

大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型 证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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，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 2023 年 8 月 29 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 2023 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	13
§ 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	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54

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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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	644,919,273.88 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	161,586,558.36 份	483,332,715.52 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		4008855558	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	陈四清

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
和指标	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	40,221,338.91	57,458,746.78
本期利润	61,883,401.81	78,373,139.22
加权平均基金份 额本期利润	0.4338	0.3815
本期加权平均净 值利润率	22.01%	19.82%
本期基金份额净 值增长率	29.69%	29.29%
3.1.2 期末数据	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利 润	139,840,682.67	384,707,400.08
期末可供分配基 金份额利润	0.8654	0.7959

期末基金资产净值	345,083,864.39	994,437,240.14
期末基金份额净值	2.136	2.057
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	113.60%	72.28%

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
过去一个月	4.25%	1.31%	4.12%	1.33%	0.13%	-0.02%
过去三个月	6.48%	1.19%	6.44%	1.22%	0.04%	-0.03%
过去六个月	29.69%	1.12%	31.19%	1.16%	-1.50%	-0.04%
过去一年	30.40%	1.21%	32.36%	1.24%	-1.96%	-0.03%
过去三年	74.51%	1.36%	65.41%	1.40%	9.10%	-0.04%
自基金合同生效起至今	113.60%	1.44%	142.41%	1.55%	-28.81%	-0.11%

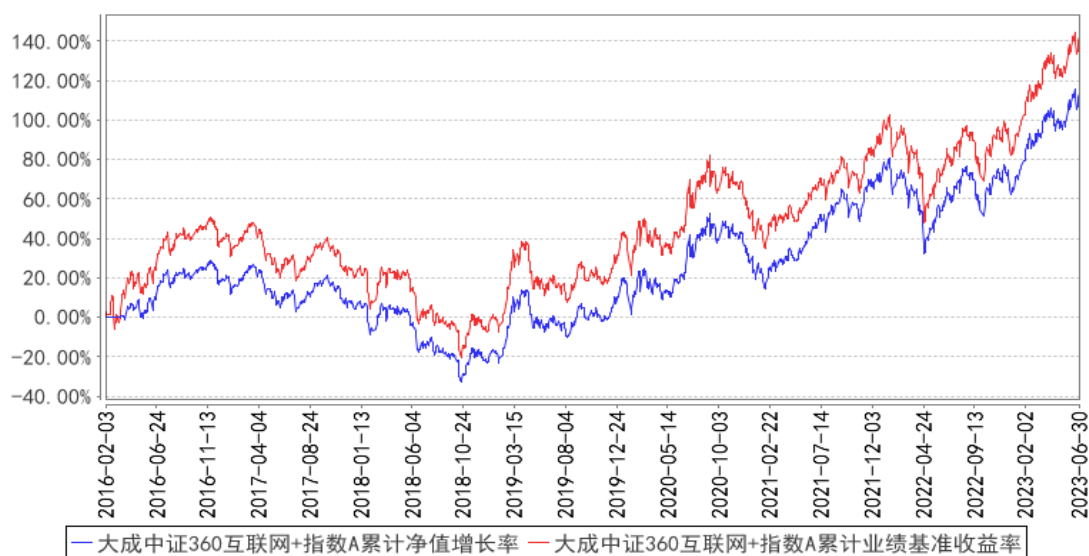
大成中证 360 互联网+指数 C

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
过去一个月	4.15%	1.30%	4.12%	1.33%	0.03%	-0.03%
过去三个月	6.25%	1.18%	6.44%	1.22%	-0.19%	-0.04%
过去六个月	29.29%	1.12%	31.19%	1.16%	-1.90%	-0.04%

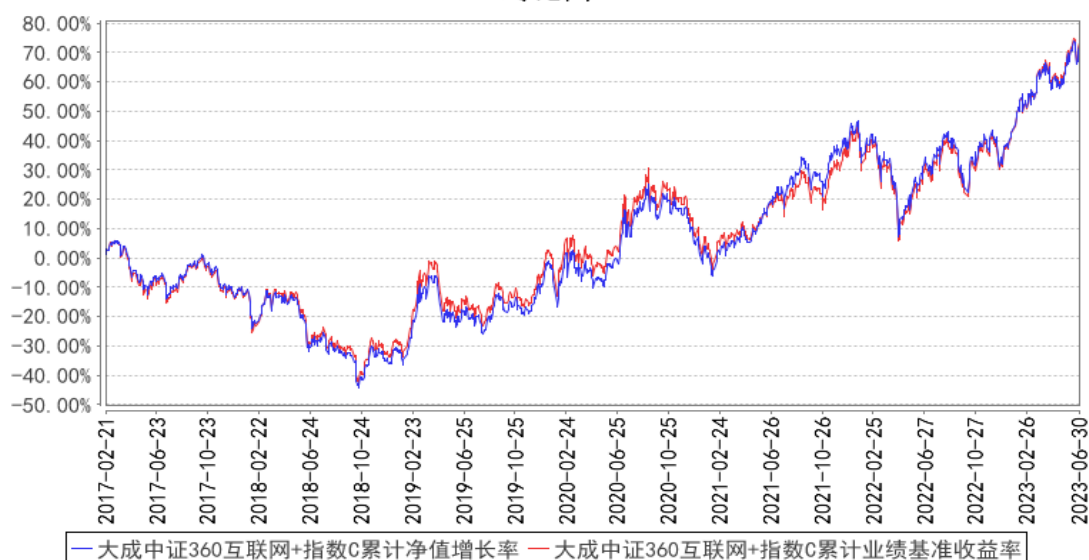
过去一年	29.53%	1.21%	32.36%	1.24%	-2.83%	-0.03%
过去三年	71.42%	1.36%	65.41%	1.40%	6.01%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	72.28%	1.48%	73.39%	1.53%	-1.11%	-0.05%

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 02 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 02 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格。

历经 24 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，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。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

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	—	12 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 日任大成智慧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。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。

4.1.3 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合规守信情况的说明

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，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 日内及 5 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，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，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。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为流动性需要。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，A 股市场呈现上涨后回调的走势。一月份，有色金属、汽车、新能源、机械和计算机等反映经济复苏和技术进步的行业涨幅居前，消费者服务、商贸零售和交通运输等行业表现落后。二月份，随着国内外人工智能技术出现重大突破，通信、计算机和传媒等 AI 上下游相关板块领涨市场，新能源、有色金属、金融和房地产等行业转而下跌。三月份，全球人工智能的应用不断涌现，带动传媒、计算机、通信和电子行业表现抢眼，其他板块大多以震荡调整为主。四月份，行情逻辑分化加大，保险、传媒、建筑和石油石化等行业领涨，消费者服务、基础化工、计算机、汽车和食品饮料等行业表现落后。五月份，市场回调压力更为突出，仅电力、电子、计算机和通信等少数行业上涨，多数行业出现回撤。六月份，政策面出现积极信号，A 股博弈经济向好的预期，家电、汽车、通信、机械和新能源等板块带动市场向上，医药、消费者服务、交运和传媒等板块出现拖累。整体来看，今年上半年，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 指数下跌 0.75%，中证 360 互联网+大数据 100 指数上涨 33.00%。在本报告期内，本基金跑输业绩比较基准的主要原因是申购量较大时短暂影响基金仓位。

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 2.136 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.69%，同期业绩比较基准收益率为 31.19%；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 2.057 元，本报告期基金份额净值增长率为 29.29%，同期业绩比较基准收益率为 31.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，业内分析国家将进一步推出各种促进经济发展的政策措施。7 月 14 日，《关于促进民营经济发展壮大的意见》发布，提出加快构建新发展格局，着力推动高质量发展，坚持社会主义市场经济改革方向，坚持“两个毫不动摇”，加快营造市场化、法治化、国际化一流营商环境，优化民营经济发展环境。7 月 24 日，政治局会议提出要继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，大力支持科技创新、实体经济和中小微企业发展；保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定；活跃资本市场，提振投资者信心；积极扩大国内需求，发挥消费拉动经济增长的基础性作用。我们认为，随着国家政策的推进落实，宏观经济将进一步恢复和发展，企业经营状况将不断向好，作为反映经济基本面和共享经济发展成果的 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

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、固定收益总部、混合资产投资部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、混合资产投资部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、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人员执行，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，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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	130,719,041.94	19,426,006.52
结算备付金		2,302,313.26	472,827.26
存出保证金		160,077.16	55,868.62
交易性金融资产	6.4.7.2	1,257,799,533.76	209,857,620.95
其中：股票投资		1,257,799,533.76	209,857,620.95
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		50,892.00	-
应收申购款		6,841,402.76	432,298.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	16,508.16	-
资产总计		1,397,889,769.04	230,244,621.90
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		46,355,114.63	2,242,396.64
应付赎回款		9,073,848.90	366,946.03
应付管理人报酬		753,567.22	158,254.14
应付托管费		94,195.90	19,781.76
应付销售服务费		374,725.16	58,204.43
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,303.10	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,715,909.60	523,690.98
负债合计		58,368,664.51	3,369,273.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	644,919,273.88	140,146,694.89
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	694,601,830.65	86,728,653.03
净资产合计		1,339,521,104.53	226,875,347.92
负债和净资产总计		1,397,889,769.04	230,244,621.90

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 644,919,273.88 份，其中大成中证 360 互联网+指数 A 基金份额总额为 161,586,558.36 份，基金份额净值 2.136 元。大成中证 360 互联网+指数 C 基金份额总额为 483,332,715.52 份，基金份额净值 2.057 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		144,602,326.98	-39,074,659.12
1. 利息收入		192,648.19	55,714.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	104,899.99	55,714.65
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		-	-
证券出借利息收入		87,748.20	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		100,686,241.77	-36,890,348.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	90,434,519.59	-39,572,035.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	34,737.27
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	10,251,722.18	2,646,949.65
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）	6.4.7.20	42,576,455.34	-3,304,123.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,146,981.68	1,064,098.29
减：二、营业总支出		4,345,785.95	2,204,220.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,658,254.78	1,286,176.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	332,281.88	160,772.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,163,109.16	588,422.70

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. 22	-	-
7. 税金及附加		315. 81	0. 07
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	191, 824. 32	168, 848. 72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		140, 256, 541. 03	-41, 278, 879. 13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		140, 256, 541. 03	-41, 278, 879. 13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		140, 256, 541. 03	-41, 278, 879. 13

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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（基金净值）	140, 146, 694. 89	-	86, 728, 653. 03	226, 875, 347. 92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	140, 146, 694. 89	-	86, 728, 653. 03	226, 875, 347. 92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	504, 772, 578. 99	-	607, 873, 177. 62	1, 112, 645, 756. 61
（一）、综合收益总额	-	-	140, 256, 541. 03	140, 256, 541. 03
（二）、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）	504, 772, 578. 99	-	467, 616, 636. 59	972, 389, 215. 58
其中：1. 基金申	848, 292, 681. 88	-	798, 105, 578. 12	1, 646, 398, 260. 0

购款				0
2. 基金赎回款	- 343,520,102.89	-	- 330,488,941.53	-674,009,044.42
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	644,919,273.88	-	694,601,830.65	1,339,521,104.53
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	56,503,531.12	-	41,541,911.08	98,045,442.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	56,503,531.12	-	41,541,911.08	98,045,442.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	119,571,437.68	-	65,443,749.91	185,015,187.59
(一)、综合收益总额	-	-	-41,278,879.13	-41,278,879.13
(二)、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)	119,571,437.68	-	106,722,629.04	226,294,066.72
其中：1. 基金申购款	468,686,574.40	-	304,057,128.76	772,743,703.16
2. 基金赎回款	- 349,115,136.72	-	- 197,334,499.72	-546,449,636.44

(三)、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）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	176,074,968.80	-	106,985,660.99	283,060,629.79

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：

<u>谭晓冈</u>	<u>范瑛</u>	<u>孙蕊</u>
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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注 6.4.4 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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

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[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项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	130,719,041.94
等于：本金	130,711,129.28
加：应计利息	7,912.66
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	130,719,041.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,227,938,923.76	—	1,257,799,533.76	29,860,610.00
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	1,227,938,923.76	-	1,257,799,533.76	29,860,610.00	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	16,508.16
待摊费用	-
合计	16,508.16

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,193.61
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,511,455.84
其中：交易所市场	1,511,455.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,260.15
应付指数使用费	50,000.00
合计	1,715,909.60

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,024,694.27	70,024,694.27
本期申购	211,179,362.04	211,179,362.04
本期赎回（以“-”号填列）	-119,617,497.95	-119,617,497.95
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	161,586,558.36	161,586,558.36
-----	----------------	----------------

大成中证 360 互联网+指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,122,000.62	70,122,000.62
本期申购	637,113,319.84	637,113,319.84
本期赎回（以“-”号填列）	-223,902,604.94	-223,902,604.94
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	483,332,715.52	483,332,715.52

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	42,240,766.33	3,040,699.04	45,281,465.37
本期利润	40,221,338.91	21,662,062.90	61,883,401.81
本期基金份额交易产生的变动数	57,378,577.43	18,953,861.42	76,332,438.85
其中：基金申购款	150,529,021.39	48,539,600.68	199,068,622.07
基金赎回款	-93,150,443.96	-29,585,739.26	-122,736,183.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	139,840,682.67	43,656,623.36	183,497,306.03

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	38,463,817.65	2,983,370.01	41,447,187.66
本期利润	57,458,746.78	20,914,392.44	78,373,139.22
本期基金份额交易产生的变动数	288,784,835.65	102,499,362.09	391,284,197.74
其中：基金申购款	440,492,054.07	158,544,901.98	599,036,956.05
基金赎回款	-151,707,218.42	-56,045,539.89	-207,752,758.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	384,707,400.08	126,397,124.54	511,104,524.62

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	90,555.12
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	13,519.73
其他	825.14
合计	104,899.99

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	90,434,519.59
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	90,434,519.59

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,075,878,712.69
减：卖出股票成本总额	981,923,131.02
减：交易费用	3,521,062.08
买卖股票差价收入	90,434,519.59

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	10,251,722.18
其中：证券出借权益补偿收入	122,637.60

基金投资产生的股利收益	-
合计	10,251,722.18

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	42,576,455.34
股票投资	42,576,455.34
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	42,576,455.34

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,125,815.20
基金转换费收入	21,166.48
合计	1,146,981.68

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,564.17
指数使用费	100,000.00

合计	191,824.32
----	------------

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。

6.4.7.24 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。

6.4.9.2 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
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
光大证券	1,940,865,317.99	63.52	1,101,084,641.99	66.11

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 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
光大证券	1,399,956.17	63.52	953,059.07	63.06
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
光大证券	785,774.91	66.11	354,453.90	65.14

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,658,254.78	1,286,176.42
其中：支付销售机构的客户维护费	797,635.88	557,158.73

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$
6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	332,281.88	160,772.10

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	—	255,137.29	255,137.29
中国工商银行	—	1,175.96	1,175.96
合计	—	256,313.25	256,313.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	—	2,983.43	2,983.43
合计	—	2,983.43	2,983.43

注：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：

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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	130,719,041.94	90,555.12	21,909,400.49	43,850.49

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

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
光大证券	688052	纳芯微	网下发行	1,218	280,140.00
光大证券	001268	联合精密	网下发行	409	7,873.25

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（2023 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	证券名称	成功认购日	受限期	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
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	30.85	23.63	532	16,412.20	12,571.16	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内 (含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	科源制药于 2023 年 5 月 26 日每 10 股送 4 股
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股锁定	26.80	22.32	566	15,168.80	12,633.12	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	32.34	31.86	559	18,078.06	17,809.74	-
301310	鑫宏	2023 年	6 个月	新股锁	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-

	业	5 月 26 日		定						
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁定	20.67	26.17	481	9,942.27	12,587.77	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	131.11	53.24	197	17,175.41	10,488.28	绿通科技于 2023 年 5 月 25 日 每 10 股送 5 股
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	73.45	46.64	123	9,034.35	5,736.72	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定	23.77	42.89	474	11,266.98	20,329.86	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	19.99	16.90	478	9,555.22	8,078.20	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	6.58	7.58	1,343	8,836.94	10,179.94	-
601065	江盐	2023 年	6 个月	新股锁	10.36	11.84	589	6,102.04	6,973.76	-

	集团	3 月 31 日		定						
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定	19.86	18.06	4,801	95,347.86	86,706.06	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	37.88	29.49	1,500	56,820.00	44,235.00	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	5.69	5.41	8,742	49,741.98	47,294.22	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	11.10	17.04	3,235	35,908.50	55,124.40	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	245.56	122.11	93	15,470.28	11,356.23	索辰科技于 2023 年 6 月 20 日 每 10 股送 4.8 股
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	152.38	135.97	150	22,857.00	20,395.50	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁定	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限

内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单位：股）	期末估值 总额
1	000823	超声电子	2023 年 7 月 10 日	9.48	500,800	4,747,584.00
2	002238	天威视讯	2023 年 7 月 10 日	6.93	55,800	386,694.00
3	002421	达实智能	2023 年 7 月 10 日	3.52	1,275,700	4,490,464.00
4	002792	通宇通讯	2023 年 7 月 10 日	18.82	299,400	5,634,708.00
5	300324	旋极信息	2023 年 7 月 10 日	3.31	344,000	1,138,640.00
6	300378	鼎捷软件	2023 年 7 月 10 日	34.25	213,000	7,295,250.00
7	300868	杰美特	2023 年 7 月 10 日	18.20	35,000	637,000.00
8	300939	秋田微	2023 年 7 月 10 日	36.36	71,600	2,603,376.00
9	301042	安联锐视	2023 年 7 月 10 日	33.95	6,000	203,700.00
10	301086	鸿富瀚	2023 年 7 月 10 日	50.70	10,200	517,140.00
11	301135	瑞德智能	2023 年 7 月 10 日	27.42	15,000	411,300.00
12	301169	零点有数	2023 年 7 月 10 日	49.49	98,500	4,874,765.00

13	301218	华是科技	2023 年 7 月 10 日	23.39	30,600	715,734.00
14	301222	浙江恒威	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	29.45	13,500	397,575.00
15	301328	维峰电子	2023 年 7 月 10 日	56.94	20,000	1,138,800.00
16	600229	城市传媒	2023 年 7 月 10 日	8.52	170,400	1,451,808.00
17	600237	铜峰电子	2023 年 7 月 10 日	8.23	69,200	569,516.00
18	600633	浙数文化	2023 年 7 月 10 日	16.21	212,400	3,443,004.00
19	601999	出版传媒	2023 年 7 月 10 日	6.70	113,400	759,780.00
20	603118	共进股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	13.29	468,300	6,223,707.00
21	688078	龙软科技	2023 年 7 月 10 日	51.55	7,200	371,160.00
22	688080	映翰通	2023 年 7 月 10 日	48.90	8,120	397,068.00
23	688109	品茗科技	2023 年 7 月 10 日	25.90	14,600	378,140.00
24	688138	清溢光电	2023 年 7 月 10 日	21.11	17,400	367,314.00
合计	-	-	-	-	4,070,120	49,154,227.00

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

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，将风险控制在可承受的范围内。

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。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

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，因此账面余额一般为未折现的合约到期现金流量。

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 2023 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	130,719,041.94	-	-	-	130,719,041.94
结算备付金	2,302,313.26	-	-	-	2,302,313.26
存出保证金	160,077.16	-	-	-	160,077.16

交易性金融资产	-	-	-	1,257,799,533.76	1,257,799,533.76
应收股利	-	-	-	50,892.00	50,892.00
应收申购款	-	-	-	6,841,402.76	6,841,402.76
其他资产	-	-	-	16,508.16	16,508.16
资产总计	133,181,432.36	-	-	1,264,708,336.68	1,397,889,769.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,073,848.90	9,073,848.90
应付管理人报酬	-	-	-	753,567.22	753,567.22
应付托管费	-	-	-	94,195.90	94,195.90
应付清算款	-	-	-	46,355,114.63	46,355,114.63
应付销售服务费	-	-	-	374,725.16	374,725.16
应交税费	-	-	-	1,303.10	1,303.10
其他负债	-	-	-	1,715,909.60	1,715,909.60
负债总计	-	-	-	58,368,664.51	58,368,664.51
利率敏感度缺口	133,181,432.36	-	-	1,206,339,672.17	1,339,521,104.53
上年度末 2022 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	19,426,006.52	-	-	-	19,426,006.52
结算备付金	472,827.26	-	-	-	472,827.26
存出保证金	55,868.62	-	-	-	55,868.62
交易性金融资产	-	-	-	209,857,620.95	209,857,620.95
应收申购款	-	-	-	432,298.55	432,298.55
资产总计	19,954,702.40	-	-	210,289,919.50	230,244,621.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	366,946.03	366,946.03
应付管理人报酬	-	-	-	158,254.14	158,254.14
应付托管费	-	-	-	19,781.76	19,781.76
应付清算款	-	-	-	2,242,396.64	2,242,396.64
应付销售服务费	-	-	-	58,204.43	58,204.43
其他负债	-	-	-	523,690.98	523,690.98
负债总计	-	-	-	3,369,273.98	3,369,273.98
利率敏感度缺口	19,954,702.40	-	-	206,920,645.52	226,875,347.92

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（上年度末：同），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）。

6.4.13.4.2 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,257,799,533.76	93.90	209,857,620.95	92.50
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	1,257,799,533.76	93.90	209,857,620.95	92.50

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	64,603,794.75	11,024,893.74
	业绩比较基准下降 5%	-64,603,794.75	-11,024,893.74

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,257,013,269.05	209,283,506.90
第二层次	72,803.70	—
第三层次	713,461.01	574,114.05
合计	1,257,799,533.76	209,857,620.95

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股票和债券，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股票和债券的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票和债券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资产(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应收款项和其他金融负债，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

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	1,257,799,533.76	89.98
	其中：股票	1,257,799,533.76	89.98
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	133,021,355.20	9.52
8	其他各项资产	7,068,880.08	0.51
9	合计	1,397,889,769.04	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	721,999,735.89	53.90

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	12,795,120.00	0.96
F	批发和零售业	48,290,576.87	3.61
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	321,294,784.85	23.99
J	金融业	24,454,270.00	1.83
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	36,328,520.58	2.71
M	科学研究和技术服务业	13,089,280.00	0.98
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	12,230,226.00	0.91
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	66,530,754.86	4.97
S	综合	—	—
	合计	1,257,013,269.05	93.84

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	—	—
C	制造业	702,927.49	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,375.51	0.00
F	批发和零售业	10,179.94	0.00
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	46,998.91	0.00

	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	786,264.71	0.06

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	300378	鼎捷软件	549,000	18,803,250.00	1.40
2	603118	共进股份	1,207,200	16,043,688.00	1.20
3	301107	瑜欣电子	421,800	14,619,588.00	1.09
4	002792	通宇通讯	771,700	14,523,394.00	1.08
5	300467	迅游科技	695,300	14,204,979.00	1.06
6	603551	奥普家居	1,095,000	14,158,350.00	1.06
7	301150	中一科技	281,360	14,070,813.60	1.05
8	300100	双林股份	1,501,700	13,935,776.00	1.04
9	600237	铜峰电子	1,677,100	13,802,533.00	1.03
10	301328	维峰电子	242,100	13,785,174.00	1.03
11	300968	格林精密	1,544,400	13,729,716.00	1.02
12	002484	江海股份	638,100	13,585,149.00	1.01
13	000561	烽火电子	1,165,100	13,480,207.00	1.01
14	002223	鱼跃医疗	374,269	13,469,941.31	1.01
15	300127	银河磁体	730,700	13,247,591.00	0.99
16	301135	瑞德智能	481,700	13,208,214.00	0.99
17	603677	奇精机械	973,880	13,176,596.40	0.98

18	002614	奥佳华	1,610,150	13,106,621.00	0.98
19	301086	鸿富瀚	258,400	13,100,880.00	0.98
20	603859	能科科技	256,000	13,089,280.00	0.98
21	002676	顺威股份	3,245,300	13,078,559.00	0.98
22	600261	阳光照明	3,559,711	12,992,945.15	0.97
23	300324	旋极信息	3,904,500	12,923,895.00	0.96
24	300939	秋田微	355,350	12,920,526.00	0.96
25	000404	长虹华意	1,864,900	12,905,108.00	0.96
26	605058	澳弘电子	574,500	12,897,525.00	0.96
27	002937	兴瑞科技	523,000	12,865,800.00	0.96
28	300597	吉大通信	1,297,500	12,858,225.00	0.96
29	603303	得邦照明	931,000	12,857,110.00	0.96
30	603215	比依股份	716,000	12,845,040.00	0.96
31	000020	深华发 A	1,109,600	12,838,072.00	0.96
32	600998	九州通	1,234,564	12,814,774.32	0.96
33	603366	日出东方	2,203,600	12,802,916.00	0.96
34	002375	亚厦股份	2,734,000	12,795,120.00	0.96
35	605258	协和电子	490,776	12,750,360.48	0.95
36	003019	宸展光电	621,015	12,730,807.50	0.95
37	605378	野马电池	545,600	12,717,936.00	0.95
38	002660	茂硕电源	1,319,400	12,705,822.00	0.95
39	300868	杰美特	697,600	12,696,320.00	0.95
40	002134	天津普林	1,239,500	12,692,480.00	0.95
41	002543	万和电气	1,603,900	12,686,849.00	0.95
42	600699	均胜电子	718,500	12,674,340.00	0.95
43	300951	博硕科技	231,500	12,646,845.00	0.94
44	301218	华是科技	540,000	12,630,600.00	0.94
45	002376	新北洋	1,559,900	12,588,393.00	0.94
46	600633	浙数文化	776,500	12,587,065.00	0.94
47	301169	零点有数	253,942	12,567,589.58	0.94
48	300852	四会富仕	303,000	12,562,380.00	0.94
49	301067	显盈科技	577,880	12,545,774.80	0.94
50	603311	金海高科	1,009,200	12,514,080.00	0.93
51	002115	三维通信	1,916,300	12,494,276.00	0.93
52	300789	唐源电气	603,560	12,445,407.20	0.93
53	688329	艾隆科技	384,116	12,445,358.40	0.93
54	300219	鸿利智汇	1,693,000	12,443,550.00	0.93
55	301042	安联锐视	366,100	12,429,095.00	0.93
56	600109	国金证券	1,429,600	12,394,632.00	0.93
57	002420	毅昌科技	2,021,800	12,393,634.00	0.93
58	688080	映翰通	253,400	12,391,260.00	0.93
59	603206	嘉环科技	717,700	12,380,325.00	0.92
60	301139	元道通信	427,900	12,362,031.00	0.92

61	301222	浙江恒威	418,741	12,331,922.45	0.92
62	002449	国星光电	1,382,100	12,286,869.00	0.92
63	688038	中科通达	819,300	12,256,728.00	0.92
64	688296	和达科技	686,100	12,246,885.00	0.91
65	605398	新炬网络	314,100	12,237,336.00	0.91
66	000823	超声电子	1,290,800	12,236,784.00	0.91
67	600455	博通股份	541,400	12,230,226.00	0.91
68	300248	新开普	1,168,800	12,190,584.00	0.91
69	605218	伟时电子	780,400	12,096,200.00	0.90
70	002215	诺普信	1,610,100	12,091,851.00	0.90
71	601555	东吴证券	1,737,700	12,059,638.00	0.90
72	300150	世纪瑞尔	2,669,800	12,040,798.00	0.90
73	003007	直真科技	465,220	11,998,023.80	0.90
74	002462	嘉事堂	870,700	11,911,176.00	0.89
75	688711	宏微科技	204,150	11,910,111.00	0.89
76	600694	大商股份	669,900	11,877,327.00	0.89
77	300808	久量股份	879,267	11,870,104.50	0.89
78	300645	正元智慧	433,200	11,835,024.00	0.88
79	000586	汇源通信	807,100	11,807,873.00	0.88
80	688138	清溢光电	559,078	11,802,136.58	0.88
81	600718	东软集团	1,105,700	11,786,762.00	0.88
82	002987	京北方	536,060	11,750,435.20	0.88
83	603003	龙宇股份	1,223,801	11,687,299.55	0.87
84	300047	天源迪科	1,429,600	11,636,944.00	0.87
85	002421	达实智能	3,288,000	11,573,760.00	0.86
86	688078	龙软科技	224,273	11,561,273.15	0.86
87	600571	信雅达	1,263,300	11,546,562.00	0.86
88	300872	天阳科技	742,800	11,543,112.00	0.86
89	301011	华立科技	490,404	11,490,165.72	0.86
90	688109	品茗科技	443,375	11,483,412.50	0.86
91	300049	福瑞股份	496,200	11,412,600.00	0.85
92	002238	天威视讯	1,639,700	11,363,121.00	0.85
93	603096	新经典	555,568	11,311,364.48	0.84
94	603230	内蒙新华	873,701	11,270,742.90	0.84
95	300805	电声股份	1,349,300	11,266,655.00	0.84
96	603999	读者传媒	1,603,900	11,211,261.00	0.84
97	002649	博彦科技	781,900	11,048,247.00	0.82
98	600229	城市传媒	1,289,374	10,985,466.48	0.82
99	600551	时代出版	984,600	10,879,830.00	0.81
100	601999	出版传媒	1,622,700	10,872,090.00	0.81

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	----	---------	-----------

	码		(股)		(%)
1	688249	晶合集成	4,801	86,706.06	0.01
2	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
3	688472	阿特斯	3,235	55,124.40	0.00
4	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
5	688469	中芯集成	8,742	47,294.22	0.00
6	688443	智翔金泰	1,500	44,235.00	0.00
7	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
8	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
9	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
10	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
11	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
12	688531	日联科技	150	20,395.50	0.00
13	301358	湖南裕能	474	20,329.86	0.00
14	301307	美利信	559	17,809.74	0.00
15	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
16	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
17	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
18	301303	真兰仪表	566	12,633.12	0.00
19	301317	鑫磊股份	481	12,587.77	0.00
20	301260	格力博	532	12,571.16	0.00
21	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
22	688507	索辰科技	93	11,356.23	0.00
23	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
24	301322	绿通科技	197	10,488.28	0.00
25	601061	中信金属	1,343	10,179.94	0.00
26	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
27	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
28	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
29	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
30	301439	泓淋电力	478	8,078.20	0.00
31	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
32	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
33	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
34	601065	江盐集团	589	6,973.76	0.00
35	301345	涛涛车业	123	5,736.72	0.00
36	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
37	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
38	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
39	001367	海森药业	55	2,171.40	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	301169	零点有数	22,783,358.63	10.04
2	002660	茂硕电源	22,266,567.00	9.81
3	603215	比依股份	20,945,672.83	9.23
4	301086	鸿富瀚	18,605,627.34	8.20
5	605398	新炬网络	18,179,855.20	8.01
6	000586	汇源通信	18,059,080.99	7.96
7	600718	东软集团	17,646,635.00	7.78
8	300852	四会富仕	16,531,322.80	7.29
9	605058	澳弘电子	16,186,170.00	7.13
10	300597	吉大通信	16,178,111.00	7.13
11	603303	得邦照明	15,522,605.96	6.84
12	688038	中科通达	15,504,251.87	6.83
13	600261	阳光照明	15,418,852.81	6.80
14	301107	瑜欣电子	15,327,788.00	6.76
15	002937	兴瑞科技	15,152,117.26	6.68
16	300127	银河磁体	15,089,023.97	6.65
17	002375	亚厦股份	14,860,514.23	6.55
18	002462	嘉事堂	14,849,764.00	6.55
19	002420	毅昌科技	14,734,894.00	6.49
20	002614	奥佳华	14,698,232.63	6.48
21	301150	中一科技	14,444,346.78	6.37
22	300789	唐源电气	14,283,833.60	6.30
23	600998	九州通	14,239,505.72	6.28
24	301011	华立科技	14,198,148.60	6.26
25	688118	普元信息	14,056,874.67	6.20
26	002484	江海股份	13,918,075.00	6.13
27	601999	出版传媒	13,798,616.00	6.08
28	300808	久量股份	13,733,319.44	6.05
29	300049	福瑞股份	13,638,303.69	6.01
30	600776	东方通信	13,600,290.03	5.99
31	301328	维峰电子	13,490,640.89	5.95
32	601555	东吴证券	13,407,724.00	5.91
33	002223	鱼跃医疗	13,376,209.22	5.90
34	002139	拓邦股份	13,366,518.00	5.89
35	301042	安联锐视	13,334,029.00	5.88
36	688329	艾隆科技	13,328,566.75	5.87
37	688711	宏微科技	13,322,096.43	5.87
38	603366	日出东方	13,320,052.00	5.87
39	002543	万和电气	13,318,199.03	5.87
40	002676	顺威股份	13,306,433.00	5.87
41	600109	国金证券	13,267,623.42	5.85
42	301139	元道通信	13,202,579.34	5.82

43	603230	内蒙新华	13,199,492.33	5.82
44	300645	正元智慧	13,167,131.00	5.80
45	603859	能科科技	13,148,284.00	5.80
46	002376	新北洋	13,135,892.00	5.79
47	002987	京北方	13,123,612.68	5.78
48	603206	嘉环科技	13,122,751.77	5.78
49	002134	天津普林	13,118,033.00	5.78
50	300219	鸿利智汇	13,088,879.00	5.77
51	002649	博彦科技	13,070,021.00	5.76
52	300805	电声股份	13,065,704.00	5.76
53	300467	迅游科技	13,033,634.00	5.74
54	600694	大商股份	13,013,598.13	5.74
55	300324	旋极信息	13,009,749.00	5.73
56	300868	杰美特	12,991,910.66	5.73
57	300248	新开普	12,966,527.18	5.72
58	600455	博通股份	12,951,249.69	5.71
59	002238	天威视讯	12,936,611.95	5.70
60	002421	达实智能	12,936,147.94	5.70
61	301135	瑞德智能	12,837,516.94	5.66
62	002449	国星光电	12,823,548.00	5.65
63	600633	浙数文化	12,746,626.00	5.62
64	002215	诺普信	12,722,093.88	5.61
65	300378	鼎捷软件	12,719,307.69	5.61
66	000404	长虹华意	12,703,695.27	5.60
67	688080	映翰通	12,694,052.86	5.60
68	301067	显盈科技	12,692,040.20	5.59
69	603311	金海高科	12,671,869.97	5.59
70	301218	华是科技	12,646,197.31	5.57
71	600571	信雅达	12,642,437.78	5.57
72	688296	和达科技	12,633,533.89	5.57
73	300872	天阳科技	12,598,202.44	5.55
74	300047	天源迪科	12,590,081.39	5.55
75	605378	野马电池	12,510,576.41	5.51
76	003019	宸展光电	12,464,980.70	5.49
77	003007	直真科技	12,410,240.00	5.47
78	300968	格林精密	12,367,306.00	5.45
79	688138	清溢光电	12,244,369.61	5.40
80	688109	品茗科技	12,240,293.82	5.40
81	002792	通宇通讯	12,205,666.91	5.38
82	000823	超声电子	12,192,934.00	5.37
83	603677	奇精机械	12,162,205.80	5.36
84	002251	步步高	12,137,755.00	5.35
85	603551	奥普家居	12,113,057.00	5.34

86	300951	博硕科技	12,053,788.50	5.31
87	600237	铜峰电子	12,000,915.94	5.29
88	000020	深华发 A	11,903,292.99	5.25
89	600180	瑞茂通	11,809,830.68	5.21
90	605218	伟时电子	11,801,673.00	5.20
91	603096	新经典	11,785,357.00	5.19
92	605258	协和电子	11,782,222.16	5.19
93	300150	世纪瑞尔	11,757,687.00	5.18
94	000561	烽火电子	11,748,026.18	5.18
95	301222	浙江恒威	11,744,798.80	5.18
96	300100	双林股份	11,639,363.00	5.13
97	002115	三维通信	11,532,165.05	5.08
98	002993	奥海科技	11,525,114.79	5.08
99	600551	时代出版	11,321,048.80	4.99
100	300939	秋田微	11,264,396.29	4.97
101	603118	共进股份	11,101,924.93	4.89
102	600699	均胜电子	11,067,639.43	4.88
103	603999	读者传媒	11,065,012.00	4.88
104	300996	普联软件	10,948,554.20	4.83
105	603386	骏亚科技	10,929,029.20	4.82
106	002081	金螳螂	10,909,458.00	4.81
107	002130	沃尔核材	10,878,405.00	4.79
108	600229	城市传媒	10,736,953.33	4.73
109	603003	龙宇股份	10,329,719.50	4.55
110	002475	立讯精密	10,306,745.00	4.54
111	603990	麦迪科技	10,242,775.27	4.51
112	002705	新宝股份	10,143,988.93	4.47
113	688590	新致软件	10,095,917.71	4.45
114	002697	红旗连锁	9,993,455.40	4.40
115	688078	龙软科技	9,752,807.10	4.30
116	002419	天虹股份	9,723,645.28	4.29
117	603613	国联股份	9,683,775.60	4.27
118	600006	东风汽车	9,671,191.08	4.26
119	300625	三雄极光	9,541,309.00	4.21
120	301185	鸥玛软件	9,439,816.20	4.16
121	688800	瑞可达	8,968,774.80	3.95
122	002273	水晶光电	8,649,670.00	3.81
123	301106	骏成科技	8,458,089.00	3.73
124	605365	立达信	8,388,607.00	3.70
125	600775	南京熊猫	8,319,688.02	3.67
126	300976	达瑞电子	8,297,908.00	3.66
127	605588	冠石科技	8,215,395.00	3.62
128	300061	旗天科技	8,191,785.00	3.61

129	000970	中科三环	8,170,093.00	3.60
130	300843	胜蓝股份	8,146,075.00	3.59
131	000049	德赛电池	8,050,044.00	3.55
132	601801	皖新传媒	8,040,310.00	3.54
133	600060	海信视像	8,004,880.53	3.53
134	301282	金禄电子	7,980,364.17	3.52
135	002181	粤传媒	7,851,026.41	3.46
136	600522	中天科技	7,848,688.00	3.46
137	002959	小熊电器	7,818,587.80	3.45
138	002938	鹏鼎控股	7,774,150.85	3.43
139	002298	中电兴发	7,730,342.26	3.41
140	601019	山东出版	7,661,991.07	3.38
141	300003	乐普医疗	7,644,582.00	3.37
142	300916	朗特智能	7,609,681.00	3.35
143	603219	富佳股份	7,588,750.00	3.34
144	603380	易德龙	7,558,493.00	3.33
145	000988	华工科技	7,534,095.00	3.32
146	605577	龙版传媒	7,500,444.00	3.31
147	002079	苏州固锔	7,494,244.14	3.30
148	600386	北巴传媒	7,456,342.00	3.29
149	600081	东风科技	7,456,150.00	3.29
150	002908	德生科技	7,400,237.80	3.26
151	300068	南都电源	7,324,894.75	3.23
152	301041	金百泽	7,012,090.00	3.09
153	002404	嘉欣丝绸	6,489,610.00	2.86
154	002296	辉煌科技	6,361,682.01	2.80
155	002976	瑞玛精密	6,144,588.40	2.71
156	000521	长虹美菱	6,078,553.00	2.68
157	002983	芯瑞达	5,809,801.20	2.56
158	300494	盛天网络	5,772,794.46	2.54
159	300615	欣天科技	5,755,594.64	2.54
160	002045	国光电器	5,728,803.00	2.53
161	000016	深康佳 A	5,695,682.00	2.51
162	002290	禾盛新材	5,568,944.00	2.45
163	600572	康恩贝	5,543,843.00	2.44
164	300075	数字政通	5,464,578.00	2.41
165	300913	兆龙互连	5,419,645.00	2.39
166	003043	华亚智能	5,234,384.28	2.31
167	002106	莱宝高科	5,203,222.00	2.29
168	605277	新亚电子	5,170,272.63	2.28
169	688181	八亿时空	5,151,342.19	2.27
170	300987	川网传媒	5,107,106.90	2.25
171	300020	银江技术	5,103,729.00	2.25

172	688579	山大地纬	5,058,541.45	2.23
173	000901	航天科技	4,717,436.28	2.08

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	688118	普元信息	18,691,309.44	8.24
2	301185	鸥玛软件	18,657,442.00	8.22
3	600776	东方通信	16,672,445.82	7.35
4	601801	皖新传媒	15,787,634.71	6.96
5	002139	拓邦股份	15,179,184.86	6.69
6	301169	零点有数	14,717,507.00	6.49
7	300494	盛天网络	14,418,758.00	6.36
8	301041	金百泽	14,359,380.78	6.33
9	002130	沃尔核材	14,215,739.68	6.27
10	605588	冠石科技	14,070,100.00	6.20
11	600180	瑞茂通	14,009,021.91	6.17
12	688590	新致软件	13,940,132.80	6.14
13	300913	兆龙互连	13,862,795.78	6.11
14	002660	茂硕电源	13,177,137.00	5.81
15	002251	步步高	12,189,745.00	5.37
16	002081	金螳螂	12,157,885.50	5.36
17	000988	华工科技	12,103,366.00	5.33
18	000521	长虹美菱	11,995,961.60	5.29
19	002993	奥海科技	11,370,115.61	5.01
20	301106	骏成科技	11,284,327.13	4.97
21	002273	水晶光电	11,198,726.11	4.94
22	300976	达瑞电子	10,948,201.54	4.83
23	300843	胜蓝股份	10,821,705.00	4.77
24	603990	麦迪科技	10,685,517.02	4.71
25	601019	山东出版	10,653,134.00	4.70
26	603386	骏亚科技	10,517,624.92	4.64
27	000970	中科三环	10,487,132.70	4.62
28	300964	本川智能	10,432,032.00	4.60
29	688579	山大地纬	10,428,369.16	4.60
30	002475	立讯精密	10,351,526.00	4.56
31	002705	新宝股份	10,283,012.11	4.53
32	600060	海信视像	10,253,791.18	4.52
33	002697	红旗连锁	10,237,416.76	4.51
34	002419	天虹股份	10,229,816.68	4.51
35	600386	北巴传媒	10,080,990.00	4.44
36	600006	东风汽车	10,002,127.00	4.41

37	300996	普联软件	9,826,544.60	4.33
38	300615	欣天科技	9,812,919.82	4.33
39	002908	德生科技	9,792,518.13	4.32
40	300625	三雄极光	9,607,712.30	4.23
41	002045	国光电器	9,602,627.00	4.23
42	002959	小熊电器	9,468,356.40	4.17
43	605398	新炬网络	9,394,881.40	4.14
44	300916	朗特智能	9,382,153.96	4.14
45	002983	芯瑞达	9,316,864.70	4.11
46	000586	汇源通信	9,025,663.00	3.98
47	300987	川网传媒	8,814,528.85	3.89
48	002976	瑞玛精密	8,696,150.40	3.83
49	605577	龙版传媒	8,640,557.00	3.81
50	300020	银江技术	8,623,573.00	3.80
51	600718	东软集团	8,491,303.88	3.74
52	603215	比依股份	8,465,072.00	3.73
53	002404	嘉欣丝绸	8,410,038.00	3.71
54	002296	辉煌科技	8,402,964.00	3.70
55	003043	华亚智能	8,284,560.71	3.65
56	000016	深康佳 A	8,226,304.00	3.63
57	300003	乐普医疗	8,128,053.00	3.58
58	603219	富佳股份	8,089,520.50	3.57
59	002938	鹏鼎控股	8,080,481.78	3.56
60	300042	朗科科技	7,944,820.27	3.50
61	600522	中天科技	7,838,201.00	3.45
62	605365	立达信	7,732,671.00	3.41
63	600775	南京熊猫	7,682,425.43	3.39
64	600081	东风科技	7,647,024.54	3.37
65	002106	莱宝高科	7,501,876.99	3.31
66	300068	南都电源	7,437,422.00	3.28
67	300061	旗天科技	7,426,517.00	3.27
68	603380	易德龙	7,354,749.05	3.24
69	000049	德赛电池	7,277,401.00	3.21
70	688800	瑞可达	7,194,975.43	3.17
71	002181	粤传媒	7,175,284.99	3.16
72	000901	航天科技	7,094,763.65	3.13
73	301282	金禄电子	7,083,222.52	3.12
74	603613	国联股份	7,061,401.00	3.11
75	002298	中电兴发	6,936,275.00	3.06
76	002290	禾盛新材	6,864,898.00	3.03
77	002079	苏州固锝	6,848,095.00	3.02
78	300852	四会富仕	6,823,274.56	3.01
79	688038	中科通达	6,519,438.00	2.87

80	600572	康恩贝	6,484,074.00	2.86
81	300597	吉大通信	6,469,024.00	2.85
82	300921	南凌科技	6,423,281.16	2.83
83	605058	澳弘电子	6,284,339.12	2.77
84	301086	鸿富瀚	6,170,858.50	2.72
85	688159	有方科技	5,927,947.38	2.61
86	300075	数字政通	5,919,869.61	2.61
87	300394	天孚通信	5,756,990.00	2.54
88	000050	深天马 A	5,496,663.44	2.42
89	605277	新亚电子	5,429,157.54	2.39
90	301107	瑜欣电子	5,369,666.16	2.37
91	688181	八亿时空	5,291,106.35	2.33
92	002194	武汉凡谷	5,243,827.40	2.31
93	300789	唐源电气	5,170,464.00	2.28
94	600261	阳光照明	5,163,712.21	2.28
95	300275	梅安森	5,126,739.00	2.26
96	002281	光迅科技	5,086,924.42	2.24
97	002937	兴瑞科技	5,046,071.00	2.22
98	300127	银河磁体	4,880,348.72	2.15
99	300130	新国都	4,775,295.00	2.10
100	300213	佳讯飞鸿	4,644,727.00	2.05

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	1,987,288,588.49
卖出股票收入（成交）总额	1,075,878,712.69

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），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规定的备选股票库

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	160,077.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	50,892.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,841,402.76
6	其他应收款	16,508.16
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,068,880.08

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

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	300378	鼎捷软件	7,295,250.00	0.54	转融通流通受限

2	603118	共进股份	6,223,707.00	0.46	转融通流通受限
3	002792	通宇通讯	5,634,708.00	0.42	转融通流通受限
4	301328	维峰电子	1,138,800.00	0.09	转融通流通受限
5	600237	铜峰电子	569,516.00	0.04	转融通流通受限

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	688249	晶合集成	86,706.06	0.01	新股锁定
2	301261	恒工精密	72,803.70	0.01	新股未上市
3	688472	阿特斯	55,124.40	0.00	新股锁定
4	688361	中科飞测	53,740.77	0.00	新股锁定
5	688469	中芯集成	47,294.22	0.00	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	34,131	4,734.30	30,669,375.75	18.98	130,917,182.61	81.02
大成中证 360 互联网+指数 C	39,024	12,385.52	325,758,531.11	67.40	157,574,184.41	32.60
合计	73,155	8,815.79	356,427,906.86	55.27	288,491,367.02	44.73

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	141,775.52	0.0877
	大成中证 360 互联网+指数 C	1,964.96	0.0004
	合计	143,740.48	0.0223

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	0
	大成中证 360 互联网+指数 C	0
	合计	0
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	70,024,694.27	70,122,000.62
本报告期基金总申购份额	211,179,362.04	637,113,319.84
减：本报告期基金总赎回份额	119,617,497.95	223,902,604.94
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	161,586,558.36	483,332,715.52

§ 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第八届董事会第二次会议审议通过，自 2023 年 3 月 25 日起，温智敏先生不再担任公司副总经理职务；聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自 2023 年 3 月 25 日起，至公司第八届董事会任期届满之日止。具体详见我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其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 (%)	

光大证券	1	1,940,865,317.99	63.52	1,399,956.17	63.52	-
招商证券	2	1,114,604,039.63	36.48	803,973.66	36.48	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：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。

2、本基金本报告期内租用的券商交易单元变更如下：

本报告期内增加交易单元：无；

本报告期内退租交易单元：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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年6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 类份额增加招商银行股份有限公司为代销机构的	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年6月12日

	公告		
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 30 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 17 日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 12 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 12 日
7	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	2023 年 4 月 27 日
8	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 26 日
9	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 17 日
11	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2022 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	2023 年 3 月 30 日
12	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
13	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
14	大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 24 日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 22 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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 3 日
17	大成基金管理有限公司关于旗下部	中国证监会基金电子披	2023 年 2 月 23 日

	分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
18	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 17 日
19	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数型证券投资基金 2022 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	2023 年 1 月 18 日
20	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 16 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

2023 年 8 月 30 日