

大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 28 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47

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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 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	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 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	402,176,542.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成中证 360 互联网+指数 A	大成中证 360 互联网+指数 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	184,003,946.75 份	218,172,595.59 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	段皓静	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		广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	层、27-33 层	
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	吴庆斌	廖林

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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	广东省深圳市南山区海德三 道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	大成中证 360 互联网+指数 A	大成中证 360 互联网+指数 C
本期已实现收益	69,391,199.71	104,363,581.03
本期利润	3,808,035.58	7,882,754.19
加权平均基金份额本期利润	0.0171	0.0234
本期加权平均净值利润率	0.49%	0.70%
本期基金份额净值增长率	0.11%	-0.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	355,959,682.16	385,150,330.64
期末可供分配基金份额利润	1.9345	1.7653
期末基金资产净值	609,255,310.53	683,499,317.54
期末基金份额净值	3.3111	3.1328
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	231.11%	162.38%

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。

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。

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

大成中证 360 互联网+指数 A

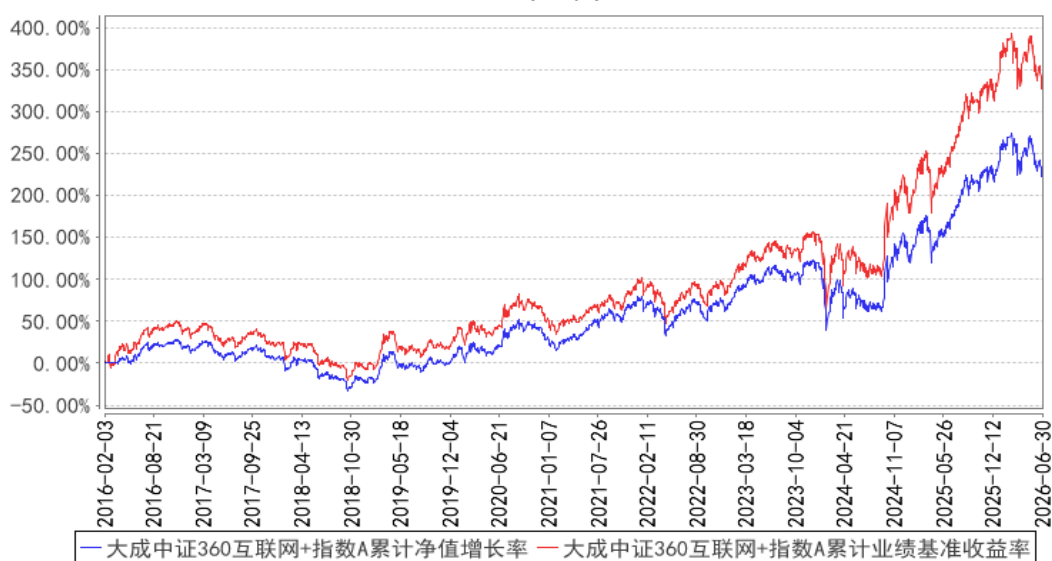
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.30%	1.55%	-1.19%	1.57%	-0.11%	-0.02%
过去六个月	0.11%	1.64%	1.22%	1.65%	-1.11%	-0.01%
过去一年	19.03%	1.39%	22.05%	1.41%	-3.02%	-0.02%
过去三年	55.01%	2.02%	80.71%	2.03%	-25.70%	-0.01%
过去五年	123.87%	1.78%	161.78%	1.79%	-37.91%	-0.01%
过去七年	239.60%	1.71%	272.97%	1.73%	-33.37%	-0.02%
过去十年	184.21%	1.64%	228.48%	1.67%	-44.27%	-0.03%
自基金合同生效起至今	231.11%	1.63%	338.05%	1.70%	-106.94%	-0.07%

大成中证 360 互联网+指数 C

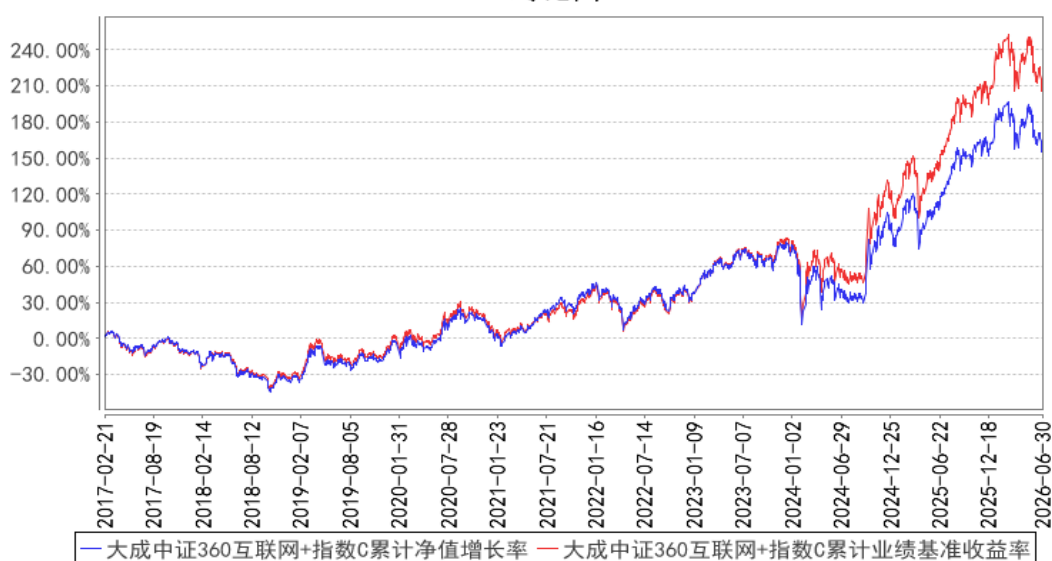
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.45%	1.55%	-1.19%	1.57%	-0.26%	-0.02%
过去六个月	-0.18%	1.64%	1.22%	1.65%	-1.40%	-0.01%
过去一年	18.31%	1.39%	22.05%	1.41%	-3.74%	-0.02%
过去三年	52.30%	2.02%	80.71%	2.03%	-28.41%	-0.01%
过去五年	117.25%	1.78%	161.78%	1.79%	-44.53%	-0.01%
过去七年	225.65%	1.71%	272.97%	1.73%	-47.32%	-0.02%
自基金合同生效起至今	162.38%	1.67%	213.33%	1.70%	-50.95%	-0.03%

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

大成中证360互联网+指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成中证360互联网+指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2. 本基金自 2017 年 1 月 18 日起增设 C 类基金份额类别，C 类的净值增长率和业绩比较基准收益率自 2017 年 2 月 21 日有份额之日开始计算。

§ 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成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

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	本基金基金经理，指数与期货投资部副总监	2016 年 2 月 3 日	-	15 年	清华大学工学博士。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，曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理、总监助理，现任指数与期货投资部副总监。2014 年 12 月 6 日至 2023 年 3 月 20 日任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 29 日至 2020 年 11 月 13 日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 日至 2021 年 4 月 27 日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。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 17 日任大成动态量化配置策略

					混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日至 2022 年 10 月 25 日任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 2 月 23 日起任大成沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 5 月 26 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2024 年 7 月 19 日起任大成中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起任大成上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 12 月 2 日起任大成中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 3 月 17 日起任大成招享汇智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》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》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，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交

易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、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，同时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，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，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证券当日成交量 5% 的情形。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

2026 年上半年，A 股市场呈现明显的结构性分化特征。一月份，市场延续去年底的涨势，继续上行，有色金属、石油石化、建材、基础化工和传媒等行业领涨，银行、非银行金融和交通运输等行业出现一定回撤。二月份，市场的分化加大，钢铁、建材、机械和煤炭等行业涨幅明显，非银行金融、银行、传媒、消费者服务和商贸零售等行业有所下行。三月份，市场调整压力增大，多数行业出现调整，仅少数行业略有上涨。四月份，在经过一季度的调整之后，科技板块开始再度活跃，电子、通信、计算机、机械和基础化工等行业涨幅突出，消费者服务、食品饮料和交通运输等行业小幅回撤。五月份，科技板块震荡上行，分化有所扩大，通信、电子和电力等少数行业表现亮眼，其他多数行业以调整为主。六月份，市场分化持续扩大，电子、通信和建材等少数行业领涨，多数行业继续调整。整体来看，在上半年，上证综指上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，中证 1000 指数上涨 15.99%，中证 2000 指数上涨 9.10%，中证 360 互联网+大数据 100 指数上涨 1.19%。在本报告期内，本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度符合基金合同要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成中证 360 互联网+指数 A 的基金份额净值为 3.3111 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.11%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%；截至本报告期末大成中证 360 互联网+指数 C 的基金份额净值为 3.1328 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.18%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年 7 月，市场在上半年上涨之后出现一轮调整。本次调整释放了一定的压力，有利于市场继续健康发展。接下来，随着政策支持的加强和经济动能的发展，我们对 A 股市场保持谨慎乐

观，投资者可以综合考虑自身对收益和风险的判断，合理作出投资决策。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，以期更好地跟踪基准指数，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。估值委员会由公司分管领导、各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。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。

各投研部门、风险管理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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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，并负责与托管人沟通估值调整事项；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人员执行，并与托管人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，投资组合经理作为估值小组成员，对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人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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期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本基金 2026 年中期报告中财务指标、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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	71,631,644.68	103,454,925.55
结算备付金		3,993,211.98	3,886,487.65
存出保证金		612,686.49	462,192.87
交易性金融资产	6.4.7.2	1,215,150,494.54	1,624,333,799.24
其中：股票投资		1,215,150,494.54	1,624,333,799.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收清算款		16,698,143.69	10,190,779.24
应收股利		-	-
应收申购款		9,213,673.09	5,109,263.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,317,299,854.47	1,747,437,448.03
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		22,245,352.31	17,155,032.59
应付管理人报酬		934,221.73	1,167,706.75
应付托管费		116,777.71	145,963.37
应付销售服务费		374,376.40	493,921.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	874,498.25	852,883.76
负债合计		24,545,226.40	19,815,507.75
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	402,176,542.34	538,185,311.05
未分配利润	6.4.7.12	890,578,085.73	1,189,436,629.23
净资产合计		1,292,754,628.07	1,727,621,940.28
负债和净资产总计		1,317,299,854.47	1,747,437,448.03

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 402,176,542.34 份。其中大成中证 360 互联网+指数 A 类基金份额总额为 184,003,946.75 份，基金份额净值 3.3111 元；大成中证 360 互联网+指数 C 类基金份额总额为 218,172,595.59 份，基金份额净值 3.1328 元。

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		23,740,778.64	282,228,360.00
1. 利息收入		217,595.56	177,675.28

其中：存款利息收入	6.4.7.13	217,595.56	177,675.28
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）		182,836,090.18	209,589,035.12
其中：股票投资收益	6.4.7.14	175,879,622.13	199,423,254.39
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-42,196.44
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	6,956,468.05	10,207,977.17
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-162,063,990.97	68,225,755.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	2,751,083.87	4,235,894.43
减：二、营业总支出		12,049,988.87	9,787,045.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,614,079.03	6,174,228.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	951,759.89	771,778.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,378,905.77	2,673,346.44
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	105,244.18	167,692.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,690,789.77	272,441,314.06
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,690,789.77	272,441,314.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,690,789.77	272,441,314.06

6.3 净资产变动表

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	538,185,311.05	-	1,189,436,629.23	1,727,621,940.28
二、本期期初净资产	538,185,311.05	-	1,189,436,629.23	1,727,621,940.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-136,008,768.71	-	-298,858,543.50	-434,867,312.21
（一）、综合收益总额	-	-	11,690,789.77	11,690,789.77
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-136,008,768.71	-	-310,549,333.27	-446,558,101.98
其中：1. 基金申购款	697,505,504.97	-	1,652,030,788.11	2,349,536,293.08
2. 基金赎回款	-833,514,273.68	-	- 1,962,580,121.38	- 2,796,094,395.06
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	402,176,542.34	-	890,578,085.73	1,292,754,628.07
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	567,452,900.37	—	735,785,387.23	1,303,238,287.60
二、本期期初净资产	567,452,900.37	—	735,785,387.23	1,303,238,287.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	38,758,740.22	—	296,768,965.27	335,527,705.49
（一）、综合收益总额	—	—	272,441,314.06	272,441,314.06
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	38,758,740.22	—	24,327,651.21	63,086,391.43
其中：1. 基金申购款	1,079,647,006.02	—	1,533,997,764.55	2,613,644,770.57
2. 基金赎回款	— 1,040,888,265.80	—	— 1,509,670,113.34	— 2,550,558,379.14
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—	—
四、本期期末净资产	606,211,640.59	—	1,032,554,352.50	1,638,765,993.09

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：

谭晓冈

范瑛

梁靖

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 基金基本情况

大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2644 号《关于准予大成中证 360 互联网

+大数据 100 指数型证券投资基金注册的批复》注册，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 326,516,765.65 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 160 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2016 年 2 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 326,561,401.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,636.19 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2017 年 1 月 18 日发布的《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》，自 2017 年 1 月 18 日起对本基金进行份额分类，增加 C 类份额，原有基金份额全部自动转换为 A 类份额。其中，不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证 360 互联网+大数据 100 指数的成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)的比例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，保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。在任何交易日日终，本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。本基金投资业绩比较基准为：中证 360 互联网+大数据 100 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行税后活期存款利率 $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证

券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关境内外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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适

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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 如基金取得源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

如基金取得源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(5) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023

年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	71,631,644.68
等于：本金	71,623,756.92
加：应计利息	7,887.76
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	71,631,644.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,342,571,006.97	—	1,215,150,494.54	— 127,420,512.43
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	1,342,571,006.97	-	1,215,150,494.54	- 127,420,512.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	19,631.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	760,647.24
其中：交易所市场	760,647.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	874,498.25

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成中证 360 互联网+指数 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	228,126,741.29	228,126,741.29
本期申购	108,366,205.02	108,366,205.02
本期赎回（以“-”号填列）	-152,488,999.56	-152,488,999.56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	184,003,946.75	184,003,946.75

大成中证 360 互联网+指数 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	310,058,569.76	310,058,569.76
本期申购	589,139,299.95	589,139,299.95
本期赎回（以“-”号填列）	-681,025,274.12	-681,025,274.12
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	218,172,595.59	218,172,595.59

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成中证 360 互联网+指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	370,976,961.39	155,376,022.43	526,352,983.82
本期期初	370,976,961.39	155,376,022.43	526,352,983.82
本期利润	69,391,199.71	-65,583,164.13	3,808,035.58
本期基金份额交易产生的变动数	-84,408,478.94	-20,501,176.68	-104,909,655.62
其中：基金申购款	201,282,010.62	73,456,183.86	274,738,194.48
基金赎回款	-285,690,489.56	-93,957,360.54	-379,647,850.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	355,959,682.16	69,291,681.62	425,251,363.78

大成中证 360 互联网+指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	459,765,872.05	203,317,773.36	663,083,645.41
本期期初	459,765,872.05	203,317,773.36	663,083,645.41
本期利润	104,363,581.03	-96,480,826.84	7,882,754.19
本期基金份额交易产生的变动数	-178,979,122.44	-26,660,555.21	-205,639,677.65
其中：基金申购款	993,117,967.79	384,174,625.84	1,377,292,593.63
基金赎回款	-1,172,097,090.23	-410,835,181.05	-1,582,932,271.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	385,150,330.64	80,176,391.31	465,326,721.95

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	203,842.33
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	9,320.18
其他	4,433.05
合计	217,595.56

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	175,879,622.13
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	175,879,622.13

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	4,329,288,107.81
减：卖出股票成本总额	4,149,103,500.67
减：交易费用	4,304,985.01
买卖股票差价收入	175,879,622.13

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,956,468.05
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,956,468.05

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-162,063,990.97

股票投资	-162,063,990.97
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-162,063,990.97

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,687,140.40
基金转换费收入	63,943.47
合计	2,751,083.87

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	11,024.63
合计	105,244.18

6.4.7.25 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 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

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,614,079.03	6,174,228.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,269,654.04	2,500,891.91
应支付基金管理人的净管理费	4,344,424.99	3,673,336.45

注：本基金管理费年费率为 0.80%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理费=前一日基金资产净值×管理费年费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	951,759.89	771,778.56

注：本基金托管费年费率为 0.10%，每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×托管费年费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成中证 360 互联网 +指数 A	大成中证 360 互联网 +指数 C	合计
	大成基金	-	372, 170. 23
中国工商银行	-	149, 086. 85	149, 086. 85
合计	-	521, 257. 08	521, 257. 08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成中证 360 互联网 +指数 A	大成中证 360 互联网 +指数 C	合计
	大成基金	-	145, 342. 25
中国工商银行	-	104, 976. 12	104, 976. 12
合计	-	250, 318. 37	250, 318. 37

注：C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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

无。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	71,631,644.68	203,842.33	95,576,299.94	166,444.49

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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	成功认购	受限期	流通	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日期		受限类型			位：股)			
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	10.11	10.11	21,194	214,271.34	214,271.34	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股未上市	10.11	10.11	49,453	499,969.83	499,969.83	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水	2026 年 4	6 个月	新股	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

	智能	月 10 日		锁定						
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平	2026 年 2	6 个月	新股	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

	发展	月 3 日		锁定						
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研	2026 年 4 月	6 个月	新股	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

	复材	月 1 日		锁定						
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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(合规与风险管理委员会、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与风险管理委员会，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，将风险控制在可接受的范围内。

6.4.13.2 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人中国工商银行股份有限公司，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”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“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	71,631,644.68	-	-	-	71,631,644.68
结算备付金	3,993,211.98	-	-	-	3,993,211.98
存出保证金	612,686.49	-	-	-	612,686.49
交易性金融资产	-	-	-	1,215,150,494.54	1,215,150,494.54
应收申购款	-	-	-	9,213,673.09	9,213,673.09
应收清算款	-	-	-	16,698,143.69	16,698,143.69
资产总计	76,237,543.15	-	-	1,241,062,311.32	1,317,299,854.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,245,352.31	22,245,352.31
应付管理人报酬	-	-	-	934,221.73	934,221.73
应付托管费	-	-	-	116,777.71	116,777.71
应付销售服务费	-	-	-	374,376.40	374,376.40
其他负债	-	-	-	874,498.25	874,498.25
负债总计	-	-	-	24,545,226.40	24,545,226.40
利率敏感度缺口	76,237,543.15	-	-	1,216,517,084.92	1,292,754,628.07
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	103,454,925.55	-	-	-	103,454,925.55
结算备付金	3,886,487.65	-	-	-	3,886,487.65
存出保证金	462,192.87	-	-	-	462,192.87
交易性金融资产	-	-	-	1,624,333,799.24	1,624,333,799.24
应收申购款	-	-	-	5,109,263.48	5,109,263.48
应收清算款	-	-	-	10,190,779.24	10,190,779.24
资产总计	107,803,606.07	-	-	1,639,633,841.96	1,747,437,448.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,155,032.59	17,155,032.59
应付管理人报酬	-	-	-	1,167,706.75	1,167,706.75
应付托管费	-	-	-	145,963.37	145,963.37
应付销售服务费	-	-	-	493,921.28	493,921.28
其他负债	-	-	-	852,883.76	852,883.76
负债总计	-	-	-	19,815,507.75	19,815,507.75
利率敏感度缺口	107,803,606.07	-	-	1,619,818,334.21	1,727,621,940.28

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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和债券，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（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	1,215,150,494.54	94.00	1,624,333,799.24	94.02
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—

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	1,215,150,494.54	94.00	1,624,333,799.24	94.02

6.4.13.4.3.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	63,873,634.46	84,800,795.42
	业绩比较基准下降 5%	-63,873,634.46	-84,800,795.42

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,212,322,567.73	1,623,450,048.00
第二层次	714,241.17	-
第三层次	2,113,685.64	883,751.24

合计	1, 215, 150, 494. 54	1, 624, 333, 799. 24
----	----------------------	----------------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1, 215, 150, 494. 54	92. 25
	其中：股票	1, 215, 150, 494. 54	92. 25
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	75, 624, 856. 66	5. 74
8	其他各项资产	26, 524, 503. 27	2. 01
9	合计	1, 317, 299, 854. 47	100. 00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资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	—	—
C	制造业	515,460,875.39	39.87
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	11,282,232.00	0.87
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	537,829,926.74	41.60
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	33,486,429.00	2.59
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	103,116,058.60	7.98
S	综合	11,147,046.00	0.86
	合计	1,212,322,567.73	93.78

7.2.2 报告期末积极投资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	36,149.82	0.00
C	制造业	2,075,952.36	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	714,241.17	0.06

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	2,827,926.81	0.22

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688699	明微电子	194,895	15,971,645.25	1.24
2	688138	清溢光电	336,178	15,800,366.00	1.22
3	301321	翰博高新	344,500	15,209,675.00	1.18
4	002861	瀛通通讯	677,300	15,090,244.00	1.17
5	301328	维峰电子	209,845	14,940,964.00	1.16
6	002745	木林森	1,173,600	14,728,680.00	1.14
7	688479	友车科技	384,300	14,591,871.00	1.13
8	301051	信濠光电	751,545	14,579,973.00	1.13
9	688653	康希通信	835,619	14,523,058.22	1.12
10	300909	汇创达	246,500	14,351,230.00	1.11

11	688173	希荻微	749,300	14,341,602.00	1.11
12	000810	创维数字	1,078,300	14,287,475.00	1.11
13	301178	天亿马	284,740	14,165,815.00	1.10
14	002077	大港股份	731,300	14,106,777.00	1.09
15	688216	气派科技	333,887	14,026,592.87	1.09
16	688391	钜泉科技	388,319	13,929,002.53	1.08
17	002876	三利谱	390,600	13,753,026.00	1.06
18	688678	福立旺	568,912	13,750,603.04	1.06
19	300270	中威电子	1,027,600	13,369,076.00	1.03
20	002174	游族网络	1,055,485	13,309,665.85	1.03
21	688061	灿瑞科技	266,200	13,222,154.00	1.02
22	300031	宝通科技	462,788	13,221,853.16	1.02
23	002134	天津普林	430,500	13,095,810.00	1.01
24	688592	司南导航	315,887	13,090,357.28	1.01
25	600288	大恒科技	952,300	12,665,590.00	0.98
26	300845	捷安高科	947,300	12,580,144.00	0.97
27	301337	亚华电子	447,000	12,426,600.00	0.96
28	300380	安硕信息	403,700	12,421,849.00	0.96
29	300043	星辉娱乐	2,835,400	12,333,990.00	0.95
30	300860	锋尚文化	479,266	12,269,209.60	0.95
31	603508	思维列控	573,550	12,251,028.00	0.95
32	688657	浩辰软件	340,222	12,169,740.94	0.94
33	301318	维海德	593,800	12,113,520.00	0.94
34	688489	三未信安	533,125	12,101,937.50	0.94
35	688030	山石网科	762,086	12,033,337.94	0.93
36	688299	长阳科技	716,550	11,973,550.50	0.93
37	301041	金百泽	354,400	11,961,000.00	0.93
38	603106	恒银科技	1,720,800	11,959,560.00	0.93
39	300513	恒实科技	1,645,876	11,916,142.24	0.92
40	300559	佳发教育	1,162,700	11,894,421.00	0.92
41	688619	罗普特	732,533	11,889,010.59	0.92
42	300150	世纪瑞尔	2,984,600	11,848,862.00	0.92
43	688683	莱尔科技	311,843	11,825,086.56	0.91
44	002161	远望谷	2,192,600	11,796,188.00	0.91
45	601801	皖新传媒	2,385,400	11,760,022.00	0.91
46	301608	博实结	233,872	11,754,406.72	0.91
47	000948	南天信息	987,042	11,735,929.38	0.91
48	600037	歌华有线	1,870,400	11,727,408.00	0.91
49	688225	亚信安全	943,694	11,720,679.48	0.91
50	300299	富春股份	2,390,000	11,711,000.00	0.91
51	301315	威士顿	306,500	11,702,170.00	0.91
52	300884	狄耐克	1,179,162	11,697,287.04	0.90
53	300183	东软载波	1,118,923	11,692,745.35	0.90

54	300787	海能实业	1,270,400	11,586,048.00	0.90
55	002376	新北洋	2,012,200	11,570,150.00	0.89
56	300369	绿盟科技	2,107,400	11,464,256.00	0.89
57	002238	天威视讯	2,114,500	11,418,300.00	0.88
58	688004	博汇科技	625,327	11,380,951.40	0.88
59	002148	北纬科技	1,958,500	11,378,885.00	0.88
60	301042	安联锐视	170,300	11,359,010.00	0.88
61	600977	中国电影	878,600	11,351,512.00	0.88
62	300598	诚迈科技	399,500	11,345,800.00	0.88
63	002858	力盛体育	1,038,800	11,333,308.00	0.88
64	300155	安居宝	2,887,900	11,320,568.00	0.88
65	300291	百纳千成	2,340,700	11,305,581.00	0.87
66	603096	新经典	843,500	11,286,030.00	0.87
67	600386	北巴传媒	3,616,100	11,282,232.00	0.87
68	603999	读者传媒	2,256,000	11,280,000.00	0.87
69	605577	龙版传媒	1,279,600	11,273,276.00	0.87
70	300098	高新兴	2,455,800	11,272,122.00	0.87
71	000607	华媒控股	3,669,300	11,264,751.00	0.87
72	688060	云涌科技	342,472	11,263,904.08	0.87
73	300050	世纪鼎利	1,901,800	11,258,656.00	0.87
74	600551	时代出版	1,692,800	11,257,120.00	0.87
75	300414	中光防雷	1,018,400	11,222,768.00	0.87
76	301159	三维天地	383,700	11,165,670.00	0.86
77	300271	华宇软件	2,314,600	11,156,372.00	0.86
78	300805	电声股份	1,538,300	11,152,675.00	0.86
79	300025	华星创业	2,654,400	11,148,480.00	0.86
80	000532	华金资本	1,037,900	11,147,046.00	0.86
81	301339	通行宝	1,088,600	11,136,378.00	0.86
82	002232	启明信息	820,200	11,121,912.00	0.86
83	300968	格林精密	1,153,000	11,114,920.00	0.86
84	688579	地纬智能	1,464,242	11,113,596.78	0.86
85	603232	格尔软件	754,700	11,078,996.00	0.86
86	300074	华平股份	3,257,400	11,075,160.00	0.86
87	300743	天地数码	758,900	11,072,351.00	0.86
88	600138	中青旅	1,695,100	11,069,003.00	0.86
89	301185	鸥玛软件	744,400	11,061,784.00	0.86
90	688244	永信至诚	774,878	11,049,760.28	0.85
91	300556	丝路视觉	630,400	10,950,048.00	0.85
92	300075	数字政通	1,070,838	10,943,964.36	0.85
93	688329	艾隆科技	540,071	10,914,834.91	0.84
94	300515	三德科技	833,900	10,882,395.00	0.84
95	688296	和达科技	943,717	10,796,122.48	0.84
96	300213	佳讯飞鸿	1,769,600	10,723,776.00	0.83

97	300552	万集科技	456,100	10,421,885.00	0.81
98	301121	紫建电子	325,120	10,410,342.40	0.81
99	688246	嘉和美康	505,300	10,383,915.00	0.80
100	300134	大富科技	1,212,400	10,366,020.00	0.80

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	001248	华润新能源	70,647	714,241.17	0.06
2	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
3	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.03
4	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
5	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
6	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
7	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
8	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
9	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
10	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
11	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
12	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
13	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
14	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
15	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
16	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
17	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
18	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
19	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
20	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
21	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
22	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
23	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
24	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
25	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
26	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
27	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
28	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
29	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
30	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
31	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
32	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
33	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
34	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
35	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	002117	东港股份	43,922,706.00	2.54
2	000607	华媒控股	42,472,863.00	2.46
3	300369	绿盟科技	37,420,514.66	2.17
4	688061	灿瑞科技	37,140,775.09	2.15
5	300270	中威电子	34,616,675.00	2.00
6	000532	华金资本	30,886,398.99	1.79
7	300299	富春股份	30,153,920.00	1.75
8	603106	恒银科技	29,377,022.00	1.70
9	000910	大亚圣象	28,781,758.91	1.67
10	300025	华星创业	28,757,777.00	1.66
11	002174	游族网络	28,633,023.35	1.66
12	002861	瀛通通讯	28,631,003.00	1.66
13	300075	数字政通	28,315,453.74	1.64
14	603677	奇精机械	28,272,359.15	1.64
15	002148	北纬科技	28,178,494.00	1.63
16	000670	盈方微	28,157,854.84	1.63
17	600006	东风股份	27,690,704.10	1.60
18	002876	三利谱	27,368,494.00	1.58
19	603096	新经典	27,337,379.80	1.58
20	300365	恒华科技	27,288,440.00	1.58

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），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	300566	激智科技	56,096,117.00	3.25
2	002843	泰嘉股份	49,461,776.00	2.86
3	003019	宸展光电	44,028,492.70	2.55
4	603629	利通电子	42,235,653.48	2.44
5	688216	气派科技	40,833,627.33	2.36
6	300976	达瑞电子	40,386,020.90	2.34
7	688689	银河微电	39,644,138.07	2.29
8	000910	大亚圣象	39,564,268.28	2.29
9	000050	深天马 A	39,214,637.46	2.27
10	603677	奇精机械	38,616,365.62	2.24
11	002905	金逸影视	38,071,711.12	2.20
12	605186	健麾信息	37,706,368.00	2.18

13	300076	*ST 宁视	37,655,981.00	2.18
14	301302	华如科技	37,322,275.13	2.16
15	002117	东港股份	37,220,217.79	2.15
16	002990	盛视科技	36,221,990.00	2.10
17	002263	大东南	34,627,156.00	2.00
18	002876	三利谱	34,609,600.94	2.00
19	002174	游族网络	34,489,309.65	2.00
20	301157	华塑科技	33,238,463.00	1.92

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），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	3,901,984,186.94
卖出股票收入（成交）总额	4,329,288,107.81

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

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。

7.12.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	612,686.49
2	应收清算款	16,698,143.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,213,673.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,524,503.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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	001248	华润新能源	714,241.17	0.06	新股未上市
2	301666	大普微	565,262.60	0.04	新股锁定
3	688820	盛合晶微	338,302.59	0.03	新股锁定
4	688808	联讯仪器	258,245.79	0.02	新股锁定
5	001399	惠科股份	179,912.24	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 (%)
大成中证 360 互联网+指数 A	51,906	3,544.95	3,235,127.94	1.76	180,768,818.81	98.24
大成中证 360 互联网+指数 C	58,848	3,707.39	27,523,194.49	12.62	190,649,401.10	87.38
合计	110,754	3,631.26	30,758,322.43	7.65	371,418,219.91	92.35

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占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）。

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	大成中证 360 互联网+指数 A	988,568.01	0.5373
	大成中证 360 互联网+指数 C	229,605.94	0.1052
	合计	1,218,173.95	0.3029

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成中证 360 互联网+指数 A	10~50
	大成中证 360 互联网+指数 C	0
	合计	10~50

本基金基金经理持有 本开放式基金	大成中证 360 互联网+指数 A	0~10
	大成中证 360 互联网+指数 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成中证 360 互联网+指数 A	大成中证 360 互联网+指数 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	228,126,741.29	310,058,569.76
本报告期基金总申 购份额	108,366,205.02	589,139,299.95
减：本报告期基金 总赎回份额	152,488,999.56	681,025,274.12
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	184,003,946.75	218,172,595.59

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

一、基金管理人的重大人事变动

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期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

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2024 年 12 月 11 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中信证券	2	1,822,196,513.45	22.15	357,150.54	22.15	-
国泰海通	2	1,765,641,007.63	21.46	346,065.59	21.46	-
华泰证券	2	1,737,067,287.55	21.11	340,465.05	21.11	新增 1 个
广发证券	1	1,172,970,737.61	14.26	229,902.32	14.26	-
中信建投证券	2	1,030,977,660.25	12.53	202,071.57	12.53	-
国信证券	1	699,101,850.63	8.50	137,023.96	8.50	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准和流程如下：

（一）筛选标准

大成基金管理有限公司（以下简称“公司”）严格按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》要求制定了证券公司筛选标准，建立了证券公司尽职调查、证券公司负面筛查、备选池筛选机制，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（二）筛选流程

1、经公司尽调符合条件的证券公司进入备选池，由股票投委会以公平、公正、公开为原则，结合定性及定量办法科学评估证券公司研究服务能力，形成证券公司白名单，并定期及不定期进行动态调整。

2、公司按照白名单与证券公司进行协议签署。

10.7.2 基金租用或者通过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	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
2	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)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 30 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 06 月 26 日
4	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 30 日
5	大成基金管理有限公司旗下 212 只公募基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 04 月 22 日

6	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 04 月 22 日
7	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 03 月 31 日
8	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 31 日
9	大成基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 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更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 03 月 03 日
11	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 02 月 14 日
12	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 30 日
13	大成基金管理有限公司旗下 205 只公募基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 01 月 22 日
14	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2026 年 01 月 22 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、本报告期内在规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

2026 年 8 月 28 日