大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30日

基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2017年8月24日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2017年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.5%以内，年跟踪误差控制在6%以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证360互联网+大数据100指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗登攀	邵明
	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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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

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

2.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中证360互联网A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.06%	1.21%	3.55%	1.36%	-0.49%	-0.15%
过去三个月	-8.02%	1.16%	-8.63%	1.28%	0.61%	-0.12%
过去六个月	-6.32%	1.09%	-7.83%	1.18%	1.51%	-0.09%
过去一年	-4.55%	1.07%	-3.59%	1.15%	-0.96%	-0.08%
自基金合同生效起至今	11.20%	1.15%	28.57%	1.59%	-17.37%	-0.44%

中证360互联网C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.06%	1.20%	3.55%	1.36%	-0.49%	-0.16%
过去三个月	-8.19%	1.16%	-8.63%	1.28%	0.44%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-7.04%	1.06%	-8.04%	1.16%	1.00%	-0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年一季度之初，市场延续了去年底的震荡下行走势。一月中旬开始，市场开始反弹，特别是低估值、高分红的蓝筹股表现优秀。进入三月份，随着美联储加息的预期升温以及最终落地，A股市场进入了震荡盘整的阶段；板块表现也产生分化，蓝筹股表现稳健，成长股出现一定的回撤。进入二季度，市场在雄安新区公布的刺激下短暂冲高之后，开始快速下跌。五月中旬之后，大盘蓝筹股和绩优股率先止跌企稳并反弹。进入六月份，中小盘股票也见底回升。六月中旬，美联储再次加息，符合市场预期；中国央行继续保持稳健中性的货币政策，确保流动性平稳，有利于资本市场的稳定。MSCI宣布A股将纳入其新兴市场指数，这将进一步推动A股的国际化，有利于中国资本市场的持续健康发展。在上半年，上证指数上涨2.86%，沪深300指数上涨10.78%，中证360互联网+大数据100指数下跌8.27%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

股票投资部、研究部、固定收益总部、风险管理部和社保基金及机构投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性、监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大成基金管理有限公司编制和披露的大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：		
银行存款	8,918,750.48	5,730,122.65
结算备付金	2,795,639.50	2,833,064.25
存出保证金	274,415.61	27,533.05
交易性金融资产	134,404,981.96	106,802,312.56
其中：股票投资	134,404,981.96	106,802,312.56
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,652.78	1,449.75
应收股利	-	-
应收申购款	1,965,597.49	466,793.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	148,361,037.82	115,861,275.91
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	414,326.23	284,831.32
应付管理人报酬	88,481.55	77,646.26
应付托管费	11,060.20	9,705.79
应付销售服务费	2,984.51	-
应付交易费用	195,777.34	167,319.29
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	195,321.70	181,102.21
负债合计	907,951.53	720,604.87
所有者权益：		
实收基金	132,593,488.07	96,978,724.22
未分配利润	14,859,598.22	18,161,946.82
所有者权益合计	147,453,086.29	115,140,671.04
负债和所有者权益总计	148,361,037.82	115,861,275.91

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

6.2 利润表

会计主体：大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
一、收入	-7,216,153.32	10,907,493.86
1.利息收入	30,743.46	359,296.50
其中：存款利息收入	30,743.46	102,250.07
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	257,046.43
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-781,644.56	5,209,757.08
其中：股票投资收益	-1,303,887.29	4,821,123.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	153,120.00	146,120.00
股利收益	369,122.73	242,513.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-6,537,776.60	4,956,523.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	72,524.38	381,917.06
减：二、费用	1,390,936.48	830,083.71
1. 管理人报酬	495,373.56	333,258.84
2. 托管费	61,921.68	41,657.35
3. 销售服务费	8,368.44	-
4. 交易费用	580,526.09	271,949.57
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	244,746.71	183,217.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-8,607,089.80	10,077,410.15
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-8,607,089.80	10,077,410.15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	96,978,724.22	18,161,946.82	115,140,671.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,607,089.80	-8,607,089.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	35,614,763.85	5,304,741.20	40,919,505.05
其中：1.基金申购款	82,639,248.48	13,570,211.09	96,209,459.57
2.基金赎回款	-47,024,484.63	-8,265,469.89	-55,289,954.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	132,593,488.07	14,859,598.22	147,453,086.29
项目	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	326,561,401.84	-	326,561,401.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,077,410.15	10,077,410.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-274,187,414.10	-1,449,274.86	-275,636,688.96
其中：1.基金申购款	28,545,297.77	1,348,172.63	29,893,470.40
2.基金赎回款	-302,732,711.87	-2,797,447.49	-305,530,159.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	52,373,987.74	8,628,135.29	61,002,123.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____罗登攀_____ _____周立新_____ _____崔伟____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

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

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

管理费的计算方法如下：

H=E×0.8%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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

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

托管费的计算方法如下：

H=E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.4.2.3 销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

本基金本报告期无当期发生的应支付关联方的销售服务费。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

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

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.5 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300209	天泽信息	2017年2月10日	临时停牌	27.72	-	-	45,600	1,122,823.11	1,264,032.00	-
600460	士兰微	2017年5月12日	临时停牌	6.07	2017年8月15日	6.68	202,400	1,253,879.72	1,228,568.00	-
002264	新华都	2017年5月10日	临时停牌	8.40	-	-	138,300	1,388,169.50	1,161,720.00	-
300089	文化长城	2017年4月19日	临时停牌	14.93	-	-	75,500	1,211,471.33	1,127,215.00	-
002076	雪莱特	2017年3月20日	临时停牌	7.07	-	-	157,200	1,114,979.55	1,111,404.00	-
300462	华铭智能	2017年4月21日	临时停牌	36.83	-	-	29,739	968,880.93	1,095,287.37	-
600734	实达集团	2017年4月5日	临时停牌	12.75	2017年7月12日	12.00	83,800	1,147,824.11	1,068,450.00	-
002654	万润科技	2017年5月10日	临时停牌	9.28	-	-	109,967	1,396,827.15	1,020,493.76	-
300322	硕贝德	2017年2月23日	临时停牌	17.02	2017年8月7日	15.32	57,300	1,056,098.30	975,246.00	-

注：本基金截至本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	134,404,981.96	90.59
	其中：股票	134,404,981.96	90.59
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,714,389.98	7.90
7	其他各项资产	2,241,665.88	1.51
8	合计	148,361,037.82	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	82,990,830.01	56.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,820,772.90	5.98
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,047,195.24	19.70
J	金融业	2,461,821.50	1.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,370,632.00	1.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,425,413.00	5.04
S	综合	1,214,208.00	0.82
	合计	134,330,872.65	91.10

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	66,469.69	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	74,109.31	0.05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排