

南方大数据 300 指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方大数据 300 指数证券投资基金	
基金简称	南方大数据 300 指数	
基金主代码	001420	
交易代码	001420	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	187,394,520.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大数据 300A 级	大数据 300C 级
下属分级基金的交易代码	001420	001426
报告期末下属分级基金的份 额总额	158,392,003.82 份	29,002,516.42 份

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

2.2 基金产品说明

投资目标	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	南方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	021-60637111
传真	0755-82763889	021-60635778
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518017	100033
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	田国立

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、大数据 300A 级

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	51,278,723.54
本期利润	9,653,460.86
加权平均基金份额本期利润	0.0576
本期加权平均净值利润率	3.66%
本期基金份额净值增长率	3.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	100,404,420.42
期末可供分配基金份额利润	0.6338
期末基金资产净值	258,796,424.24
期末基金份额净值	1.6339
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	63.39%

2、大数据 300C 级

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,703,019.48
本期利润	1,590,472.57
加权平均基金份额本期利润	0.0542
本期加权平均净值利润率	3.52%
本期基金份额净值增长率	3.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	17,360,798.44
期末可供分配基金份额利润	0.5985
期末基金资产净值	46,363,314.86
期末基金份额净值	1.5986
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	59.86%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大数据 300A 级

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.03%	0.83%	-0.54%	0.84%	1.57%	-0.01%
过去三个月	9.22%	1.00%	6.06%	1.00%	3.16%	0.00%
过去六个月	3.25%	1.32%	0.02%	1.33%	3.23%	-0.01%
过去一年	38.30%	1.30%	24.99%	1.30%	13.31%	0.00%
过去三年	65.19%	1.30%	40.12%	1.30%	25.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	63.39%	1.32%	10.79%	1.40%	52.60%	-0.08%

大数据 300C 级

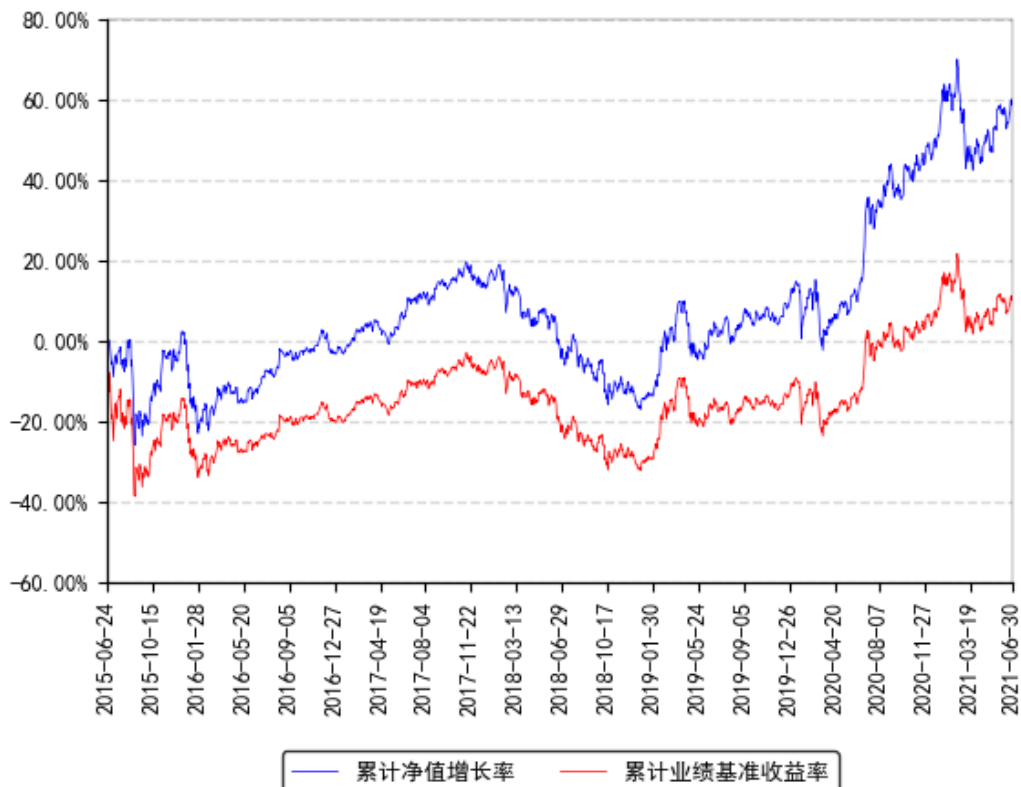
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.99%	0.83%	-0.54%	0.84%	1.53%	-0.01%
过去三个月	9.11%	1.00%	6.06%	1.00%	3.05%	0.00%
过去六个月	3.04%	1.32%	0.02%	1.33%	3.02%	-0.01%
过去一年	37.75%	1.30%	24.99%	1.30%	12.76%	0.00%
过去三年	63.22%	1.30%	40.12%	1.30%	23.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	59.86%	1.32%	10.79%	1.40%	49.07%	-0.08%

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

大数据300A级累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大数据300C级累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，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。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 1.4 万亿元，旗下管理 245 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔蕾	本基金基金经理	2019 年 6 月 28 日	-	6 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险经理师(FRM)，特许金融分析师(CFA)，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2018 年 11 月 8 日至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF(QDII)基金经理；2019 年 6 月 28 日至今，任大数据 300 基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2019 年 11 月 29 日至今，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50

					基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2020 年 3 月 26 日至今，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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% 的情况。

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

i300 指数报告期内下跌 0.05%。

我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

(3) 新股上市初期涨幅较大的影响；

(4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.6339 元，报告期内，份额净值增长率为 3.25%，同期业绩基准增长率为 0.02%；本基金 C 份额净值为 1.5986 元，报告期内，份额净值增长率为 3.04%，同期业绩基准增长率为 0.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年海外发达市场股市普涨，A 股在一季度大幅震荡，结构性分化加剧。展望下半年，随着经济的持续复苏，全球央行货币宽松的节奏有所下降，全球股市上行趋势放缓，风险资产上行空间受限。在国内货币政策难以大幅宽松或收紧的预期下，下半年市场或仍需在震荡行情中寻找结构性机会。但放眼全球，由于欧美股市估值处于历史极值状态，大中华地区权益市场性价比凸显。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用

可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告（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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	6,732,826.34	6,741,224.91
结算备付金		3,604,784.61	6,502,934.97
存出保证金		956,125.26	1,913,986.94
交易性金融资产	6.4.4.2	296,120,069.34	347,318,725.87
其中：股票投资		283,090,869.34	330,114,025.87
基金投资		-	-
债券投资		13,029,200.00	17,204,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		36,788.52	1,730.82
应收利息	6.4.4.5	275,725.27	248,653.50
应收股利		39,650.00	-

应收申购款		210,085.85	168,095.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		307,976,055.19	362,895,352.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		1,570,180.73	1,156,904.30
应付管理人报酬		124,132.39	148,965.45
应付托管费		37,239.74	44,689.61
应付销售服务费		14,847.15	17,407.90
应付交易费用	6.4.4.7	24,837.71	64,315.83
应交税费		1,444.02	20,746.81
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	1,043,634.35	1,028,014.31
负债合计		2,816,316.09	2,481,044.21
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	187,394,520.24	228,426,713.18
未分配利润	6.4.4.10	117,765,218.86	131,987,595.51
所有者权益合计		305,159,739.10	360,414,308.69
负债和所有者权益总计		307,976,055.19	362,895,352.90

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，大数据 300A 级份额净值 1.6339 元，基金份额总额 158,392,003.82 份；大数据 300C 级份额净值 1.5986 元，基金份额总额 29,002,516.42 份；总份额合计 187,394,520.24 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		13,070,679.49	14,485,537.44
1. 利息收入		431,078.72	531,260.55
其中：存款利息收入	6.4.4.11	47,441.18	95,040.56
债券利息收入		140,679.28	238,780.09
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		242,958.26	197,439.90
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		61,284,801.01	26,951,751.98
其中：股票投资收益	6.4.4.12	58,309,515.57	23,266,644.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	73,792.38	-29,497.50
资产支持证券投资 收益	6.4.4.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	772,568.90	-348,480.00
股利收益	6.4.4.17	2,128,924.16	4,063,084.88
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.4.18	-48,737,809.59	-13,095,581.77
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.4.19	92,609.35	98,106.68
减：二、费用		1,826,746.06	2,188,009.69

1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	770,639.70	960,030.47
2. 托管费	6.4.7.2.2	231,191.91	288,009.15
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	90,263.81	100,675.61
4. 交易费用	6.4.4.20	541,878.47	644,843.16
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		4,618.79	711.07
7. 其他费用	6.4.4.21	188,153.38	193,740.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,243,933.43	12,297,527.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,243,933.43	12,297,527.75

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	228,426,713.18	131,987,595.51	360,414,308.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,243,933.43	11,243,933.43
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）	-41,032,192.94	-25,466,310.08	-66,498,503.02
其中：1. 基金申购款	27,956,163.29	16,347,555.66	44,303,718.95
2. 基金赎回款	-68,988,356.23	-41,813,865.74	-110,802,221.97
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）	187,394,520.24	117,765,218.86	305,159,739.10
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	417,704,692.60	54,109,920.23	471,814,612.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,297,527.75	12,297,527.75
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）	-113,433,277.32	-12,097,034.63	-125,530,311.95
其中：1. 基金申购款	36,671,168.04	3,244,189.66	39,915,357.70
2. 基金赎回款	-150,104,445.36	-15,341,224.29	-165,445,669.65
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）	304,271,415.28	54,310,413.35	358,581,828.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____ ____徐超____ ____徐超____
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.2 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.3.3 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。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	6,732,826.34
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	6,732,826.34

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	273,816,300.42	283,090,869.34	9,274,568.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券 交易所市场	12,988,200.00	13,029,200.00	41,000.00

	银行间市场	-	-	-
	合计	12,988,200.00	13,029,200.00	41,000.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		286,804,500.42	296,120,069.34	9,315,568.92

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	7,619,640.00	-	-	-
—股指期货	7,619,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,619,640.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资/国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2109	IF2109	5.00	7,749,600.00	129,960.00
总额合计	-	5.00	7,749,600.00	129,960.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	129,960.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	579.56
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	1,344.80
应收债券利息	268,016.01
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	5,773.20
其他	11.70
合计	275,725.27

6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	24,837.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	24,837.71

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,526.28
应付证券出借违约金	-
应退替代款	-
预提费用	134,302.56
应付指数使用费	906,805.51
可退替代款	-
其他	-
合计	1,043,634.35

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

大数据 300A 级		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	194,097,519.43	194,097,519.43
本期申购	19,242,226.67	19,242,226.67
本期赎回（以“-”号填列）	-54,947,742.28	-54,947,742.28
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	158,392,003.82	158,392,003.82

大数据 300C 级		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,329,193.75	34,329,193.75
本期申购	8,713,936.62	8,713,936.62
本期赎回（以“-”号填列）	-14,040,613.95	-14,040,613.95
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,002,516.42	29,002,516.42

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

大数据 300A 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	85,722,223.31	27,337,510.78	113,059,734.09
本期利润	51,278,723.54	-41,625,262.68	9,653,460.86
本期基金份额交易产生的变动数	-19,667,370.07	-2,641,404.46	-22,308,774.53
其中：基金申购款	12,043,551.07	-531,028.69	11,512,522.38
基金赎回款	-31,710,921.14	-2,110,375.77	-33,821,296.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,333,576.78	-16,929,156.36	100,404,420.42

大数据 300C 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,194,854.99	4,733,006.43	18,927,861.42
本期利润	8,703,019.48	-7,112,546.91	1,590,472.57
本期基金份额交易产生的变动数	-2,493,870.95	-663,664.60	-3,157,535.55
其中：基金申购款	5,180,515.79	-345,482.51	4,835,033.28
基金赎回款	-7,674,386.74	-318,182.09	-7,992,568.83

本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,404,003.52	-3,043,205.08	17,360,798.44

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
活期存款利息收入			18,758.96
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			28,389.30
其他			292.92
合计			47,441.18

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额		322,753,452.41
减：卖出股票成本总额		264,443,936.84
买卖股票差价收入		58,309,515.57

6.4.4.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		5,228,911.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		5,065,000.00
减：应收利息总额		90,119.31
买卖债券差价收入		73,792.38

6.4.4.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.4.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.4.16 衍生工具收益

6.4.4.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.4.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	772,568.90

6.4.4.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,128,924.16
其中：证券出借权益补偿收入	381,903.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,128,924.16

6.4.4.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-48,188,741.02
——股票投资	-48,238,241.02
——债券投资	49,500.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-549,068.57
——权证投资	-
——期货投资	-549,068.57
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-48,737,809.59

6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	86,073.60
基金转换费收入	6,535.75
合计	92,609.35

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.4.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	541,878.47
银行间市场交易费用	-
合计	541,878.47

6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行费用	3,850.82
合计	188,153.38

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

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

无。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	288,014,916.36	49.39%	356,876,274.60	54.83%

6.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	28,801.72	19.18%	6,284.70	25.30%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	35,681.67	22.79%	16,810.96	24.07%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.7.2 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	770,639.70	960,030.47
其中：支付销售机构的客户维护费	276,005.15	168,816.94

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 × 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	231,191.91	288,009.15

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

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

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大数据 300A 级	大数据 300C 级	合计
华泰证券	-	779.25	779.25
南方基金	-	7,321.82	7,321.82
兴业证券	-	16.26	16.26
合计	-	8,117.33	8,117.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大数据 300A 级	大数据 300C 级	合计
华泰证券	-	1,008.13	1,008.13
南方基金	-	10,327.53	10,327.53
兴业证券	-	67.03	67.03
合计	-	11,402.69	11,402.69

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

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

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

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

6.4.7.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.7.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

华泰证券	80,499,350.00	102,234.56	6,278,300.00	2,215.93
兴业证券	12,528,650.00	19,222.96	-	-

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	13,839,100.00	10,618.54	-	-

6.4.7.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:)	出借期限 (单位:)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
兴业证券	2020122300000559	芒果超媒	2020 年 12 月 23 日	-	-	28	3.10	1,741.37	-	-
华泰证券	202106290000937	蓝色光标	2021 年 6 月 29 日	90,900.00	15,000.00	28	3.50	8.58	90,750.00	8.84

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:)	出借期限 (单位:)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.7.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	6,732,826.34	18,758.96	10,597,433.26	46,292.29

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

6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	718	108,059.00
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	2,019	73,128.18
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
华泰联合证券	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32

兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
华泰联合证 券	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
兴业证券	-	-	-	-	-
华泰联合证 券	-	-	-	-	-

6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认 购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量（单 位：股）	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	创业板 新股锁 定期	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	创业板 新股锁 定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	创业板 新股锁 定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	创业板 新股锁 定期	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板 新股锁 定期	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板 新股锁 定期	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	创业板 新股锁 定期	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	创业板 新股锁 定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	锁定期 转增	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	创业板 新股锁 定期	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	创业板 新股锁 定期	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	创业板 新股锁 定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	创业板 新股锁 定期	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	创业板 新股锁 定期	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	创业板 新股锁 定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	创业板 新股锁 定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	创业板 新股锁 定期	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	创业板 新股锁 定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板 新股锁 定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	48.59	90.39	232	11,272.88	20,970.48	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

		日	日	定期						
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	创业板 新股锁 定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	创业板 新股锁 定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	创业板 新股锁 定期	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	创业板 新股锁 定期	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	创业板 新股锁 定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	创业板 新股锁 定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	创业板 新股锁 定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	创业板 新股锁 定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	创业板 新股锁 定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	创业板 新股锁 定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	创业板 新股锁 定期	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	创业板 新股锁 定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	创业板 新股锁 定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	创业板 新股锁 定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021 年	2021 年	创业板	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-

		6月21日	12月29日	新股锁定期						
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	创业板新股锁定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688083	中望软件	2021年3月4日	2021年9月13日	科创板新股锁定期	150.50	524.08	718	108,059.00	376,289.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688367	工大高科	2021年6月21日	2021年12月28日	科创板新股锁定期	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
688621	阳光诺和	2021年6月11日	2021年12月21日	科创板新股锁定期	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	创业板新股锁定期	24.60	163.00	393	9,667.80	64,059.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	配债未上市	100.00	100.00	198	19,800.00	19,800.00	-

		日	日							
123117	健帆转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	94	9,400.00	9,400.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东及董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	15,800	586,476.00	890,330.00	-

本基金截至 2021 年 06 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	600887	伊利股份	2021年7月7日	36.83	40,000.00	1,473,200.00
2	002475	立讯精密	2021年7月26日	46.00	30,000.00	1,380,000.00
3	000725	京东方A	2021年7月26日	6.24	215,000.00	1,341,600.00
4	600031	三一重工	2021年7月12日	29.07	45,000.00	1,308,150.00
5	000002	万科A	2021年7月26日	23.81	50,000.00	1,190,500.00
6	600309	万华化学	2021年7月26日	108.82	10,000.00	1,088,200.00
7	600036	招商银行	2021年7月22日	54.19	20,000.00	1,083,800.00
8	601919	中远海控	2021年7月8日 -2021年7月26日	30.54	30,000.00	916,200.00
9	002714	牧原股份	2021年7月27日	60.82	15,000.00	912,300.00
10	300124	汇川技术	2021年7月22日	74.26	10,000.00	742,600.00

11	300015	爱尔眼科	2021 年 7 月 22 日	70.98	10,000.00	709,800.00
12	002027	分众传媒	2021 年 7 月 8 日	9.41	75,000.00	705,750.00
13	002241	歌尔股份	2021 年 7 月 12 日	42.74	15,000.00	641,100.00
14	002271	东方雨虹	2021 年 7 月 14 日	55.32	10,000.00	553,200.00
15	000063	中兴通讯	2021 年 7 月 14 日	33.23	15,000.00	498,450.00
16	300012	华测检测	2021 年 7 月 14 日	31.88	10,000.00	318,800.00
17	600111	北方稀土	2021 年 7 月 8 日	20.70	15,000.00	310,500.00
18	600089	特变电工	2021 年 7 月 12 日	12.85	20,000.00	257,000.00
19	601233	桐昆股份	2021 年 7 月 8 日	24.09	10,000.00	240,900.00
20	002050	三花智控	2021 年 7 月 14 日	23.98	10,000.00	239,800.00
21	600406	国电南瑞	2021 年 7 月 14 日	23.24	10,000.00	232,400.00
22	600143	金发科技	2021 年 7 月 12 日	20.86	10,000.00	208,600.00
23	300144	宋城演艺	2021 年 7 月 13 日	16.80	10,000.00	168,000.00
24	600522	中天科技	2021 年 7 月 14 日	10.00	15,000.00	150,000.00
25	002600	领益智造	2021 年 7 月 22 日	9.19	15,000.00	137,850.00
26	002078	太阳纸业	2021 年 7 月 22 日	13.35	10,000.00	133,500.00
27	601838	成都银行	2021 年 7 月 7 日	12.64	10,000.00	126,400.00
28	600066	宇通客车	2021 年 7 月 14 日	12.49	10,000.00	124,900.00
29	600867	通化东宝	2021 年 7 月 12 日	11.94	10,000.00	119,400.00
30	601168	西部矿业	2021 年 7 月 12 日	11.93	10,000.00	119,300.00
31	000807	云铝股份	2021 年 7 月 8 日	11.90	10,000.00	119,000.00
32	000825	太钢不锈	2021 年 7 月 12 日	7.49	15,000.00	112,350.00

33	600606	绿地控股	2021 年 7 月 14 日	5.45	20,000.00	109,000.00
34	601997	贵阳银行	2021 年 7 月 14 日	7.16	15,000.00	107,400.00
35	002092	中泰化学	2021 年 7 月 12 日	10.27	10,000.00	102,700.00
36	601866	中远海发	2021 年 7 月 26 日	3.75	25,000.00	93,750.00
37	601128	常熟银行	2021 年 7 月 14 日	6.20	15,000.00	93,000.00
38	300058	蓝色光标	2021 年 7 月 27 日	6.05	15,000.00	90,750.00
39	600153	建发股份	2021 年 7 月 14 日	8.10	10,000.00	81,000.00
40	300296	利亚德	2021 年 7 月 8 日	7.82	10,000.00	78,200.00
41	000723	美锦能源	2021 年 7 月 8 日	7.56	10,000.00	75,600.00
42	000932	华菱钢铁	2021 年 7 月 22 日	6.60	10,000.00	66,000.00
43	600808	马钢股份	2021 年 7 月 8 日	4.29	15,000.00	64,350.00
44	600039	四川路桥	2021 年 7 月 14 日	6.27	10,000.00	62,700.00
45	000778	新兴铸管	2021 年 7 月 14 日	3.72	15,000.00	55,800.00
46	002701	奥瑞金	2021 年 7 月 14 日	5.14	10,000.00	51,400.00
47	002266	浙富控股	2021 年 7 月 12 日	4.99	10,000.00	49,900.00
48	300002	神州泰岳	2021 年 7 月 8 日	4.85	10,000.00	48,500.00
49	600266	城建发展	2021 年 7 月 14 日	4.74	10,000.00	47,400.00
50	600120	浙江东方	2021 年 7 月 14 日	4.28	10,000.00	42,800.00
51	002244	滨江集团	2021 年 7 月 12 日	4.19	10,000.00	41,900.00
52	600968	海油发展	2021 年 7 月 12 日	2.59	15,000.00	38,850.00
53	600466	蓝光发展	2021 年 7 月 8 日	2.95	10,000.00	29,500.00
合计	-	-	-	-	1,055,000.00	19,094,050.00

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合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

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

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

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	6,732,826.34	-	-	-	6,732,826.34
结算备付金	3,604,784.61	-	-	-	3,604,784.61
存出保证金	26,173.26	-	-	929,952.00	956,125.26
交易性金融资产	13,000,000.00	-	29,200.00	283,090,869.34	296,120,069.34
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	275,725.27	275,725.27
应收股利	-	-	-	39,650.00	39,650.00
应收申购款	-	-	-	210,085.85	210,085.85

应收证券清算款	-	-	-	36,788.52	36,788.52
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,363,784.21	-	29,200.00	284,583,070.98	307,976,055.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,570,180.73	1,570,180.73
应付管理人报酬	-	-	-	124,132.39	124,132.39
应付托管费	-	-	-	37,239.74	37,239.74
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	14,847.15	14,847.15
应付交易费用	-	-	-	24,837.71	24,837.71
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,444.02	1,444.02
其他负债	-	-	-	1,043,634.35	1,043,634.35
负债总计	-	-	-	2,816,316.09	2,816,316.09
利率敏感度缺口	23,363,784.21	-	29,200.00	281,766,754.89	305,159,739.10
上年度末 2020 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	6,741,224.91	-	-	-	6,741,224.91
结算备付金	6,502,934.97	-	-	-	6,502,934.97
存出保证金	37,810.94	-	-	1,876,176.00	1,913,986.94
交易性金融资产	16,982,700.00	-	222,000.00	330,114,025.87	347,318,725.87
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	248,653.50	248,653.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	168,095.89	168,095.89
应收证券清算款	-	-	-	1,730.82	1,730.82
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,264,670.8	-	222,000.00	332,408,682.	362,895,352.

	2			08	90
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,156,904.30	1,156,904.30
应付管理人报酬	-	-	-	148,965.45	148,965.45
应付托管费	-	-	-	44,689.61	44,689.61
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	17,407.90	17,407.90
应付交易费用	-	-	-	64,315.83	64,315.83
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	20,746.81	20,746.81
其他负债	-	-	-	1,028,014.31	1,028,014.31
负债总计	-	-	-	2,481,044.21	2,481,044.21
利率敏感度缺口	30,264,670.8 2	-	222,000.00	329,927,637. 87	360,414,308. 69

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-1,832.77	-20,667.35
2.市场利率平行下降25个基点	1,843.45	20,786.67	

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 80%以上的基金资产投资于股票(含存托凭证)；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%，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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	283,090,869.34	92.77	330,114,025.87	91.59
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	283,090,869.34	92.77	330,114,025.87	91.59

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，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。

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
	1.组合自身基准上升 5%	15,043,083.67	18,013,693.29
	2.组合自身基准下降 5%	-15,043,083.67	-18,013,693.29

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	283,090,869.34	91.92
	其中：股票	283,090,869.34	91.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,029,200.00	4.23
	其中：债券	13,029,200.00	4.23
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,337,610.95	3.36
8	其他资产	1,518,374.90	0.49
9	合计	307,976,055.19	100.00

注：通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 19,094,050.00 元，占基金资产净值的比例为 6.26%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,990,612.40	0.98
B	采矿业	1,060,935.00	0.35
C	制造业	178,470,861.87	58.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,808,716.39	1.25
E	建筑业	344,880.72	0.11
F	批发和零售业	3,310,670.06	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	4,728,177.00	1.55
H	住宿和餐饮业	560,829.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,988,331.93	3.27
J	金融业	48,710,558.74	15.96

K	房地产业	4,553,869.00	1.49
L	租赁和商务服务业	7,827,135.00	2.56
M	科学研究和技术服务业	5,978,036.75	1.96
N	水利、环境和公共设施管理业	202,072.18	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	300,816.00	0.10
Q	卫生和社会工作	7,813,861.30	2.56
R	文化、体育和娱乐业	1,691,436.00	0.55
S	综合	749,070.00	0.25
	合计	283,090,869.34	92.77

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	6,700	13,779,890.00	4.52
2	600036	招商银行	224,800	12,181,912.00	3.99
3	601318	中国平安	187,800	12,071,784.00	3.96
4	000858	五粮液	33,300	9,919,737.00	3.25
5	601012	隆基股份	77,000	6,840,680.00	2.24
6	000333	美的集团	93,815	6,695,576.55	2.19
7	601166	兴业银行	304,000	6,247,200.00	2.05
8	601888	中国中免	18,400	5,521,840.00	1.81
9	600276	恒瑞医药	77,946	5,297,989.62	1.74
10	300059	东方财富	153,380	5,029,330.20	1.65
11	000651	格力电器	91,900	4,787,990.00	1.57
12	603259	药明康德	29,640	4,641,327.60	1.52
13	600887	伊利股份	108,600	3,999,738.00	1.31
14	002594	比亚迪	15,800	3,965,800.00	1.30
15	002475	立讯精密	82,700	3,804,200.00	1.25
16	600900	长江电力	183,900	3,795,696.00	1.24
17	000001	平安银行	164,398	3,718,682.76	1.22
18	000725	京东方 A	541,700	3,380,208.00	1.11
19	600031	三一重工	114,600	3,331,422.00	1.09
20	600309	万华化学	28,600	3,112,252.00	1.02
21	000002	万科 A	130,500	3,107,205.00	1.02
22	300015	爱尔眼科	43,565	3,092,243.70	1.01
23	603288	海天味业	21,950	2,830,452.50	0.93
24	002714	牧原股份	44,820	2,725,952.40	0.89
25	603501	韦尔股份	8,300	2,672,600.00	0.88

26	601919	中远海控	82,800	2,528,712.00	0.83
27	002142	宁波银行	63,484	2,473,971.48	0.81
28	300124	汇川技术	32,000	2,376,320.00	0.78
29	002304	洋河股份	10,800	2,237,760.00	0.73
30	002230	科大讯飞	32,800	2,216,624.00	0.73
31	300014	亿纬锂能	20,900	2,172,137.00	0.71
32	300122	智飞生物	11,600	2,166,068.00	0.71
33	300274	阳光电源	18,100	2,082,586.00	0.68
34	600438	通威股份	46,200	1,999,074.00	0.66
35	600690	海尔智家	75,100	1,945,841.00	0.64
36	002241	歌尔股份	45,100	1,927,574.00	0.63
37	002027	分众传媒	201,000	1,891,410.00	0.62
38	300347	泰格医药	9,762	1,886,994.60	0.62
39	002460	赣锋锂业	15,200	1,840,568.00	0.60
40	603986	兆易创新	9,580	1,800,082.00	0.59
41	000100	TCL 科技	229,800	1,757,970.00	0.58
42	002709	天赐材料	16,360	1,743,648.80	0.57
43	600763	通策医疗	4,200	1,726,200.00	0.57
44	600585	海螺水泥	41,900	1,719,995.00	0.56
45	002271	东方雨虹	31,000	1,714,920.00	0.56
46	002812	恩捷股份	6,900	1,615,290.00	0.53
47	603799	华友钴业	13,900	1,587,380.00	0.52
48	600570	恒生电子	16,700	1,557,275.00	0.51
49	601601	中国太保	53,700	1,555,689.00	0.51
50	600660	福耀玻璃	27,200	1,519,120.00	0.50
51	000338	潍柴动力	83,900	1,499,293.00	0.49
52	600104	上汽集团	68,000	1,493,960.00	0.49
53	601211	国泰君安	85,600	1,467,184.00	0.48
54	000063	中兴通讯	43,700	1,452,151.00	0.48
55	600019	宝钢股份	168,900	1,290,396.00	0.42
56	002049	紫光国微	8,200	1,264,358.00	0.41
57	002410	广联达	17,961	1,224,940.20	0.40
58	002371	北方华创	4,100	1,137,258.00	0.37
59	600406	国电南瑞	46,920	1,090,420.80	0.36
60	000538	云南白药	9,300	1,076,196.00	0.35
61	601628	中国人寿	30,200	1,023,478.00	0.34
62	002821	凯莱英	2,500	931,500.00	0.31
63	600346	恒力石化	34,000	892,160.00	0.29
64	600460	士兰微	15,800	890,330.00	0.29
65	600426	华鲁恒升	28,650	886,717.50	0.29
66	300413	芒果超媒	12,800	878,080.00	0.29
67	600009	上海机场	17,700	851,901.00	0.28
68	300408	三环集团	20,000	848,400.00	0.28

69	300496	中科创达	5,400	848,124.00	0.28
70	300595	欧普康视	8,140	842,897.00	0.28
71	000157	中联重科	91,200	842,688.00	0.28
72	300012	华测检测	26,300	838,444.00	0.27
73	002050	三花智控	34,600	829,708.00	0.27
74	002179	中航光电	10,400	821,808.00	0.27
75	600111	北方稀土	39,700	821,790.00	0.27
76	603486	科沃斯	3,500	798,280.00	0.26
77	600089	特变电工	61,200	786,420.00	0.26
78	603882	金域医学	4,900	782,873.00	0.26
79	601901	方正证券	82,000	767,520.00	0.25
80	603369	今世缘	14,100	763,656.00	0.25
81	600143	金发科技	36,300	757,218.00	0.25
82	002601	龙佰集团	21,800	753,844.00	0.25
83	600132	重庆啤酒	3,800	752,210.00	0.25
84	000009	中国宝安	41,000	749,070.00	0.25
85	002001	新和成	26,000	745,680.00	0.24
86	601138	工业富联	58,900	730,949.00	0.24
87	601233	桐昆股份	30,200	727,518.00	0.24
88	600176	中国巨石	46,634	723,293.34	0.24
89	002007	华兰生物	19,500	715,260.00	0.23
90	300003	乐普医疗	22,100	709,852.00	0.23
91	600741	华域汽车	26,700	701,409.00	0.23
92	300285	国瓷材料	14,300	697,125.00	0.23
93	002236	大华股份	32,700	689,970.00	0.23
94	600600	青岛啤酒	5,900	682,335.00	0.22
95	000786	北新建材	17,300	679,025.00	0.22
96	601100	恒立液压	7,900	678,768.00	0.22
97	601877	正泰电器	20,000	667,600.00	0.22
98	002008	大族激光	16,400	662,396.00	0.22
99	300529	健帆生物	7,600	656,336.00	0.22
100	601336	新华保险	14,200	651,922.00	0.21
101	603806	福斯特	6,200	651,806.00	0.21
102	603345	安井食品	2,500	635,050.00	0.21
103	300207	欣旺达	19,100	621,896.00	0.20
104	600885	宏发股份	9,400	589,380.00	0.19
105	002202	金风科技	48,000	583,680.00	0.19
106	002624	完美世界	23,500	561,885.00	0.18
107	601799	星宇股份	2,400	541,728.00	0.18
108	603899	晨光文具	6,200	524,272.00	0.17
109	002555	三七互娱	21,700	521,234.00	0.17
110	000425	徐工机械	81,400	518,518.00	0.17
111	603589	口子窖	7,400	500,906.00	0.16

112	600029	南方航空	82,600	497,252.00	0.16
113	002648	卫星石化	12,520	490,658.80	0.16
114	300136	信维通信	15,700	484,816.00	0.16
115	002138	顺络电子	12,400	480,748.00	0.16
116	300144	宋城演艺	28,600	480,480.00	0.16
117	300146	汤臣倍健	14,600	480,340.00	0.16
118	600522	中天科技	46,600	466,000.00	0.15
119	600884	杉杉股份	19,800	461,736.00	0.15
120	002353	杰瑞股份	10,100	451,470.00	0.15
121	600704	物产中大	56,500	444,655.00	0.15
122	002223	鱼跃医疗	11,600	442,308.00	0.14
123	000636	风华高科	14,600	441,212.00	0.14
124	600872	中炬高新	10,300	432,806.00	0.14
125	600739	辽宁成大	20,600	428,686.00	0.14
126	300628	亿联网络	5,100	427,380.00	0.14
127	603444	吉比特	800	424,000.00	0.14
128	601607	上海医药	19,900	420,487.00	0.14
129	603737	三棵树	2,380	418,880.00	0.14
130	600392	盛和资源	24,000	416,640.00	0.14
131	002508	老板电器	8,900	413,850.00	0.14
132	601838	成都银行	32,600	412,064.00	0.14
133	603833	欧派家居	2,900	411,684.00	0.13
134	002444	巨星科技	12,000	408,960.00	0.13
135	601168	西部矿业	33,900	404,427.00	0.13
136	300676	华大基因	3,400	403,240.00	0.13
137	002030	达安基因	18,780	398,887.20	0.13
138	000860	顺鑫农业	9,300	392,274.00	0.13
139	600486	扬农化工	3,500	391,195.00	0.13
140	600699	均胜电子	14,800	377,696.00	0.12
141	688083	中望软件	718	376,289.44	0.12
142	002078	太阳纸业	28,000	373,800.00	0.12
143	000513	丽珠集团	7,400	370,148.00	0.12
144	000830	鲁西化工	19,700	368,981.00	0.12
145	000988	华工科技	15,600	366,912.00	0.12
146	600563	法拉电子	2,300	364,228.00	0.12
147	600332	白云山	10,700	362,195.00	0.12
148	000807	云铝股份	30,300	360,570.00	0.12
149	002212	天融信	18,200	359,814.00	0.12
150	002080	中材科技	13,600	355,912.00	0.12
151	002463	沪电股份	23,000	355,810.00	0.12
152	002600	领益智造	38,300	351,977.00	0.12
153	601865	福莱特	8,900	351,817.00	0.12
154	002511	中顺洁柔	12,700	349,885.00	0.11

155	002938	鹏鼎控股	9,700	348,036.00	0.11
156	600201	生物股份	19,800	345,510.00	0.11
157	600516	方大炭素	46,300	344,472.00	0.11
158	000039	中集集团	18,900	343,602.00	0.11
159	002916	深南电路	3,000	333,390.00	0.11
160	600066	宇通客车	26,500	330,985.00	0.11
161	600606	绿地控股	60,500	329,725.00	0.11
162	002028	思源电气	10,700	329,453.00	0.11
163	601997	贵阳银行	46,000	329,360.00	0.11
164	300244	迪安诊断	8,500	325,550.00	0.11
165	300001	特锐德	10,800	325,188.00	0.11
166	600754	锦江酒店	5,700	324,615.00	0.11
167	002603	以岭药业	11,100	323,676.00	0.11
168	600529	山东药玻	9,400	319,130.00	0.10
169	603605	珀莱雅	1,600	314,736.00	0.10
170	000825	太钢不锈	41,900	313,831.00	0.10
171	600867	通化东宝	25,400	303,276.00	0.10
172	002156	通富微电	12,600	302,904.00	0.10
173	603816	顾家家居	3,900	301,392.00	0.10
174	002607	中公教育	14,400	300,816.00	0.10
175	600171	上海贝岭	9,800	298,214.00	0.10
176	603156	养元饮品	10,400	297,232.00	0.10
177	601128	常熟银行	47,800	296,360.00	0.10
178	002092	中泰化学	28,700	294,749.00	0.10
179	300463	迈克生物	7,000	294,630.00	0.10
180	600380	健康元	21,000	288,330.00	0.09
181	600895	张江高科	15,500	283,185.00	0.09
182	002064	华峰化学	19,900	282,580.00	0.09
183	300296	利亚德	36,100	282,302.00	0.09
184	300482	万孚生物	4,290	277,520.10	0.09
185	000723	美锦能源	36,200	273,672.00	0.09
186	300630	普利制药	5,200	272,480.00	0.09
187	601866	中远海发	71,500	268,125.00	0.09
188	002572	索菲亚	11,000	266,200.00	0.09
189	000998	隆平高科	16,500	264,660.00	0.09
190	002920	德赛西威	2,400	264,192.00	0.09
191	601699	潞安环能	22,200	262,182.00	0.09
192	002690	美亚光电	4,700	262,072.00	0.09
193	600271	航天信息	19,900	259,297.00	0.08
194	002557	洽洽食品	6,000	258,600.00	0.08
195	603290	斯达半导	800	256,000.00	0.08
196	000012	南玻 A	24,800	253,952.00	0.08
197	300271	华宇软件	13,100	252,175.00	0.08

198	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.08
199	601615	明阳智能	15,500	250,945.00	0.08
200	300618	寒锐钴业	3,100	244,404.00	0.08
201	603195	公牛集团	1,200	242,400.00	0.08
202	600153	建发股份	29,900	242,190.00	0.08
203	002382	蓝帆医疗	11,600	241,860.00	0.08
204	600060	海信视像	14,300	241,670.00	0.08
205	300058	蓝色光标	39,100	236,555.00	0.08
206	603658	安图生物	3,120	236,402.40	0.08
207	600258	首旅酒店	9,900	236,214.00	0.08
208	600409	三友化工	23,000	232,530.00	0.08
209	600511	国药股份	7,000	231,420.00	0.08
210	600004	白云机场	20,500	229,190.00	0.08
211	601717	郑煤机	19,600	227,948.00	0.07
212	300418	昆仑万维	13,600	222,768.00	0.07
213	300223	北京君正	2,200	222,024.00	0.07
214	000932	华菱钢铁	33,500	221,100.00	0.07
215	600998	九州通	14,300	219,791.00	0.07
216	603338	浙江鼎力	3,700	217,153.00	0.07
217	603260	合盛硅业	2,800	215,348.00	0.07
218	688161	威高骨科	2,019	214,114.95	0.07
219	002595	豪迈科技	7,900	210,930.00	0.07
220	000581	威孚高科	10,100	210,383.00	0.07
221	002056	横店东磁	16,000	208,000.00	0.07
222	600325	华发股份	30,500	205,570.00	0.07
223	002831	裕同科技	6,900	204,861.00	0.07
224	600801	华新水泥	11,600	203,812.00	0.07
225	002408	齐翔腾达	16,400	203,688.00	0.07
226	002372	伟星新材	9,800	202,566.00	0.07
227	600808	马钢股份	46,700	200,343.00	0.07
228	000488	晨鸣纸业	24,400	198,616.00	0.07
229	600216	浙江医药	12,200	195,322.00	0.06
230	000999	华润三九	7,300	195,275.00	0.06
231	600755	厦门国贸	23,400	192,114.00	0.06
232	600039	四川路桥	30,200	189,354.00	0.06
233	603866	桃李面包	6,060	189,072.00	0.06
234	002745	木林森	14,100	188,940.00	0.06
235	002281	光迅科技	7,600	186,960.00	0.06
236	600141	兴发集团	9,900	186,417.00	0.06
237	603638	艾迪精密	4,340	186,055.80	0.06
238	002032	苏泊尔	2,900	184,991.00	0.06
239	603883	老百姓	3,400	179,112.00	0.06
240	600859	王府井	6,200	179,056.00	0.06

241	002925	盈趣科技	4,580	178,207.80	0.06
242	000778	新兴铸管	47,800	177,816.00	0.06
243	600398	海澜之家	24,531	177,604.44	0.06
244	002010	传化智联	23,000	177,330.00	0.06
245	603198	迎驾贡酒	4,000	177,200.00	0.06
246	601577	长沙银行	19,800	177,012.00	0.06
247	002048	宁波华翔	9,000	175,500.00	0.06
248	002563	森马服饰	14,200	169,690.00	0.06
249	002242	九阳股份	5,200	168,948.00	0.06
250	603225	新凤鸣	8,000	162,400.00	0.05
251	600782	新钢股份	28,700	160,146.00	0.05
252	300002	神州泰岳	32,800	159,080.00	0.05
253	002701	奥瑞金	30,800	158,312.00	0.05
254	000528	柳工	19,300	158,260.00	0.05
255	002266	浙富控股	31,000	154,690.00	0.05
256	600064	南京高科	16,400	152,356.00	0.05
257	002867	周大生	7,700	152,229.00	0.05
258	002128	露天煤业	14,400	149,904.00	0.05
259	000930	中粮科技	16,500	148,665.00	0.05
260	600260	凯乐科技	16,600	147,408.00	0.05
261	000400	许继电气	11,600	146,856.00	0.05
262	600985	淮北矿业	12,000	146,520.00	0.05
263	600273	嘉化能源	16,800	146,160.00	0.05
264	600507	方大特钢	21,400	145,092.00	0.05
265	002110	三钢闽光	20,800	140,192.00	0.05
266	000089	深圳机场	17,900	139,083.00	0.05
267	600376	首开股份	24,800	138,880.00	0.05
268	603228	景旺电子	5,200	136,240.00	0.04
269	600120	浙江东方	30,240	129,427.20	0.04
270	000090	天健集团	23,000	127,190.00	0.04
271	600266	城建发展	26,600	126,084.00	0.04
272	601598	中国外运	24,100	121,705.00	0.04
273	600373	中文传媒	12,100	119,306.00	0.04
274	600006	东风汽车	16,200	118,260.00	0.04
275	300459	金科文化	35,500	114,665.00	0.04
276	002440	闰土股份	12,800	113,280.00	0.04
277	600643	爱建集团	16,200	113,076.00	0.04
278	601098	中南传媒	12,800	112,896.00	0.04
279	603893	瑞芯微	800	111,568.00	0.04
280	600835	上海机电	6,500	105,625.00	0.03
281	002244	滨江集团	25,100	105,169.00	0.03
282	000501	鄂武商 A	8,900	104,130.00	0.03
283	600729	重庆百货	3,700	101,565.00	0.03

284	601928	凤凰传媒	14,100	100,674.00	0.03
285	600648	外高桥	6,800	100,504.00	0.03
286	600968	海油发展	37,800	97,902.00	0.03
287	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.03
288	000028	国药一致	2,500	94,600.00	0.03
289	600566	济川药业	5,200	93,080.00	0.03
290	600787	中储股份	17,300	92,209.00	0.03
291	603355	莱克电气	1,400	87,122.00	0.03
292	000062	深圳华强	5,100	86,241.00	0.03
293	600623	华谊集团	9,400	82,814.00	0.03
294	000959	首钢股份	14,200	79,804.00	0.03
295	000869	张裕 A	2,100	77,994.00	0.03
296	600466	蓝光发展	25,700	75,815.00	0.02
297	300919	中伟股份	430	70,090.00	0.02
298	603515	欧普照明	2,500	64,175.00	0.02
299	603786	科博达	800	60,400.00	0.02
300	002901	大博医疗	800	58,312.00	0.02
301	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
302	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
303	601003	柳钢股份	9,100	53,690.00	0.02
304	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
305	601869	长飞光纤	1,700	41,412.00	0.01
306	603868	飞科电器	900	37,854.00	0.01
307	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
308	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.01
309	300981	中红医疗	316	30,450.72	0.01
310	601512	中新集团	3,000	29,880.00	0.01
311	002423	中粮资本	3,300	29,865.00	0.01
312	300953	震裕科技	294	29,847.30	0.01
313	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
314	300941	创识科技	489	24,552.06	0.01
315	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
316	301009	可靠股份	807	22,541.97	0.01
317	300937	药易购	334	18,057.04	0.01
318	300982	苏文电能	370	17,322.28	0.01
319	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
320	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.01
321	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00
322	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.00
323	300996	普联软件	310	14,068.34	0.00
324	301013	利和兴	504	13,986.51	0.00
325	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
326	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.00

327	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
328	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
329	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
330	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
331	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
332	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
333	300958	建工修复	393	10,879.74	0.00
334	300948	冠中生态	380	10,503.04	0.00
335	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00
336	300993	玉马遮阳	497	10,079.55	0.00
337	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
338	300961	深水海纳	436	9,727.10	0.00
339	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
340	300985	致远新能	345	8,763.45	0.00
341	300978	东箭科技	630	8,741.53	0.00
342	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
343	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
344	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
345	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
346	300992	泰福泵业	298	6,885.42	0.00
347	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
348	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
349	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
350	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
351	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
352	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
353	300998	宁波方正	203	4,347.24	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	600036	招商银行	13,040,402.00	3.62
2	000858	五粮液	11,314,455.13	3.14
3	601888	中国中免	6,886,276.00	1.91
4	601012	隆基股份	6,584,826.00	1.83
5	000651	格力电器	5,657,998.95	1.57
6	600031	三一重工	5,491,124.47	1.52

7	600887	伊利股份	5,210,706.87	1.45
8	300059	东方财富	4,983,873.60	1.38
9	603259	药明康德	4,648,360.40	1.29
10	002594	比亚迪	4,119,505.00	1.14
11	600309	万华化学	3,980,661.50	1.10
12	000002	万科A	3,925,297.20	1.09
13	600900	长江电力	3,758,798.50	1.04
14	603288	海天味业	3,607,279.66	1.00
15	000725	京东方A	3,545,772.00	0.98
16	300015	爱尔眼科	3,008,655.64	0.83
17	601318	中国平安	2,803,178.00	0.78
18	600690	海尔智家	2,661,067.00	0.74
19	000661	长春高新	2,567,681.00	0.71
20	002027	分众传媒	2,504,844.00	0.69

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	600030	中信证券	14,053,505.96	3.90
2	601166	兴业银行	13,675,967.81	3.79
3	600276	恒瑞医药	12,767,158.00	3.54
4	000001	平安银行	11,929,876.78	3.31
5	601899	紫金矿业	11,831,667.03	3.28
6	002714	牧原股份	11,253,421.00	3.12
7	002475	立讯精密	9,803,278.40	2.72
8	000333	美的集团	8,721,448.00	2.42
9	600809	山西汾酒	8,260,466.00	2.29
10	300124	汇川技术	6,933,038.32	1.92
11	002304	洋河股份	6,791,125.00	1.88
12	600519	贵州茅台	6,142,505.90	1.70
13	000063	中兴通讯	5,992,411.00	1.66
14	002142	宁波银行	5,887,337.50	1.63
15	300122	智飞生物	5,781,183.96	1.60
16	002460	赣锋锂业	5,555,036.00	1.54
17	600999	招商证券	5,516,453.00	1.53
18	300347	泰格医药	5,444,890.00	1.51
19	002230	科大讯飞	4,413,451.50	1.22
20	601211	国泰君安	4,364,083.61	1.21

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	265,659,021.33
卖出股票收入（成交）总额	322,753,452.41

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	13,000,000.00	4.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	29,200.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,029,200.00	4.27

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019640	20 国债 10	130,000	13,000,000.00	4.26
2	127038	国微转债	198	19,800.00	0.01
3	123117	健帆转债	94	9,400.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2109	IF2109	5	7,749,600.00	129,960.00	-
公允价值变动总额合计（元）					129,960.00
股指期货投资本期收益（元）					772,568.90
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-549,068.57

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除兴业银行（证券代码 601166）、招商银行（证券代码 600036）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、兴业银行（证券代码 601166）

兴业银行 2020 年 9 月 11 日公告称，因为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定、为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性、违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性等原因，中国人民银行福州中心支行对公司给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

2、招商银行（证券代码 600036）

招商银行 2021 年 5 月 21 日公告称，为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司罚款 7170 万元。

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

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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	956,125.26
2	应收证券清算款	36,788.52
3	应收股利	39,650.00
4	应收利息	275,725.27
5	应收申购款	210,085.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,518,374.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600036	招商银行	1,083,800.00	0.36	转融通融出

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
大数据 300A 级	35,952	4,405.65	21,653.55	0.01%	158,370,350.27	99.99%
大数据 300C 级	29,235	992.05	-	-	29,002,516.42	100.00%
合计	65,187	2,874.72	21,653.55	0.01%	187,372,866.69	99.99%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	大数据 300A 级	158.03	0.0001%
	大数据 300C 级	52,335.25	0.1805%
	合计	52,493.28	0.0280%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大数据 300A 级	0
	大数据 300C 级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大数据 300A 级	0
	大数据 300C 级	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大数据 300A 级	大数据 300C 级
基金合同生效日(2015 年 6 月 24 日)基金份额总额	1,874,441,043.18	240,559,049.56
本报告期期初基金份额总额	194,097,519.43	34,329,193.75
本报告期基金总申购份额	19,242,226.67	8,713,936.62
减：报告期基金总赎回份额	54,947,742.28	14,040,613.95
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	158,392,003.82	29,002,516.42

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长病逝缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

本基金本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	295,104,079.58	50.61%	121,376.70	80.82%	-
华泰证券	1	288,014,916.36	49.39%	28,801.72	19.18%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
申万宏源	332,752.59	29.22%	-	-	-	-
华泰证券	806,159.10	70.78%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于北京恒宇天泽基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-07
2	南方基金关于旗下部分基金增加招商银行招赢通为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-15
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-25
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-19
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
11	南方基金关于旗下部分基金增加东方财富证券为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会	2021-03-26

		会基金电子披露网站	
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金修订基金合同有关条款的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
14	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
15	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
21	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
22	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21
23	南方基金管理股份有限公司关于北京加和基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-08
24	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11
25	南方基金管理股份有限公司关于大河财富基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
26	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	上海证券报、基金管	2021-06-25

	关联方承销证券的关联交易公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
--	----------------	--------------------	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方大数据 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方大数据 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方大数据 300 指数证券投资基金 2021 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>