# 大成丰财宝货币市场基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 大成丰财宝货币 | |
| 基金主代码 | 000626 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014年6月18日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 14,945,375,162.73份 | |
| 投资目标 | 在有效控制投资组合风险,保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。 | |
| 投资策略 | 本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法, 对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险特征,在风险与收益的配比中,力求将各类风险降到最低,并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。 | |
| 业绩比较基准 | 活期存款利率(税后) | |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 | |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成丰财宝货币A | 大成丰财宝货币B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000626 | 000627 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,517,813.65份 | 14,928,857,349.08份 |

§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2018年7月1日 – 2018年9月30日 | |
|---|---|---|
| | 大成丰财宝货币A | 大成丰财宝货币B |
| 1.本期已实现收益 | 132,923.84 | 140,247,453.25 |
| 2.本期利润 | 132,923.84 | 140,247,453.25 |
| 3.期末基金资产净值 | 16,517,813.65 | 14,928,857,349.08 |

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

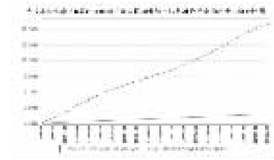
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

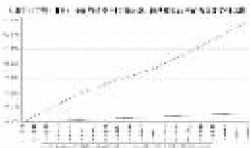
| 大成丰财宝货币A | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①–③ | ②–④ |
| 过去三个月 | 0.7429% | 0.0011% | 0.0882% | 0.0000% | 0.6547% | 0.0011% |

| 大成丰财宝货币B | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.8039% | 0.0011% | 0.0882% | 0.0000% | 0.7157% | 0.0011% |

注:本货币基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





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 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈会荣 | 本基金基金经理 | 2016年8月6日 | – | 11年 | 经济学学士。2007年10月加入大成基金管理有限公司,历任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理、固定收益总部基金经理。2016年8月6日起任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月6日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理。2016年9月6日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016年11月2日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月1日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月22日起担任大成月添利理财债券型证券投资基金、大成慧成货币市场基金和大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金基金经理。2018年8月17日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。具备基金从业资格。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

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2018年3季度公司旗下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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,经济下行压力增加,央行为促进社融增速的提高,维持了货币流动性的充裕。纵观三季度,隔夜回购利率均值约为2.35%,较上季度下降35BP,14天回购加权利率均值约为2.95%,较上季度下降115BP。1年期金融债收益率下行约77bp,1年AAA短期融资券下行约100bp,1年AA+短融品种下行约100bp。

本基金将以流动性为第一前提,根据组合特点在合理期限范围内配置组合资产,努力提高组合静态收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成丰财宝货币A的基金份额净值收益率为0.7429%,本报告期大成丰财宝货币B的基金份额净值收益率为0.8039%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

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 | 固定收益投资 | 1,589,965,122.67 | 10.63 |
| | 其中:债券 | 1,589,965,122.67 | 10.63 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 2 | 买入返售金融资产 | 5,839,722,539.59 | 39.06 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 7,468,266,148.99 | 49.95 |
| 4 | 其他资产 | 54,500,654.88 | 0.36 |
| 5 | 合计 | 14,952,454,466.13 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 0.01 | |
| | 其中:买断式回购融资 | – | |
| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | – | – |
| | 其中:买断式回购融资 | – | – |

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 47 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 52 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 18 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 55.81 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 2 | 30天(含)—60天 | 8.35 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 3 | 60天(含)—90天 | 10.76 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 4 | 90天(含)—120天 | 24.10 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 5 | 120天(含)—397天(含) | 0.67 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| | 合计 | 99.68 | – |

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 49,616,053.81 | 0.33 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 871,775,681.81 | 5.83 |
| | 其中:政策性金融债 | 871,775,681.81 | 5.83 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 同业存单 | 668,573,387.05 | 4.47 |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 1,589,965,122.67 | 10.64 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | – | – |

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 111821253 | 18渤海银行CD253 | 2,800,000 | 279,579,710.14 | 1.87 |
| 2 | 170211 | 17国开11 | 2,100,000 | 210,064,162.35 | 1.41 |
| 3 | 111813053 | 18浙商银行CD053 | 2,000,000 | 199,672,290.98 | 1.34 |
| 4 | 111812057 | 18北京银行CD057 | 1,700,000 | 169,350,005.08 | 1.13 |
| 5 | 130434 | 13农发34 | 1,600,000 | 160,911,982.44 | 1.08 |
| 6 | 170413 | 17农发13 | 1,000,000 | 100,086,348.76 | 0.67 |
| 7 | 080310 | 08进出10 | 1,000,000 | 100,026,645.03 | 0.67 |
| 8 | 080420 | 08农发20 | 800,000 | 80,173,665.02 | 0.54 |
| 9 | 130334 | 13进出34 | 500,000 | 50,057,264.24 | 0.33 |
| 10 | 160208 | 16国开08 | 500,000 | 49,957,236.87 | 0.33 |

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)–0.5%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0326% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0023% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0144% |

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

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十名资产支持证券投资明细

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元

5.9.2 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未出现本期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。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收利息 | 54,500,634.88 |
| 4 | 应收申购款 | 20.00 |
| 5 | 其他应收款 | – |
| 6 | 待摊费用 | – |
| 7 | 其他 | – |
| 8 | 合计 | 54,500,654.88 |

5.9.4 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 | 大成丰财宝货币A | 大成丰财宝货币B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 17,696,870.97 | 17,788,034,109.69 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,550,883.41 | 140,844,754.78 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 4,729,940.73 | 3,000,021,515.39 |
| 报告期期末基金份额总额 | 16,517,813.65 | 14,928,857,349.08 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 红利发放 | 2018-09-28 | 43.38 | 43.38 | – |
| 合计 | | | 43.38 | 43.38 | |

注:红利发放为期间合计数。

§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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
| 机构 | 1 | 20180701–20180930 | 17,788,034,109.69 | 140,823,239.39 | 3,000,000,000.00 | 14,928,857,349.08 | 99.89 |
| 个人 | – | – | – | – | – | – | – |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险,甚至有可能引起基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 | | | | | | | |

注:申购份额均为报告期内本基金进行收益分配,机构投资者选择红利再投资方式,其红利转换为基金份额的情况。

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招财宝货币市场基金的文件;

2、《大成丰财宝货币市场基金基金合同》;

3、《大成丰财宝货币市场基金托管协议》;

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

2018年10月25日

# 大成中证红利指数证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 大成中证红利指数 |
| 基金主代码 | 090010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年2月2日 |
| 报告期末基金份额总额 | 130,789,992.57份 |
| 投资目标 | 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,紧密跟踪标的指数,追求指数投资偏离度和跟踪误差最小化,力争本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,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和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及其他特殊情况(如成份股流动性不足)对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人可以使用其他适当的方法进行调整,以实现对跟踪误差的有效控制。 |
| 业绩比较基准 | 中证红利指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金,风险与收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§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(2018年7月1日 – 2018年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 3,441,837.33 |
| 2.本期利润 | 1,322,490.35 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0106 |
| 4.期末基金资产净值 | 216,582,523.78 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.656 |

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。

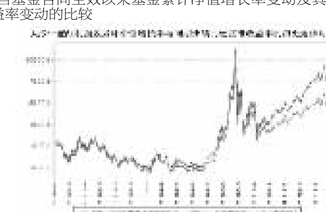
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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① | 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 | 0.24% | 1.07% | –1.75% | 1.10% | 1.99% | –0.03% |

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



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。在建仓期结束时及本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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | 2014年12月6日 | – | 7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,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

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2018年3季度公司旗下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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年三季度,A股市场在上半年大幅下跌之后,进入底部震荡区域。七月份,经过上半年严格调控之后,市场预期政策可望适度宽松,A股出现一波反弹。八月到九月中旬,由于宽松不达预期,加上中美贸易冲突进一步升级,以及美联储加息预期逐步落地,A股市场震荡下行。九月下旬,临近中秋和国庆假期,市场情绪有所好转,在大盘蓝筹股的带动下,A股在短期内出现较为强劲的反弹。在本季度,上证指数下跌0.92%,沪深300指数下跌2.05%,中证红利指数下跌1.87%。

在本报告期内,本基金严格按照中证红利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1.15%,日均偏离度为0.06%。

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1.656元;本报告期基金份额净值增长率为0.24%,业绩比较基准收益率为–1.75%。

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 | 199,521,831.82 | 91.85 |
| | 其中:股票 | 199,521,831.82 | 91.85 |
| 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 | 16,576,992.49 | 7.63 |
| 8 | 其他资产 | 1,115,451.28 | 0.51 |
| 9 | 合计 | 217,214,275.59 | 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 | – | – |
| B | 采矿业 | 9,937,116.57 | 4.59 |
| C | 制造业 | 77,033,048.32 | 35.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 31,920,386.90 | 14.74 |
| E | 建筑业 | 1,489,502.88 | 0.69 |
| F | 批发和零售业 | 5,193,622.98 | 2.40 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,662,506.27 | 8.16 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | – | – |
| J | 金融业 | 39,751,615.85 | 18.35 |
| K | 房地产业 | 16,443,770.52 | 7.59 |
| 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 | 199,431,570.29 | 92.08 |

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 | – | – |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 90,261.53 | 0.04 |
| 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 | – | – |
| 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 | – | – |
| 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 | 90,261.53 | 0.04 |

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 | 601088 | 中国神华 | 260,591 | 5,313,450.49 | 2.45 |
| 2 | 000895 | 双汇发展 | 202,300 | 5,290,145.00 | 2.44 |
| 3 | 600104 | 上汽集团 | 132,935 | 4,424,076.80 | 2.04 |
| 4 | 601288 | 农业银行 | 1,025,929 | 3,990,863.81 | 1.84 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 98,468 | 3,958,413.60 | 1.83 |
| 6 | 600011 | 华能国际 | 511,316 | 3,942,246.36 | 1.82 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 638,327 | 3,683,146.79 | 1.70 |
| 8 | 601988 | 中国银行 | 928,534 | 3,454,146.48 | 1.59 |
| 9 | 601328 | 交通银行 | 557,135 | 3,253,668.40 | 1.50 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 100,975 | 3,098,922.75 | 1.43 |

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 | 002937 | 兴瑞科技 | 2,114 | 36,593.34 | 0.02 |
| 2 | 300749 | 顶固集创 | 1,317 | 30,857.31 | 0.01 |
| 3 | 300748 | 金力永磁 | 2,008 | 22,810.88 | 0.01 |

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

无。

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之一交通银行(601328)的发行主体交通银行股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字(2018)1号)。本基金认为,对交通银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

本基金投资的前十名证券之一招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司于2018年2月12日因违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等,受到中国银行业监督管理委员会处罚(银监罚决字(2018)1号)。本基金认为,对招商银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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。

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 20,020.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 3,166.71 |
| 5 | 应收申购款 | 1,092,264.24 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 1,115,451.28 |

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

无。

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

无。

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 123,370,052.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 25,084,203.32 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 17,664,262.76 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | – |
| 报告期期末基金份额总额 | 130,789,992.57 |

§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红利指数证券投资基金的文件;

2、《大成中证红利指数证券投资基金基金合同》;

3、《大成中证红利指数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

2018年10月25日

# 大成中证互联网金融指数分级证券投资基金

## 2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月25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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30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 | 62,098,304.69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进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。<br>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。 | | |
| 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。 | | |
| 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份额总额 | 57,171,882.69份 | 2,463,211.00份 | 2,463,211.00份 |
| 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 |

§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(2018年7月1日 – 2018年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | –100,298.77 |
| 2.本期利润 | –2,546,292.50 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | –0.0446 |
| 4.期末基金资产净值 | 47,755,459.68 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7690 |

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。

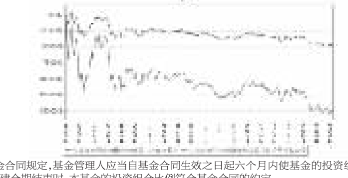
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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① | 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 | –5.09% | 1.43% | –4.49% | 1.40% | –0.60% | 0.03% |

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



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 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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 | – | 14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。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 |
| 夏高 | 本基金基金经理 | 2015年6月29日 | – | 7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,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

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2018年3季度公司旗下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%的交易情形;投资组合间债券交易存在1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;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年三季度,A股市场在上半年大幅下跌之后,进入底部震荡区域。七月份,经过上半年严格调控之后,市场预期政策可望适度宽松,A股出现一波反弹。八月到九月中旬,由于宽松不达预期,加上中美贸易冲突进一步升级,以及美联储加息预期逐步落地,A股市场震荡下行。九月下旬,临近中秋和国庆假期,市场情绪有所好转,在大盘蓝筹股的带动下,A股在短期内出现较为强劲的反弹。在本季度,上证指数下跌0.92%,沪深300指数下跌2.05%,中证互联网金融指数下跌4.76%。

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0.84%,日均偏离度为0.03%。

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0.7690元;本报告期基金份额净值增长率为–5.09%,业绩比较基准收益率为–4.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内,曾出现了连续20个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§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 | 44,359,325.12 | 92.21 |
| | 其中:股票 | 44,359,325.12 | 92.21 |
| 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 | 3,739,043.50 | 7.77 |
| 8 | 其他资产 | 9,047.65 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 48,107,416.27 | 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 | – | – |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 8,819,752.48 | 18.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 860,400.00 | 1.80 |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 批发和零售业 | 1,472,620.80 | 3.08 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 137,296.40 | 0.29 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 15,824,622.68 | 33.14 |
| J | 金融业 | 13,163,172.23 | 27.56 |
| K | 房地产业 | 1,825,176.21 | 3.82 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,256,284.32 | 4.72 |
| 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 | 44,359,325.12 | 92.89 |

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

无。

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 | 63,110 | 1,755,720.20 | 3.68 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 24,600 | 1,685,100.00 | 3.53 |
| 3 | 600271 | 航天信息 | 60,458 | 1,682,546.14 | 3.52 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 148,600 | 1,642,030.00 | 3.44 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 95,200 | 1,518,440.00 | 3.18 |
| 6 | 600570 | 恒生电子 | 27,500 | 1,518,275.00 | 3.18 |
| 7 | 601998 | 中信银行 | 239,461 | 1,451,133.66 | 3.04 |
| 8 | 601555 | 东吴证券 | 207,103 | 1,323,388.17 | 2.77 |
| 9 | 600109 | 国金证券 | 186,400 | 1,308,528.00 | 2.74 |
| 10 | 002024 | 苏宁易购 | 96,510 | 1,300,954.80 | 2.72 |

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

无。

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之一平安银行(000001)的发行主体平安银行股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字(2018)2号)。本基金认为,对平安银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

本基金投资的前十名证券之一兴业银行(601166)的发行主体兴业银行股份有限公司于2018年4月19日因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监银罚决字(2018)1号)。本基金认为,对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

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。

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 649.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 678.25 |
| 5 | 应收申购款 | 7,720.34 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 9,047.65 |

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

无。

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

无。

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 | 57,138,805.99 | 2,463,211.00 | 2,463,211.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,130,954.12 | – | – |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,097,877.42 | – | – |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | – | – | – |
| 报告期期末基金份额总额 | 57,171,882.69 | 2,463,211.00 | 2,463,211.00 |

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

本报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

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

2018年10月25日