

大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券
投资基金
2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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的情况.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金	
基金简称	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数	
基金主代码	002236	
交易代码	002236	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	132,593,488.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中证 360 互联网 A	中证 360 互联网 C
下属分级基金的交易代码:	002236	003359
报告期末下属分级基金的份额总额	126,959,335.80 份	5,634,152.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5% 以内，年跟踪误差控制在 6% 以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，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。
业绩比较基准	中证 360 互联网+大数据 100 指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场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		大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	郭明
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	层	
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	刘卓	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§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

基金级别	中证 360 互联网 A	中证 360 互联网 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,849,785.17	-219,528.03
本期利润	-8,090,608.25	-516,481.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0769	-0.1500
本期加权平均净值利润率	-6.61%	-13.32%
本期基金份额净值增长率	-6.32%	-7.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	14,237,922.98	621,675.24
期末可供分配基金份额利润	0.1121	0.1103
期末基金资产净值	141,197,258.78	6,255,827.51
期末基金份额净值	1.112	1.110
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	11.20%	-7.04%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人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。

4. 根据我公司 2017 年 1 月 18 日《关于大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金增加 C 类份额并相应修订基金合同的公告》，自 2017 年 1 月 18 日起，大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金增加收取销售服务费的 C 类份额。C 类份额自 2017 年 2 月 21 日起有份额。

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

中证 360 互联网 A

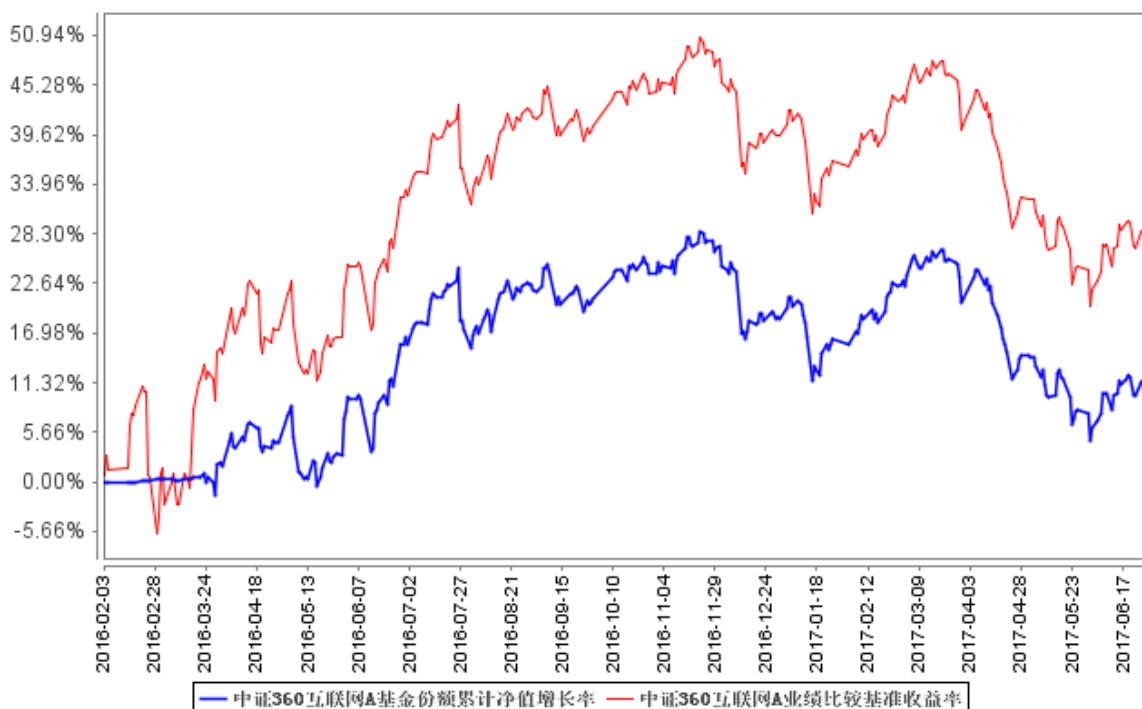
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	----------	----------	--------------	-----	-----

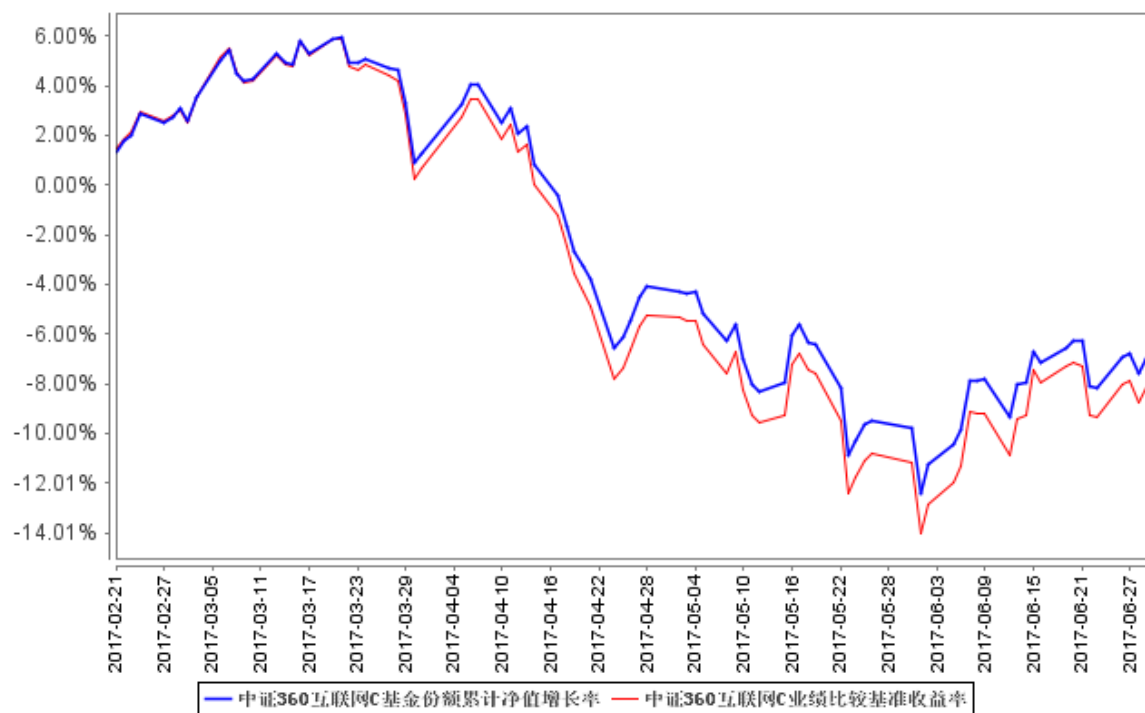
		准差②	率③	④		
过去一个月	3.06%	1.21%	3.55%	1.36%	-0.49%	-0.15%
过去三个月	-8.02%	1.16%	-8.63%	1.28%	0.61%	-0.12%
过去六个月	-6.32%	1.09%	-7.83%	1.18%	1.51%	-0.09%
过去一年	-4.55%	1.07%	-3.59%	1.15%	-0.96%	-0.08%
自基金合同生效起至今	11.20%	1.15%	28.57%	1.59%	-17.37%	-0.44%

中证 360 互联网 C

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	3.06%	1.20%	3.55%	1.36%	-0.49%	-0.16%
过去三个月	-8.19%	1.16%	-8.63%	1.28%	0.44%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-7.04%	1.06%	-8.04%	1.16%	1.00%	-0.10%

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





注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§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

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 5 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金，4 只 QDII 基金及 74 只开放式证券投资基金。

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		
夏高先生	本基金基金经理	2016 年 2 月 3 日	-	6 年	工学博士。2011 年 1 月至 2012 年 5 月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，历任数量投资部高级数量分析师及基金经理助理。2014 年 12 月 6 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016 年 2 月 3 日起担任大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21 日起担任大成智惠量化多策略灵活配置混合型

					证券投资基金基金经理。 具有基金从业资格。国籍： 中国
--	--	--	--	--	-----------------------------------

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 4 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与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股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 6 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

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

今年一季度之初，市场延续了去年底的震荡下行走势。一月中旬开始，市场开始反弹，特别是低估值、高分红的蓝筹股表现优秀。进入三月份，随着美联储加息的预期升温以及最终落地，A 股市场进入了震荡盘整的阶段；板块表现也产生分化，蓝筹股表现稳健，成长股出现一定的回撤。进入二季度，市场在雄安新区公布的刺激下短暂冲高之后，开始快速下跌。五月中旬之后，

大盘蓝筹股和绩优股率先止跌企稳并反弹。进入六月份，中小盘股票也见底回升。六月中旬，美联储再次加息，符合市场预期；中国央行继续保持稳健中性的货币政策，确保流动性平稳，有利于资本市场的稳定。MSCI 宣布 A 股将纳入其新兴市场指数，这将进一步推动 A 股的国际化，有利于中国资本市场的持续健康发展。在上半年，上证指数上涨 2.86%，沪深 300 指数上涨 10.78%，中证 360 互联网+大数据 100 指数下跌 8.27%。

在本报告期内，本基金严格按照中证 360 互联网+大数据 100 指数的成分及其权重构建投资组合，较好地跟踪了基准指数。基金年化跟踪误差为 1.93%，日均偏离度为 0.012%，各项指标均符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中证 360 互联网 A 基金份额净值为 1.112 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.32%，同期业绩比较基准收益率为-7.83%；截至本报告期末中证 360 互联网 C 基金份额净值为 1.110 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.04%，同期业绩比较基准收益率为-8.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年下半年，政府将进一步加强宏观调控，出台更有力度稳增长措施，稳中推进各项改革，继续坚持积极的财政政策和稳健中性的货币政策，努力促进经济持续健康发展。预计美元还会有至少一次加息，但人民币汇率将保持平稳，这将有利于金融市场的稳定。监管机构进一步加强监管，坚持新股发行常态化，有利于资本市场的长远健康发展。我们认为在诸多因素的作用下，下半年的 A 股市场值得投资者关注。

本基金将坚持被动型、全复制的指数化投资理念，严格按照基准指数的成分及其权重构建投资组合，继续深入研究更加高效的交易策略和风险控制方法，积极应对大额、频繁申购、赎回及其他突发事件的影响，以期更好地跟踪基准指数，力争将跟踪误差控制在更低的水平，为投资者提供专业化服务。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、社保基金及机构投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境

发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种/在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金的管理人——大成基金管理有限公司在大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金半年度报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	8,918,750.48	5,730,122.65
结算备付金		2,795,639.50	2,833,064.25
存出保证金		274,415.61	27,533.05
交易性金融资产	6.4.3.2	134,404,981.96	106,802,312.56
其中：股票投资		134,404,981.96	106,802,312.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	1,652.78	1,449.75
应收股利		-	-
应收申购款		1,965,597.49	466,793.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		148,361,037.82	115,861,275.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		414,326.23	284,831.32
应付管理人报酬		88,481.55	77,646.26
应付托管费		11,060.20	9,705.79
应付销售服务费		2,984.51	-
应付交易费用	6.4.3.7	195,777.34	167,319.29
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	195,321.70	181,102.21
负债合计		907,951.53	720,604.87
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	132,593,488.07	96,978,724.22
未分配利润	6.4.3.10	14,859,598.22	18,161,946.82
所有者权益合计		147,453,086.29	115,140,671.04
负债和所有者权益总计		148,361,037.82	115,861,275.91

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，大成中证 360 互联网 A 类基金份额净值 1.112 元，大成中证 360 互联网 C 类基金份额净值 1.110 元，基金份额总额 132,593,488.07 份，其中大成中证 360 互联网 A 类基金份额 126,959,335.80 份，大成中证 360 互联网 C 类基金份额 5,634,152.27 份。

6.2 利润表

会计主体：大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 2 月 3 日(基金 合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-7,216,153.32	10,907,493.86
1.利息收入		30,743.46	359,296.50
其中：存款利息收入	6.4.3.11	30,743.46	102,250.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	257,046.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-781,644.56	5,209,757.08
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-1,303,887.29	4,821,123.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	153,120.00	146,120.00
股利收益	6.4.3.16	369,122.73	242,513.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-6,537,776.60	4,956,523.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	72,524.38	381,917.06
减：二、费用		1,390,936.48	830,083.71
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	495,373.56	333,258.84
2. 托管费	6.4.6.2.2	61,921.68	41,657.35
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	8,368.44	-
4. 交易费用	6.4.3.19	580,526.09	271,949.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	244,746.71	183,217.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,607,089.80	10,077,410.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,607,089.80	10,077,410.15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	96,978,724.22	18,161,946.82	115,140,671.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,607,089.80	-8,607,089.80
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）	35,614,763.85	5,304,741.20	40,919,505.05
其中：1.基金申购款	82,639,248.48	13,570,211.09	96,209,459.57
2.基金赎回款	-47,024,484.63	-8,265,469.89	-55,289,954.52
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)	132,593,488.07	14,859,598.22	147,453,086.29
项目	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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)	326,561,401.84	-	326,561,401.84
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	10,077,410.15	10,077,410.15
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)	-274,187,414.10	-1,449,274.86	-275,636,688.96
其中：1.基金申购款	28,545,297.77	1,348,172.63	29,893,470.40
2.基金赎回款	-302,732,711.87	-2,797,447.49	-305,530,159.36
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)	52,373,987.74	8,628,135.29	61,002,123.03

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：

 罗登攀 周立新 崔伟
 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 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 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税

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

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	8,918,750.48
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,918,750.48

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	144,849,846.02	134,404,981.96	-10,444,864.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	144,849,846.02	134,404,981.96	-10,444,864.06

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 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	1,191,960.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	1,191,960.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 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投资产生的持仓损益，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 2017 年 6 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
IC1707	IC1707	1	1,220,600.00	28,640.00
总额合计			1,220,600.00	28,640.00
减：可抵销期货暂收款				28,640.00
股指期货投资净额				-

6.4.3.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,499.87
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	145.53
应收债券利息	-
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	-
其他	7.38
合计	1,652.78

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	195,777.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	195,777.34

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,511.77
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	143,809.93
合计	195,321.70

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

中证 360 互联网 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,978,724.22	96,978,724.22
本期申购	73,702,658.56	73,702,658.56
本期赎回(以“-”号填列)	-43,722,046.98	-43,722,046.98
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	126,959,335.80	126,959,335.80

金额单位：人民币元

中证 360 互联网 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	8,936,589.92	8,936,589.92
本期赎回(以“-”号填列)	-3,302,437.65	-3,302,437.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,634,152.27	5,634,152.27

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

中证 360 互联网 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,698,843.63	-5,109,418.80	14,589,424.83
本期利润	-1,849,785.17	-6,240,823.08	-8,090,608.25
本期基金份额交易产生的变动数	6,218,832.53	-2,052,248.12	4,166,584.41

其中：基金申购款	15,460,958.24	-3,440,632.96	12,020,325.28
基金赎回款	-9,242,125.71	1,388,384.84	-7,853,740.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,067,890.99	-13,402,490.00	10,665,400.99

单位：人民币元

中证 360 互联网 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-219,528.03	-296,953.52	-516,481.55
本期基金份额交易产生的变动数	1,277,382.19	-139,225.40	1,138,156.79
其中：基金申购款	1,995,763.44	-445,877.63	1,549,885.81
基金赎回款	-718,381.25	306,652.23	-411,729.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,057,854.16	-436,178.92	621,675.24

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,800.43
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	2,789.10
其他	153.93
合计	30,743.46

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	181,726,914.96
减：卖出股票成本总额	183,030,802.25
买卖股票差价收入	-1,303,887.29

6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	153,120.00

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	369,122.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	369,122.73

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,566,416.60
——股票投资	-6,566,416.60
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	28,640.00
合计	-6,537,776.60

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	70,667.06
转换费收入	1,857.32
合计	72,524.38

注：赎回费率随投资人持有基金份额期限的增加而递减，其中不低于 25% 的部分归入基金财产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	579,141.23
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	1,384.86
合计	580,526.09

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	119,014.74
银行划款手续费	936.78
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	244,746.71

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（自然季度）人民币 50,000.00 元。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.4.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系**6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易**

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交易。

6.4.6.2 关联方报酬**6.4.6.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	495,373.56	333,258.84
其中：支付销售机构的客户维护费	196,216.11	100,740.42

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	61,921.68	41,657.35

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.6.2.3 销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.6% 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：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额对应的资产净值} \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

本基金本报告期无当期发生的应支付关联方的销售服务费。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.6.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 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
中国工商银行	8,918,750.48	27,800.43	2,901,679.80	75,404.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配事项。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
--------	------	-----------------	----------------	--------	------	------	-----	----------	----------	---

6.4.8.2 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
300209	天泽信息	2017 年 2 月 10 日	临时停牌	27.72	-	-	45,600	1,122,823.11	1,264,032.00	-
600460	士兰微	2017 年 5 月 12 日	临时停牌	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	202,400	1,253,879.72	1,228,568.00	-
002264	新华都	2017 年 5 月 10 日	临时停牌	8.40	-	-	138,300	1,388,169.50	1,161,720.00	-
300089	文化长城	2017 年 4 月 19 日	临时停牌	14.93	-	-	75,500	1,211,471.33	1,127,215.00	-
002076	雪莱特	2017 年 3 月 20 日	临时停牌	7.07	-	-	157,200	1,114,979.55	1,111,404.00	-
300462	华铭智能	2017 年 4 月 21 日	临时停牌	36.83	-	-	29,739	968,880.93	1,095,287.37	-
600734	实达集团	2017 年 4 月 5 日	临时停牌	12.75	2017 年 7 月 12 日	12.00	83,800	1,147,824.11	1,068,450.00	-

002654	万润科技	2017年5月10日	临时停牌	9.28	-	-	109,967	1,396,827.15	1,020,493.76	-
300322	硕贝德	2017年2月23日	临时停牌	17.02	2017年8月7日	15.32	57,300	1,056,098.30	975,246.00	-

注：本基金截至本报告期末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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(董事会合规审计和风险控制委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审计和风险控制委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

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。

6.4.9.2 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行中国工商银行，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，违约风险可能性很小。

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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有债券投资(上年度末：同)。

6.4.9.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，

可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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和结算备付金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017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	8,918,750.48	-	-	-	8,918,750.48
结算备付金	2,795,639.50	-	-	-	2,795,639.50
存出保证金	18,089.61	-	-	256,326.00	274,415.61
交易性金融资产	-	-	-	134,404,981.96	134,404,981.96
应收利息	-	-	-	1,652.78	1,652.78
应收申购款	1,915.52	-	-	1,963,681.97	1,965,597.49
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,734,395.11	-	-	136,626,642.71	148,361,037.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	28,640.00	28,640.00
应付赎回款	-	-	-	414,326.23	414,326.23
应付管理人报酬	-	-	-	88,481.55	88,481.55
应付托管费	-	-	-	11,060.20	11,060.20

应付销售服务费	-	-	-	2,984.51	2,984.51
应付交易费用	-	-	-	195,777.34	195,777.34
其他负债	-	-	-	166,681.70	166,681.70
负债总计	-	-	-	907,951.53	907,951.53
利率敏感度缺口	11,734,395.11	-	-	135,718,691.18	147,453,086.29
上年度末 2016 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	5,730,122.65	-	-	-	5,730,122.65
结算备付金	2,833,064.25	-	-	-	2,833,064.25
存出保证金	27,533.05	-	-	-	27,533.05
交易性金融资产	-	-	-	106,802,312.56	106,802,312.56
应收利息	-	-	-	1,449.75	1,449.75
应收申购款	2,288.26	-	-	464,505.39	466,793.65
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,593,008.21	-	-	107,268,267.70	115,861,275.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	284,831.32	284,831.32
应付管理人报酬	-	-	-	77,646.26	77,646.26
应付托管费	-	-	-	9,705.79	9,705.79
应付交易费用	-	-	-	167,319.29	167,319.29
其他负债	-	-	-	181,102.21	181,102.21
负债总计	-	-	-	720,604.87	720,604.87
利率敏感度缺口	8,593,008.21	-	-	106,547,662.83	115,140,671.04

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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的股票，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。

本基金采用被动式指数化投资方法，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或成份股发生配股、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，力求降低跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产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%。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	134,404,981.96	91.15	106,802,312.56	92.76
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	134,404,981.96	91.15	106,802,312.56	92.76

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	6,780,000.00	2,930,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%	-6,780,000.00	-2,930,000.00	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§7 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	134,404,981.96	90.59
	其中：股票	134,404,981.96	90.59
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	11,714,389.98	7.90
7	其他各项资产	2,241,665.88	1.51
8	合计	148,361,037.82	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	82,990,830.01	56.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,820,772.90	5.98
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,047,195.24	19.70
J	金融业	2,461,821.50	1.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,370,632.00	1.61
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	7,425,413.00	5.04
S	综合	1,214,208.00	0.82
	合计	134,330,872.65	91.10

7.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	66,469.69	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	74,109.31	0.05

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002530	金财互联	46,500	1,369,890.00	0.93
2	600180	瑞茂通	96,700	1,357,668.00	0.92
3	002388	新亚制程	126,100	1,354,314.00	0.92
4	300264	佳创视讯	152,000	1,343,680.00	0.91
5	603999	读者传媒	60,100	1,341,432.00	0.91
6	603703	盛洋科技	74,400	1,336,968.00	0.91
7	300128	锦富技术	158,400	1,330,560.00	0.90
8	300184	力源信息	105,900	1,317,396.00	0.89
9	600619	海立股份	121,080	1,317,350.40	0.89
10	000823	超声电子	91,300	1,316,546.00	0.89
11	300241	瑞丰光电	102,895	1,314,998.10	0.89
12	603311	金海环境	65,100	1,303,953.00	0.88
13	300282	汇冠股份	61,600	1,299,760.00	0.88
14	600345	长江通信	62,700	1,292,247.00	0.88
15	300130	新国都	68,400	1,292,076.00	0.88
16	300242	明家联合	135,800	1,288,742.00	0.87
17	002235	安妮股份	105,600	1,288,320.00	0.87
18	002090	金智科技	54,200	1,287,250.00	0.87
19	600088	中视传媒	73,100	1,280,712.00	0.87
20	300366	创意信息	76,400	1,280,464.00	0.87
21	002380	科远股份	69,400	1,280,430.00	0.87
22	002445	中南文化	99,400	1,277,290.00	0.87
23	300494	盛天网络	54,826	1,271,414.94	0.86
24	300223	北京君正	52,200	1,271,070.00	0.86
25	600728	佳都科技	164,220	1,271,062.80	0.86
26	000521	美菱电器	198,500	1,270,400.00	0.86
27	600203	福日电子	151,300	1,269,407.00	0.86
28	300272	开能环保	125,580	1,264,590.60	0.86
29	300209	天泽信息	45,600	1,264,032.00	0.86
30	002615	哈尔斯	110,950	1,253,735.00	0.85
31	300277	海联讯	144,600	1,253,682.00	0.85
32	300302	同有科技	69,600	1,253,496.00	0.85

33	300365	恒华科技	35,100	1,253,070.00	0.85
34	000404	华意压缩	159,200	1,252,904.00	0.85
35	000779	三毛派神	89,410	1,250,845.90	0.85
36	300102	乾照光电	146,000	1,246,840.00	0.85
37	601999	出版传媒	136,700	1,246,704.00	0.85
38	600363	联创光电	88,900	1,245,489.00	0.84
39	002416	爱施德	115,410	1,245,273.90	0.84
40	002425	凯撒文化	135,940	1,242,491.60	0.84
41	000851	高鸿股份	136,200	1,238,058.00	0.84
42	002660	茂硕电源	129,400	1,234,476.00	0.84
43	300046	台基股份	66,000	1,234,200.00	0.84
44	002670	国盛金控	77,565	1,233,283.50	0.84
45	600237	铜峰电子	205,600	1,231,544.00	0.84
46	600081	东风科技	98,913	1,231,466.85	0.84
47	000701	厦门信达	98,500	1,231,250.00	0.84
48	600460	士兰微	202,400	1,228,568.00	0.83
49	600599	熊猫金控	49,900	1,228,538.00	0.83
50	002079	苏州固锴	166,502	1,227,119.74	0.83
51	300227	光韵达	56,500	1,225,485.00	0.83
52	600229	城市传媒	130,600	1,223,722.00	0.83
53	600206	有研新材	140,700	1,221,276.00	0.83
54	002290	中科新材	74,400	1,220,904.00	0.83
55	000948	南天信息	100,400	1,220,864.00	0.83
56	002093	国脉科技	138,700	1,220,560.00	0.83
57	002463	沪电股份	268,200	1,220,310.00	0.83
58	000802	北京文化	83,800	1,220,128.00	0.83
59	002403	爱仕达	92,573	1,220,112.14	0.83
60	600288	大恒科技	115,000	1,219,000.00	0.83
61	002181	粤传媒	225,200	1,218,332.00	0.83
62	002527	新时达	114,600	1,218,198.00	0.83
63	300050	世纪鼎利	120,800	1,216,456.00	0.82
64	000733	振华科技	76,400	1,214,760.00	0.82
65	000609	绵石投资	81,600	1,214,208.00	0.82
66	002266	浙富控股	248,800	1,214,144.00	0.82
67	300167	迪威视讯	103,400	1,213,916.00	0.82
68	002546	新联电子	203,900	1,213,205.00	0.82
69	002106	莱宝高科	119,571	1,211,254.23	0.82
70	002119	康强电子	70,500	1,211,190.00	0.82
71	300079	数码视讯	206,700	1,209,195.00	0.82

72	300074	华平股份	177,000	1,208,910.00	0.82
73	600105	永鼎股份	149,800	1,208,886.00	0.82
74	300042	朗科科技	33,000	1,204,500.00	0.82
75	300468	四方精创	26,900	1,199,471.00	0.81
76	002587	奥拓电子	159,050	1,199,237.00	0.81
77	300390	天华超净	130,600	1,197,602.00	0.81
78	002315	焦点科技	48,000	1,197,120.00	0.81
79	603996	中新科技	69,900	1,195,290.00	0.81
80	300339	润和软件	94,700	1,193,220.00	0.81
81	300353	东土科技	92,400	1,190,112.00	0.81
82	300349	金卡智能	42,600	1,189,392.00	0.81
83	002052	同洲电子	187,400	1,188,116.00	0.81
84	300247	乐金健康	178,300	1,187,478.00	0.81
85	300010	立思辰	91,600	1,186,220.00	0.80
86	300493	润欣科技	91,500	1,181,265.00	0.80
87	300047	天源迪科	93,600	1,180,296.00	0.80
88	002296	辉煌科技	109,400	1,179,332.00	0.80
89	300177	中海达	103,400	1,175,658.00	0.80
90	603688	石英股份	101,900	1,174,907.00	0.80
91	300139	晓程科技	112,000	1,174,880.00	0.80
92	300356	光一科技	134,700	1,173,237.00	0.80
93	002247	帝龙文化	88,800	1,165,056.00	0.79
94	002264	新华都	138,300	1,161,720.00	0.79
95	002599	盛通股份	79,054	1,161,303.26	0.79
96	300162	雷曼股份	109,700	1,155,141.00	0.78
97	300031	宝通科技	62,700	1,153,053.00	0.78
98	300063	天龙集团	138,000	1,152,300.00	0.78
99	300025	华星创业	145,800	1,147,446.00	0.78
100	601599	鹿港文化	180,700	1,131,182.00	0.77
101	300089	文化长城	75,500	1,127,215.00	0.76
102	002564	天沃科技	122,300	1,116,599.00	0.76
103	002502	骅威文化	118,500	1,112,715.00	0.75
104	002076	雪莱特	157,200	1,111,404.00	0.75
105	300377	赢时胜	96,350	1,097,426.50	0.74
106	300462	华铭智能	29,739	1,095,287.37	0.74
107	600734	实达集团	83,800	1,068,450.00	0.72
108	002654	万润科技	109,967	1,020,493.76	0.69
109	300322	硕贝德	57,300	975,246.00	0.66
110	300275	梅安森	49,600	951,328.00	0.65

111	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
112	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
2	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
3	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
4	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
5	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01

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	300356	光一科技	3,483,443.84	3.03
2	002296	辉煌科技	2,392,797.98	2.08
3	300493	润欣科技	2,360,440.00	2.05
4	002235	安妮股份	2,315,199.82	2.01
5	002660	茂硕电源	2,309,746.00	2.01
6	300494	盛天网络	2,272,845.75	1.97
7	002315	焦点科技	2,231,713.00	1.94
8	002369	卓翼科技	1,926,287.44	1.67
9	600203	福日电子	1,724,494.96	1.50
10	002380	科远股份	1,679,817.71	1.46
11	300130	新国都	1,650,955.02	1.43
12	000404	华意压缩	1,625,036.00	1.41
13	300264	佳创视讯	1,624,847.60	1.41
14	300242	明家联合	1,600,860.26	1.39
15	002416	爱施德	1,594,074.10	1.38
16	603996	中新科技	1,592,159.00	1.38
17	300223	北京君正	1,581,141.00	1.37

18	600599	熊猫金控	1,576,110.00	1.37
19	300349	金卡智能	1,565,906.75	1.36
20	002502	骅威文化	1,565,385.82	1.36

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（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	002369	卓翼科技	2,777,777.68	2.41
2	600729	重庆百货	2,537,242.39	2.20
3	300356	光一科技	2,407,324.42	2.09
4	002188	巴士在线	2,341,937.00	2.03
5	300036	超图软件	2,322,705.00	2.02
6	300256	星星科技	2,276,945.00	1.98
7	300246	宝莱特	2,256,925.00	1.96
8	300028	金亚科技	2,215,668.00	1.92
9	300303	聚飞光电	2,212,252.00	1.92
10	002579	中京电子	2,171,330.96	1.89
11	300229	拓尔思	2,139,877.00	1.86
12	600757	长江传媒	2,075,558.60	1.80
13	002131	利欧股份	2,066,688.29	1.79
14	002341	新纶科技	1,995,583.00	1.73
15	000921	海信科龙	1,888,406.04	1.64
16	600892	大晟文化	1,676,971.00	1.46
17	002148	北纬通信	1,602,188.80	1.39
18	300075	数字政通	1,562,684.00	1.36
19	002388	新亚制程	1,500,827.86	1.30
20	300323	华灿光电	1,495,131.00	1.30

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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	217,199,888.25
卖出股票收入（成交）总额	181,726,914.96

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

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

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
IC1707	IC1707	1	1,220,600.00	28,640.00	-
公允价值变动总额合计(元)					28,640.00
股指期货投资本期收益(元)					153,120.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					28,640.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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
1	存出保证金	274,415.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,652.78
5	应收申购款	1,965,597.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,241,665.88

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**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

1	002879	长缆科技	23,660.26	0.02	新股锁定
2	002882	金龙羽	18,389.20	0.01	新股锁定
3	300670	大烨智能	13,760.87	0.01	新股锁定
4	300672	国科微	10,659.36	0.01	新股锁定
5	300671	富满电子	7,639.62	0.01	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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
中证 360 互联网 A	9,871	12,861.85	8,295,115.46	6.53%	118,664,220.34	93.47%
中证 360 互联网 C	792	7,113.83	-	0.00%	5,634,152.27	100.00%
合计	10,663	12,434.91	8,295,115.46	6.26%	124,298,372.61	93.74%

注：1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

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	中证 360 互联网 A	638,188.71	0.5027%
	中证 360 互联网 C	-	-
	合计	638,188.71	0.4813%

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，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）。

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的情况

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中证 360 互联网 A	10~50
	中证 360 互联网 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开	中证 360 互联网 A	0

开放式基金	中证 360 互联网 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中证 360 互联网 A	中证 360 互联网 C
基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）基金份额总额	326,561,401.84	-
本报告期期初基金份额总额	96,978,724.22	-
本报告期基金总申购份额	73,702,658.56	8,936,589.92
减：本报告期基金总赎回份额	43,722,046.98	3,302,437.65
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	126,959,335.80	5,634,152.27

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履行职务的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到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	323,887,863.71	81.50%	295,159.86	81.50%	-
长江证券	1	47,967,863.42	12.07%	43,713.03	12.07%	-
中信证券	1	25,552,038.51	6.43%	23,285.68	6.43%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

华创证券	1	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：根据中国证监会颁布的《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，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内本基金新增交易单元：东方证券、长江证券。

本报告期内本基金退租交易单元：无。

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

无。

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	关于大成中证 360 互联网大数据 100 指数证券投资基金增加广州证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 2 日
2	关于大成中证 360 互联网大数据 100 指数型证券投资基金 C 类份额增加深圳众禄基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 10 日
3	关于大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金增加 C 类份额并相应修改基金合同的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 18 日
4	关于大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日

	金 C 增加部分销售机构的公告		
5	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金更新招募说明书（2017 年 1 期）-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 18 日
6	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金更新招募说明书（2017 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 18 日
7	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 21 日
8	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
9	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
10	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 21 日
11	【大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金】托管协议	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 18 日
12	【大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金】基金合同	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 18 日
13	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
14	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
15	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 7 日
16	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日

17	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 31 日
18	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 28 日
19	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 15 日
20	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日
21	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 14 日
22	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 6 日
23	大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 17 日
24	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 11 日
25	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日
26	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 4 日
27	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 19 日
28	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
29	大成基金管理有限公司关于	中国证监会指定报	2017 年 4 月 28 日

	旗下基金投资非公开发行的公告	刊及本公司网站	
30	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 27 日
31	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 3 日
32	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
33	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
34	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 2 日
35	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
36	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 27 日
37	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 1 月 17 日
38	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 11 日
39	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 17 日
40	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
41	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 22 日
42	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 12 日
43	大成基金管理有限公司关于	中国证监会指定报	2017 年 5 月 24 日

	公司旗下部分基金估值调整的公告	刊及本公司网站	
44	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 (姚余栋)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
45	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 (谭晓冈)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
46	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 (杜鹏)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
47	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 (陈翔凯)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
48	大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日
49	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 26 日
50	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 27 日
51	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 28 日
52	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 29 日
53	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
54	大成基金关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 16 日
55	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 6 月 21 日
56	大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 5 月 6 日

§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

无。

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大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日