

# 大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 29 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 2018 年 8 月 28 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>50</b>
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.....	50

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## §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	
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	73,151,050.16 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	68,958,439.03 份	4,192,611.13 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	赵冰	郭明
	联系电话	0755-83183388	010-66105798
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105799
注册地址		深圳市福田区深南大道	北京市西城区复兴门内大街 55

	7088 号招商银行大厦 32 层	号
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	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dcfund.com.cn">http://www.dcfund.com.cn</a>
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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-9,286,014.74	-513,913.38
本期利润	-12,535,747.59	-662,981.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1766	-0.1772
本期加权平均净值利润率	-17.56%	-17.77%
本期基金份额净值增长率	-17.47%	-17.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-9,006,763.95	-575,465.98
期末可供分配基金份额利润	-0.1306	-0.1373
期末基金资产净值	59,951,675.08	3,617,145.15
期末基金份额净值	0.869	0.863
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-13.10%	-27.72%

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。

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。本报告关于 C 类份额的指标计算起始日均为 2017 年 2 月 21 日。

#### 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

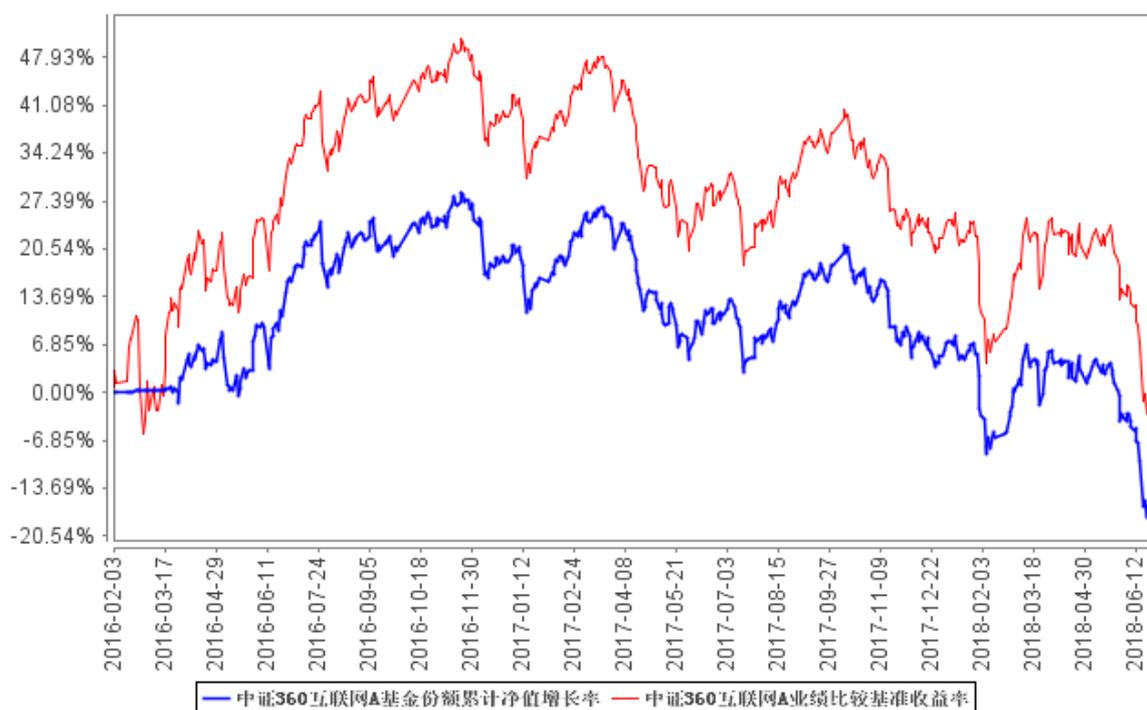
阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	收益率标准 差④		
过去一个月	-10.32%	2.15%	-10.56%	2.29%	0.24%	-0.14%
过去三个月	-17.79%	1.58%	-17.48%	1.68%	-0.31%	-0.10%
过去六个月	-17.47%	1.65%	-15.85%	1.77%	-1.62%	-0.12%
过去一年	-21.85%	1.39%	-20.08%	1.49%	-1.77%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	-13.10%	1.26%	2.75%	1.55%	-15.85%	-0.29%

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	-10.29%	2.15%	-10.56%	2.29%	0.27%	-0.14%
过去三个月	-17.89%	1.58%	-17.48%	1.68%	-0.41%	-0.10%
过去六个月	-17.65%	1.65%	-15.85%	1.77%	-1.80%	-0.12%
过去一年	-22.25%	1.39%	-20.08%	1.49%	-2.17%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	-27.72%	1.31%	-26.51%	1.41%	-1.21%	-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 2018 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，5 只 QDII 基金及 75 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	-	7 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。自 2017 年 3 月 21 日起担任大成智慧

					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变动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变动导致个别组合间的成交价格存在一定差异，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 1 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 2 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

今年上半年，受到国内外经济形势和中美贸易问题等一系列事件的冲击，A 股市场整体出现大幅下跌的行情。一月份，在金融地产等权重股的带动下，大盘连续走强，快速拉升。一月底至二月初，在外围市场调整的情绪传导下，市场迅速回落，大盘股和中小盘股均出现大幅调整。春

节前后至三月上中旬，市场触底反弹，并且出现风格分化，以创业板为代表的中小盘股票涨幅大大高于传统蓝筹股。三月下旬，受到中美贸易问题的影响，市场出现一次快速调整。四月到五月上中旬，中美贸易问题出现阶段性缓和，市场情绪有所恢复，股指平稳震荡有所抬升。五月下旬至六月底，随着中美贸易问题再度升级，双方出台一系列关税措施，导致市场担忧增大；同时人民币汇率快速下跌，棚改货币化暂停，市场情绪过分悲观，导致 A 股持续下跌，创出两年内的新低。今年上半年，上证指数下跌 13.90%，沪深 300 指数下跌 12.90%，中证 360 互联网+大数据 100 指数下跌 16.71%。

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 2.73%，日均偏离度 0.12%，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 0.869 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.47%；截至本报告期末中证 360 互联网 C 基金份额净值为 0.863 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.65%；同期业绩比较基准收益率为-15.85%。

#### 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经济调控。7 月 23 日，国务院召开常务会议，部署更好发挥财政金融政策作用，支持扩内需调结构，促进实体经济发展；积极的财政政策更加积极，稳健的货币政策松紧适度，保持适度的社会融资规模和流动性合理充裕。财政政策和货币政策可望对冲中美贸易摩擦对中国经济的冲击，流动性紧张和利率上行的状况得到缓解，预计下半年经济将稳中向好。A 股市场经历了上半年的大幅调整，随着宏观经济的改善和流动性的合理充裕，我们对下半年的市场保持谨慎乐观的态度。

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的真实、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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	5,115,137.43	7,118,362.61
结算备付金		159,430.55	226,565.87
存出保证金		6,996.57	23,128.49
交易性金融资产	6.4.3.2	58,653,031.96	81,320,218.13
其中：股票投资		58,653,031.96	81,320,218.13
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		-	140,113.99
应收利息	6.4.3.5	1,091.07	1,337.30
应收股利		-	-
应收申购款		102,968.35	141,928.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		64,038,655.93	88,971,655.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		100,246.93	102,368.65
应付管理人报酬		43,421.88	60,754.66
应付托管费		5,427.74	7,594.34
应付销售服务费		1,722.94	2,097.44
应付交易费用	6.4.3.7	100,157.22	139,245.81

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	218,858.99	260,195.19
负债合计		469,835.70	572,256.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	73,151,050.16	84,007,308.73
未分配利润	6.4.3.10	-9,582,229.93	4,392,090.46
所有者权益合计		63,568,820.23	88,399,399.19
负债和所有者权益总计		64,038,655.93	88,971,655.28

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，大成中证 360 互联网 A 类基金份额净值 0.869 元，大成中证 360 互联网 C 类基金份额净值 0.863 元，基金份额总额 73,151,050.16 份，其中大成中证 360 互联网 A 类基金份额 68,958,439.03 份，大成中证 360 互联网 C 类基金份额 4,192,611.13 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-12,236,562.27	-7,216,153.32
1.利息收入		21,885.26	30,743.46
其中：存款利息收入	6.4.3.11	21,885.26	30,743.46
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,888,724.00	-781,644.56
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-9,177,737.27	-1,303,887.29
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
股利收益	6.4.3.16	289,013.27	369,122.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-3,398,801.43	-6,537,776.60
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	29,077.90	72,524.38
<b>减：二、费用</b>		962,167.28	1,390,936.48
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	297,401.09	495,373.56
2. 托管费	6.4.6.2.2	37,175.15	61,921.68
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	11,079.67	8,368.44
4. 交易费用	6.4.3.19	346,384.08	580,526.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	270,127.29	244,746.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-13,198,729.55	-8,607,089.80
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-13,198,729.55	-8,607,089.80

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	84,007,308.73	4,392,090.46	88,399,399.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,198,729.55	-13,198,729.55
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）	-10,856,258.57	-775,590.84	-11,631,849.41
其中：1.基金申购款	19,625,900.55	-219,730.14	19,406,170.41
2.基金赎回款	-30,482,159.12	-555,860.70	-31,038,019.82

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）	73,151,050.16	-9,582,229.93	63,568,820.23
项目	上年度可比期间 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

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》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深地税告[2011]6号《深圳市地方税务局关于代征地方教育附加的通告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股票的股息、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。

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该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

(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。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	5,115,137.43
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：	5,115,137.43

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	72,450,826.49	58,653,031.96	-13,797,794.53
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	72,450,826.49	58,653,031.96	-13,797,794.53

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.3.4 买入返售金融资产

本基金于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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,023.75
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	64.53
应收债券利息	-
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	-
其他	2.79
合计	1,091.07

### 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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	100,157.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	100,157.22

### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	257.49
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	168,601.50
-	-
合计	218,858.99

#### 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	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	80,018,699.58	80,018,699.58
本期申购	17,139,951.22	17,139,951.22
本期赎回(以“-”号填列)	-28,200,211.77	-28,200,211.77
本期末	68,958,439.03	68,958,439.03

金额单位：人民币元

中证 360 互联网 C		
项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,988,609.15	3,988,609.15
本期申购	2,485,949.33	2,485,949.33
本期赎回(以“-”号填列)	-2,281,947.35	-2,281,947.35
本期末	4,192,611.13	4,192,611.13

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	12,984,351.37	-8,782,034.87	4,202,316.50
本期利润	-9,286,014.74	-3,249,732.85	-12,535,747.59
本期基金份额交易产生的变动数	-1,537,993.20	864,660.34	-673,332.86
其中：基金申购款	1,705,564.35	-1,858,348.73	-152,784.38
基金赎回款	-3,243,557.55	2,723,009.07	-520,548.48

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,160,343.43	-11,167,107.38	-9,006,763.95

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	626,467.29	-436,693.33	189,773.96
本期利润	-513,913.38	-149,068.58	-662,981.96
本期基金份额交易产生的变动数	-12,026.10	-90,231.88	-102,257.98
其中：基金申购款	213,518.40	-280,464.16	-66,945.76
基金赎回款	-225,544.50	190,232.28	-35,312.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,527.81	-675,993.79	-575,465.98

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,259.19
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	1,524.22
其他	101.85
合计	21,885.26

#### 6.4.3.12 股票投资收益

##### 6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	118,986,146.35
减：卖出股票成本总额	128,163,883.62
买卖股票差价收入	-9,177,737.27

**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**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.3.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	289,013.27
基金投资产生的股利收益	-
合计	289,013.27

**6.4.3.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,398,801.43
——股票投资	-3,398,801.43
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-3,398,801.43

**6.4.3.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	27,537.72
转换费收入	1,540.18
合计	29,077.90

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	346,384.08
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	-
合计	346,384.08

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	1,525.79
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	270,127.29

### 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

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 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

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	297,401.09	495,373.56
其中：支付销售机构的客户维护费	126,642.90	196,216.11

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

**6.4.6.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,175.15	61,921.68

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

**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：

日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 × 0.6% ÷ 当年天数。

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期末及上年度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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 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	5,115,137.43	20,259.19	8,918,750.48	27,800.43

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（2018 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

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### 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
300049	福瑞股份	2017年12月4日	重大事项	13.35	2018年7月9日	11.93	59,700	886,885.88	796,995.00	-
300131	英唐智控	2018年5月29日	重大事项	5.67	-	-	104,000	654,619.00	589,680.00	-
300247	乐金健康	2018年6月19日	重大事项	5.06	2018年7月3日	5.57	100	530.39	506.00	-

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

本基金本报告期末无从事银行间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

本基金本报告期末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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

##### **6.4.9.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回

需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，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资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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 2018 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	5,115,137.43	-	-	-	5,115,137.43
结算备付金	159,430.55	-	-	-	159,430.55
存出保证金	6,996.57	-	-	-	6,996.57
交易性金融资产	-	-	-	58,653,031.96	58,653,031.96
应收利息	-	-	-	1,091.07	1,091.07
应收申购款	847.91	-	-	102,120.44	102,968.35

资产总计	5,282,412.46	-	-	58,756,243.47	64,038,655.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	100,246.93	100,246.93
应付管理人报酬	-	-	-	43,421.88	43,421.88
应付托管费	-	-	-	5,427.74	5,427.74
应付销售服务费	-	-	-	1,722.94	1,722.94
应付交易费用	-	-	-	100,157.22	100,157.22
其他负债	-	-	-	218,858.99	218,858.99
负债总计	-	-	-	469,835.70	469,835.70
利率敏感度缺口	5,282,412.46	-	-	58,286,407.77	63,568,820.23
上年度末 2017 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	7,118,362.61	-	-	-	7,118,362.61
结算备付金	226,565.87	-	-	-	226,565.87
存出保证金	23,128.49	-	-	-	23,128.49
交易性金融资产	-	-	-	81,320,218.13	81,320,218.13
应收证券清算款	-	-	-	140,113.99	140,113.99
应收利息	-	-	-	1,337.30	1,337.30
应收申购款	5,426.45	-	-	136,502.44	141,928.89
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,373,483.42	-	-	81,598,171.86	88,971,655.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	102,368.65	102,368.65
应付管理人报酬	-	-	-	60,754.66	60,754.66
应付托管费	-	-	-	7,594.34	7,594.34
应付销售服务费	-	-	-	2,097.44	2,097.44
应付交易费用	-	-	-	139,245.81	139,245.81
其他负债	-	-	-	260,195.19	260,195.19
负债总计	-	-	-	572,256.09	572,256.09
利率敏感度缺口	7,373,483.42	-	-	81,025,915.77	88,399,399.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	58,653,031.96	92.27	81,320,218.13	91.99
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	58,653,031.96	92.27	81,320,218.13	91.99

##### 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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,943,200.00	4,090,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,943,200.00	-4,090,000.00

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	58,653,031.96	91.59
	其中：股票	58,653,031.96	91.59
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	5,274,567.98	8.24
7	其他各项资产	111,055.99	0.17
8	合计	64,038,655.93	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	-	0.00
B	采矿业	561,600.00	0.88
C	制造业	34,121,117.50	53.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	559,098.00	0.88
F	批发和零售业	2,366,080.20	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	533,445.00	0.84
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,416,974.74	14.81
J	金融业	1,191,876.00	1.87
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	2,929,503.14	4.61

M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,074,954.38	7.98
S	综合	511,202.00	0.80
	合计	57,265,850.96	90.08

### 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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	797,501.00	1.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	589,680.00	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	1,387,181.00	2.18

### 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	002289	宇顺电子	81,800	810,638.00	1.28
2	300242	佳云科技	101,200	712,448.00	1.12
3	300312	邦讯技术	87,400	697,452.00	1.10
4	600619	海立股份	59,600	680,632.00	1.07
5	002218	拓日新能	217,700	666,162.00	1.05
6	300031	宝通科技	48,500	664,450.00	1.05
7	300462	华铭智能	24,200	646,140.00	1.02
8	300076	GQY 视讯	121,800	637,014.00	1.00
9	000861	海印股份	252,314	633,308.14	1.00
10	600288	大恒科技	81,600	633,216.00	1.00
11	000802	北京文化	60,215	628,644.60	0.99
12	002528	英飞拓	150,600	628,002.00	0.99
13	300071	华谊嘉信	158,200	624,890.00	0.98
14	002712	思美传媒	33,600	624,624.00	0.98
15	300102	乾照光电	94,900	622,544.00	0.98
16	300046	台基股份	52,200	620,658.00	0.98
17	300167	迪威迅	108,700	616,329.00	0.97
18	600081	东风科技	60,913	615,221.30	0.97
19	300301	长方集团	134,400	610,176.00	0.96
20	002420	毅昌股份	147,200	604,992.00	0.95
21	600006	东风汽车	147,800	604,502.00	0.95
22	300184	力源信息	56,100	601,392.00	0.95
23	000851	高鸿股份	111,700	600,946.00	0.95
24	002036	联创电子	45,700	599,584.00	0.94
25	000627	天茂集团	85,300	598,806.00	0.94
26	300155	安居宝	125,400	596,904.00	0.94
27	002416	爱施德	101,660	596,744.20	0.94
28	002197	证通电子	72,500	594,500.00	0.94
29	300217	东方电热	247,400	593,760.00	0.93

30	600599	熊猫金控	37,300	593,070.00	0.93
31	300213	佳讯飞鸿	93,900	591,570.00	0.93
32	300329	海伦钢琴	72,540	590,475.60	0.93
33	002316	亚联发展	64,100	589,720.00	0.93
34	600854	春兰股份	140,000	589,400.00	0.93
35	300250	初灵信息	48,200	588,040.00	0.93
36	300127	银河磁体	45,248	587,771.52	0.92
37	002389	南洋科技	43,400	587,636.00	0.92
38	002546	新联电子	157,400	587,102.00	0.92
39	300150	世纪瑞尔	121,500	586,845.00	0.92
40	000561	烽火电子	99,000	586,080.00	0.92
41	300414	中光防雷	34,800	585,336.00	0.92
42	300322	硕贝德	68,700	585,324.00	0.92
43	300303	聚飞光电	211,932	580,693.68	0.91
44	000521	美菱电器	151,000	579,840.00	0.91
45	300330	华虹计通	64,814	578,789.02	0.91
46	300378	鼎捷软件	46,000	577,300.00	0.91
47	002642	荣之联	62,800	577,132.00	0.91
48	002231	奥维通信	98,900	575,598.00	0.91
49	000662	天夏智慧	89,504	575,510.72	0.91
50	000533	万家乐	155,400	573,426.00	0.90
51	002654	万润科技	104,400	573,156.00	0.90
52	600105	永鼎股份	157,360	572,790.40	0.90
53	002115	三维通信	70,100	572,717.00	0.90
54	002724	海洋王	102,360	572,192.40	0.90
55	002401	中远海科	57,000	571,710.00	0.90
56	002599	盛通股份	54,800	571,564.00	0.90
57	300256	星星科技	135,800	569,002.00	0.90
58	600355	精伦电子	140,600	568,024.00	0.89
59	300182	捷成股份	74,900	567,742.00	0.89
60	000701	厦门信达	81,700	566,998.00	0.89
61	300148	天舟文化	125,900	566,550.00	0.89
62	002463	沪电股份	151,400	566,236.00	0.89
63	002335	科华恒盛	31,300	564,965.00	0.89
64	002403	爱仕达	62,480	562,944.80	0.89
65	300027	华谊兄弟	91,300	562,408.00	0.88
66	300157	恒泰艾普	86,400	561,600.00	0.88
67	300227	光韵达	51,900	561,558.00	0.88
68	300331	苏大维格	40,000	561,200.00	0.88

69	002375	亚厦股份	104,700	559,098.00	0.88
70	300460	惠伦晶体	53,900	557,865.00	0.88
71	601999	出版传媒	100,300	556,665.00	0.88
72	002380	科远股份	42,700	555,100.00	0.87
73	300438	鹏辉能源	28,700	554,197.00	0.87
74	000892	欢瑞世纪	117,100	551,541.00	0.87
75	002288	超华科技	129,700	551,225.00	0.87
76	600551	时代出版	62,217	549,998.28	0.87
77	600775	南京熊猫	97,000	549,020.00	0.86
78	002575	群兴玩具	137,900	547,463.00	0.86
79	600831	广电网络	90,800	546,616.00	0.86
80	300426	唐德影视	44,250	546,487.50	0.86
81	600576	祥源文化	105,400	544,918.00	0.86
82	300052	中青宝	50,800	541,528.00	0.85
83	300292	吴通控股	147,800	540,948.00	0.85
84	002315	焦点科技	37,400	540,804.00	0.85
85	002189	利达光电	41,200	539,308.00	0.85
86	002344	海宁皮城	110,500	537,030.00	0.84
87	601599	鹿港文化	131,900	536,833.00	0.84
88	603128	华贸物流	91,500	533,445.00	0.84
89	300249	依米康	81,500	528,120.00	0.83
90	002290	中科新材	47,100	527,049.00	0.83
91	300392	腾信股份	57,500	523,825.00	0.82
92	002429	兆驰股份	209,100	518,568.00	0.82
93	002130	沃尔核材	118,830	518,098.80	0.82
94	300264	佳创视讯	94,600	516,516.00	0.81
95	600455	博通股份	23,300	511,202.00	0.80
96	603729	龙韵股份	12,700	509,651.00	0.80
97	002045	国光电器	70,500	504,075.00	0.79
98	002247	帝龙文化	55,100	451,820.00	0.71
99	300028	*金亚	161,800	372,140.00	0.59

### 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	300049	福瑞股份	59,700	796,995.00	1.25
2	300131	英唐智控	104,000	589,680.00	0.93
3	300247	乐金健康	100	506.00	0.00

## 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	002115	三维通信	1,486,564.00	1.68
2	002723	金莱特	1,467,725.00	1.66
3	002316	亚联发展	1,397,235.44	1.58
4	300342	天银机电	1,391,375.50	1.57
5	300414	中光防雷	1,381,450.00	1.56
6	002417	深南股份	1,378,508.00	1.56
7	002289	宇顺电子	1,369,474.62	1.55
8	000070	特发信息	1,356,027.00	1.53
9	300249	依米康	1,257,792.00	1.42
10	300046	台基股份	1,219,277.50	1.38
11	603636	南威软件	990,436.00	1.12
12	603703	盛洋科技	911,506.00	1.03
13	300167	迪威迅	882,310.00	1.00
14	300005	探路者	873,283.00	0.99
15	002288	超华科技	857,308.00	0.97
16	002052	同洲电子	851,931.60	0.96
17	002416	爱施德	847,459.00	0.96
18	002218	拓日新能	844,192.00	0.95
19	002315	焦点科技	842,153.00	0.95
20	300220	金运激光	840,166.00	0.95

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	600892	大晟文化	1,580,969.00	1.79
2	300349	金卡智能	1,564,353.00	1.77
3	300248	新开普	1,502,273.10	1.70
4	002766	索菱股份	1,476,381.00	1.67
5	002723	金莱特	1,439,432.20	1.63
6	002177	御银股份	1,435,472.00	1.62
7	300083	劲胜智能	1,413,464.00	1.60
8	002388	新亚制程	1,387,128.00	1.57
9	300209	天泽信息	1,375,515.00	1.56
10	000070	特发信息	1,359,724.00	1.54
11	002462	嘉事堂	1,331,367.16	1.51
12	002417	深南股份	1,315,691.00	1.49
13	300342	天银机电	1,302,466.23	1.47
14	300241	瑞丰光电	1,278,754.52	1.45
15	300216	千山药机	1,170,005.45	1.32
16	300390	天华超净	1,144,852.00	1.30
17	002137	麦达数字	1,087,540.00	1.23
18	603636	南威软件	1,074,316.00	1.22
19	002189	利达光电	1,028,975.76	1.16
20	002235	安妮股份	961,793.00	1.09

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	108,895,498.88
卖出股票收入（成交）总额	118,986,146.35

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**

本基金本报告期末投资股指期货。

### **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	6,996.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,091.07
5	应收申购款	102,968.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,055.99

### 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	300049	福瑞股份	796,995.00	1.25	重大事项
2	300131	英唐智控	589,680.00	0.93	重大事项
3	300247	乐金健康	506.00	0.00	重大事项

### 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	13,219	5,216.62	24,206.01	0.04%	68,934,233.02	99.96%
中证 360 互联网 C	489	8,573.85	-	0.00%	4,192,611.13	100.00%
合计	13,708	5,336.38	24,206.01	0.03%	73,126,844.15	99.97%

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	367,768.29	0.5333%
	中证 360 互联网 C	0.00	0.0000%
	合计	367,768.29	0.5028%

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、基金投资和研发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放式基金	中证 360 互联网 A	-
	中证 360 互联网 C	-
	合计	-

## §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	80,018,699.58	3,988,609.15
本报告期基金总申购份额	17,139,951.22	2,485,949.33
减：本报告期基金总赎回份额	28,200,211.77	2,281,947.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	68,958,439.03	4,192,611.13

## §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

本报告期内，基金管理人、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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
海通证券	1	120,328,669.52	52.92%	109,657.43	52.92%	-

申万宏源	1	70,490,294.17	31.00%	64,239.09	31.00%	-
长江证券	1	36,568,819.25	16.08%	33,325.25	16.08%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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：海通证券。

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	关于基金管理人再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月30日
2	大成基金管理有限公司关于提请直销非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月22日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为销	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018年6月16日

	售机构的公告		
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海挖财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	2018 年 6 月 9 日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四川天府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	2018 年 5 月 17 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海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	2018 年 5 月 4 日
7	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 4 月 20 日
8	关于大成基金管理有限公司南京分公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 4 月 3 日
9	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2017 年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 31 日
10	《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》修订前后对照表	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
11	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	2018 年 3 月 27 日
12	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	2018 年 3 月 27 日
13	关于调整公司旗下证券投资基金赎回费的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
14	关于修订公司旗下证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 27 日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蛋卷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	2018 年 3 月 17 日
16	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及摘要（2018 年 1 期）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 16 日

17	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金开通直销平台基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 3 月 10 日
18	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	2018 年 2 月 8 日
19	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	2018 年 2 月 2 日
20	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 20 日
21	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2018 年 1 月 5 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

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同的有关条款进行了修改，主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确，具体内容详见 2018 年 3 月 27 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

## §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

2018 年 8 月 29 日