

大成中证互联网金融指数分级证券投资基金
2017 年半年度报告
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。

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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.4 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的情况.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45

§11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金		
基金简称	大成互联网金融指数分级		
场内简称	互联网金融		
基金主代码	502036		
交易代码	502036		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 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	82,795,534.35 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 7 日		
下属分级基金的基金简称	互联网金融	网金 A	网金 B
下属分级基金场内简称：	互联网金融	网金 A	网金 B
下属分级基金的交易代码	502036	502037	502038
报告期末下属分级基金份额总额	76,409,312.35 份	3,193,111.00 份	3,193,111.00 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控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>本基金力争互联网金融份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证互联网金融指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。从本基金所分离的两类基金份额来看，互联网金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对

	稳定的特征；互联网金融 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	较高风险、较高预期收益	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益

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	郭明
	联系电话	0755-83183388	010-66105799
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008885558	95588
传真		0755-83199588	010-66105798
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		刘卓	易会满

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》、《中国证券报》、《上海证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-2,488,698.07
本期利润	-5,906,538.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0749
本期加权平均净值利润率	-7.49%
本期基金份额净值增长率	-6.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-41,957,739.30
期末可供分配基金份额利润	-0.5068
期末基金资产净值	80,872,652.35
期末基金份额净值	0.9768
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-34.15%

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、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）。

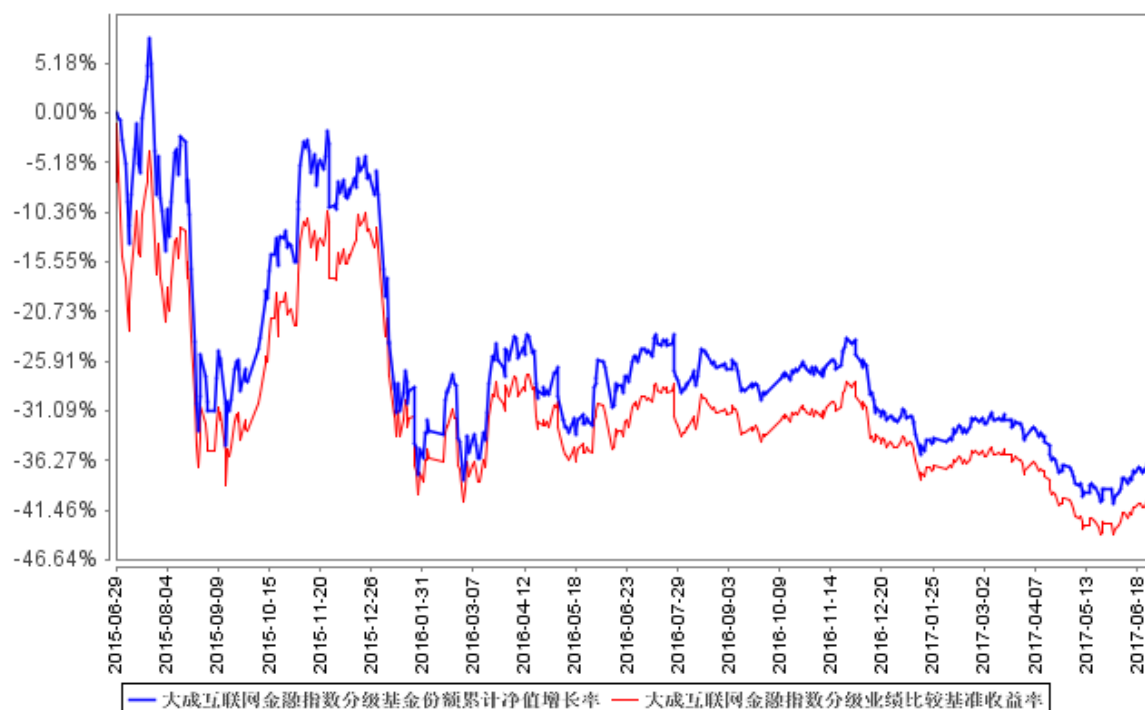
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	4.54%	0.91%	4.48%	0.86%	0.06%	0.05%
过去三个月	-4.11%	0.89%	-4.53%	0.88%	0.42%	0.01%
过去六个月	-6.51%	0.85%	-8.18%	0.85%	1.67%	0.00%
过去一年	-13.05%	0.96%	-14.36%	0.96%	1.31%	0.00%
自基金合同生效起至今	-34.15%	2.25%	-40.26%	2.25%	6.11%	0.00%

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。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期末（2017年6月30日）
网金 A 与网金 B 基金份额配比	1:1
期末网金 A 份额参考净值	1.0297
期末网金 B 份额参考净值	0.9239
大成网金 A 的预计年收益率	5.50%

§ 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		
苏秉毅先生	本基金基金经理、数量与指数投资部副总监	2015年6月29日	-	13年	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日担任深证成长40

					<p>交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012 年 8 月 24 日起任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013 年 1 月 1 日至 2015 年 8 月 25 日兼任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2013 年 2 月 7 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 5 日起任大成深证成份交易型开放式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 3 月 4 日起担任大成核心双动力混合型证券投资基金及大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任数量与指数投资部副总监。具有基金从业资格。国籍：中国</p>
夏高先生	本基金基金经理	2015 年 6 月 29 日	-	6 年	<p>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</p>

					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 日起担任大成智慧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，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%，中证互联网金融指数下跌 8.62%。

在本报告期内，本基金严格按照中证互联网金融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 0.63%，日均偏离度为 0.02%，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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9768 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.51%，业绩比较基准收益率为-8.18%。

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

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互联网金融指数分级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，大成中证互联网金融指数分级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互联网金融指数分级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，大成中证互联网金融指数分级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互联网金融指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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：大成中证互联网金融指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.3.1	4,718,385.62	6,173,294.32
结算备付金		-	-
存出保证金		1,824.36	8,187.00
交易性金融资产	6.4.3.2	75,124,335.87	87,698,515.26
其中：股票投资		75,124,335.87	87,698,515.26
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		1,466,300.85	-
应收利息	6.4.3.5	877.26	1,295.35
应收股利		-	-
应收申购款		3,836.75	29.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		81,315,560.71	93,881,321.90
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		85,460.79	108,186.60
应付管理人报酬		65,748.41	82,519.47
应付托管费		14,464.64	18,154.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	18,679.35	24,780.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	258,555.17	220,407.71
负债合计		442,908.36	454,048.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	122,830,391.65	132,659,100.40
未分配利润	6.4.3.10	-41,957,739.30	-39,231,826.86
所有者权益合计		80,872,652.35	93,427,273.54
负债和所有者权益总计		81,315,560.71	93,881,321.90

注：截止本报告期末，基金份额总额 82,795,534.35 份，其中大成中证互联网金融指数分级证券投资基金之基础份额的份额总额为 76,409,312.35 份，基金份额净值 0.9768 元；大成中证互联网金融指数分级证券投资基金之 A 份额的份额总额为 3,193,111.00 份，基金份额参考净值 1.0297 元；大成中证互联网金融指数分级证券投资基金之 B 份额的份额总额为 3,193,111.00 份，基金份额参考净值 0.9239 元。

6.2 利润表

会计主体：大成中证互联网金融指数分级证券投资基金

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	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-5,033,440.72	-51,847,585.02
1.利息收入		19,675.39	35,146.87
其中：存款利息收入	6.4.3.11	19,675.39	35,146.87
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,642,957.11	-23,326,295.95
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-2,114,715.18	-24,144,232.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	471,758.07	817,936.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-3,417,840.67	-28,685,969.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	7,681.67	129,533.64
减：二、费用		873,098.02	1,385,577.62
1. 管理人报酬	6.4.6.1.1	429,440.94	691,369.50
2. 托管费	6.4.6.1.2	94,477.01	152,101.32
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	40,664.80	208,099.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	308,515.27	334,007.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,906,538.74	-53,233,162.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,906,538.74	-53,233,162.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中证互联网金融指数分级证券投资基金

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）	132,659,100.40	-39,231,826.86	93,427,273.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,906,538.74	-5,906,538.74
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）	-9,828,708.75	3,180,626.30	-6,648,082.45
其中：1.基金申购款	2,114,938.36	-694,842.19	1,420,096.17
2.基金赎回款	-11,943,647.11	3,875,468.49	-8,068,178.62
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）	122,830,391.65	-41,957,739.30	80,872,652.35

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 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）	273,654,844.48	-19,735,116.68	253,919,727.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-53,233,162.64	-53,233,162.64
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）	-119,139,428.04	35,471,074.10	-83,668,353.94
其中：1.基金申购款	27,005,673.03	-7,008,195.69	19,997,477.34
2.基金赎回款	-146,145,101.07	42,479,269.79	-103,665,831.28
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）	154,515,416.44	-37,497,205.22	117,018,211.22

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>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>崔伟</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 重要会计政策和会计估计

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[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[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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	4,718,385.62
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,718,385.62

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	100,895,358.03	75,124,335.87	-25,771,022.16

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	100,895,358.03	75,124,335.87	-25,771,022.16

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	876.54
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.72
合计	877.26

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	18,679.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	18,679.35

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	283.90
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	208,271.27
合计	258,555.17

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	89,420,694.67	132,659,100.40
本期申购	1,425,605.13	2,114,938.36
本期赎回(以“-”号填列)	-8,050,765.45	-11,943,647.11
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	82,795,534.35	122,830,391.65

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-27,802,506.37	-11,429,320.49	-39,231,826.86
本期利润	-2,488,698.07	-3,417,840.67	-5,906,538.74
本期基金份额交易产生的变动数	2,054,957.26	1,125,669.04	3,180,626.30
其中：基金申购款	-437,144.92	-257,697.27	-694,842.19
基金赎回款	2,492,102.18	1,383,366.31	3,875,468.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,236,247.18	-13,721,492.12	-41,957,739.30

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	19,517.69
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	127.31
其他	30.39
合计	19,675.39

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	16,072,443.37
减：卖出股票成本总额	18,187,158.55
买卖股票差价收入	-2,114,715.18

6.4.3.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.3.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	471,758.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	471,758.07

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-3,417,840.67
——股票投资	-3,417,840.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-3,417,840.67

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	7,681.67
合计	7,681.67

注：本基金的场内赎回费率为固定值 0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额 25% 的部分归入基金资产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	40,664.80
银行间市场交易费用	-
合计	40,664.80

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	244.00
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	308,515.27

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 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、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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.6.1 关联方报酬

6.4.6.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	429,440.94	691,369.50
其中：支付销售机构的客户维护费	171,197.82	293,024.30

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 1.00%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×1.00%÷当年天数。

6.4.6.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	94,477.01	152,101.32

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 0.22%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×0.22%÷当年天数。

6.4.6.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.3.1 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。

6.4.6.3.2 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。

6.4.6.4 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1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
工商银行	4,718,385.62	19,517.69	7,222,851.50	33,971.52

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。

6.4.6.5 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。

6.4.6.6 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。

6.4.7 利润分配情况

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金不进行收益分配。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.2 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
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	临时停牌	28.63	-	-	51,249	2,645,520.75	1,467,258.87	-
300085	银之杰	2017 年 6 月 30 日	临时停牌	18.50	2017 年 7 月 7 日	18.88	40,770	1,523,861.84	754,245.00	-
002711	欧浦智网	2017 年 6 月 26 日	临时停牌	18.79	2017 年 7 月 17 日	12.01	39,320	607,261.32	738,822.80	-
600289	亿阳信通	2017 年 5 月 10 日	临时停牌	10.94	2017 年 8 月 18 日	12.03	65,300	1,058,821.11	714,382.00	-
300322	硕贝德	2017 年 2 月 23 日	临时停牌	17.02	2017 年 8 月 7 日	15.32	35,200	493,269.61	599,104.00	-

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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 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。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。从本基金所分拆的两类基金份额来看，互联网金融 A 类份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；互联网金融 B 类份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

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。

6.4.9.2 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行中国工商银行，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。

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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有债券投资。(上年度末：同)。

6.4.9.3 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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和结算备付金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	4,718,385.62	-	-	-	4,718,385.62
存出保证金	1,824.36	-	-	-	1,824.36
交易性金融资产	-	-	-	75,124,335.87	75,124,335.87
应收证券清算款	-	-	-	1,466,300.85	1,466,300.85
应收利息	-	-	-	877.26	877.26
应收申购款	-	-	-	3,836.75	3,836.75
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,720,209.98	-	-	76,595,350.73	81,315,560.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	85,460.79	85,460.79
应付管理人报酬	-	-	-	65,748.41	65,748.41
应付托管费	-	-	-	14,464.64	14,464.64
应付交易费用	-	-	-	18,679.35	18,679.35
其他负债	-	-	-	258,555.17	258,555.17
负债总计	-	-	-	442,908.36	442,908.36
利率敏感度缺口	4,720,209.98	-	-	76,152,442.37	80,872,652.35
上年度末 2016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	6,173,294.32	-	-	-	6,173,294.32
存出保证金	8,187.00	-	-	-	8,187.00
交易性金融资产	-	-	-	87,698,515.26	87,698,515.26
应收利息	-	-	-	1,295.35	1,295.35
应收申购款	-	-	-	29.97	29.97
资产总计	6,181,481.32	-	-	87,699,840.58	93,881,321.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	108,186.60	108,186.60
应付管理人报酬	-	-	-	82,519.47	82,519.47
应付托管费	-	-	-	18,154.28	18,154.28
应付交易费用	-	-	-	24,780.30	24,780.30
其他负债	-	-	-	220,407.71	220,407.71

负债总计	-	-	-	454,048.36	454,048.36
利率敏感度缺口	6,181,481.32	-	-	87,245,792.22	93,427,273.54

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，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）

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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，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和备选成份股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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2017 年 6 月 30 日		2016 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	75,124,335.87	92.89	87,698,515.26	93.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	75,124,335.87	92.89	87,698,515.26	93.87

6.4.9.4.3.2 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 (2017 年 6 月 30 日)	上年度末 (2016 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%	4,050,000.00	4,990,000.00
2. 业绩比较基准下降 5%	-4,050,000.00	-4,990,000.00	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	75,124,335.87	92.39
	其中：股票	75,124,335.87	92.39
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	4,718,385.62	5.80
7	其他各项资产	1,472,839.22	1.81
8	合计	81,315,560.71	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	16,742,369.75	20.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	2,832,920.50	3.50
G	交通运输、仓储和邮政业	738,822.80	0.91
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,142,382.90	33.56
J	金融业	21,377,389.18	26.43
K	房地产业	3,279,969.32	4.06
L	租赁和商务服务业	3,010,481.42	3.72
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00

R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	75,124,335.87	92.89

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	57,400	2,679,432.00	3.31
2	601318	中国平安	48,700	2,416,007.00	2.99
3	300136	信维通信	60,100	2,405,202.00	2.97
4	600271	航天信息	116,258	2,399,565.12	2.97
5	002024	苏宁云商	208,810	2,349,112.50	2.90
6	000001	平安银行	240,700	2,260,173.00	2.79
7	600177	雅戈尔	223,081	2,257,579.72	2.79
8	601998	中信银行	358,461	2,254,719.69	2.79
9	601166	兴业银行	133,500	2,250,810.00	2.78
10	601555	东吴证券	198,003	2,223,573.69	2.75
11	600109	国金证券	188,500	2,209,220.00	2.73
12	601216	君正集团	445,980	2,180,842.20	2.70
13	000997	新大陆	95,855	2,174,949.95	2.69
14	300059	东方财富	177,840	2,137,636.80	2.64
15	300033	同花顺	31,400	1,953,394.00	2.42
16	002385	大北农	299,145	1,881,622.05	2.33
17	002183	怡亚通	216,434	1,867,825.42	2.31
18	002410	广联达	97,900	1,840,520.00	2.28
19	600588	用友网络	106,800	1,828,416.00	2.26
20	600909	华安证券	169,100	1,706,219.00	2.11
21	000627	天茂集团	199,100	1,608,728.00	1.99
22	300104	乐视网	51,249	1,467,258.87	1.81
23	600446	金证股份	73,169	1,286,311.02	1.59
24	601375	中原证券	124,900	1,256,494.00	1.55
25	300166	东方国信	91,857	1,233,639.51	1.53

26	300079	数码视讯	201,000	1,175,850.00	1.45
27	600198	大唐电信	90,100	1,150,577.00	1.42
28	000712	锦龙股份	69,800	1,142,626.00	1.41
29	002261	拓维信息	97,300	1,139,383.00	1.41
30	300077	国民技术	82,256	1,126,084.64	1.39
31	002670	国盛金控	69,900	1,111,410.00	1.37
32	002153	石基信息	46,600	1,059,218.00	1.31
33	002285	世联行	127,480	1,022,389.60	1.26
34	002657	中科金财	34,500	1,000,155.00	1.24
35	300170	汉得信息	87,600	903,156.00	1.12
36	002104	恒宝股份	83,400	783,126.00	0.97
37	002095	生意宝	22,107	764,017.92	0.94
38	300085	银之杰	40,770	754,245.00	0.93
39	002711	欧浦智网	39,320	738,822.80	0.91
40	600289	亿阳信通	65,300	714,382.00	0.88
41	300339	润和软件	52,200	657,720.00	0.81
42	600745	中茵股份	34,101	638,029.71	0.79
43	002344	海宁皮城	74,800	622,336.00	0.77
44	300377	赢时胜	54,400	619,616.00	0.77
45	300226	上海钢联	16,301	606,397.20	0.75
46	300322	硕贝德	35,200	599,104.00	0.74
47	002797	第一创业	60,080	553,336.80	0.68
48	300178	腾邦国际	40,650	520,320.00	0.64
49	000987	越秀金控	41,600	483,808.00	0.60
50	002197	证通电子	37,900	476,024.00	0.59
51	300386	飞天诚信	24,374	433,613.46	0.54
52	600870	厦华电子	53,500	422,650.00	0.52
53	300205	天喻信息	37,605	390,339.90	0.48
54	600599	熊猫金控	15,600	384,072.00	0.47
55	300248	新开普	23,601	381,628.17	0.47
56	300295	三六五网	19,700	368,587.00	0.46
57	002315	焦点科技	13,900	346,666.00	0.43
58	002017	东信和平	30,301	337,250.13	0.42
59	300130	新国都	17,500	330,575.00	0.41
60	000948	南天信息	25,200	306,432.00	0.38
61	300531	优博讯	12,300	260,268.00	0.32
62	300380	安硕信息	10,000	247,600.00	0.31
63	300312	邦讯技术	18,800	238,008.00	0.29
64	300546	雄帝科技	5,900	185,260.00	0.23

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

本基金本报告期末未持有积极投资。

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	600909	华安证券	1,679,639.00	1.80
2	601375	中原证券	1,262,779.00	1.35
3	002670	国盛金控	1,100,988.00	1.18
4	601216	君正集团	736,715.00	0.79
5	000987	越秀金控	500,270.72	0.54
6	002183	怡亚通	376,821.00	0.40
7	002385	大北农	363,346.00	0.39
8	600570	恒生电子	344,482.00	0.37
9	300531	优博讯	278,750.00	0.30
10	300079	数码视讯	231,797.37	0.25
11	300059	东方财富	231,240.00	0.25
12	600198	大唐电信	218,329.00	0.23
13	300166	东方国信	209,686.10	0.22
14	300546	雄帝科技	187,916.00	0.20
15	002657	中科金财	149,474.60	0.16
16	002711	欧浦智网	140,423.00	0.15
17	300339	润和软件	137,725.00	0.15
18	002344	海宁皮城	123,393.00	0.13
19	300248	新开普	82,844.00	0.09
20	300380	安硕信息	49,872.00	0.05

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	601318	中国平安	1,433,672.00	1.53
2	000627	天茂集团	1,119,490.20	1.20

3	300178	腾邦国际	1,063,953.00	1.14
4	002285	世联行	930,479.49	1.00
5	000712	锦龙股份	882,477.00	0.94
6	300136	信维通信	833,374.08	0.89
7	600870	厦华电子	634,431.00	0.68
8	601166	兴业银行	586,983.00	0.63
9	000001	平安银行	560,543.00	0.60
10	002797	第一创业	541,704.00	0.58
11	601519	*ST 智慧	530,626.00	0.57
12	600177	雅戈尔	520,123.40	0.56
13	601998	中信银行	416,358.00	0.45
14	002024	苏宁云商	389,926.00	0.42
15	600599	熊猫金控	347,917.75	0.37
16	600109	国金证券	261,438.00	0.28
17	600271	航天信息	212,981.00	0.23
18	300377	赢时胜	167,890.00	0.18
19	300583	赛托生物	124,217.52	0.13
20	601555	东吴证券	114,140.00	0.12

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	9,030,819.83
卖出股票收入（成交）总额	16,072,443.37

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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	1,824.36
2	应收证券清算款	1,466,300.85
3	应收股利	-
4	应收利息	877.26
5	应收申购款	3,836.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,472,839.22
---	----	--------------

7.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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
互联网金融	2,815	27,143.63	1,885,476.00	2.47%	74,523,836.35	97.53%
网金 A	86	37,129.20	1,409,161.00	44.13%	1,783,950.00	55.87%
网金 B	497	6,424.77	27,268.00	0.85%	3,165,843.00	99.15%
合计	3,398	24,365.96	3,321,905.00	4.01%	79,473,629.35	95.99%

注：1、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末上市基金前十名持有人

互联网金融

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	海通资管—上海银行—海通赢家系列—年年鑫集合资产管理计划	977,579.00	30.62%
2	张文江	355,000.00	11.12%
3	王雁波	343,153.00	10.75%
4	李家琪	216,400.00	6.78%
5	海通资管—建行—海通海蓝宝润集合资产管理计划	209,333.00	6.56%
6	上海明沘投资管理有限公司—明沘多策略对冲 1 号基金	188,075.00	5.89%
7	曾珠	93,944.00	2.94%
8	付炜	93,900.00	2.94%
9	李怡名	92,459.00	2.90%
10	高明桂	69,900.00	2.19%

网金 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈天涯	295,486.00	9.25%
2	吴同新	200,000.00	6.26%
3	谢纳新	177,623.00	5.56%
4	杨珍荣	175,531.00	5.50%
5	陈国忠	152,873.00	4.79%

6	贡维贞	116,865.00	3.66%
7	邱继荣	50,900.00	1.59%
8	程鑫源	50,826.00	1.59%
9	杨炜	47,600.00	1.49%
10	王秀	46,795.00	1.47%

网金 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	袁慧	2,044,759.00	30.82%
2	海通资管—上海银行—海通赢家系列—年年鑫集合资产管理计划	1,884,625.00	28.40%
3	钱兰英	281,236.00	4.24%
4	王绍英	170,000.00	2.56%
5	马鑫	131,764.00	1.99%
6	徐建强	128,274.00	1.93%
7	李月凤	87,831.00	1.32%
8	苏兆平	85,471.00	1.29%
9	马玉蓉	79,078.00	1.19%
10	陈东红	78,674.00	1.19%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	互联网金融	1,285.85	0.0017%
	网金 A	-	-
	网金 B	-	-
	合计	1,285.85	0.0017%

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）。

8.4 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的情况

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	互联网金融	0
	网金 A	0
	网金 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	互联网金融	0
	网金 A	0

	网金 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	互联网金融	网金 A	网金 B
基金合同生效日（2015 年 6 月 29 日） 基金份额总额	215,967,281.63	36,375,764.00	36,375,764.00
本报告期期初基金份额总额	80,472,972.67	4,473,861.00	4,473,861.00
本报告期基金总申购份额	1,425,605.13	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	8,050,765.45	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	2,561,500.00	-1,280,750.00	-1,280,750.00
本报告期期末基金份额总额	76,409,312.35	3,193,111.00	3,193,111.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议（以下简称“董事会”）审议通过，杜鹏女士不再担任公司督察长。董事会同时决议，同意在公司新督察长任职前，由公司总经理罗登攀先生代为履行督察长职务，代为履职时间不超过 90 日。基金管理人于 2017 年 5 月 17 日发布了《大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告》，经公司第六届董事会第二十六次会议审议通过，决定继续由总经理罗登攀先生代为履行督察长职务。代为履职的时间自董事会决议通过之日起不超过 90 日。

2、基金管理人于 2017 年 2 月 18 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十四次会议审议通过，陈翔凯先生、谭晓冈先生和姚余栋先生担任公司副总经理。

二、基金托管人基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金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有限公司，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

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
申银万国	1	14,462,608.04	58.81%	13,179.86	58.81%	-
长江证券	1	9,026,750.15	36.71%	8,225.82	36.70%	-
中信证券	1	1,102,799.97	4.48%	1,005.05	4.48%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：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。

本报告期内本基金退租交易单元：无；新增交易单元：东方证券、长江证券。

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	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月28日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月27日
3	大成基金关于旗下部分基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月21日
4	大成基金关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月16日

	构的公告		
5	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月14日
6	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中文在线”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
7	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三诺生物”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
8	大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年6月2日
9	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月27日
10	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月24日
11	大成基金管理有限公司关于总经理继续代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月17日
12	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月12日
13	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月12日
14	大成基金关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月6日
15	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统建行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年5月4日
16	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月29日
17	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月28日
18	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月28日
19	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月27日
20	大成基金管理有限公司关于《上海证券交易所分级基金业务管理指	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年4月26日

	引》实施的风险提示公告		
21	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 22 日
22	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 2017 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 21 日
23	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 18 日
24	大成基金管理有限公司关于撤销北京理财中心的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 14 日
25	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 11 日
26	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 4 月 1 日
27	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 31 日
28	大成基金管理有限公司更正公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 29 日
29	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
30	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 2016 年年度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
31	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为开放式基金销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 25 日
32	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 17 日
33	大成基金管理有限公司关于调整网上直销系统招行直联渠道基金交易费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 8 日
34	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加长沙银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 3 月 7 日
35	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（姚余栋）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
36	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（谭晓冈）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
37	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（杜鹃）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
38	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（陈翔凯）	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 18 日
39	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加汉口银行股份有限公司	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017 年 2 月 15 日

	公司为销售机构的公告		
40	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金更新招募说明书(2016年2期)-摘要	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月11日
41	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金更新招募说明书(2016年2期)	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月11日
42	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年2月11日
43	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月21日
44	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月19日
45	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月17日
46	大成基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月17日
47	关于大成基金管理有限公司旗下部分基金增加郑州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月11日
48	大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统适用渠道大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月11日
49	关于大成基金管理有限公司撤销西安分公司的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月6日
50	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金之互联网金融 A 份额 2017 年度约定年基准收益率的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月4日
51	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金之互联网金融 A 份额 2017 年度约定年基准收益率的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月4日
52	大成基金管理有限公司关于旗下基金实行网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及本公司网站	2017年1月3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互联网金融指数分级证券投资基金的文件；
- 2、《大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成中证互联网金融指数分级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、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

本期报告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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人大成基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费用）

国际互联网址：<http://www.dcfund.com.cn>

大成基金管理有限公司

2017年8月24日