大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年9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

报告送出日期：2026年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成中证 360 互联网+大数据 100 指数	
基金主代码	002236	
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	
报告期末基金份额总额	358,195,342.49 份	
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。	
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	
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	169,938,600.43 份	188,256,742.06 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 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
1.本期已实现收益	-39,381,264.87	-44,032,569.68
2.本期利润	17,530,360.01	20,092,585.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.1002	0.0999
4.期末基金资产净值	580,766,004.75	607,807,905.55
5.期末基金份额净值	3.4175	3.2286

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、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	净值增长率①	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	3.21%	1.79%	1.89%	1.78%	1.32%	0.01%
过去六个月	1.87%	1.67%	0.68%	1.68%	1.19%	-0.01%
过去一年	7.88%	1.57%	8.05%	1.58%	-0.17%	-0.01%
过去三年	65.50%	2.06%	89.55%	2.06%	-24.05%	0.00%
过去五年	122.06%	1.81%	163.88%	1.82%	-41.82%	-0.01%
过去七年	244.51%	1.72%	276.30%	1.74%	-31.79%	-0.02%
过去十年	182.91%	1.65%	217.76%	1.69%	-34.85%	-0.04%
自基金合同生效起至今	241.75%	1.63%	346.35%	1.71%	-104.60%	-0.08%

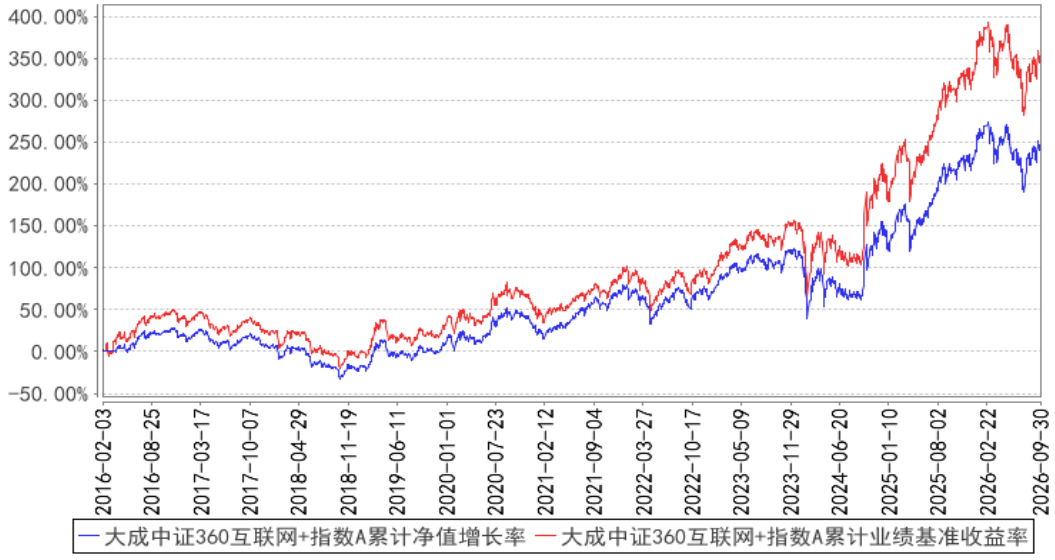
大成中证 360 互联网+指数 C

阶段	净值增长率①	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	3.06%	1.79%	1.89%	1.78%	1.17%	0.01%
过去六个月	1.56%	1.67%	0.68%	1.68%	0.88%	-0.01%
过去一年	7.23%	1.57%	8.05%	1.58%	-0.82%	-0.01%

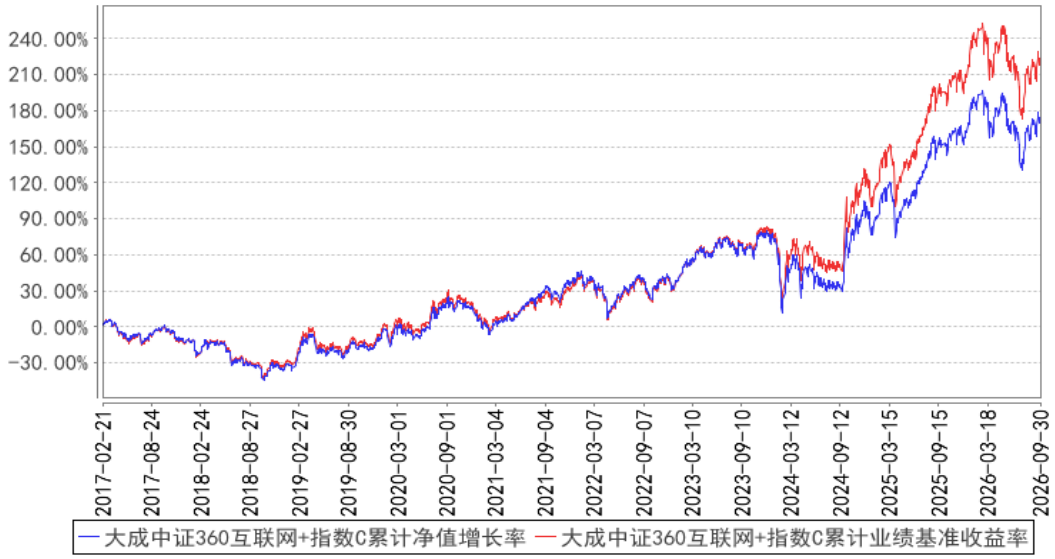
过去三年	62.49%	2.06%	89.55%	2.06%	-27.06%	0.00%
过去五年	115.53%	1.81%	163.88%	1.82%	-48.35%	-0.01%
过去七年	230.46%	1.72%	276.30%	1.74%	-45.84%	-0.02%
自基金合同生效起至今	170.40%	1.67%	219.26%	1.70%	-48.86%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。2026 年 9 月 22 日起任大成智享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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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间连续 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，A 股市场整体出现回调，科技板块回调幅度较为明显。七月份，市场风格发

生变化，价值风格走强，银行、保险、食品饮料、煤炭和消费者服务等行业上涨，而科技等板块显著回调，电子、通信、建材和机械等行业回调幅度较大。八月份，市场整体出现反弹，电子、通信、煤炭、机械、石油石化和有色金属等行业领涨，仅少数行业略微下跌。九月份，市场再次调整，仅房地产、银行和医药等少数行业上涨，多数行业继续回落。整体来看，2026 年三季度，上证综指下跌 6.16%，沪深 300 指数下跌 12.49%，中证 500 指数下跌 17.67%，中证 1000 指数下跌 17.15%，中证 360 互联网+大数据 100 指数上涨 1.93%。在本报告期内，本基金的跟踪误差和跟踪偏离符合基金合同要求。

4.5 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 3.4175 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.21%，同期业绩比较基准收益率为 1.89%；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 3.2286 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.06%，同期业绩比较基准收益率为 1.89%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,116,332,525.48	93.10
	其中：股票	1,116,332,525.48	93.10
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	78,066,971.48	6.51
8	其他资产	4,683,571.53	0.39
9	合计	1,199,083,068.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	538,822,758.69	45.33
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	21,493,029.00	1.81
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	426,457,657.36	35.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	65,033,931.75	5.47
M	科学研究和技术服务业	10,766,827.41	0.91
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	11,475,117.00	0.97
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	33,229,881.00	2.80
S	综合	-	-
	合计	1,107,279,202.21	93.16

5.2.2 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	39,069.96	0.00
C	制造业	8,531,267.25	0.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	461,891.02	0.04
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	21,095.04	0.00
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	9,053,323.27	0.76

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	688175	高凌信息	625,415	18,130,780.85	1.53
2	300691	联合光电	737,700	15,159,735.00	1.28
3	001326	联域股份	135,000	13,639,050.00	1.15
4	300787	海能实业	1,079,600	12,814,852.00	1.08
5	688489	三未信安	443,088	12,140,611.20	1.02
6	688329	艾隆科技	505,689	12,111,251.55	1.02
7	688130	晶华微	470,300	12,086,710.00	1.02
8	688030	山石网科	612,678	12,002,362.02	1.01
9	301339	苏交数智	960,800	11,769,800.00	0.99
10	300808	久量股份	582,400	11,700,416.00	0.98

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	688825	长鑫科技	172,527	6,668,168.55	0.56
2	001248	华润新能源	49,453	461,891.02	0.04
3	301666	大普微	1,220	403,990.80	0.03
4	688808	联讯仪器	241	360,866.17	0.03
5	688820	盛合晶微	2,391	268,891.86	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	446,849.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,236,721.67
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,683,571.53

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	6,668,168.55	0.56	新股锁定
2	001248	华润新能源	461,891.02	0.04	新股锁定
3	301666	大普微	403,990.80	0.03	新股锁定
4	688808	联讯仪器	360,866.17	0.03	新股锁定
5	688820	盛合晶微	268,891.86	0.02	新股锁定

5.11.6 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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	184,003,946.75	218,172,595.59
报告期期间基金总申购份额	22,904,131.89	80,808,983.96
减:报告期期间基金总赎回份额	36,969,478.21	110,724,837.49
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	169,938,600.43	188,256,742.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2026 年 9 月 1 日，公司召开大成基金管理有限公司第九届董事会第五次会议，审议通过《关于姚余栋先生辞去公司副总经理职务的议案》，同意姚余栋先生自董事会决议作出之日起辞去公司副总经理职务。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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 10 月 27 日