

大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月29日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的投资业绩并不代表其招募说明书及投资有风险,投资者在作出投资决策前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,应阅读半年度报告全文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

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
基金代码	002236
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年02月26日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,151,060.16份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称:	A:中证360互联网C B:中证360互联网
下属分级基金的代码:	002236 002539
报告期末A级基金份额总额	68,968,439.03份
报告期末B级基金份额总额	4,182,621.13份

2.2 基金产品说明

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×40%+中证100指数收益率×40%+上证国债指数收益率×20%
本基金采用被动式指数化投资方法,按照标的指数的构成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进行相应调整。
本基金为股票型基金,跟踪标的指数收益率高于组合基准,申购费率与同期市场基金一致,本基金为股票型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人及基金托管人

姓名	职务	基金管理人	基金托管人
魏庆华	董事长	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
陈一峰	副董事长	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
魏庆华	总经理	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
陈一峰	副总经理	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
魏庆华	督察长	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
魏庆华	首席风险官	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

2.4 信息披露方式

基金半年度报告正文的互联网网址: <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 主要会计数据和财务指标

3.1 主要会计数据和财务指标

基金级别	中证360互联网A	中证360互联网B
3.1.1 期间损益	报告期末(2018年1月1日至2018年6月30日)	报告期末(2018年1月1日至2018年6月30日)
3.1.2 期间损益	19,286,014.74	-512,013.23
3.1.3 期间损益	-12,526,747.59	-682,381.96
3.1.4 期间损益	-0.1796	-0.1772
3.1.5 期间损益	-17.47%	-17.65%
3.1.6 期间损益	-0.1306	-0.1373
3.1.7 期间损益	59,961,675.09	3,617,146.15
3.1.8 期间损益	68,968,439.03	0.983

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认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。
3.根据我公司在2017年1月18日关于大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金增加C类份额并相应修订基金合同的公告,自2017年1月18日起,大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金增加收取销售服务费的C类份额。C类份额自2017年2月21日起有份额。本报告关于C类份额的指标计算起始日均为2017年2月21日。
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
中证360互联网A

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去一个月	-10.32%	2.15%	-10.56%	2.29%	0.24%
过去三个月	-17.79%	1.58%	-17.48%	1.68%	-0.31%
过去六个月	-17.47%	1.65%	-16.58%	1.77%	-1.62%
过去一年	-21.85%	1.38%	-20.08%	1.49%	-1.77%
自基金合同生效起至今	-13.10%	1.26%	2.75%	1.65%	-18.89%

中证360互联网C

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-③
过去一个月	-10.29%	2.15%	-10.56%	2.29%	0.27%
过去三个月	-17.89%	1.58%	-17.48%	1.68%	-0.41%
过去六个月	-17.65%	1.65%	-16.58%	1.77%	-1.80%
过去一年	-22.25%	1.38%	-20.08%	1.49%	-2.01%
自基金合同生效起至今	-27.27%	1.31%	-28.51%	1.41%	-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,本基金的各类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券基金[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2名大股东组成,分别为大成资产管理(中国)有限公司(60%)、大成证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(15%)。主营业务为公募基金的销售、销售和理财,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、特定客户资产管理及QDII业务资格。

经过十多年的稳健发展,公司形成了强大稳固的综合实力,公司旗下基金产品齐全,风格多样,构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理5只ETF及1只ETF联接基金,5只ODI基金及75只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限
魏庆华	基金基金经理	2016年02月23日	-	7年

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。
3.2 管理人报告期内基金管理人遵守诚信情况的说明
报告期内,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制度和内控制度,基金管理人运用投资分析方法和工具,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间交易价差进行分析,分析结果表明:债券交易间交易价差率、股票间交易价差率变动主要来自源于市场因素(如同一个交易日价格振幅较高)及组合交易时机选择,因投资组合成交时间不一致,以及成交价格的不同导致个别组合间的成交价格存在一定差异,但结合交易价差专项分析,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出现存在异常交易行为,主动投资组合间股票交易存在1笔同日反向交易,原因为投资策略需要,主动型投资组合与指数型投资组合之间因数据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笔当日成交5%的情况;主动投资组合间债券

交易存在2笔同日反向交易,原因为投资策略需要,投资组合间相应交易同日反向交易的市场成交比例、成交价格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 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
今年上半年,受到国内外经济形势和中美贸易问题等一系列事件的冲击,A股市场整体出现大幅下跌行情。一月份,在金融地产等权重股的带动下,大盘连续走强,快速回升。一月底至二月初,在外围市场情绪的带领下,市场迅速回落,大盘和中小盘股均出现大幅调整。春节前后至三月中旬,市场触底反弹,并出现风格分化,以创业板为代表的中小盘股票涨幅大幅高于传统蓝筹股。三月下旬,受到中美贸易问题的影响,市场出现一次快速调整,四月至五月上旬,中美贸易问题出现阶段性缓和,市场情绪有所恢复,股指平稳震荡有所抬升。五月下旬至六月底,随着中美贸易问题再度升级,双方出台一系列关税措施,导致市场大幅调整;同时人民币汇率快速下跌,棚改货币化收缩,市场情绪过于悲观,导致个股持续下跌,创出两年来的新低。今年上半年,上证指数下跌13.90%,沪深300指数下跌12.90%,中证360互联网+大数据100指数下跌16.71%。

在本报告期内,本基金严格按照中证360互联网+大数据100指数的成分及权重构建投资组合,较好地跟踪了基准指数。基金年化跟踪误差2.73%,日均偏离度0.12%,各项指标均符合基金合同约定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末中证360互联网A基金份额净值为0.889元,本报告期基金份额净值增长率为-17.47%;截至本报告期末中证360互联网C基金份额净值为0.863元,本报告期基金份额净值增长率为-17.65%;同期业绩比较基准收益率为-15.08%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
今年下半年,政府将进一步加大宏观经济调控,7月23日,国务院召开常务会议,部署更好发挥财政金融政策作用,支持扩大内需措施,促进实体经济发展的,积极的财政政策和稳健的货币政策紧密配合,适时适度的社会融资规模和流动性更加充裕,财政政策和货币政策有望对冲中美贸易摩擦对中国经济的冲击,流动性紧张和利率上行的状况得到缓解,预计下半年经济将稳中向好。A股市场经历了上半年的大幅调整,随着宏观经济的改善和流动性的合理充裕,我们对下半年的市场保持谨慎乐观的态度。
本基金将坚持被动投资,复制指数的指数化投资策略,严格按照基准指数的成分及权重构建投资组合,继续深入研究宏观经济政策、行业政策和风险控制方法,积极应对大额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水平,为投资者提供专业化服务。

4.6 管理人对于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允价值委员会,公允价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,公允价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,估值委员会中包括两名投资部基金经理。
股票投资部、研究部、固定收益部、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调整或者调整的投资品种;提出估值的数据分析模型;对需要进行估值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基金的估值、估值复核,监察稽核部、社保基金及机构投资部负责估值数据的核对;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估值核算员负责,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值委员会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,由估值委员会讨论决定特别估值方案并与托管银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,截止本报告期末,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,由其授权提供银行间同业市场交易的债券品种(在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理办法另有规定的除外))的估值数据。

4.7 管理人对于报告期内基金估值定价情况的说明
本基金管理人严格按照《证券投资基金估值业务的规定》进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。
4.8 报告期内管理人对于本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况
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托管人—大成基金管理有限公司,在对本基金托管的基金资产净值计算、净值复核、基金份额净值计算、净值增长率的计算、基金收益分配等各个环节严格按照基金合同、招募说明书等基金文件规定的程序进行估值,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。
5.3 托管人对本半年度报告中基金信息内容的真实、准确和完整发表意见
本基金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。
5.4 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

资产	本期 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	5,115,137.43	7,118,382.61
结算备付金	159,430.65	226,546.87
存出保证金	6,996.87	21,126.49
交易性金融资产	58,063,031.96	81,330,218.13
应收利息	58,063,031.96	81,330,218.13
基金投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
其他应收款	1,091.07	-
其他资产	-	-
资产总计	64,038,665.93	89,791,662.28
负债和所有者权益:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	102,389.64	-
应付管理人报酬	43,421.88	60,754.60
应付销售服务费	5,422.74	7,534.34
应付利息	1,722.94	2,097.47
应付交易费用	100,157.22	139,246.81
应付税费	-	-
其他负债	-	-
所有者权益:		
实收基金	73,151,060.16	84,007,382.73
未分配利润	-9,826,229.03	4,382,006.46
所有者权益合计	63,324,831.13	88,399,391.19
所有者权益总计	64,038,665.93	89,791,662.28

注:报告截止日2018年6月30日,大成中证360互联网A类基金份额净值0.889元,大成中证360互联网C类基金份额净值0.863元,基金份额总额为73,151,060.16份,其中大成中证360互联网A类基金份额68,968,439.03份,大成中证360互联网C类基金份额4,182,621.13份。

6.1.2 利润表
会计主体:大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-12,236,662.27	-7,216,153.32
1.利息收入	21,896.28	30,743.46
2.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-8,888,724.08	-781,644.66
3.投资收益(损失以“-”号填列)	-9,177,727.27	-1,302,897.28
4.其他收入	-	-
二、费用	29,077.99	72,524.38
1.管理人报酬	297,401.09	496,373.66
2.托管费	37,176.15	61,923.85
3.销售服务费	11,079.67	8,308.44
4.其他费用	346,234.08	580,520.05
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-12,258,565.99	-7,246,897.70
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-12,258,565.99	-7,246,897.70
五、其他综合收益	-	-
六、综合收益总额	-12,258,565.99	-7,246,897.70

注:本基金本报告期及上年度可比期间无当期发生的应支付关联方的销售服务费。
6.4.4.3 关联方及关联方关系
6.4.4.3.1 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
6.4.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的关联方

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册地和基金销售机构	基金管理人、注册地和基金销售机构
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	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。
6.4.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.4.1 通过交易单元交易的情况
本基金本报告期及上年度可比期间无通过交易单元进行的交易。
6.4.4.2 关联方报酬

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	297,401.09	496,373.66
期末应付给机构的客户报酬	136,042.90	196,216.11

注:支付基金管理人大成基金的报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。
6.4.4.2.2 基金托管费

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	37,176.15	61,923.85
期末应付给机构的客户报酬	136,042.90	196,216.11

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。
6.4.4.2.3 销售服务费
支付基金销售机构的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:
日销售服务费=C类基金份额对应的资产净值×0.6%÷当年天数。
本基金本报告期及上年度可比期间无当期发生的应支付关联方的销售服务费。
6.4.4.3 关联方及关联方关系
6.4.4.3.1 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
6.4.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的关联方

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册地和基金销售机构	基金管理人、注册地和基金销售机构
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	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。
6.4.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.4.1 通过交易单元交易的情况
本基金本报告期及上年度可比期间无通过交易单元进行的交易。
6.4.4.2 关联方报酬

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的报酬	297,401.09	496,373.66
期末应付给机构的客户报酬	136,042.90	196,216.11

注:支付基金管理人大成基金的报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。
6.4.4.2.2 基金托管费
支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。
6.4.4.2.3 销售服务费
支付基金销售机构的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:
日销售服务费=C类基金份额对应的资产净值×0.6%÷当年天数。
本基金本报告期及上年度可比期间无当期发生的应支付关联方的销售服务费。
6.4.4.3 关联方及关联方关系
6.4.4.3.1 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
6.4.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的关联方

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、注册地和基金销售机构	基金管理人、注册地和基金销售机构
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	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。
6.4.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联交易
6.4.4.1 通过交易单元交易的情况
本基金本报告期及上年度可比期间无通过交易单元进行的交易。
6.4.4.2 关联方报酬

注:本基金本报告期及上年度可比期间无当期发生的应支付关联方的销售服务费。
6.4.4.3 关联方及关联方关系
6.4.4.3.1 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
6.4.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的关联方

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		所有者权益合计
	实收基金	未分配利润	
一、期初所有者权益(基金净值)	84,007,382.73	4,382,006.46	88,399,391.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-12,258,565.99	-7,246,897.70	-19,505,463.69
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净申购减少以“-”号填列)	-10,856,238.07	-775,500.94	-11,631,739.01
其中:1.基金申购款	19,626,500.65	-219,720.14	19,406,780.51
2.基金赎回款	-30,482,738.72	-655,780.79	-31,138,519.51
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净赎回减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	73,151,060.16	-9,826,229.03	63,324,831.13

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

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	0.00	0.00
B	医药生物	561,690.00	0.88
C	制造业	34,121,117.50	53.68
D	电力、热力、燃气及水利生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	569,098.00	0.89
F	批发和零售业	2,366,208.00	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	53,426.00	0.08