(上接B66版)

75	万银财富（北京）基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内 办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08 法定代表人:李招弟 联系人:付少帅 电话:010-59497361 传真:010-64788105 客服电话:400-059-8888 网址:www.wy-fund.com
76	和讯信息科技有限公司	注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人:王利 联系人:张紫薇 电话:0755-82021122 传真:0755-82020055 客服电话:4009200022 网址:licaike.hexun.com
77	宜信普泽投资顾问（北京）有限公司	注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809 法定代表人:沈伟峰 联系人:王巨明 电话:010-52855713 传真:010-85894285 客服电话:4006099200 网址:www.yixinfund.com
78	浙江金观诚财富管理有限公司	注册地址:杭州市拱墅区登云路45号（6楼大厦）1幢10楼1001室 办公地址:杭州市拱墅区登云路43号金诚集团（6楼大厦）h3楼 法人:徐黎云 联系人:宋舒岚 电话:0571-88337888 传真:0571-88337666 客服电话:400-068-0058 网址:www.jincheng-fund.com
79	泛华普益基金销售有限公司	注册地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 办公地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 法定代表人:于海锋 联系人:邓勤 电话:13981713068 传真:028-82000996-805 客服电话:400-8588588 网址:http://www.pyfund.cn
80	嘉实财富管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 法定代表人:赵学军 联系人:梁琪 电话:021-20289890 传真:021-20280110 客服电话:400-021-8850 网址:www.harvestwm.cn
81	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层 法定代表人:杨鹏 联系人:张燕 电话:010-83363099 传真:010-83363072 客服电话:400-166-1188 网址:https s:8.jrj.com.cn
82	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人:梁越 联系人:赵鹏程 电话:010-56810780 传真:010-57756199 客服电话:400-788-8868-5 网址:www.chtfund.com
83	北京钱景财富投资管理有限公司	注册地址:北京市海淀区丰慧中路7幢9层1008-1012 办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 法定代表人:赵荣春 联系人:高静 电话:010-59158281 传真:010-57569671 客服电话:400-893-6885 网址:www.qianjing.com
84	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 法定代表人:梁睿 联系人:张旭 电话:010-66154828 传真:010-88067526 客服电话:400-6262-818 网址:www.5irich.com
85	海银基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元 办公地址:上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场16楼 法定代表人:刘惠 联系人:刘艳妮 电话:021-80133827 传真:021-80133413 客服电话:400-808-1016 网址:www.fundhaiyin.com
86	上海联泰资产管理有限公司	注册地址:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室 办公地址:上海市长宁区金钟路968号2号楼B座6楼 法定代表人:燕斌 联系人:汤蕾 电话:021-51507071 传真:021-62990063 客服电话:4000-466-788 网址:http/www.66money.com
87	北京增财基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区南礼士路66号建成大厦1208 办公地址:北京市西城区南礼士路66号建成大厦1208 法定代表人:罗增安 联系人:史丽丽 电话:010-67000988-6028 传真:010-67000988-6000 客服电话:010-67000988 网址:www.zcvc.com.cn
88	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼 法定代表人:沈微伟 联系人:赵沛然 电话:021-50583533 传真:021-50583633 客服电话:4000676266 网址:www.leadfund.com.cn
89	上海汇付金融服务有限公司	注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层 办公地址:上海市黄浦区中山南路100号19层 法定代表人:冯修敏 联系人:周丹 电话:021-33323999 传真:021-33323993 客服电话:400-820-2819 网址:https s://fty.chinapnr.com
90	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	注册地址:厦门市思明区envi江道2号第一广场1501-1504 办公地址:厦门市思明区envi江道2号第一广场1501-1504 法定代表人:陈洪生 联系人:李智磊 电话:0592-3122716 传真:0592-3122701 客服电话:0592-3122679 网址:www.xds.com.cn
91	中信建投期货有限公司	注册地址:重庆 办公地址:渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B、名义层11-A、8-B4、9-B4 法定代表人:彭文德 联系人:万宏 电话:021-68762007 传真:021-68763048 客服电话:400-8877-780 网址:www.cfc108.com
92	上海陆金所资产管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼9单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人:郭坚 联系人:宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址:www.lufunds.com
93	中经北证（北京）资产管理有限公司	注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层 办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层 法定代表人:徐福星 联系人:李美 电话:18810595051 传真:010-88381550 客服电话:010-69292940 网址:www.bjfunds.com
94	中信期货有限公司	注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 法定代表人:张皓 联系人:洪波 电话:0755-23953913 传真:0755-83217421 客服电话:400-990-8826 网址:http s://www.citicsf.com
95	北京乐融多源投资咨询有限公司	注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室 法定代表人:董浩 联系人:张婷婷 电话:18510480202 客服电话:400-068-1176 网址:www.jimufund.com
96	北京新浪仓石基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室 办公地址:北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室 法定代表人:张琪 联系人:付文红 电话:010-62675369 客服电话:010-82244185 网址:http s://www.xincai.com
97	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔B1201-1203室 法定代表人:肖雪 联系人:吴楚杰 电话:020-89689099 传真:020-89629011 客服电话:020-89629066 网址:www.yingmi.cn
98	深圳富济财富管理有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室 法定代表人:齐小贺 联系人:熊秀军 电话:0755-83999907-806 传真:0755-83999926 客服电话:0755-83999913 网址:www.jinqianwo.cn
99	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 法定代表人:陈继武 联系人:李晓明 电话:021-63333319 传真:021-63332523 客服电话:4000178000 网址:www.lingxianfund.com
100	大泰金石投资管理有限公司	注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室 办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼 法定代表人:袁顺刚 联系人:何延宇 电话:13917225742 传真:021-22268089 客服电话:400-928-2266021-22267995 网址:www.dfunds.com
101	济安财富（北京）资本管理有限公司	注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室 办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座46层 济安财富 法定代表人:杨健 联系人:付志恒 电话:010-65309516-802 传真:010-65330699 客服电话:400-075-6663 网址:http s://www.jianfortune.com

3.2登记机构

南方基金管理有限公司

住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层

法定代表人:吴万善

电话：0755 82763849

传真：0755 82763889

联系人:古和鹏

3.3出具法律意见书的律师事务所

上海市通力律师事务所

注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

联系人:黎明

电话：021）3135 8666

传真：021）3135 8600

经办律师:黎明、孙睿

3.4审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

联系电话：021 23238888

传真:(021)23238800

联系人:陈燕

经办注册会计师:薛竞、陈慕

§4基金名称

南方大数据300指数证券投资基金

§5基金的类型

股票型证券投资基金

§6基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求与此指数收益率相似的回报。

§7基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金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(但需符合中国证监会的相关规定)

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:

本基金80%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于标的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%

§8基金的投资策略

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。

(一)投资策略原理

南方大数据300指数基金是跟踪大数据300指数的普通指数基金。大数据300指数为策略指数,对样本空间的股票,按照财务因子得分、市场驱动因子得分和大数据因子得分进行模型优化,然后将计算的综合得分从高到低排序,选取排名在前300名的股票构成大数据300指数初始样本股。具体来看,财务因子主要包括最新市净率PB、市盈率PE、净资产收益率ROE、年度营业收入同比增长率、年度净利润同比增长率,剔除PE、ROE排名靠后的股票、剔除营业收入同比增长为负和年度净利润同比增长为负的股票;计算净利润的一致预期变化率和一致预期的PEG(市盈率相对盈利增长比率)得分作为财务一致预期指标得分,通过因子模型计算上述得分作为财务因子总得分。市场驱动因子主要包括最近一个月股票换手率、波动率、价格变化率、流动性因子,通过量化因子模型计算得分作为市场驱动因子的总得分。大数据因子主要包括根据新浪财经频道下的股票页面访问热度计算单个股票的热度得分,根据财经频道下的新闻报道正负面影响计算单个股票新闻报道得分,根据股票在微博上的正负面文章影响计算单个股票微博得分,综合上述得分并根据历史回测优化结果作为大数据得分。最后,在指数编制方案约定的规则下进行调整与等权重计算,最终确定指数成份股与权重。南方大数据300指数基金则通过复制法进行被动式指数化投资,紧密跟踪大数据300指数。若将来大数据300指数编制方案发生调整,届时将根据调整后方案更新招募说明书中相关内容。

(二)资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将主要投资于标的指数成份股及备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法,按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下,本基金将配合使用比化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。

(三)股票投资策略

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。

1.股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。特殊情况下,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

2.股票投资组合的调整

(1)定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

(2)不定期调整

1）当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整;

2）根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

3）特殊情况下,如本基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

上述特殊情况包括但不限于以下情形:①法律法规的限制;②标的指数成份股长期停牌;③标的指数成份股流动性严重不足;④成份股上市公司存在重大违规行为,有可能面临重大的处罚或诉讼。

(四)债券投资策略

在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。

(五)权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(六)股指期货等投资策略

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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

(六)资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模,并进行分散投资,以降低流动性风险。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

§9基金业绩比较基准

1.本基金的标的指数:大数据300指数,及其未来可能发生的变更。

大数据300指数由深圳证券信息有限公司与南方基金管理有限公司、北京新浪互联信息服务有限公司联合编制,是基于财经媒体与社交平台挖掘投资情绪并应用于指数选样的策略指数。大数据300指数通过对财经领域的“大数据”进行定性与定量分析,同时考量股票基本面与市场驱动情况,精选出综合排名靠前的300只股票组成指数样本股。根据合作方签署的合作协议及其补充协议,南方基金管理有限公司有权收取指数使用许可费总额的三分之一。北京新浪互联信息服务有限公司在大数据300指数的合作中负责大数据原始数据的提供,提供了如网页点击量、小股页面点击率、个股新闻点击率、个股新闻微博提及率等互联网数据;南方基金负责原始数据(包括互联网数据、财务数据、市场驱动数据)的整理和加工,研究策略模型和确定编制指数的策略;深圳证券信息有限公司负责具体指数编制和指数点位计算、发布等日常运维工作。

如果指数编制单位变更或停止大数据300指数的编制、发布或授权,或大数据300指数由其他指数替代,或由于指数编制方法的重大变更等事项导致大数据300指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,变更本基金的标的指数。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更不涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则无需召开基金份额持有人大会,在报中国证监会备案后及时公告。

2.本基金业绩比较基准:

大数据300指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%

若本基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更而由此引起的业绩比较基准的变更,则基金管理人应就变更标的指数及业绩比较基准召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案并在指定媒介公告。若标的指数变更不涉及本基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等)而由此引起的业绩比较基准的变更,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

§10基金的风险收益特征

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。

§11基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日(未经审计)。

1.1 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

1.2 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	16,128,926.00	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	3,233,955.00	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

1.3 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

1.4 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。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和拟益明细

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

1.9.2 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。

1.10 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。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

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》(编证调查字[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。基金管理人对上述投票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

1.11.2

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。

1.11.3 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

1.11.4 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。

1.11.5 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。

§12基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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
2015.6.24-2015.9.30	-20.30%	2.58%	-33.31%	3.52%	13.01%	-0.94%
自基金成立至今	-20.30%	2.58%	-33.31%	3.52%	13.01%	-0.94%

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
2015.6.24-2015.9.30	-20.35%	2.58%	-33.31%	3.52%	12.96%	-0.94%
自基金成立至今	-20.35%	2.58%	-33.31%	3.52%	12.96%	-0.94%

§13基金的费用概览

13.1与基金运作有关的费用

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费;

4、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

5、《基金合同》项下与基金相关的信息披露费用;

6、《基金合同》项下与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金的证券、期货交易费用;

9、基金的银行汇划费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、指数使用许可费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法从基金财产中支付指数使用许可费。指数使用许可费的计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日计提的指数使用许可费

E为前一日的资产净值

自基金成立的下一季度(自然季度)起,指数使用许可费收取下限为每季度(自然季度)5万元,即不足5万元时按照5万元收取。基金成立日所在季度,若按规模计提的指数使用许可费超过5万元,则按实际天数计提;若按规模计提的指数使用许可费不足5万元,则:

当季指数使用许可费=50,000元×基金当季存续天数÷当季天数。

指数使用许可费每日计算,逐日累计,按季度支付。基金管理人应于每个季度(自然季度)结束后10个工作日内与标的指数许可方结算该季度的指数使用费。

如果指数使用许可协议约定的指数使用许可费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

4、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.4%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第5-10项费用”,根据有关法规、招募说明书及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、托管费率、销售服务费,无需召开基金份额持有人大会。除根据法律法规要求提高该等费用或调低费率标准以外,提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

13.2与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金A类基金份额收取申购费用,C类基金份额不收取申购费用。

申购本基金A类基金份额的投资人,其申购费率最高不高于1.2%,且随申购金额的增加而递减,如下表所示:

申购金额（M）	申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<300万	0.8%
300万≤M<500万	0.4%
M≥500万	每笔1,000元

投资人重复申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费用

本基金A、类基金份额、C类基金份额在投资人赎回时收取赎回费。

(1)A类基金份额赎回费用

A类基金份额赎回费率最高不超过0.5%,随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示(其中1年指365天):

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.25%
N≥2年	0

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(2)C类基金份额赎回费用

C类基金份额赎回费率最高不超过1.5%,随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示(其中1年指365天):

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<7日	1.5%
7日≤N<30日	0.75%
30日≤N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.25%
N≥2年	0

对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费,赎回费用全额归入基金财产;对于持有期长于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费,赎回费用75%归入基金财产;对于持有期长于3个月但小于6个月的基金份额所收取的赎回费,赎回费用50%归入基金财产;对于持有期长于6个月的基金份额所收取的赎回费,赎回费用25%归入基金财产。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

4、基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下,对基金销售费用实行一定的优惠,费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

§14对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“重要提示”部分,对“重要提示”进行了更新。

2、在“基金管理人”部分,对“主要人员情况”进行了更新。

3、在“基金托管人”部分,对“基金托管人”进行了更新。

4、在“相关服务机构”部分,对“销售机构”进行了更新,对“审计基金财产的会计师事务所”进行了更新。

5