

大成中证互联网金融指数分级 证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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。本中期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 2020 年 8 月 27 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
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	38
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	38
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	38

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	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
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情况	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 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	大成中证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		
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	49,745,070.47 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份额总额	44,429,048.47 份	2,658,011.00 份	2,658,011.00 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	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>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%×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	<p>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。</p>		
	互联网金融	网金 A	网金 B
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	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.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	吴庆斌	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	-2,654,172.31
本期利润	2,594,067.83
加权平均基金份额本期利润	0.0475
本期加权平均净值利润率	5.42%
本期基金份额净值增长率	6.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-30,509,924.07
期末可供分配基金份额利润	-0.6133
期末基金资产净值	46,252,816.33
期末基金份额净值	0.9298
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-30.78%

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

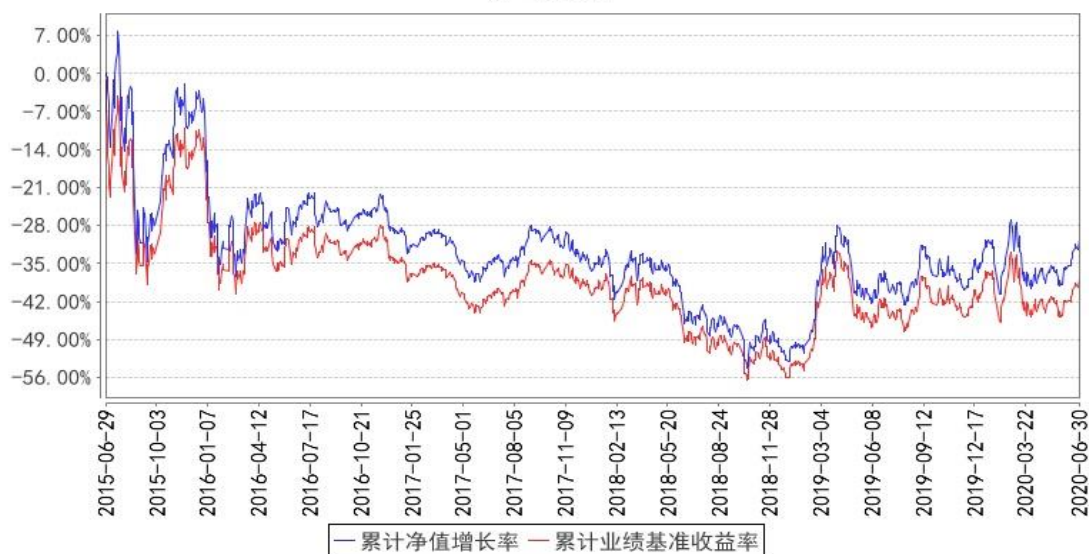
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	13.13%	1.21%	12.44%	1.26%	0.69%	-0.05%
过去三个月	14.10%	1.36%	12.42%	1.39%	1.68%	-0.03%
过去六个月	6.00%	2.03%	4.06%	2.07%	1.94%	-0.04%
过去一年	12.13%	1.72%	9.09%	1.75%	3.04%	-0.03%

过去三年	5.11%	1.66%	4.14%	1.66%	0.97%	0.00%
自基金合同生效起至今	-30.78%	1.92%	-37.79%	1.89%	7.01%	0.03%

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

大成中证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。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2020年1月1日至2020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	1.0296
期末网金B份额参考净值	0.8300
其他指标	报告期末（2020年6月30日）
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。

经过二十年的稳健发展，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 2020 年 6 月 30 日，公司管理公募基金产品数量共 103 只。

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	本基金基金经理	2015 年 6 月 29 日	-	9 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，曾担任数量与指数投资部高级数量分析师、基金经理助理，现任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
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 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、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
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.3 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；部分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 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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

今年上半年，受到新型冠状病毒疫情的影响，A 股市场呈现宽幅震荡的走势。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。二季度，随着国内疫情得到根本控制，以及流动性政策边际宽松，股票市场出现单边上涨的行情。其中消费者服务、医药、食品饮料、电子和传媒等受益于疫情被控制后需求预期好转的行业涨幅居前，而建筑、石油石化、纺织服装、煤炭和农林牧渔等行业表现落后。整体来看，今年上半年，上证指数下跌 2.15%，沪深 300 指数上涨 1.64%，中证互联网金融指数上涨 4.12%。

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 0.91%，日均跟踪偏离度为 0.04%，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 0.9298 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.00%，同期业绩比较基准收益率为 4.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，中国经济经受住了疫情的考验，大多数行业已经从受损中逐步恢复。A 股经过上半年的震荡调整，已经充分消化疫情对经济和市场的影响，夯实了估值底部。七月以来，市场快速上涨，创出今年以来的新高。外资加速流入 A 股，沪深两市成交量和公募基金发行规模也超过历史高点。这表明，中国经济有足够的韧性，在疫情不利的条件下仍然能够保持发展，作为中国经济“晴雨表”的 A 股对国内外投资者具有更强的吸引力。下半年，我们预期国家将会推出更多的改革开放措施，同时流动性相对宽松的局面仍将维持。资本市场改革加速，上证综指编制方案革

新，科创板 50 指数发布，创业板注册制方案落地，以及一系列改革措施，将有利于 A 股长期健康稳定发展。基于以上因素，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、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。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五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理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；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；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人员执行，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，投资组合经理作为估值小组成员，对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及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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

本基金在本报告期内，曾出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 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 托管人对本中期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 2020 年中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	3,146,368.25	3,543,956.41
结算备付金		-	-

存出保证金		2,104.57	1,352.47
交易性金融资产	6.4.3.2	43,290,046.73	49,407,991.40
其中：股票投资		43,290,046.73	49,407,991.40
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		240,527.83	-
应收利息	6.4.3.5	267.70	690.14
应收股利		-	-
应收申购款		3,843.02	940.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		46,683,158.10	52,954,931.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		164,598.55	98,738.91
应付管理人报酬		36,486.34	43,766.62
应付托管费		8,026.98	9,628.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	31,604.96	9,561.91
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	189,624.94	140,023.06
负债合计		430,341.77	301,719.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	66,853,486.23	80,669,851.22
未分配利润	6.4.3.10	-20,600,669.90	-28,016,638.98
所有者权益合计		46,252,816.33	52,653,212.24
负债和所有者权益总计		46,683,158.10	52,954,931.40

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 49,745,070.47 份，其中互联网金融基金份额总额为 44,429,048.47 份，基金份额净值 0.9298 元。网金 A 基金份额总额为 2,658,011.00 份，基

金份额净值 1.0296 元。网金 B 基金份额总额为 2,658,011.00 份，基金份额净值 0.8300 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,140,180.74	14,692,371.76
1. 利息收入		10,087.46	13,594.49
其中：存款利息收入	6.4.3.11	10,087.46	13,594.49
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,120,793.35	-1,107,848.68
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-2,394,263.84	-1,470,033.25
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		-	-
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	273,470.49	362,184.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	5,248,240.14	15,765,773.40
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	2,646.49	20,852.55
减：二、费用		546,112.91	559,101.59
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	238,382.69	272,190.07
2. 托管费	6.4.6.2.2	52,444.17	59,881.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	65,586.45	53,422.99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	189,699.60	173,606.72
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,594,067.83	14,133,270.17
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,594,067.83	14,133,270.17

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: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	80,669,851.22	-28,016,638.98	52,653,212.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,594,067.83	2,594,067.83
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)	-13,816,364.99	4,821,901.25	-8,994,463.74
其中: 1. 基金申购款	722,604.52	-256,906.98	465,697.54
2. 基金赎回款	-14,538,969.51	5,078,808.23	-9,460,161.28
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)	66,853,486.23	-20,600,669.90	46,252,816.33
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	92,359,923.43	-48,707,857.20	43,652,066.23

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,133,270.17	14,133,270.17
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)	-5,111,112.38	1,185,720.39	-3,925,391.99
其中: 1. 基金申购款	16,198,205.97	-6,363,790.33	9,834,415.64
2. 基金赎回款	-21,309,318.35	7,549,510.72	-13,759,807.63
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)	87,248,811.05	-33,388,866.64	53,859,944.41

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:

谭晓冈

周立新

刘亚林

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[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[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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，股票的股息、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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	3,146,368.25
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	3,146,368.25

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	44,521,383.05	43,290,046.73	-1,231,336.32
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	44,521,383.05	43,290,046.73	-1,231,336.32

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	266.89
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	-
应收资产支持证券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	0.81

合计	267.70
----	--------

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	31,604.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	31,604.96

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	117.34
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
应付指数使用费	100,000.00
合计	189,624.94

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,025,555.92	80,669,851.22
本期申购	537,682.70	722,604.52
本期赎回（以“-”号填列）	-10,818,168.15	-14,538,969.51
本期末	49,745,070.47	66,853,486.23

注：1. 本基金的基金份额包括互联网金融份额、互联网金融 A 份额和互联网金融 B 份额。本期申购含申购的互联网金融份额和配对转入的互联网金融 A 份额和互联网金融 B 份额，本期赎回含赎回的互联网金融份额和配对转出的互联网金融 A 份额和互联网金融 B 份额。

2. 截至本期末，本基金于上交所上市的互联网金融 A 份额为 2,658,011.00 份、互联网金融 B 份额为 2,658,011.00 份，互联网金融场内份额为 4,961,722.00 份，托管在场外未上市的互联网金融场外份额为 39,467,326.47 份。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，其中上市的基金份额可选择按市价流通，未上市的基金份额可按基金份额净值申购赎回；场外未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回，通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系

统之间的转换。

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	-33,719,529.86	5,702,890.88	-28,016,638.98
本期利润	-2,654,172.31	5,248,240.14	2,594,067.83
本期基金份额交易产生的变动数	5,863,778.10	-1,041,876.85	4,821,901.25
其中：基金申购款	-306,302.11	49,395.13	-256,906.98
基金赎回款	6,170,080.21	-1,091,271.98	5,078,808.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-30,509,924.07	9,909,254.17	-20,600,669.90

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	10,028.82
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	44.65
其他	13.99
合计	10,087.46

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	25,118,793.68
减：卖出股票成本总额	27,513,057.52
买卖股票差价收入	-2,394,263.84

6.4.3.13 债券投资收益

无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	273,470.49
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	273,470.49

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	5,248,240.14
股票投资	5,248,240.14
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,248,240.14

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	2,646.49
合计	2,646.49

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的0.5%，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	65,586.45
银行间市场交易费用	-
合计	65,586.45

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行划款手续费	192.00
指数使用费	100,000.00
上市费	29,835.26
合计	189,699.60

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币 50,000.00 元。

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

无。

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”）	基金销售机构、基金管理人
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金销售机构、基金托管人

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

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
光大证券	25,011,146.65	61.81	8,737,085.79	25.90

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	22,792.80	61.81	22,792.80	72.12
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
光大证券	7,962.31	25.91	7,962.31	49.24

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	238,382.69	272,190.07
其中：支付销售机构的客户维护费	92,162.87	106,442.77

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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	52,444.17	59,881.81

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。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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

无。

6.4.6.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	3,146,368.25	10,028.82	3,561,858.80	13,337.01

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2020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

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 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
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	746	4,431.24	4,431.24	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	732	7,327.32	7,327.32	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	345	6,082.35	6,082.35	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月2日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于本期末，本基金无债券投资(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。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般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存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	3,146,368.25	-	-	-	3,146,368.25
存出保证金	2,104.57	-	-	-	2,104.57
交易性金融资产	-	-	-	43,290,046.73	43,290,046.73
应收利息	-	-	-	267.70	267.70
应收申购款	-	-	-	3,843.02	3,843.02
应收证券清算款	-	-	-	240,527.83	240,527.83
资产总计	3,148,472.82	-	-	43,534,685.28	46,683,158.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	164,598.55	164,598.55
应付管理人报酬	-	-	-	36,486.34	36,486.34
应付托管费	-	-	-	8,026.98	8,026.98
应付交易费用	-	-	-	31,604.96	31,604.96
其他负债	-	-	-	189,624.94	189,624.94
负债总计	-	-	-	430,341.77	430,341.77
利率敏感度缺口	3,148,472.82	-	-	43,104,343.51	46,252,816.33
上年度末 2019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	3,543,956.41	-	-	-	3,543,956.41
存出保证金	1,352.47	-	-	-	1,352.47

交易性金融资产	-	-	-	49,407,991.40	49,407,991.40
应收利息	-	-	-	690.14	690.14
应收申购款	-	-	-	940.98	940.98
资产总计	3,545,308.88	-	-	49,409,622.52	52,954,931.40
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	98,738.91	98,738.91
应付管理人报酬	-	-	-	43,766.62	43,766.62
应付托管费	-	-	-	9,628.66	9,628.66
应付交易费用	-	-	-	9,561.91	9,561.91
其他负债	-	-	-	140,023.06	140,023.06
负债总计	-	-	-	301,719.16	301,719.16
利率敏感度缺口	3,545,308.88	-	-	49,107,903.36	52,653,212.24

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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 2020年6月30日		上年度末 2019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	43,290,046.73	93.59	49,407,991.40	93.84
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	43,290,046.73	93.59	49,407,991.40	93.84

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		
	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 (2020年6月30日)	上年度末 (2019年12月31日)
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	2,270,000.00	2,590,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,270,000.00	-2,590,000.00

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	43,290,046.73	92.73
	其中：股票	43,290,046.73	92.73
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	3,146,368.25	6.74
8	其他各项资产	246,743.12	0.53
9	合计	46,683,158.10	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	7,161,558.71	15.48
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	2,152,314.70	4.65
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	22,609,480.82	48.88
J	金融业	10,051,643.14	21.73
K	房地产业	113,497.20	0.25
L	租赁和商务服务业	1,153,826.24	2.49
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	43,242,320.81	93.49

7.2.2 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	-	-
C	制造业	31,552.26	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,279.84	0.01
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	9,893.82	0.02
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	47,725.92	0.10

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	78,800	1,591,760.00	3.44
2	600570	恒生电子	14,051	1,513,292.70	3.27
3	600588	用友网络	34,118	1,504,603.80	3.25
4	002410	广联达	20,900	1,456,730.00	3.15
5	002065	东华软件	105,900	1,325,868.00	2.87
6	002439	启明星辰	31,200	1,312,584.00	2.84
7	000977	浪潮信息	31,200	1,222,416.00	2.64
8	600271	航天信息	73,658	1,196,205.92	2.59
9	002024	苏宁易购	134,510	1,179,652.70	2.55
10	601166	兴业银行	74,000	1,167,720.00	2.52
11	000001	平安银行	87,700	1,122,560.00	2.43
12	601318	中国平安	15,601	1,113,911.40	2.41
13	002195	二三四五	377,152	1,059,797.12	2.29
14	002152	广电运通	79,400	1,027,436.00	2.22
15	300033	同花顺	7,200	958,176.00	2.07
16	600109	国金证券	80,500	918,505.00	1.99
17	601555	东吴证券	103,334	843,205.44	1.82
18	002268	卫士通	38,700	825,858.00	1.79
19	002153	石基信息	21,100	823,533.00	1.78
20	300226	上海钢联	10,141	797,082.60	1.72
21	000997	新大陆	48,555	775,908.90	1.68
22	300369	绿盟科技	31,600	735,964.00	1.59
23	002368	太极股份	16,400	716,516.00	1.55
24	300674	宇信科技	15,900	686,085.00	1.48
25	300348	长亮科技	33,400	634,600.00	1.37
26	002797	第一创业	81,580	564,533.60	1.22
27	300352	北信源	76,400	538,620.00	1.16
28	601998	中信银行	101,961	525,099.15	1.14
29	002183	怡亚通	97,934	524,926.24	1.13
30	002506	协鑫集成	200,900	524,349.00	1.13
31	000851	高鸿股份	59,800	494,546.00	1.07
32	000555	神州信息	32,000	492,160.00	1.06
33	002251	步步高	34,200	478,116.00	1.03
34	002010	传化智联	85,900	467,296.00	1.01
35	300170	汉得信息	46,600	448,292.00	0.97
36	300339	润和软件	42,000	435,540.00	0.94
37	600909	华安证券	60,300	411,849.00	0.89

38	300663	科蓝软件	13,867	384,254.57	0.83
39	300085	银之杰	23,370	374,387.40	0.81
40	002670	国盛金控	38,617	353,345.55	0.76
41	000627	天茂集团	65,800	342,818.00	0.74
42	002647	仁东控股	9,400	333,512.00	0.72
43	300377	赢时胜	34,300	320,362.00	0.69
44	002530	金财互联	25,700	314,568.00	0.68
45	300287	飞利信	75,700	314,155.00	0.68
46	002104	恒宝股份	36,800	313,168.00	0.68
47	300468	四方精创	13,104	310,564.80	0.67
48	300465	高伟达	20,600	285,928.00	0.62
49	002197	证通电子	27,200	281,520.00	0.61
50	300248	新开普	22,235	274,824.60	0.59
51	601519	大智慧	33,100	266,786.00	0.58
52	300130	新国都	19,399	266,736.25	0.58
53	002668	奥马电器	57,180	260,169.00	0.56
54	600577	精达股份	88,600	246,308.00	0.53
55	300386	飞天诚信	13,774	235,810.88	0.51
56	300202	聚龙股份	21,800	234,350.00	0.51
57	300494	盛天网络	9,200	219,420.00	0.47
58	000987	越秀金控	18,400	214,544.00	0.46
59	002017	东信和平	17,700	210,984.00	0.46
60	600571	信雅达	23,200	210,888.00	0.46
61	601375	中原证券	44,500	209,150.00	0.45
62	300368	汇金股份	21,100	203,615.00	0.44
63	300773	拉卡拉	5,800	201,666.00	0.44
64	603383	顶点软件	4,500	200,655.00	0.43
65	002154	报喜鸟	64,200	199,020.00	0.43
66	300333	兆日科技	22,200	196,914.00	0.43
67	000948	南天信息	15,100	196,149.00	0.42
68	300541	先进数通	10,900	194,129.00	0.42
69	300300	汉鼎宇佑	31,317	189,467.85	0.41
70	000712	锦龙股份	14,900	186,250.00	0.40
71	300551	古鳌科技	9,400	177,942.00	0.38
72	300205	天喻信息	17,005	176,852.00	0.38
73	002095	生意宝	8,407	169,821.40	0.37
74	002177	御银股份	40,200	168,840.00	0.37
75	300061	旗天科技	26,800	161,604.00	0.35
76	600318	新力金融	12,000	152,880.00	0.33
77	002315	焦点科技	10,080	144,547.20	0.31
78	002453	华软科技	30,200	144,054.00	0.31
79	300290	荣科科技	22,800	143,184.00	0.31

80	002622	融钰集团	44,300	135,115.00	0.29
81	300546	雄帝科技	5,400	129,222.00	0.28
82	603106	恒银科技	13,238	123,510.54	0.27
83	002285	世联行	40,680	113,497.20	0.25
84	300330	华虹计通	8,900	93,984.00	0.20
85	300399	京天利	5,300	93,015.00	0.20
86	300380	安硕信息	4,600	88,734.00	0.19
87	300656	民德电子	2,900	63,800.00	0.14

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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603087	甘李药业	129	12,938.70	0.03
2	300843	胜蓝股份	732	7,327.32	0.02
3	300824	北鼎股份	500	6,855.00	0.01
4	600956	新天绿能	1,246	6,279.84	0.01
5	300845	捷安高科	345	6,082.35	0.01
6	300840	酷特智能	746	4,431.24	0.01
7	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01

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	002410	广联达	1,261,370.00	2.40
2	000977	浪潮信息	1,230,341.00	2.34
3	002065	东华软件	1,225,442.00	2.33
4	002439	启明星辰	1,206,510.28	2.29
5	002152	广电运通	945,417.00	1.80
6	300369	绿盟科技	690,121.62	1.31
7	002368	太极股份	658,315.00	1.25
8	300348	长亮科技	572,404.50	1.09
9	300352	北信源	546,789.00	1.04
10	300674	宇信科技	534,753.00	1.02
11	002506	协鑫集成	527,613.00	1.00
12	002010	传化智联	489,827.00	0.93
13	000555	神州信息	473,177.00	0.90
14	000851	高鸿股份	451,668.00	0.86
15	002251	步步高	415,043.00	0.79
16	002647	仁东控股	320,201.00	0.61
17	600271	航天信息	299,802.00	0.57

18	300468	四方精创	285,164.00	0.54
19	601555	东吴证券	279,690.80	0.53
20	600577	精达股份	253,008.00	0.48

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	002385	大北农	1,765,162.30	3.35
2	300136	信维通信	1,527,536.80	2.90
3	600177	雅戈尔	1,275,394.74	2.42
4	600415	小商品城	1,228,768.00	2.33
5	600588	用友网络	997,935.50	1.90
6	600446	金证股份	997,933.81	1.90
7	600570	恒生电子	917,046.80	1.74
8	300033	同花顺	881,904.78	1.67
9	000690	宝新能源	749,612.00	1.42
10	600109	国金证券	743,523.00	1.41
11	601555	东吴证券	705,946.14	1.34
12	300324	旋极信息	637,031.25	1.21
13	300059	东方财富	622,129.00	1.18
14	300038	数知科技	569,858.00	1.08
15	300322	硕贝德	476,826.78	0.91
16	601998	中信银行	472,041.00	0.90
17	600909	华安证券	382,890.00	0.73
18	300229	拓尔思	376,962.00	0.72
19	002512	达华智能	364,524.83	0.69
20	002797	第一创业	360,065.00	0.68

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	16,146,872.71
卖出股票收入（成交）总额	25,118,793.68

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,104.57
2	应收证券清算款	240,527.83

3	应收股利	-
4	应收利息	267.70
5	应收申购款	3,843.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	246,743.12

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300843	胜蓝股份	7,327.32	0.02	新股流通受限
2	300845	捷安高科	6,082.35	0.01	新股流通受限

7.12.6 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。

§ 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	4,752	9,349.55	-	-	44,429,048.47	100.00
网金 A	61	43,573.95	-	-	2,658,011.00	100.00

网金 B	340	7,817.68	-	-	2,658,011.00	100.00
合计	5,153	9,653.61	-	-	49,745,070.47	100.00

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占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）。

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	袁慧	2,257,189.00	45.49
2	钱兰英	227,792.00	4.59
3	马鑫	152,692.00	3.08
4	钱中明	111,000.00	2.24
5	林殷利	103,160.00	2.08
6	李月凤	101,781.00	2.05
7	蔡为人	100,163.00	2.02
8	马玉蓉	91,638.00	1.85
9	高飞	77,757.00	1.57
10	罗维勃	73,413.00	1.48

网金 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	施鸿宇	1,190,769.00	44.80
2	王雁波	357,953.00	13.47
3	黄英	180,800.00	6.80
4	郭国棠	180,600.00	6.79
5	陈鹭	105,000.00	3.95
6	李怡名	92,359.00	3.47
7	鲍刚	77,750.00	2.93
8	杨宁	51,000.00	1.92
9	黄晖	49,900.00	1.88
10	马鑫	34,838.00	1.31

网金 B

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	11.12
2	谢纳新	177,623.00	6.68
3	杨珍荣	175,531.00	6.60
4	王小丽	175,400.00	6.60
5	陈国忠	151,000.00	5.68
6	尉睦金	105,812.00	3.98

7	陈远杰	105,000.00	3.95
8	项曙光	93,430.00	3.52
9	刘丽	72,278.00	2.72
10	倪建萍	71,150.00	2.68

注：1、以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。 2、下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的上市份额。

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	160.00	0.0004
	网金 A	0.00	0.0000
	网金 B	0.00	0.0000
	合计	160.00	0.0003

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	54,672,533.92	2,676,511.00	2,676,511.00

本报告期基金总申购份额	537,682.70	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	10,818,168.15	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	37,000.00	-18,500.00	-18,500.00
本报告期期末基金份额总额	44,429,048.47	2,658,011.00	2,658,011.00

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

无。

二、基金托管人的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

无。

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

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	25,011,146.65	61.81%	22,792.80	61.81%	-
长江证券	1	10,881,485.18	26.89%	9,916.63	26.89%	-
海通证券	1	4,572,583.58	11.30%	4,166.99	11.30%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用券商专用交易单元的选择标准和程序：

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。

2、本基金本报告期内新增交易单元：无，退租交易单元：无。

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	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 2 日
2	大成中证互联网金融指数分级证券投	上海证券报、中国证监会	2020 年 5 月 30 日

	资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	会基金电子披露网站及本公司网站	
3	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 29 日
4	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 30 日
5	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 29 日
6	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 29 日
7	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 28 日
8	大成基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
9	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	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 22 日
10	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 17 日
11	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 16 日
12	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 15 日
13	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 14 日
14	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 3 日
15	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 2 日
16	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 1 日

17	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金暂停场内分拆业务及跨系统转托管（场外转场内）业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 1 日
18	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 31 日
19	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 28 日
20	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 27 日
21	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 26 日
22	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
23	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
24	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 24 日
25	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
26	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
27	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 20 日
28	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 19 日
29	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 11 日
30	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 3 日
31	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及	2020 年 2 月 29 日

		本公司网站	
32	大成基金管理有限公司关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
33	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 7 日
34	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 6 日
35	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 5 日
36	大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
37	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
38	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 2020 年度约定年基准收益率的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 3 日
39	大成中证互联网金融指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 1 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

备查文件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。

大成基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日