# 交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

# 2019 年半年度报告

# 2019 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

# §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 28 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录**.....2
1.1 重要提示.....2
**§2 基金简介**.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....6
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**.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....8
**§4 管理人报告**.....9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....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.....11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....12
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.....12
**§5 托管人报告**.....12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....12
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.....12
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.....12
**§6 半年度财务会计报告（未经审计）**.....12
6.1 资产负债表.....12
6.2 利润表.....14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....15
6.4 报表附注.....17
**§7 投资组合报告**.....36
7.1 期末基金资产组合情况.....36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....37
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.....38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....42
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.....42
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.....43
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.....43
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.....43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....43
7.12 投资组合报告附注.....43
**§8 基金份额持有人信息**.....44

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 44
8.2 期末上市基金前十名持有人 ..... 44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 45
**§9 开放式基金份额变动** ..... 46
**§10 重大事件揭示** ..... 46
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 46
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 ..... 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 47
10.4 基金投资策略的改变 ..... 47
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 ..... 47
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 47
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 47
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 47
10.9 其他重大事件 ..... 49
**11 影响投资者决策的其他重要信息** ..... 54
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 54
**§12 备查文件目录** ..... 54
12.1 备查文件目录 ..... 54
12.2 存放地点 ..... 54
12.3 查阅方式 ..... 54

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金名称 | 交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金 | | |
| 基金简称 | 交银中证互联网金融指数分级 | | |
| 场内简称 | E 金融 | | |
| 基金主代码 | 164907 | | |
| 交易代码 | 164907 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 26 日 | | |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 102,848,892.90 份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 | | |
| 上市日期 | 2015 年 7 月 8 日 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | E 金融 | E 金融 A | E 金融 B |
| 下属分级基金的场内简称 | E 金融 | E 金融 A | E 金融 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 164907 | 150317 | 150318 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 101,737,574.90 份 | 555,659.00 份 | 555,659.00 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 投资策略 | 本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证互联网金融指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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，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成份股流动性不足时，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，从而使得投 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 资组合紧密地跟踪标的指数。 | | |
| 业绩比较基准 | 中证互联网金融指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5% | | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银互联网金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银互联网金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。 | | |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 交银 E 金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征 | 交银 E 金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征 | 交银 E 金融 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征 |

## 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 | | 交银施罗德基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王晚婷 | 田青 |
| | 联系电话 | （021）61055050 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5000，021-61055000 | 010-67595096 |
| 传真 | | （021）61055054 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙） | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 阮红 | 田国立 |

### 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》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fund001.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

### 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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）** |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -4,614,444.99 |
| 本期利润 | 22,201,413.79 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2533 |
| 本期加权平均净值利润率 | 24.72% |
| 本期基金份额净值增长率 | 28.85% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **报告期末(2019 年 6 月 30 日)** |
| 期末可供分配利润 | -61,137,296.40 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.594 |
| 期末基金资产净值 | 87,385,059.89 |
| 期末基金份额净值 | 0.850 |
| **3.1.3 累计期末指标** | **报告期末(2019 年 6 月 30 日)** |
| 基金份额累计净值增长率 | -41.09% |

注：1、本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

## 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 | 3.79% | 1.63% | 3.61% | 1.62% | 0.18% | 0.01% |
| 过去三个月 | -8.98% | 2.03% | -9.12% | 2.03% | 0.14% | 0.00% |
| 过去六个月 | 28.85% | 2.10% | 29.27% | 2.10% | -0.42% | 0.00% |
| 过去一年 | 9.21% | 1.91% | 8.65% | 1.88% | 0.56% | 0.03% |
| 过去三年 | -20.28% | 1.46% | -18.25% | 1.44% | -2.03% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -41.09% | 1.94% | -47.89% | 1.94% | 6.80% | 0.00% |

注：本基金业绩比较基准为中证互联网金融指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%，每日进行再平衡过程。

### 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

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015 年 6 月 26 日至 2019 年 6 月 30 日）

注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

# §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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本金为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、普通混合型和股票型在内的 80 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 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 | | |
| 蔡铮 | 交银上证 180 公司治理 ETF 及其联接、交银深证 300 价值 ETF 及其联接、交银国证新能源指数分级、交银中证海外中国互联网指数（QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级、交银中证环境治理指数（LOF)、交银致远智投混合的基金经理，公司量化投资副 | 2015-06-26 | - | 10 年 | 蔡铮先生，中国国籍，复旦大学电子工程硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。2009 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部数量分析师、基金经理助理、量化投资部助理总经理、量化投资部副总经理。2012 年 12 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日担任交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数证券投资基金基金经理，2015 年 4 月 22 日至 2017 年 3 月 24 日担任交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金经理，2015 年 4 月 22 日至 2017 年 3 月 24 日担任交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 7 月 18 日担任交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经理。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 总监兼多元资产管理副总监 | | | | |

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

## 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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的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证券当日总成交量 5%的情况有 1 次，是投资组合因投资策略需要而发生同日反向交易，未发现不公平

交易和利益输送的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未发现异常。

## 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

2019 年上半年国内宏观环境基本稳定，央行货币政策维持稳健，财政政策加力提效，减税降费力度加大，积极扶持中小企业和新经济发展，多方面政策持续发力缓解经济下行压力。年初的快速上涨使得市场情绪显著修复，成交大幅回暖，但四月之后 A 股市场出现较大幅调整，投资者情绪回归冷静。直至六月中旬科创板宣布正式开板，市场信心才有所提振。作为跟踪基准指数的指数基金，上半年基金总体呈现先上行后震荡走势。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标” 及“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”部分披露。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，我们认为宏观经济依然面临一定挑战，投资和消费增速下行压力犹存，政策力度或将持续加码，新兴产业加速发展，开放创新将释放经济增长的内在潜力。减税降费将仍是下半年经济工作的重心，推动居民收入与企业盈利进一步改善，但对于消费端和投资端的拉动作用可能还有待验证。总体而言，从中长期来看我们对 A 股市场仍维持谨慎乐观的看法。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，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。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，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本基金本报告期内无需预警说明。

## §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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## §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：交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 4,478,677.76 | 4,853,304.11 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 5,659.64 | 505.72 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 83,177,477.27 | 70,476,688.18 |
| 其中：股票投资 | | 82,477,057.27 | 70,476,688.18 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 700,420.00 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 18,507.36 | 1,394.57 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,038.85 | 5,189.50 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| **资产总计** | | 87,681,360.88 | 75,337,082.08 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末**<br>**2019 年 6 月 30 日** | **上年度末**<br>**2018 年 12 月 31 日** |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 22,880.13 | 23,984.77 |
| 应付管理人报酬 | | 70,112.31 | 67,172.74 |
| 应付托管费 | | 15,424.70 | 14,778.02 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 21,397.77 | 11,316.32 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 166,486.08 | 160,088.98 |
| 负债合计 | | 296,300.99 | 277,340.83 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 148,522,356.29 | 164,286,853.22 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -61,137,296.40 | -89,227,111.97 |
| 所有者权益合计 | | 87,385,059.89 | 75,059,741.25 |
| 负债和所有者权益总计 | | 87,681,360.88 | 75,337,082.08 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 102,848,892.90 份，其中交银互联网金融份额净值 0.850 元，基金份额 101,737,574.90 份；交银互联网金融 A 份额参考净值 1.013 元，基金份额 555,659.00 份；交银互联网金融 B 份额参考净值 0.687 元，基金份额 555,659.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | **23,011,133.87** | **-10,744,382.36** |
| 1.利息收入 | | 25,118.06 | 23,043.21 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 16,843.16 | 23,043.21 |
| 债券利息收入 | | 8,274.90 | - |
| 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） | | -3,844,127.01 | -13,489,777.14 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -4,501,414.37 | -14,136,543.56 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 60,974.88 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 596,312.48 | 646,766.42 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 26,815,858.78 | 2,714,472.03 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 14,284.04 | 7,879.54 |
| **减：二、费用** | | **809,720.08** | **948,301.84** |
| 1．管理人报酬 | | 443,137.50 | 527,111.04 |
| 2．托管费 | | 97,490.23 | 115,964.43 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．交易费用 | 6.4.7.19 | 51,644.97 | 55,476.24 |
| 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 | 6.4.7.20 | 217,447.38 | 249,750.13 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | **22,201,413.79** | **-11,692,684.20** |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | **22,201,413.79** | **-11,692,684.20** |

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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、期初所有者权益（基金净值） | 164,286,853.22 | -89,227,111.97 | 75,059,741.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 22,201,413.79 | 22,201,413.79 |
| 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 | -15,764,496.93 | 5,888,401.78 | -9,876,095.15 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 列） | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 6,096,134.71 | -2,615,730.88 | 3,480,403.83 |
| 2.基金赎回款 | -21,860,631.64 | 8,504,132.66 | -13,356,498.98 |
| 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） | 148,522,356.29 | -61,137,296.40 | 87,385,059.89 |
| **项目** | **上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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） | 189,333,083.84 | -73,578,412.96 | 115,754,670.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -11,692,684.20 | -11,692,684.20 |
| 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） | -23,255,042.36 | 8,801,312.37 | -14,453,729.99 |
| 其中：1.基金申购款 | 7,991,753.32 | -3,125,555.68 | 4,866,197.64 |
| 2.基金赎回款 | -31,246,795.68 | 11,926,868.05 | -19,319,927.63 |
| 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） | 166,078,041.48 | -76,469,784.79 | 89,608,256.69 |

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：

基金管理人负责人：谢卫，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

交银施罗德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]941 号文《关于准予交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金注册的批复》核准，由交银施罗德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《交银施罗德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。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 441,524,789.06 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 750 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 441,570,114.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 45,325.03 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“交银互联网金融份额”)、稳健收益类份额(以下简称“交银互联网金融 A 份额”)与积极收益类份额(以下简称“交银互联网金融 B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售交银互联网金融份额。投资人场外认购所得的交银互联网金融份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的交银互联网金融份额，将按 1∶1 的基金份额配比自动分离为交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额。交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的数量保持 1：1 的比例不变。基金合同生效后，交银互联网金融份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内交银互联网金融份额与交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额之间可以按照约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内交银互联网金融份额按照 1∶1 的份额配比转换成 1 份交银互联网金融 A 份额与 1 份交银互联网金融 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份交银互联网金融 A 份额与 1 份交银互联网金融 B 份额按照 1∶1 的基金份额配比转换成 2 份场内交银互联网金融份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：交银互联网金融份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为交银互联网金融份额、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额数量的总和。本基金每份交银互联网金融 A 份额与每份交银互联网金融 B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份交银互联网金融份额的基金份额净值之和。交银互联网金融 A 份额的约定年收益率为同期中国人民银行公布的金融机构人民币一年期定期存款利率(税后)+4%，交银互联网金融 A 份额的份额参考净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值后，根据交银互联网金融份额的基金份额净值与交

银互联网金融 A 份额、交银互联网金融 B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为场内交银互联网金融份额分配给交银互联网金融 A 份额持有人。交银互联网金融份额持有人持有的每 2 份交银互联网金融份额将按 1 份交银互联网金融 A 份额获得新增交银互联网金融份额的分配。持有场外交银互联网金融份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外交银互联网金融份额的分配；持有场内交银互联网金融份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内交银互联网金融份额的分配。经过上述份额折算后，交银互联网金融份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。交银互联网金融 B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，或当交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的比例为 1:1，份额折算后交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值、交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值和交银互联网金融份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，基金份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值及交银互联网金融 A 份额、交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为交银互联网金融份额分别分配给交银互联网金融份额、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的持有人。当交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，交银互联网金融份额、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2015]第 331 号文审核同意，本基金交银互联网金融 A 份额(150317) 59,000,681.00 份基金份额和交银互联网金融 B 份额(150318) 59,000,681.00 份基金份额于 2015 年 7 月 8 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的交银互联网金融份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的交银互联网金融份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，

以中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，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以后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证互联网金融指数收益率×95%＋银行活期存款利率(税后)×5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4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。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

**6.4.5.3差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

**6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 6.4.7重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 4,478,677.76 |
| 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 | 4,478,677.76 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 105,197,254.82 | 82,477,057.27 | -22,720,197.55 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 702,892.55 | 700,420.00 | -2,472.55 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 702,892.55 | 700,420.00 | -2,472.55 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 105,900,147.37 | 83,177,477.27 | -22,722,670.10 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应收活期存款利息 | 899.38 |
| 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 | 17,605.48 |
| 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 | - |
| 其他 | 2.50 |
| 合计 | 18,507.36 |

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 21,397.77 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 21,397.77 |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|---|---|

| | 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 83.58 |
| 预提信息披露费 | 56,896.94 |
| 应付指数使用费 | 50,000.00 |
| 预提审计费 | 29,752.78 |
| 预提上市年费 | 29,752.78 |
| 合计 | 166,486.08 |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 74,050,919.10 | 164,286,853.22 |
| 本期申购 | 4,681.02 | 10,380.07 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,248.90 | -7,204.34 |
| 2019 年 1 月 2 日基金拆分/份额折算前 | 74,052,351.22 | 164,290,028.95 |
| 基金拆分/份额折算调整 | 419,271.56 | |
| 本期申购 | 2,706,523.61 | 5,971,157.97 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -7,659,820.24 | -16,898,750.45 |
| 2019 年 4 月 4 日基金拆分/份额折算前 | 69,518,326.15 | 153,362,436.47 |
| 基金拆分/份额折算调整 | 36,682,214.03 | |
| 本期申购 | 79,355.44 | 114,596.67 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,431,002.72 | -4,954,676.85 |
| 本期末 | 102,848,892.90 | 148,522,356.29 |

注：1.本基金的基金份额包括交银互联网金融份额、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额，交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额不可进行申购和赎回。2.根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2019 年 1 月 2 日为份额折算基准日，对交银互联网金融的场外份额、场内份额以及交银互联网金融 A 份额实施定期份额折算。根据《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，折算前交银互联网金融场外和场内份额分别为 71,303,609.22 份和 1,633,074.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.005661839，

折算后交银互联网金融场外份额总额和场内份额总额分别为 71,707,318.78 份和 1,648,636.00 份，份额净值为 1.003 元；折算前交银互联网金融 A 份额总额为 557,834.00 份，份额参考净值 1.011 元，根据基金份额折算公式，交银互联网金融 A 份额折算比例为 0.011323679，折算后交银互联网金融 A 份额总额为 557,834.00 份，份额参考净值为 1.000 元。

3.根据《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，当交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。于 2019 年 4 月 3 日，交银互联网金融份额的基金份额参考净值为 1.529 元，达到及基金合同规定的不定期份额折算阀值。根据《关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的基金管理人确定 2019 年 4 月 4 日为份额折算基准日实施不定期份额折算。

折算前，交银互联网金融份额场外和场内份额分别为 102,233,427.18 份和 2,242,934.06 份，份额参考净值为 1.528 元，份额折算比例为 0.527662533，折算后交银互联网金融份额场外份额总额和场内份额总额分别为 102,233,427.18 份和 2,838,473.00 份，场内份额包括交银互联网金融 A 份额折算产生新增份额 7,667.00 份，份额净值为 1.000 元，场内份额包括交银互联网金融 B 份额折算产生新增份额 587,873.00 份，份额净值为 1.000 元。

折算前，交银互联网金融 A 份额总额为 564,320.00 份，份额参考净值为 1.014 元，根据基金份额折算公式，交银互联网金融 A 份额折算比例为 0.013586678，折算后交银互联网金融 A 份额总额为 564,320.00 份，份额参考净值为 1.000 元；折算前，交银互联网金融 B 份额总额为 564,320.00 份，份额参考净值为 2.042 元，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 1.041738389，折算后交银互联网金融 B 份额总额为 564,320.00 份，份额参考净值为 1.000 元。

### 6.4.7.10 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 | -59,038,156.83 | -30,188,955.14 | -89,227,111.97 |
| 本期利润 | -4,614,444.99 | 26,815,858.78 | 22,201,413.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,821,492.51 | 66,909.27 | 5,888,401.78 |
| 其中：基金申购款 | -2,217,033.19 | -398,697.69 | -2,615,730.88 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金赎回款 | 8,038,525.70 | 465,606.96 | 8,504,132.66 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -57,831,109.31 | -3,306,187.09 | -61,137,296.40 |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 16,685.82 |
| 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 | 121.09 |
| 其他 | 36.25 |
| 合计 | 16,843.16 |

### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 20,440,435.67 |
| 减：卖出股票成本总额 | 24,941,850.04 |
| 买卖股票差价收入 | -4,501,414.37 |

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 710,725.31 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 638,310.00 |
| 减：应收利息总额 | 11,440.43 |
| 买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 60,974.88 |

### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 596,312.48 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 596,312.48 |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 26,815,858.78 |
| ——股票投资 | 26,818,331.33 |
| ——债券投资 | -2,472.55 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| 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 | 26,815,858.78 |

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---|---|

| | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 14,284.04 |
| 合计 | 14,284.04 |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2、持有期少于 7 日的各类份额，相应的赎回费率不低于 1.5%，并全额计入基金财产。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 51,644.97 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 51,644.97 |

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---|---|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 56,896.94 |
| 银行费用 | 1,044.88 |
| 上市年费 | 29,752.78 |
| 指数使用费 | 100,000.00 |
| 合计 | 217,447.38 |

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 元。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1或有事项**

无。

**6.4.8.2资产负债表日后事项**

无。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 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 |
| --- | --- |
| 交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
| --- | --- | --- |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 443,137.50 | 527,111.04 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 175,149.33 | 205,891.73 |

注：支付基金管理人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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
| --- | --- | --- |

| | | |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 97,490.23 | 115,964.43 |

注：支付基金托管人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。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.4.2 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**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

**6.4.10.5 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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 |
| 中国建设银行 | 4,478,677.76 | 16,685.82 | 6,241,226.39 | 22,721.75 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金于本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，以中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象，采用指数化投资，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银互联网金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银互联网金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。本基金绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证互联网金融指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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，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成份股流动性不足时，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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风

险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。

**6.4.13.2 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建设银行，因而与该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，因此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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2018 年 12 月 31 日：无）。

**6.4.13.3 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。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

**6.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

**6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1 至 5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| **资产** | | | | | |
| 银行存款 | 4,478,677.76 | - | - | - | 4,478,677.76 |
| 存出保证金 | 5,659.64 | - | - | - | 5,659.64 |
| 交易性金融资产 | 700,420.00 | - | - | 82,477,057.27 | 83,177,477.27 |
| 应收利息 | - | - | - | 18,507.36 | 18,507.36 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,038.85 | 1,038.85 |
| **资产总计** | 5,184,757.40 | - | - | 82,496,603.48 | 87,681,360.88 |
| **负债** | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 22,880.13 | 22,880.13 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 70,112.31 | 70,112.31 |
| 应付托管费 | - | - | - | 15,424.70 | 15,424.70 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 21,397.77 | 21,397.77 |
| 其他负债 | - | - | - | 166,486.08 | 166,486.08 |
| **负债总计** | - | - | - | 296,300.99 | 296,300.99 |
| **利率敏感度缺口** | 5,184,757.40 | - | - | 82,200,302.49 | 87,385,059.89 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **上年度末 2018 年 12 月 31 日** | **1 年以内** | **1 至 5 年** | **5 年以上** | **不计息** | **合计** |
| **资产** | | | | | |
| 银行存款 | 4,853,304.11 | - | - | - | 4,853,304.11 |
| 存出保证金 | 505.72 | - | - | - | 505.72 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 70,476,688.18 | 70,476,688.18 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,394.57 | 1,394.57 |
| 应收申购款 | - | - | - | 5,189.50 | 5,189.50 |
| **资产总计** | 4,853,809.83 | - | - | 70,483,272.25 | 75,337,082.08 |
| **负债** | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 23,984.77 | 23,984.77 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 67,172.74 | 67,172.74 |
| 应付托管费 | - | - | - | 14,778.02 | 14,778.02 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 11,316.32 | 11,316.32 |
| 其他负债 | - | - | - | 160,088.98 | 160,088.98 |
| **负债总计** | - | - | - | 277,340.83 | 277,340.83 |
| **利率敏感度缺口** | 4,853,809.83 | - | - | 70,205,931.42 | 75,059,741.25 |

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予以分类。

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.80%(2018 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

**6.4.13.4.2 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。

**6.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证互联网金融指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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，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成份股流动性不足时，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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，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以后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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，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。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2018 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 | 82,477,057.27 | 94.38 | 70,476,688.18 | 93.89 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 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** | 82,477,057.27 | 94.38 | 70,476,688.18 | 93.89 |

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

| 假设 | 除“中证互联网金融”指数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：人民币万元） | |
| | | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| | 1.“中证互联网金融”指数上升 5% | 增加约 420 | 增加约 366 |
| | 2.“中证互联网金融”指数下降 5% | 减少约 420 | 减少约 366 |

## §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 | 82,477,057.27 | 94.06 |
| | 其中：股票 | 82,477,057.27 | 94.06 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 700,420.00 | 0.80 |
| | 其中：债券 | 700,420.00 | 0.80 |
| | 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 | 4,478,677.76 | 5.11 |
| 8 | 其他各项资产 | 25,205.85 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 87,681,360.88 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 7.2.2 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 13,542,554.57 | 15.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,587,782.00 | 1.82 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,479,680.00 | 2.84 |
| 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 | 34,270,251.01 | 39.22 |
| J | 金融业 | 24,111,370.42 | 27.59 |
| K | 房地产业 | 3,147,024.21 | 3.60 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,338,395.06 | 3.82 |
| 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 | 82,477,057.27 | 94.38 |

### 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通过港股通投资的股票。

## 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 | 300033 | 同花顺 | 28,796 | 2,832,374.56 | 3.24 |
| 2 | 600588 | 用友网络 | 102,773 | 2,762,538.24 | 3.16 |
| 3 | 600570 | 恒生电子 | 38,804 | 2,644,492.60 | 3.03 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 189,512 | 2,611,475.36 | 2.99 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 29,300 | 2,596,273.00 | 2.97 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 189,970 | 2,574,093.50 | 2.95 |
| 7 | 600109 | 国金证券 | 259,956 | 2,526,772.32 | 2.89 |
| 8 | 002024 | 苏宁易购 | 216,000 | 2,479,680.00 | 2.84 |
| 9 | 601555 | 东吴证券 | 236,521 | 2,424,340.25 | 2.77 |
| 10 | 600271 | 航天信息 | 104,352 | 2,405,313.60 | 2.75 |
| 11 | 300136 | 信维通信 | 98,349 | 2,404,633.05 | 2.75 |
| 12 | 002195 | 二三四五 | 608,171 | 2,365,785.19 | 2.71 |
| 13 | 600177 | 雅戈尔 | 369,754 | 2,347,937.90 | 2.69 |
| 14 | 601998 | 中信银行 | 390,346 | 2,330,365.62 | 2.67 |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 127,203 | 2,326,542.87 | 2.66 |
| 16 | 002268 | 卫士通 | 83,100 | 2,031,795.00 | 2.33 |
| 17 | 002797 | 第一创业 | 303,680 | 1,925,331.20 | 2.20 |
| 18 | 002385 | 大北农 | 360,559 | 1,907,357.11 | 2.18 |
| 19 | 000627 | 天茂集团 | 285,510 | 1,852,959.90 | 2.12 |
| 20 | 000997 | 新大陆 | 103,498 | 1,748,081.22 | 2.00 |
| 21 | 600909 | 华安证券 | 261,598 | 1,710,850.92 | 1.96 |
| 22 | 002153 | 石基信息 | 45,399 | 1,642,989.81 | 1.88 |
| 23 | 600415 | 小商品城 | 385,400 | 1,587,848.00 | 1.82 |
| 24 | 000690 | 宝新能源 | 246,550 | 1,587,782.00 | 1.82 |
| 25 | 600446 | 金证股份 | 72,499 | 1,423,880.36 | 1.63 |
| 26 | 002670 | 国盛金控 | 111,899 | 1,409,927.40 | 1.61 |
| 27 | 300170 | 汉得信息 | 100,599 | 1,367,140.41 | 1.56 |
| 28 | 300226 | 上海钢联 | 15,701 | 1,176,946.96 | 1.35 |
| 29 | 300339 | 润和软件 | 78,998 | 1,113,871.80 | 1.27 |
| 30 | 300038 | 数知科技 | 116,220 | 1,087,819.20 | 1.24 |
| 31 | 002183 | 怡亚通 | 210,592 | 1,004,523.84 | 1.15 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 32 | 300324 | 旋极信息 | 145,472 | 842,282.88 | 0.96 |
| 33 | 000712 | 锦龙股份 | 64,799 | 832,019.16 | 0.95 |
| 34 | 601375 | 中原证券 | 154,598 | 817,823.42 | 0.94 |
| 35 | 002285 | 世联行 | 177,181 | 799,086.31 | 0.91 |
| 36 | 601519 | 大智慧 | 112,700 | 799,043.00 | 0.91 |
| 37 | 300377 | 赢时胜 | 63,149 | 714,846.68 | 0.82 |
| 38 | 300085 | 银之杰 | 50,051 | 710,223.69 | 0.81 |
| 39 | 002657 | 中科金财 | 38,260 | 665,724.00 | 0.76 |
| 40 | 300663 | 科蓝软件 | 21,400 | 658,478.00 | 0.75 |
| 41 | 300287 | 飞利信 | 162,700 | 645,919.00 | 0.74 |
| 42 | 300130 | 新国都 | 40,619 | 645,842.10 | 0.74 |
| 43 | 300322 | 硕贝德 | 40,299 | 624,634.50 | 0.71 |
| 44 | 300300 | 汉鼎宇佑 | 58,061 | 602,673.18 | 0.69 |
| 45 | 002104 | 恒宝股份 | 80,742 | 580,534.98 | 0.66 |
| 46 | 300205 | 天喻信息 | 36,549 | 546,773.04 | 0.63 |
| 47 | 002095 | 生意宝 | 21,423 | 511,152.78 | 0.58 |
| 48 | 002512 | 达华智能 | 108,700 | 491,324.00 | 0.56 |
| 49 | 002017 | 东信和平 | 37,900 | 473,750.00 | 0.54 |
| 50 | 600571 | 信雅达 | 49,800 | 464,136.00 | 0.53 |
| 51 | 002530 | 金财互联 | 44,500 | 434,320.00 | 0.50 |
| 52 | 002344 | 海宁皮城 | 90,902 | 423,603.32 | 0.48 |
| 53 | 600086 | 东方金钰 | 95,600 | 420,640.00 | 0.48 |
| 54 | 002668 | 奥马电器 | 79,688 | 412,783.84 | 0.47 |
| 55 | 000587 | 金洲慈航 | 150,500 | 388,290.00 | 0.44 |
| 56 | 600318 | 新力金融 | 51,900 | 387,693.00 | 0.44 |
| 57 | 002197 | 证通电子 | 51,100 | 387,338.00 | 0.44 |
| 58 | 002453 | 华软科技 | 64,700 | 384,318.00 | 0.44 |
| 59 | 603106 | 恒银金融 | 28,366 | 369,325.32 | 0.42 |
| 60 | 300386 | 飞天诚信 | 29,601 | 362,316.24 | 0.41 |
| 61 | 000987 | 越秀金控 | 39,800 | 358,996.00 | 0.41 |
| 62 | 300229 | 拓尔思 | 33,500 | 353,090.00 | 0.40 |
| 63 | 000948 | 南天信息 | 31,800 | 329,130.00 | 0.38 |
| 64 | 300178 | 腾邦国际 | 52,426 | 322,419.90 | 0.37 |
| 65 | 300248 | 新开普 | 40,845 | 318,591.00 | 0.36 |
| 66 | 002622 | 融钰集团 | 95,200 | 309,400.00 | 0.35 |
| 67 | 300531 | 优博讯 | 15,855 | 278,413.80 | 0.32 |
| 68 | 002315 | 焦点科技 | 16,601 | 277,402.71 | 0.32 |
| 69 | 300295 | 三六五网 | 21,800 | 275,770.00 | 0.32 |
| 70 | 300368 | 汇金股份 | 37,701 | 272,578.23 | 0.31 |
| 71 | 300546 | 雄帝科技 | 9,500 | 239,305.00 | 0.27 |
| 72 | 300380 | 安硕信息 | 9,700 | 187,016.00 | 0.21 |
| 73 | 300674 | 宇信科技 | 6,200 | 174,778.00 | 0.20 |
| 74 | 300494 | 盛天网络 | 14,700 | 171,549.00 | 0.20 |

### 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股票。

## 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 | 601519 | 大智慧 | 760,999.00 | 1.01 |
| 2 | 002385 | 大北农 | 564,799.00 | 0.75 |
| 3 | 002017 | 东信和平 | 478,729.00 | 0.64 |
| 4 | 002195 | 二三四五 | 433,532.00 | 0.58 |
| 5 | 300339 | 润和软件 | 422,417.00 | 0.56 |
| 6 | 300136 | 信维通信 | 421,389.00 | 0.56 |
| 7 | 000627 | 天茂集团 | 402,828.00 | 0.54 |
| 8 | 002453 | 华软科技 | 373,508.00 | 0.50 |
| 9 | 600271 | 航天信息 | 369,359.00 | 0.49 |
| 10 | 600318 | 新力金融 | 354,368.00 | 0.47 |
| 11 | 000948 | 南天信息 | 330,989.00 | 0.44 |
| 12 | 300038 | 数知科技 | 289,449.00 | 0.39 |
| 13 | 002024 | 苏宁易购 | 285,790.00 | 0.38 |
| 14 | 000997 | 新大陆 | 262,400.00 | 0.35 |
| 15 | 002268 | 卫士通 | 250,457.00 | 0.33 |
| 16 | 300300 | 汉鼎宇佑 | 240,551.00 | 0.32 |
| 17 | 000690 | 宝新能源 | 219,044.00 | 0.29 |
| 18 | 600415 | 小商品城 | 212,472.00 | 0.28 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 19 | 300058 | 蓝色光标 | 209,825.00 | 0.28 |
| 20 | 002153 | 石基信息 | 204,593.00 | 0.27 |

注：“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 | 002410 | 广联达 | 2,641,084.02 | 3.52 |
| 2 | 600745 | 闻泰科技 | 1,735,732.98 | 2.31 |
| 3 | 300166 | 东方国信 | 1,195,885.92 | 1.59 |
| 4 | 300079 | 数码科技 | 1,129,418.96 | 1.50 |
| 5 | 300058 | 蓝色光标 | 912,906.00 | 1.22 |
| 6 | 601555 | 东吴证券 | 894,879.00 | 1.19 |
| 7 | 600570 | 恒生电子 | 879,540.00 | 1.17 |
| 8 | 600588 | 用友网络 | 608,230.00 | 0.81 |
| 9 | 300077 | 国民技术 | 588,245.38 | 0.78 |
| 10 | 600577 | 精达股份 | 572,213.00 | 0.76 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 551,633.00 | 0.73 |
| 12 | 600109 | 国金证券 | 435,359.00 | 0.58 |
| 13 | 000001 | 平安银行 | 419,550.00 | 0.56 |
| 14 | 300059 | 东方财富 | 391,782.00 | 0.52 |
| 15 | 002797 | 第一创业 | 355,314.00 | 0.47 |
| 16 | 600271 | 航天信息 | 304,324.00 | 0.41 |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 281,803.00 | 0.38 |
| 18 | 600909 | 华安证券 | 281,218.00 | 0.37 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 19 | 600177 | 雅戈尔 | 275,553.00 | 0.37 |
| 20 | 601998 | 中信银行 | 275,496.00 | 0.37 |

注：“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

| | |
|---|---|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 10,123,887.80 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 20,440,435.67 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 700,420.00 | 0.80 |
| | 其中：政策性金融债 | 700,420.00 | 0.80 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 700,420.00 | 0.80 |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 108603 | 国开 1804 | 7,000 | 700,420.00 | 0.80 |

**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。

**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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 5,659.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 18,507.36 |
| 5 | 应收申购款 | 1,038.85 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 25,205.85 |

**7.12.4 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。

### 7.12.5 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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 |
| E 金融 | 4,376 | 23,248.99 | 123.00 | 0.00% | 101,737,451.90 | 100.00% |
| E 金融 A | 66 | 8,419.08 | - | - | 555,659.00 | 100.00% |
| E 金融 B | 338 | 1,643.96 | 117.00 | 0.02% | 555,542.00 | 99.98% |
| 合计 | 4,780 | 21,516.50 | 240.00 | 0.00% | 102,848,652.90 | 100.00% |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

E 金融

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 李何品 | 207,757.00 | 7.70% |
| 2 | 史文华 | 205,675.00 | 7.63% |
| 3 | 崔红运 | 110,798.00 | 4.11% |
| 4 | 林利平 | 77,568.00 | 2.88% |
| 5 | 王萃华 | 76,383.00 | 2.83% |
| 6 | 刘红霞 | 76,180.00 | 2.82% |
| 7 | 王淑华 | 69,255.00 | 2.57% |
| 8 | 晁秀云 | 69,253.00 | 2.57% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 9 | 高乃钧 | 69,250.00 | 2.57% |
| 10 | 吕连香 | 69,250.00 | 2.57% |

注：持有人为场内持有人。

E 金融 A

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 蔡玲柳 | 168,349.00 | 30.30% |
| 2 | 丁峰 | 96,700.00 | 17.40% |
| 3 | 李丛 | 75,637.00 | 13.61% |
| 4 | 彭登梅 | 40,000.00 | 7.20% |
| 5 | 郭国棠 | 31,777.00 | 5.72% |
| 6 | 黄晖 | 28,342.00 | 5.10% |
| 7 | 张小林 | 23,009.00 | 4.14% |
| 8 | 林利平 | 18,415.00 | 3.31% |
| 9 | 方春娣 | 8,645.00 | 1.56% |
| 10 | 刘辉荣 | 7,344.00 | 1.32% |

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

E 金融 B

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 周宗庚 | 55,361.00 | 9.96% |
| 2 | 李丛 | 44,721.00 | 8.05% |
| 3 | 黄跃杰 | 23,600.00 | 4.25% |
| 4 | 项曙光 | 23,139.00 | 4.16% |
| 5 | 吴珉 | 17,552.00 | 3.16% |
| 6 | 姚念振 | 12,887.00 | 2.32% |
| 7 | 严能 | 12,063.00 | 2.17% |
| 8 | 项松洁 | 11,678.00 | 2.10% |
| 9 | 赵春玲 | 11,019.00 | 1.98% |
| 10 | 刘晓宏 | 11,019.00 | 1.98% |

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

## 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 | E 金融 | - | - |
| | E 金融 A | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | E 金融 B | - | - |
| | 合计 | - | - |

**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 | E 金融 | 0 |
| | E 金融 A | 0 |
| | E 金融 B | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | E 金融 | 0 |
| | E 金融 A | 0 |
| | E 金融 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | E 金融 | E 金融 A | E 金融 B |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）基金份额总额 | 323,568,752.09 | 59,000,681.00 | 59,000,681.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 72,935,251.10 | 557,834.00 | 557,834.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 39,892,045.66 | - | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 11,094,071.86 | - | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | 4,350.00 | -2,175.00 | -2,175.00 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 101,737,574.90 | 555,659.00 | 555,659.00 |

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及基金折算后调整份额。

## §10 重大事件揭示

**10.1 基金份额持有人大会决议**

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

**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**

1、基金管理人的重大人事变动：2019 年 2 月 28 日本基金管理人发布公告，经公司第五届董事会第五次会议审议通过，选举谢卫先生担任公司总经理。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人中国建设银行股份有限公司于 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为资产托管业务部总经理。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内未发生涉及本基金管理人、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**

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

**10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件**

无。

**10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

**10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

**10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况**

**10.8.1 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 | |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 953,869.00 | 3.12% | 888.26 | 3.12% | - |
| 东方证券股份有限公司 | 1 | 940,565.00 | 3.08% | 875.97 | 3.08% | - |
| 国盛证券有限责任公司 | 1 | 6,060,856.78 | 19.83% | 5,644.38 | 19.83% | - |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | 3,687,455.74 | 12.06% | 3,434.14 | 12.06% | - |
| 东吴证券股份有限公司 | 1 | 271,607.00 | 0.89% | 252.91 | 0.89% | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1 | 245,411.17 | 0.80% | 228.58 | 0.80% | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2 | 2,237,982.00 | 7.32% | 2,084.27 | 7.32% | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 2 | 211,727.00 | 0.69% | 197.19 | 0.69% | - |
| 西部证券股份有限公司 | 1 | 1,462,802.00 | 4.79% | 1,362.38 | 4.79% | - |
| 方正证券股份有限公司 | 1 | 14,492,047.78 | 47.41% | 13,496.42 | 47.41% | - |
| 安信证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 公司 | | | | | | |
| 中泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 300,810.00 | 21.44% | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | 399,385.31 | 28.46% | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 702,892.55 | 50.10% | - | - | - | - |

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为国盛证券有限公司，其它交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、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进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

### 10.9 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 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-01-03 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 券投资基金定期折算业务期间 E 金融 A 份额停复牌的公告 | | |
| 2 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-01-04 |
| 3 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-01-04 |
| 4 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之交银互联网金融 A 份额约定年基准收益率调整的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-01-04 |
| 5 | 交银施罗德基金管理有限公司关于调整投资者场外投资旗下部分基金单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-01-15 |
| 6 | 交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金 2018 年第 4 季度报告 | 上海证券报 | 2019-01-21 |
| 7 | 交银施罗德基金管理有限公司关于开展网上直销交易平台交易费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-01-28 |
| 8 | 交银施罗德基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-01-29 |
| 9 | 交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金（更新）招募说明书摘要（2018 年第 2 号） | 上海证券报 | 2019-02-02 |
| 10 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金暂停大额申购业务的公告 | 上海证券报 | 2019-02-21 |
| 11 | 交银施罗德基金管理有限公司关于总经理变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-02-28 |
| 12 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金调整大额申购业务限额的公告 | 上海证券报 | 2019-02-28 |
| 13 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-07 |
| 14 | 交银施罗德基金管理有限公司关于暂停苏州财路基金销售有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-03-07 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 15 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-08 |
| 16 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-12 |
| 17 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-13 |
| 18 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-14 |
| 19 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-21 |
| 20 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-22 |
| 21 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-23 |
| 22 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 交易价格波动的提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-27 |
| 23 | 交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金 2018 年年度报告摘要 | 上海证券报 | 2019-03-27 |
| 24 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-03-30 |
| 25 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-04-01 |
| 26 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算 | 上海证券报 | 2019-04-02 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 的风险提示公告 | | |
| 27 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-04-03 |
| 28 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告 | 上海证券报 | 2019-04-04 |
| 29 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停及办理折算业务完毕后恢复申购、赎回业务并设大额申购业务限额的公告 | 上海证券报 | 2019-04-04 |
| 30 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金不定期折算业务期间 E 金融 A、E 金融 B 份额停复牌的公告 | 上海证券报 | 2019-04-08 |
| 31 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告 | 上海证券报 | 2019-04-09 |
| 32 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 A 和 E 金融 B 不定期份额折算后前收盘价调整的公告 | 上海证券报 | 2019-04-09 |
| 33 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与奕丰基金销售有限公司基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-04-12 |
| 34 | 交银施罗德基金管理有限公司关于取消纸质对账单寄送的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-04-12 |
| 35 | 交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金 2019 年第 1 季度报告 | 上海证券报 | 2019-04-20 |
| 36 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与其基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-04-23 |
| 37 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 交易价格波动的提示公告 | 上海证券报 | 2019-05-07 |
| 38 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交 | 上海证券报 | 2019-05-10 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | | |
| 39 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-05-15 |
| 40 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-05-18 |
| 41 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-05-23 |
| 42 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与其基金前端申购费率（含定期定额投资）优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-05-23 |
| 43 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-05-28 |
| 44 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-05-31 |
| 45 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-06-05 |
| 46 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-06-11 |
| 47 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | 上海证券报 | 2019-06-14 |
| 48 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公 | 上海证券报 | 2019-06-19 |
| 49 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交 | 上海证券报 | 2019-06-22 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之 E 金融 B 溢价风险提示公告 | | |
| 50 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2019-06-22 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据有关法律法规规定和基金合同的约定，本基金可投资科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。有关详情请查阅本基金管理人于 2019 年 6 月 22 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金募集注册的文件；

2、《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、关于申请募集注册交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金的法律意见书；

8、报告期内交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金

管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。