600	812,916.00	0.07
241	600203	福日电子	68,400	803,016.00	0.07
242	300187	永清环保	64,500	794,640.00	0.07
243	300444	双杰电气	32,900	789,600.00	0.07
244	300190	维尔利	48,900	786,801.00	0.07
245	600178	东安动力	71,100	784,944.00	0.07
246	002732	燕塘乳业	20,500	781,460.00	0.07
247	002232	启明信息	58,500	778,635.00	0.07
248	002370	亚太药业	26,300	770,590.00	0.07
249	002705	新宝股份	45,510	769,574.10	0.07
250	600829	人民同泰	49,400	754,832.00	0.06
251	300420	五洋科技	30,200	754,396.00	0.06
252	002209	达意隆	32,100	744,399.00	0.06
253	000544	中原环保	42,200	733,436.00	0.06
254	000862	银星能源	86,200	732,700.00	0.06
255	300360	炬华科技	37,800	727,272.00	0.06
256	300209	天泽信息	29,200	726,496.00	0.06
257	600605	汇通能源	30,700	725,441.00	0.06

258	300200	高盟新材	39,900	714,210.00	0.06
259	600258	首旅酒店	31,200	713,232.00	0.06
260	000663	永安林业	41,500	699,275.00	0.06
261	002483	润邦股份	58,700	692,073.00	0.06
262	600644	乐山电力	75,300	689,748.00	0.06
263	600629	华建集团	33,000	689,040.00	0.06
264	300192	科斯伍德	44,900	677,990.00	0.06
265	002270	华明装备	47,100	675,414.00	0.06
266	300389	艾比森	30,900	670,530.00	0.06
267	002548	金新农	46,200	666,666.00	0.06
268	002403	爱仕达	44,800	654,976.00	0.06
269	002265	西仪股份	33,800	645,580.00	0.05
270	002543	万和电气	37,000	643,800.00	0.05
271	002726	龙大肉食	36,700	639,681.00	0.05
272	600371	万向德农	39,000	636,870.00	0.05
273	002615	哈尔斯	36,000	631,800.00	0.05
274	300121	阳谷华泰	34,500	628,935.00	0.05
275	600167	联美控股	37,800	628,236.00	0.05
276	300176	鸿特精密	20,600	625,622.00	0.05
277	002193	山东如意	27,400	615,130.00	0.05
278	002765	蓝黛传动	21,500	602,000.00	0.05
279	300375	鹏翎股份	24,200	580,316.00	0.05
280	300313	天山生物	30,400	577,600.00	0.05
281	002549	凯美特气	56,500	573,475.00	0.05
282	600213	亚星客车	36,500	568,670.00	0.05
283	002750	龙津药业	33,900	563,757.00	0.05
284	300239	东宝生物	69,100	558,328.00	0.05
285	300469	信息发展	6,800	544,816.00	0.05
286	002713	东易日盛	21,100	541,215.00	0.05
287	300265	通光线缆	36,400	536,900.00	0.05
288	603011	合锻智能	46,200	533,148.00	0.05
289	600980	北矿科技	21,600	531,360.00	0.05
290	002724	海洋王	20,500	529,720.00	0.04
291	600828	茂业商业	61,400	518,830.00	0.04
292	603223	恒通股份	15,300	516,069.00	0.04
293	002680	长生生物	29,200	505,160.00	0.04
294	300092	科新机电	33,800	469,144.00	0.04
295	300283	温州宏丰	47,600	467,432.00	0.04
296	300387	富邦股份	13,800	423,660.00	0.04

297	002645	华宏科技	14,500	414,845.00	0.04
298	300405	科隆精化	8,700	403,332.00	0.03
299	600984	建设机械	35,900	313,766.00	0.03
300	600623	华谊集团	20,112	270,305.28	0.02
301	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.02
302	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
303	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
304	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
305	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.01
306	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
307	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01
308	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
309	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
310	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
311	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
312	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
313	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
314	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
315	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
316	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
317	603239	N 仙通	924	29,059.80	0.00
318	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
319	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
320	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
321	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.00
322	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
323	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
324	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
325	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
326	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
327	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
328	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601318	中国平安	67,435,982.89	4.34
2	600036	招商银行	62,863,192.18	4.04
3	601668	中国建筑	55,596,398.97	3.58
4	600104	上汽集团	47,345,659.58	3.05
5	000858	五粮液	40,617,442.92	2.61
6	601328	交通银行	33,376,111.89	2.15
7	002304	洋河股份	26,189,981.58	1.68
8	600900	长江电力	23,271,768.92	1.50
9	600048	保利地产	22,079,953.44	1.42
10	600000	浦发银行	21,039,267.32	1.35
11	601166	兴业银行	19,125,041.21	1.23
12	601169	北京银行	18,793,834.91	1.21
13	601398	工商银行	18,416,685.00	1.18
14	002594	比亚迪	17,451,956.61	1.12
15	600066	宇通客车	16,737,616.57	1.08
16	601288	农业银行	15,160,409.00	0.98
17	000001	平安银行	15,129,668.80	0.97
18	002415	海康威视	13,887,616.10	0.89
19	601988	中国银行	13,657,930.00	0.88
20	600276	恒瑞医药	13,356,966.11	0.86

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

#### 8.4.2 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	601318	中国平安	73,261,427.61	4.71
2	600036	招商银行	69,460,061.08	4.47
3	600016	民生银行	69,107,099.11	4.44
4	000002	万科 A	65,138,910.20	4.19
5	601169	北京银行	47,414,781.75	3.05
6	601288	农业银行	44,900,175.47	2.89
7	600104	上汽集团	39,497,015.66	2.54
8	600030	中信证券	36,817,541.69	2.37
9	600048	保利地产	36,698,033.27	2.36
10	600837	海通证券	36,479,212.74	2.35

11	600000	浦发银行	32,011,511.65	2.06
12	601601	中国太保	31,423,060.26	2.02
13	601668	中国建筑	26,187,451.28	1.68
14	000858	五粮液	24,173,815.73	1.55
15	601166	兴业银行	22,987,457.02	1.48
16	601328	交通银行	18,875,136.28	1.21
17	000776	广发证券	18,033,280.58	1.16
18	000423	东阿阿胶	16,758,589.60	1.08
19	002415	海康威视	16,750,949.50	1.08
20	600999	招商证券	16,159,614.65	1.04

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。

### 8.4.3 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	2,079,278,378.69
卖出股票收入（成交）总额	2,359,054,727.23

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。

### 8.5 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。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.9.1 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
IF1701	IF1701	96	94,809,600.00	-2,551,380.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-2,551,380.00
股指期货投资本期收益（元）					2,354,360.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,298,220.00



## 8.9.2 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。

## 8.10 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。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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	19,052,769.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,546.98
5	应收申购款	231,048.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,301,365.29

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	33,602	32,650.30	47,039,392.98	4.29%	1,050,075,908.24	95.71%
大数据 300C	8,863	12,912.68	0.00	0.00%	114,445,049.99	100.00%
合计	42,465	28,530.80	47,039,392.98	3.88%	1,164,520,958.23	96.12%

### 9.2 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	111,510.06	0.0102%
	大数据 300C	267.86	0.0002%
	合计	111,777.92	0.0092%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本开放式基金。

本基金基金经理未持有本开放式基金。

## § 10 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	142,862,034.94	38,872,953.96
减:本报告期基金总赎回份额	457,368,652.61	77,587,932.96
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	1,097,115,301.22	114,445,049.99

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

根据南方基金管理有限公司第七届董事会第一次会议审议通过，并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，自 2016 年 10 月 18 日起，张海波先生担任本基金管理人董事长，吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。

基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会任期届满，根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定，公司股东会 2016 年第一次临时会议选举产生了公司第七届董事会。

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第二十八次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于 2016 年 10 月 19 日发布公告，自 2016 年 10 月 17 日起，郑文祥先生不再担任本基金管理人副总经理。

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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 91,000.00 元。

### 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
银河证券	1	12,496,222,405.30	56.34%	249,622.79	56.34%	-
申万宏源	1	11,830,190,639.49	41.31%	183,043.74	41.31%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	103,994,200.30	2.35%	10,399.56	2.35%	-

注：1、为节约交易单元资源，我国在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、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，我国制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

#### A：选择标准

- (a) 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- (b) 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；
- (c) 公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- (d) 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：

- (a) 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；
- (b) 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；
- (c) 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。

### 11.7.2 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

银河证券	-	-795,000,000.00	71.95%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-310,000,000.00	28.05%	-	-

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。