南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方创新经济灵活配置混合
交易代码	001053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月24日
报告期末基金份额总额	2,191,600,200.45份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金、货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

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"南方创新经济"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-412,106,181.48
2.本期利润	-384,046,095.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1656
4.期末基金资产净值	1,759,355,723.99
5.期末基金份额净值	0.803

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损益。

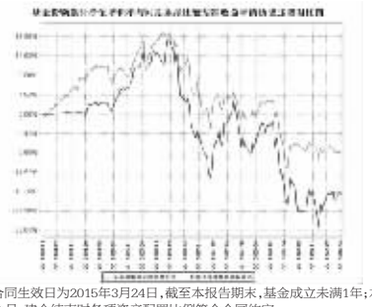
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值增长率①	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	-16.09%	3.17%	-16.99%	2.01%	0.90%	1.16%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金的基金合同生效日为2015年3月24日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本基金合同生效之日起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜冬松	本基金基金经理	2015年3月24日	-	13年	第三军医大学医学硕士,具有基金从业资格。曾担任天津272医院外科主治医师、深圳健安医药市场部部长、中新药业成药分公司学术推广部部长;2002年4月至2008年8月,历任平安证券研究所研究员、医药行业首席研究员、行业部副总经理。2008年9月加入南方基金,任研究部医药行业首席研究员和消费组组长;2012年3月至2015年4月,任南方消费基金经理;2013年7月至今,任南方高端装备(原食品饮料)基金经理;2014年1月至今,任南方医保基金经理;2015年3月至今,任南方创新经济的基金经理。
章晖	本基金基金经理	2015年6月19日	-	6年	北京大学西方经济学硕士,具有基金从业资格、金融分析师(CFA)资格,2009年7月加入南方基金,担任研究部研究员、高级研究员;2014年2月至2015年5月,任南方新优享基金经理助理;2015年5月至今,任南方新优享基金经理;2015年6月至今,任南方创新经济基金经理。

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《南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次,其中2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,2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度制造业景气程度仍然低迷,工业经济继续回落。国际金融市场和大宗商品价格波动性上升,跨市场跨地区相互影响,风险隐患增多,当前资金流出势头仍未稳定。食品价格和大宗商品价格纷纷回落,通缩正重新成为物价主要风险,这也意味着宽松货币政策仍有加码空间。

三季度A股市场大幅下跌,各种风格指数差异并不明显,其中沪深300指数下跌28.39%,中证500指数下跌31.24%,创业板指数下跌27.14%。行业方面,银行、旅游、医药行业表现出一定的防御性,钢铁、有色、煤炭等行业跌幅超过40%。

三季度创新经济基金抓住了七月中旬的反弹行情,但没能及时撤出,未能很好的为投资者规避风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年三季度,本基金净值增长-16.09%,同期业绩比较基准增长-16.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度经济,我们认为随着汽车和地产相关刺激政策的出台,四季度经济有望短暂企稳,但中长期角度来看,改革与创新才是长期趋势。

我们认为四季度市场信心将有所恢复,仍然战略看好新经济。个股选择方面偏好估值合理的白马成长和短期超跌、代表转型方向的新兴产业龙头公司。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,262,679,060.73	71.09
	其中:股票	1,262,679,060.73	71.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	499,991,714.57	28.15
8	其他资产	13,429,737.11	0.76
9	合计	1,776,100,512.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	13,683,600.00	0.78
B	采矿业	162.37	0.00
C	制造业	945,749,205.04	53.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,971,866.80	1.31
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	38,936,149.96	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	18,265,685.88	1.04
H	住宿和餐饮业	27,684,120.00	1.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,661,882.00	2.03
J	金融业	17,240,535.00	0.98
K	房地产业	46,546,064.00	2.65
L	租赁和商务服务业	21,198,870.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	38,972,966.15	2.22
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	35,767,953.53	2.03
S	综合	-	-
	合计	1,262,679,060.73	71.77

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002450	康得新	1,864,558	56,477,461.82	3.21
2	002415	海康威视	1,601,168	52,166,053.44	2.97
3	002020	京新药业	1,842,449	48,824,898.50	2.78
4	000018	中冠A	1,839,802	45,995,050.00	2.61
5	002236	大华股份	1,245,046	42,095,005.26	2.39
6	002573	清新环境	2,210,605	38,972,966.15	2.22
7	603108	润达医疗	571,414	38,936,149.96	2.21
8	300101	振芯科技	1,733,078	37,607,792.60	2.14
9	300063	天龙集团	1,049,254	37,248,517.00	2.12
10	300367	东方网力	658,395	37,113,726.15	2.11

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除海通证券(600837)外,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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,184,864.46
2	应收证券清算款	8,766,008.88
3	应收股利	-
4	应收利息	98,751.96
5	应收申购款	380,111.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,429,737.11

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中不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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,824,328,314.85
报告期期间基金总申购份额	77,678,183.15
减:报告期期间基金总赎回份额	710,406,297.55
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,191,600,200.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	11,222,222.22
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,222,222.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.51

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年7月7日	11,222,222.22	10,000,000.00	-
合计			11,222,222.22	10,000,000.00	

注:申购金额为1000万元时,申购费率按每笔1000元收取。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同

2、南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金2015年3季度报告原文

8.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦31-33层

8.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方大数据300指数证券投资基金

【2015】第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月27日

§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。

基金托管人中国建行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方大数据300指数	
场内简称	大数据300	
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	
报告期末基金份额总额	1,979,468,850.39份	
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。	
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	
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	1,767,429,966.97份	212,038,883.42份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	
	大数据300A	大数据300C
1. 本期已实现收益	-56,923,579.52	-7,380,835.55
2. 本期利润	-382,072,654.33	-49,330,256.95
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2053	-0.2082
4. 期末基金资产净值	1,408,701,850.35	168,882,603.04
5. 期末基金份额净值	0.797/0	0.7965

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、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 本报告期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

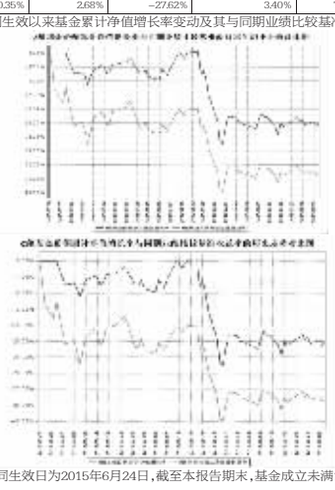
大数据300A

阶段	净值增长率①	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	-20.30%	2.68%	-27.62%	3.40%	7.32%	-0.72%

大数据300C

阶段	净值增长率①	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	-20.35%	2.68%	-27.62%	3.40%	7.27%	-0.72%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金的基金合同生效日为2015年6月24日,截至本报告期末,基金成立未满1 年,建仓期6个月尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	7年	北京大学工学硕士,具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金,历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员;2014年12月至今,任南方恒生ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500原材料ETF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,任南方国企改革、南方高铁、南方策略优化、大数据300、南方500信息、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指数证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次,其中2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,2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,A市场经历了一波很大的调整。根据市场的调整情况,本基金的建仓操作采取了相对谨慎的策略。严格根据实际的成分股分布进行逐步建仓,与同期成立的股票型指数基金相比,基金建仓效果显著,相对业绩基准获得了明显的超额收益。

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0.7970元;C级份额净值为0.7965元。

报告期内,本基金A级份额净值增长率为-20.30%,同期业绩基准增长率为-27.62%;C级份额净值增长率为-20.35%,同期业绩基准增长率为-27.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看,经过两轮大幅下跌,上证指数已跌破年线,跌至3000点附近,将今年以来指数涨幅和整体投资者收益全部抹掉。展望四季度,A股市场去泡沫已经比较彻底,除了一部分小盘股和题材股估值泡沫仍然偏高,部分蓝筹股已经跌出价值,预计四季度仍有一定的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,358,246,175.25	85.72
	其中:股票	1,358,246,175.25	85.72
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	223,419,621.28	14.10
7	其他资产	2,804,780.58	0.18
8	合计	1,584,470,577.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,392,375.00	0.09
B	采矿业	16,128,928.00	1.02
C	制造业	433,433,348.31	27.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,499,535.59	1.30
E	建筑业	145,859,380.56	9.25
F	批发和零售业	25,936,706.65	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	73,633,297.17	4.67
H	住宿和餐饮业	3,233,965.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,906,361.72	1.64
J	金融业	518,852,299.69	32.89
K	房地产业	25,237,190.00	1.60
L	租赁和商务服务业	20,142,687.38	1.28
M	科学研究和技术服务业	2,226,048.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	4,232,203.18	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,739,176.16	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	39,051,703.84	2.48
S	综合	740,979.00	0.05
	合计	1,358,246,175.25	86.10

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,334,353	69,703,780.58	4.42
2	600000	浦发银行	4,034,787	67,098,507.81	4.25
3	601166	兴业银行	4,107,533	59,805,680.48	3.79
4	600030	中信证券	2,921,200	39,669,896.00	2.51
5	600837	海通证券	2,910,414	37,107,778.50	2.35
6	601668	中国建筑	5,622,600	32,498,628.00	2.06
7	601169	北京银行	3,706,364	31,911,794.04	2.02
8	601288	农业银行	9,534,977	28,890,980.31	1.83
9	601601	中国太保	1,133,357	25,149,191.83	1.59
10	601390	中国中铁	2,218,893	24,274,689.42	1.54

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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
IF1510	IF1510	11	10,313,820.00	-56,460.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-56,460.00
股指期货投资本期收益(元)					3,310,260.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-56,460.00

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除海通证券(600837)外,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。根据2015年8月25日海通证券股份有限公司(下称海通证券,股票代码:600837)《海通证券股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》,海通证券于2015年8月24日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(津证调查字【2015011】号)。因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对海通证券进行立案调查。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,538,897.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	62,731.90
5	应收申购款	203,150.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,804,780.58

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大数据300A	大数据300C
报告期期初基金份额总额	1,874,441,043.18	240,559,049.56
报告期期间基金总申购份额	3,281,188.89	720,261.88
减:报告期期间基金总赎回份额	110,292,265.10	29,240,428.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,767,429,966.97	212,038,883.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

-

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《南方大数据300指数证券投资基金基金合同》

2、《南方大数据300指数证券投资基金托管协议》

3、南方大数据300指数证券投资基金2015年第3季度报告原文。

8.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦31-33层

8.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方大数据100指数证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年07月01日起至2015年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方大数据100指数
交易代码	001113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月24日
报告期末基金份额总额	8,520,868,177.36份
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100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。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,174,129,660.42
2.本期利润	-2,727,626,902.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3091
4.期末基金资产净值	6,228,319,010.14
5.期末基金份额净值	0.7309

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、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 本报告期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

阶段	净值增长率①	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	-27.91%	4.31%	-29.26%	3.93%	1.35%	0.38%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:本基金的基金合同生效日为2015年4月24日,截至本报告期末,基金成立未满1 年,建仓期6个月尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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4月24日	-	7年	北京大学工学硕士,具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金,历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员;2014年12月至今,任南方恒生ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500原材料ETF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,任南方国企改革、南方高铁、南方策略优化、大数据300、南方500信息、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"