大成中证互联网金融指数分级 证券投资基金 2020年第1季度报告

2020年3月31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: 2020年4月22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规定,于 2020 年 4 月 21 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2020年1月1日起至3月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	大成互联网金融指数分级		
场内简称	互联金融		
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		
报告期末基金份额总额	54, 225, 126. 16 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		
	跟踪偏离度控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%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。		
	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。		

	本基金力争互联网金融份	额净值增长率与同期业约	责比较基准之间的日	
	均跟踪偏离度不超过 0.39	5%,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起	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。			
业绩比较基准	95%×中证互联网金融指数收益率+5%×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	益相对较高的特征。	
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	互联金融	网金 A	网金 B	
下属分级基金的场内简称	互联金融	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的			0.554.014.00.00	
份额总额	48, 675, 504. 16 份	2,774,811.00 份	2,774,811.00份	
下属分级基金的风险收益	₩ 숙 등 대사		<u> </u>	
特征	较高风险、较高预期收益	低风险、収益相对稳定	尚风险、尚视期収益	

§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(2020年1月1日-2020年3月31日)
1. 本期已实现收益	-395, 840. 93
2. 本期利润	-3, 251, 852. 37
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0575
4. 期末基金资产净值	44, 185, 982. 26
5. 期末基金份额净值	0. 8149

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。

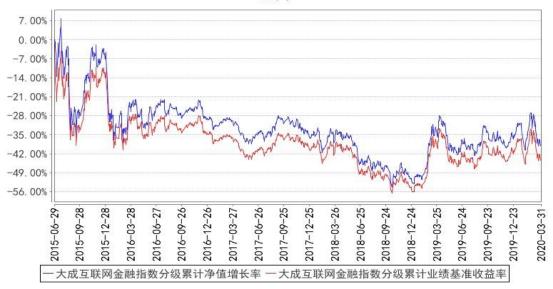
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率	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	-7. 10%	2. 55%	-7. 43%	2. 59%	0.33%	-0.04%

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

大成互联网金融指数分级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: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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	田务 任本基金的基金经理期限		江光月小左阳	2只 四	
姓名	い 分	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
苏秉毅	本基金基金 经理,数量 与指数投资 部副总监	2015年6月29日	-	16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,曾担
		任规划发展部
		高级产品设计
		师、数量与指
		数投资部基金
		经理助理,现
		任数量与指数
		投资部副总
		监。2012年8
		月 28 日至
		2014年1月23
		日任大成中证
		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
		日任深证成长
		40 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

					ロス 001 F 左 0
					日至 2015 年 8
					月 25 日任大
					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。2018年
					6月26日起任
					大成景恒混合
					型证券投资基
					金基金经理。
					具有基金从业
					资格。国籍:
					中国
					工学博士。
					2011年1月至
					2012年5月就
	本基金基金				职于博时基金
夏高	经理	2015年6月29日	_	9年	管理有限公
					司,任股票投
					资部投资分析
					员。2012年7
	<u> </u>	<u> </u>			八。2012 午1

金管理有限公司,自新数量分析所,是是一个的人,也是一个的人,也是一个的人,也是一个的人,也是一个的人,也是一个的人,也是一个的人,也是一个的人,也是一个的人,也是一个的人,也是一个一个的人,也是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			ı	
司,曾报教设资部所从,是是一个的人,是一个的人,是一个的人,是一个的人,是一个的人,是一个的人,是一个的人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个人,是一个				月加入大成基
量与指数数分析师理是全级任数量全级任数量全级任数量。2014年12月6中证券登理。2014年12月6中证券经理。2015担担任政数证基金全6月大成中证据数资理。2015担担证数资理。2015担担证数数是全2月间,100分数理。2016年12日起任代的数据,2016年12日起任代的数据,2017年12日起任代配数据。2017年12日起任代配置投资理。2017年12日起任代配置投资理。2017年12日起生代和12时间,12时间,12时间,12时间,12时间,12时间,12时间,12时间,				金管理有限公
部高级基金经理助理,现数是分析师证,现实是一个证明,现实是一个证明,现实是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一个证明,是一个正确,是一种正确,是一种正是一种是一种正确,是一种正确,是一种正确,是一种正是一种正确,是一种正确,是一种正确,是一种正确,是一种正确,是一种正确,是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是				司,曾担任数
析师、基金经理助理,现任数量与监助理。2014年12月6日近红投经理。2015年12月6日近红投经理。2015年12月12月2日近上担取分基金基金经理的指数基金基金经理,2016年2月成中证指数基金基金全月,3中区,100年2月成份,100年2月2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,100年2月,1				量与指数投资
理助理,现任数量与指数投资部总归4年12月6日起红利资理。2014年12月6日起红利资基金基金处理。2015年6月2成中证互联分经理。1日起担联分级基金处理。2016年2月3日在任大成联网级证券投资基。2016年2月3日担任大成联网指资基金基金基础经验经理。2017年3月2日是任务置限分经理。2017年3月2日是任务宣传、企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业				部高级数量分
数量与指数投资部总监助理。2014年12月6日起任大成中证红投资理。2015年6月25日起担任大成中证互联对分级证基金经理。2015年6月25日起担互联网金融指数分级证券投资基金2016年2月3日起任大成中证360互联的指资理。2017年3日起任大成型证券投经和工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工				析师、基金经
资部总监助理。2014年12月6日起任大成中证红牧投理。2015年6月25日起担任大成中证互联网金基金全理。2015年6月25日起担联网金融指数分级证券投资基金经理。2016年2月3日起任大成中证360互联网十数据100指资型证券经理工务2017年3月21日起任务成份。2017年3月21日起任多策启量化多策启量化多策启量化多策启量化多策启量和证券经经理。具有基金从业资格。国籍;				理助理,现任
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25日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金经理。2016年2月3日起任大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资理。2017年3月21日起任大成智惠量化支策强。2017年3月21日起任大成智惠量化多策。是基金经理。具有基金从业资格。国籍:				数量与指数投
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25日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金经理。2016年2月3日起任大成中证360互联网士发数据100指数型证券投资基金基金经理。2017年3月21日起任大成智惠量化方成智惠量化多策混合型证券投资格。国籍:				资部总监助
成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015年6月25日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金经理。2016年2月3日起任大成平的省份,在2月3日起任大成平的省份,在2月3日起任大成平的省份,在2月3日起任大成为省级。基金经理。2017年3月21日起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:				理。2014年12
数证券投资基金基金经理。2015年6月26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:				月6日起任大
金基金经理。2015年6月25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日起任大成智惠量化4岁策略灵活配置资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:				成中证红利指
2015年6月28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:				数证券投资基
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日起任大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券经理。具有基金从业资格。国籍:				金基金经理。
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日起任大成智惠量化多策略灵活配置很全型证券投资率。是有基金从业资格。国籍:				2015年6月29
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日起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:				日起担任大成
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日起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:				中证互联网金
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 日起任大成智 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:				融指数分级证
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日起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:				券投资基金基
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:				金经理。2016
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:				年2月3日起
数据 100 指数型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 21日起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:				任大成中证
型证券投资基金基金经理。 2017年3月21日起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:				360 互联网+大
金基金经理。 2017年3月21 日起任大成智 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:				数据 100 指数
2017年3月21 日起任大成智 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:				型证券投资基
日起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:				金基金经理。
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:				2017年3月21
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:				日起任大成智
型证券投资基金基金经理。 具有基金从业资格。国籍:				惠量化多策略
金基金经理。 具有基金从业 资格。国籍:				灵活配置混合
具有基金从业 资格。国籍:				型证券投资基
资格。国籍:				
				具有基金从业
中国				
				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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

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不存在同日反向交易。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不存在同日反向交易。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 报告期内基金投资策略和运作分析

今年初到一月中旬,受到中美签署第一阶段经贸协议等利好的刺激,市场延续了去年底以来的涨势,上证综指突破 3100 点。一月中旬到二月初,随着国内新型冠状病毒疫情的快速增长以及对经济和生活的严格管控,市场产生担忧,A股快速回调,并在春节后的第一个交易日集中释放风险情绪。随后以科技股为代表的受疫情影响相对较小的板块开始上涨,并带动市场快速反弹。三月,疫情在海外出现失控迹象,美国股市大幅下跌,出现多次熔断,全球市场情绪低迷,美联储等央行"放水"救市收效甚微。市场担心国内外疫情引起我国一季度经济大幅下滑,导致 A股大幅下挫,上证综指跌破 2700 点,科技股等前期上涨较多的板块跌幅较大。整体来看,在本季度,上证综指下跌 9.83%,沪深 300 指数下跌 10.02%,中证互联网金融指数下跌 7.91%。

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,年化跟踪误差为 0.79%, 日均跟踪偏离度为 0.04%。

4.5 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 0.8149 元;本报告期基金份额净值增长率为-7.10%,业绩比较基准收益率为-7.43%。

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	41, 065, 219. 65	91. 96
	其中: 股票	41, 065, 219. 65	91. 96
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	3, 583, 768. 57	8.03
8	其他资产	6, 465. 90	0.01
9	合计	44, 655, 454. 12	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		_
В	采矿业		_
С	制造业	8, 269, 652. 09	18.72
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	722, 280. 00	1. 63
Е	建筑业		_
F	批发和零售业	1, 143, 288. 30	2.59
G	交通运输、仓储和邮政业		_
Н	住宿和餐饮业		_
Ι	信息传输、软件和信息技术服 务业	17, 137, 861. 74	38. 79
J	金融业	12, 084, 569. 69	27. 35
K	房地产业	201, 313. 80	0.46

L	租赁和商务服务业	1, 471, 388. 83	3. 33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	<u> </u>	_
Q	卫生和社会工作	<u> </u>	_
R	文化、体育和娱乐业	<u> </u>	_
S	综合	_	_
	合计	41, 030, 354. 45	92. 86

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	-	_
В	采矿业	_	_
С	制造业	6, 722. 80	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和		
D	供应业	_	=
Е	建筑业	-	_
F	批发和零售业	15, 506. 82	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
I	信息传输、软件和信息技术服		
1	务业	_	_
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	12, 635. 58	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	_	-
S	综合	_	-
	合计	34, 865. 20	0.08

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 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	600588	用友网络	42, 983	1, 739, 092. 18	3. 94
2	002385	大北农	200, 845	1, 737, 309. 25	3. 93
3	600570	恒生电子	17,070	1, 500, 453. 00	3.40
4	300059	东方财富	88, 817	1, 425, 512. 85	3. 23
5	300033	同花顺	13,000	1, 411, 800. 00	3. 20
6	601555	东吴证券	178, 234	1, 411, 613. 28	3. 19
7	600109	国金证券	136, 500	1, 248, 975. 00	2. 83
8	600177	雅戈尔	183, 842	1, 171, 073. 54	2. 65
9	002024	苏宁易购	126, 610	1, 143, 288. 30	2. 59
10	600271	航天信息	59, 658	1, 138, 871. 22	2. 58

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	603353	和顺石油	558	15, 506. 82		0.04
2	300825	阿尔特	1, 182	12, 635. 58		0.03
3	002979	雷赛智能	686	6, 722. 80		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

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。

- 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未出现被监管部门立案调查,或在报告编制目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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	1, 920. 10
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	_

4	应收利息	735. 92
5	应收申购款	3, 809. 88
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	_
9	合计	6, 465. 90

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

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	601555	东吴证券	325, 757. 52	0.74	配股流通受限

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	占基金资产净	流通受限情况
17, 4	以示 [[阿	双 示石物	允价值 (元)	值比例(%)	说明
1	603353	和顺石油	15, 506. 82	0.04	新股流通受限
2	002979	雷赛智能	6, 722. 80	0.02	新股流通受限

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	互联金融	网金 A	网金 B
报告期期初基金份额总额	54, 672, 533. 92	2, 676, 511. 00	2, 676, 511. 00
报告期期间基金总申购份额	192, 244. 17	_	_
减:报告期期间基金总赎回份额	5, 992, 673. 93	_	_
报告期期间基金拆分变动份额	-196, 600. 00	98, 300. 00	98, 300. 00
(份额减少以"-"填列)	-190, 000. 00	96, 500. 00	98, 300. 00
报告期期末基金份额总额	48, 675, 504. 16	2, 774, 811. 00	2, 774, 811. 00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金折算后调整的份额。

§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

无。

§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。
- 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 2020 年 4 月 22 日