南方大数据300指数证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年09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：2026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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 2026 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
报告期末基金份额总额	242,198,806.85 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	南方基金管理股份有限公司	
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	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C
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	147,184,401.31 份	95,014,405.54 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（2026 年 7 月 1 日－2026 年 9 月 30 日）	
	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C
1.本期已实现收益	9,718,729.65	5,140,407.55
2.本期利润	53,476,131.99	23,578,920.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.3618	0.3573
4.期末基金资产净值	318,572,754.95	197,036,391.70
5.期末基金份额净值	2.1644	2.0738

注：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；

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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

南方大数据 300 指数 A

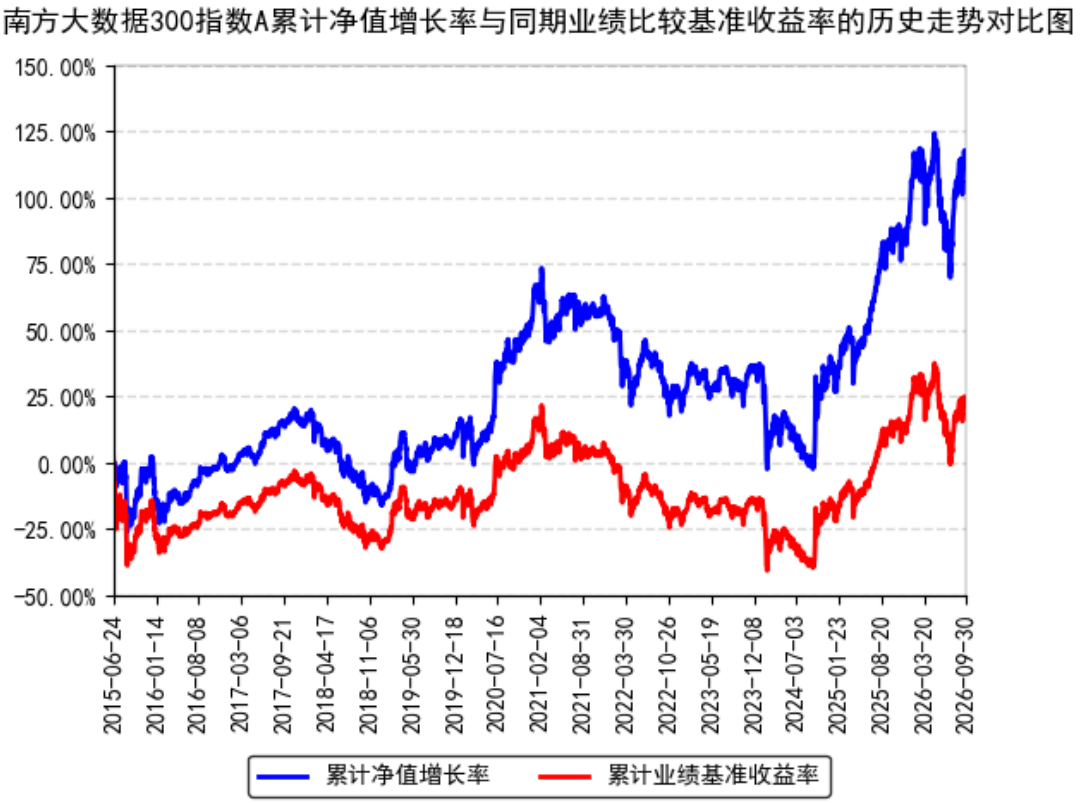
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	20.06%	1.68%	11.93%	1.69%	8.13%	-0.01%
过去六个月	6.46%	1.61%	0.13%	1.59%	6.33%	0.02%
过去一年	15.74%	1.52%	8.08%	1.52%	7.66%	0.00%
过去三年	65.83%	1.62%	50.11%	1.70%	15.72%	-0.08%
过去五年	38.80%	1.43%	20.15%	1.49%	18.65%	-0.06%

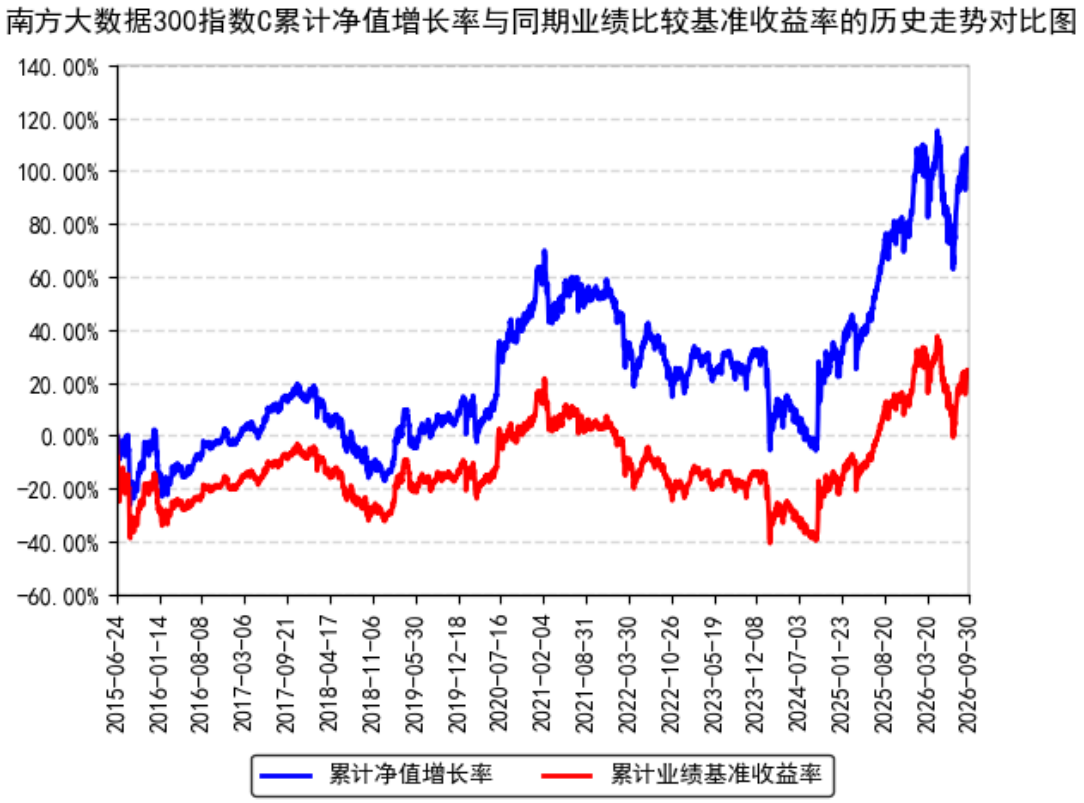
过去七年	105.64%	1.39%	49.69%	1.43%	55.95%	-0.04%
过去十年	123.80%	1.29%	54.95%	1.32%	68.85%	-0.03%
自基金合同生效起至今	116.44%	1.36%	24.02%	1.43%	92.42%	-0.07%

南方大数据 300 指数 C

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	19.94%	1.68%	11.93%	1.69%	8.01%	-0.01%
过去六个月	6.26%	1.61%	0.13%	1.59%	6.13%	0.02%
过去一年	15.28%	1.52%	8.08%	1.52%	7.20%	0.00%
过去三年	63.86%	1.62%	50.11%	1.70%	13.75%	-0.08%
过去五年	36.06%	1.43%	20.15%	1.49%	15.91%	-0.06%
过去七年	99.98%	1.38%	49.69%	1.43%	50.29%	-0.05%
过去十年	115.19%	1.29%	54.95%	1.32%	60.24%	-0.03%
自基金合同生效起至今	107.38%	1.36%	24.02%	1.43%	83.36%	-0.07%

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





§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		
解锐	本基金基金经理	2022 年 2 月 18 日	-	9 年	中国国籍，清华大学金融专业硕士，具有基金从业资格。2017 年 7 月加入南方基金，任数量化投资部量化研究员；2020 年 8 月 10 日至 2022 年 2 月 18 日，任投资经理；2022 年 2 月 18 日至今，任南方沪深 300 增强、大数据 300 基金经理；2024 年 12 月 6 日至今，任南方大数据 100 指数基金经理；2025 年 9 月 9 日至今，任南方中证 A500 指数增强基金经理；2026 年 9 月 14 日至今，任南方乾元稳健添利债券基金经理。

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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金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》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，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利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。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8次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度A股整体震荡调整，指数表现分化明显。创业板指、中证500、中证1000、沪深300分别下跌27.80%、17.67%、17.15%和12.49%。指数层面看，大盘股相对抗跌，科技成长调整幅度更大，防御风格相对占优。行业层面，煤炭、石油石化、农林牧渔涨幅居前，分别录得19.29%、15.32%、15.10%；电子、通信、建筑材料表现较弱，分别录得-32.65%、-28.72%、-26.10%。本季度行业分化主要体现为前期科技主线降温，能源与农业板块相对走强。海外利率上行压制高估值板块，叠加前期获利盘兑现，AI硬件及相关上游材料方向调整明显。国内需求修复偏慢，也使市场对盈利兑现更加谨慎。另一方面，地缘局势加剧能源供应担忧，部分行业供给收缩和养殖产能去化预期也受到关注，带动资金重新评估能源与农业板块的盈利前景。部分能源企业的高股息属性进一步增强了其在调整行情中的吸引力。

本基金主要采用被动投资方法投资于大数据300成分股，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。期间我们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。

4.5 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2.1644元，报告期内，份额净值增长率为20.06%，同期业绩基准增长率为11.93%；本基金C份额净值为2.0738元，报告期内，份额净值增长率为19.94%，同期业绩基准增长率为11.93%。

4.6 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 投资组合报告

5.1 报告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	465,009,752.75	89.67
	其中：股票	465,009,752.75	89.67
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	49,537,325.97	9.55
8	其他资产	4,014,156.81	0.77
9	合计	518,561,235.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	35,310.75	0.01
C	制造业	388,488,648.68	75.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,688,275.52	2.27
E	建筑业	4,586,362.40	0.89

F	批发和零售业	11,459,115.00	2.22
G	交通运输、仓储和邮政业	6,944,638.72	1.35
H	住宿和餐饮业	2,285,157.00	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,569,461.68	0.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,723,412.00	0.92
L	租赁和商务服务业	2,285,010.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	16,209,083.00	3.14
N	水利、环境和公共设施管理业	11,410,438.00	2.21
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	2,324,840.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	465,009,752.75	90.19

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	603949	雪龙集团	155,500	2,862,755.00	0.56
2	603073	彩蝶实业	126,700	2,645,496.00	0.51
3	002813	路畅科技	99,700	2,630,086.00	0.51
4	001318	阳光乳业	198,800	2,592,352.00	0.50
5	603948	建业股份	119,600	2,554,656.00	0.50
6	300717	华信新材	118,900	2,473,120.00	0.48
7	300824	北鼎股份	296,800	2,427,824.00	0.47
8	000020	深华发A	169,000	2,413,320.00	0.47
9	300960	通业科技	124,100	2,401,335.00	0.47
10	603511	爱慕股份	184,100	2,393,300.00	0.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

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

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

无。

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

无。

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

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

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库。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（如有）没有超出基金合同约定的备选股票库，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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	62,958.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,951,198.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,014,156.81

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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	002813	路畅科技	2,630,086.00	0.51	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方大数据300指数A	南方大数据300指数C
报告期期初基金份额总额	151,211,385.75	44,987,714.52
报告期期间基金总申购份额	7,816,034.42	68,115,741.64
减：报告期期间基金总赎回份额	11,843,018.86	18,089,050.62
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	147,184,401.31	95,014,405.54

§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

本报告期末，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

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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2026年3季度报告原文。

9.2 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。

9.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com