

# 大成中证互联网金融指数分级 证券投资基金清算报告

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

清算报告出具日：2020年11月11日

清算报告公告日：2020年11月13日

## 一、重要提示

大成中证互联网金融指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 1154 号《关于准予大成中证互联网金融指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。于 2015 年 6 月 29 日成立并正式运作,本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成,行使下列职权:(二)决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”;第八十条规定,“有下列情形之一的,基金合同终止:(二)基金份额持有人大会决定终止”。根据《大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》“第二十四部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、本基金合同的终止”中约定,“有下列情形之一的,本基金合同应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的”。基金管理人于 2020 年 9 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,以通讯方式审议《关于终止大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同相关事项的议案》,并陆续发布了提示性公告。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效,本次基金份额持有人大会于 2020 年 10 月 29 日表决通过了本次会议议案,本次大会决议自该日起生效。基金管理人于 2020 年 10 月 30 日刊登了《大成基金管理有限公司关于大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自 2020 年 10 月 30 日起进入清算期,由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、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于 2020 年 10 月 30 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

## 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		
基金最后运作日（2020年10月29日）基金份额总额	56,529,462.03份		
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
基金最后运作日（2020年10月29日）下属分级基金的份额总额	52,142,140.03份	2,193,661.00份	2,193,661.00份

## 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</p>

	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。		
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、预期收益相对较高的特征。		
	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

## 三、财务会计报告

## 资产负债表（已经审计）

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10月29日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	3,848,680.75	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	4,132.63	衍生金融负债	-
交易性金融资产	53,592,579.53	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	53,592,579.53	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	472,528.31
资产支持 证券投资	-	应付管理人报酬	48,221.15
基金投资	-	应付托管费	10,608.66
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	18,401.98
应收证券清算款	371,224.54	应付税费	-
应收利息	5,857.31	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	250,171.06
其他资产	-	<b>负债合计</b>	<b>799,931.16</b>
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	75,971,918.34
		未分配利润	-18,949,374.74
		<b>所有者权益合计</b>	<b>57,022,543.60</b>
<b>资产总计</b>	<b>57,822,474.76</b>	<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>57,822,474.76</b>

注：基金最后运作日2020年10月29日，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净值1.0087元，大成中证互联网金融指数分级证券投资基金之A份额的份额参考净值1.0478元，大成中证互联网金融指数分级证券投资基金之B份额的份额参考净值0.9697元。大成中证互联网金融指数分级证券投资基金份额总额为56,529,462.03份，其中基础份额为52,142,140.03份，A类基金份额为2,193,661.00份，B类基金份额为2,193,661.00份。

#### 四、基金财产分配

自 2020 年 10 月 30 日至 2020 年 11 月 11 日止为清算期间,基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算,全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下:

##### 1、资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 3,848,680.75 元。
- (2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 4,132.63 元。为保护基金份额持有人利益,加快清盘速度,基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。
- (3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 5,857.31 元。为保护基金份额持有人利益,加快清盘速度,基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。
- (5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 371,224.54 元,该款项于 2020 年 10 月 30 日转入本基金托管户。
- (6) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 53,592,579.53 元,为本基金持有的下述未变现资产,已于清算期间全部卖出变现。

证券名称	证券代码	数量	最后运作日估值金额(元)
国金证券	600109	94,300.00	1,465,422.00
航天信息	600271	86,258.00	1,335,273.84
新力金融	600318	14,100.00	144,666.00
恒生电子	600570	16,451.00	1,507,569.64
信雅达	600571	27,200.00	228,208.00
精达股份	600577	103,400.00	336,050.00
用友网络	600588	39,918.00	1,752,400.20
华安证券	600909	70,600.00	583,862.00
兴业银行	601166	86,700.00	1,543,260.00
中国平安	601318	18,301.00	1,439,556.66
中原证券	601375	53,700.00	286,758.00
大智慧	601519	38,700.00	359,136.00
东吴证券	601555	120,534.00	1,212,572.04
中信银行	601998	118,961.00	605,511.49
恒银科技	603106	15,538.00	127,877.74
顶点软件	603383	5,200.00	200,720.00
平安银行	000001	102,300.00	1,817,871.00
神州信息	000555	37,400.00	670,582.00
天茂集团	000627	77,000.00	393,470.00
锦龙股份	000712	17,600.00	250,096.00
高鸿股份	000851	70,100.00	434,620.00
南天信息	000948	17,800.00	203,454.00
浪潮信息	000977	36,500.00	1,127,850.00

越秀金控	000987	21,500.00	353,030.00
新大陆	000997	56,855.00	913,091.30
传化智联	002010	100,100.00	562,562.00
东信和平	002017	20,700.00	225,837.00
苏宁易购	002024	156,910.00	1,518,888.80
东华软件	002065	123,500.00	1,157,195.00
生意宝	002095	9,807.00	183,390.90
恒宝股份	002104	43,100.00	348,248.00
广电运通	002152	93,000.00	1,112,280.00
石基信息	002153	24,800.00	1,015,064.00
报喜鸟	002154	75,100.00	267,356.00
御银股份	002177	47,100.00	248,688.00
怡亚通	002183	114,234.00	580,308.72
二三四五	002195	439,452.00	1,217,282.04
证通电子	002197	32,000.00	312,640.00
步步高	002251	40,000.00	462,000.00
卫士通	002268	45,300.00	851,187.00
世联行	002285	47,680.00	256,041.60
焦点科技	002315	11,880.00	210,988.80
太极股份	002368	26,859.00	716,866.71
广联达	002410	24,500.00	1,786,050.00
启明星辰	002439	36,500.00	1,158,145.00
华软科技	002453	35,400.00	181,602.00
协鑫集成	002506	234,200.00	847,804.00
金财互联	002530	30,200.00	274,518.00
融钰集团	002622	51,900.00	156,219.00
仁东控股	002647	11,000.00	643,280.00
奥马电器	002668	66,980.00	301,410.00
国盛金控	002670	45,317.00	423,713.95
第一创业	002797	98,280.00	1,026,043.20
同花顺	300033	8,500.00	1,189,405.00
东方财富	300059	98,700.00	2,405,319.00
旗天科技	300061	31,400.00	201,902.00
银之杰	300085	27,370.00	649,216.40
新国都	300130	22,799.00	326,025.70
汉得信息	300170	54,600.00	530,166.00
聚龙股份	300202	25,500.00	296,820.00
天喻信息	300205	20,005.00	285,271.30
上海钢联	300226	11,841.00	786,360.81
新开普	300248	26,035.00	323,094.35
飞利信	300287	88,600.00	510,336.00
荣科科技	300290	26,700.00	194,910.00
汉鼎宇佑	300300	36,617.00	267,304.10

华虹计通	300330	10,500.00	137,025.00
兆日科技	300333	26,000.00	314,860.00
润和软件	300339	49,200.00	580,560.00
长亮科技	300348	39,000.00	940,680.00
北信源	300352	89,500.00	599,650.00
汇金股份	300368	24,700.00	493,506.00
绿盟科技	300369	36,900.00	678,960.00
赢时胜	300377	40,100.00	521,300.00
安硕信息	300380	5,300.00	153,276.00
飞天诚信	300386	16,274.00	442,815.54
京天利	300399	6,100.00	135,725.00
高伟达	300465	24,200.00	399,300.00
四方精创	300468	15,404.00	388,488.88
盛天网络	300494	11,200.00	199,696.00
先进数通	300541	12,800.00	306,432.00
雄帝科技	300546	6,400.00	144,064.00
古鳌科技	300551	11,100.00	280,497.00
民德电子	300656	3,400.00	97,512.00
科蓝软件	300663	16,367.00	514,905.82
宇信科技	300674	18,600.00	715,170.00
拉卡拉	300773	6,800.00	243,508.00

## 2、负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 48,221.15 元。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 10,608.66 元。
- (3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 18,401.98 元。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 472,528.31 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 250,171.06 元，该款项包含截止至基金合同终止日预提审计费 31,000.00 元，预提信息披露费 66,000.00 元，预提上市费 50,000.00 元，应付赎回费 206.64 元，应付指数使用费 100,964.42 元，其他应付款-汇划费 2,000.00 元。

## 3、清算期间损益情况

清算期间损益情况		单位：人民币元
项目		
一、清算期间收入		
存款利息收入（注 1）		5,160.38



变现损益（注2）	-629,775.30
其他收入（注3）	8.41
清算期间收入小计①	-624,606.51
二、清算期间费用	
交易费用	105,966.61
清算期间费用小计②	105,966.61
三、清算期间基金净赎回金额（注4）	
清算期间基金净赎回金额小计③	24,648.92
三、清算期间净收益①-②-③	-755,222.04

注1：存款利息收入为自2020年10月30日至2020年11月11日期间的银行存款利息、结算备付金和结算保证金利息。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。

注2：变现损益为本次清算期间扣除红利补税后的卖出股票投资金额与基金最后运作日估值金额的差额。

注3：其他收入为基金赎回费收入。

注4：清算期间基金净赎回为2020年10月30日确认的投资者赎回申请。

#### 4、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2020年10月29日基金净资产	57,022,543.60
加：清算期间净收益	-755,222.04
二、清算期结束日2020年11月11日基金净资产	56,267,321.56

注：资产处置及负债清偿后，于2020年11月11日本基金剩余财产为人民币56,267,321.56元，根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2020年11月11日至清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

#### 5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

## 五、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1)《大成中证互联网金融指数分级证券投资基金清算审计报告》
- (2)《关于〈大成中证互联网金融指数分级证券投资基金清算报告〉的法律意见》

### 2、存放地点

基金管理人的办公住所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

大成中证互联网金融指数分级证券投资基金财产清算小组

2020年11月11日