

大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(C 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2020 年 12 月 1 日

送出日期：2020 年 12 月 2 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|--|----------------|-----------------|
| 基金简称 | 大成 MSCI 价值 100ETF 联接 | 基金代码 | 007782 |
| 下属基金简称 | 大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C | 下属基金交易代码 | 007783 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 9 月 26 日 | | |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 刘淼 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020 年 6 月 29 日 |
| | | 证券从业日期 | 2008 年 4 月 1 日 |
| 基金经理 | 张钟玉 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2019 年 9 月 26 日 |
| | | 证券从业日期 | 2010 年 7 月 19 日 |
| 其他 | 《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

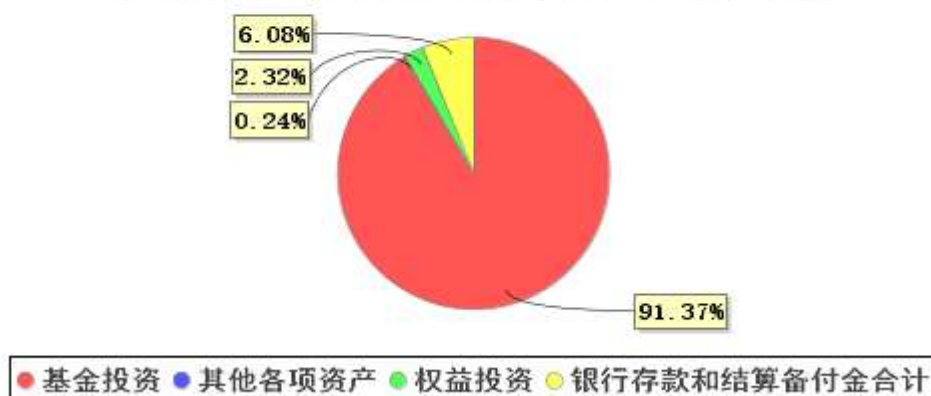
详见《大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 通过主要投资于目标 ETF, 紧密跟踪标的指数即 MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数的表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资范围 | 本基金跟踪标的指数为: MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数。 本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国内依法发 |

| | |
|---------------|---|
| | <p>行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为:投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规对基金的投资组合比例要求有变更的,以变更后的比例为准,在履行适当程序后,本基金的投资比例会做相应调整。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过 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。1、资产配置策略;2、目标 ETF 投资策略;3、成份股、备选成份股投资策略;4、债券投资策略;5、资产支持证券的投资策略;6、衍生金融产品投资策略;7、存托凭证投资策略</p> |
| 业绩比较基准 | MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数收益率*95%+银行活期存款(税后)利率*5% |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票 ETF 的联接基金,主要通过投资于目标 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与 MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数及目标 ETF 的表现密切相关,其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。</p> |

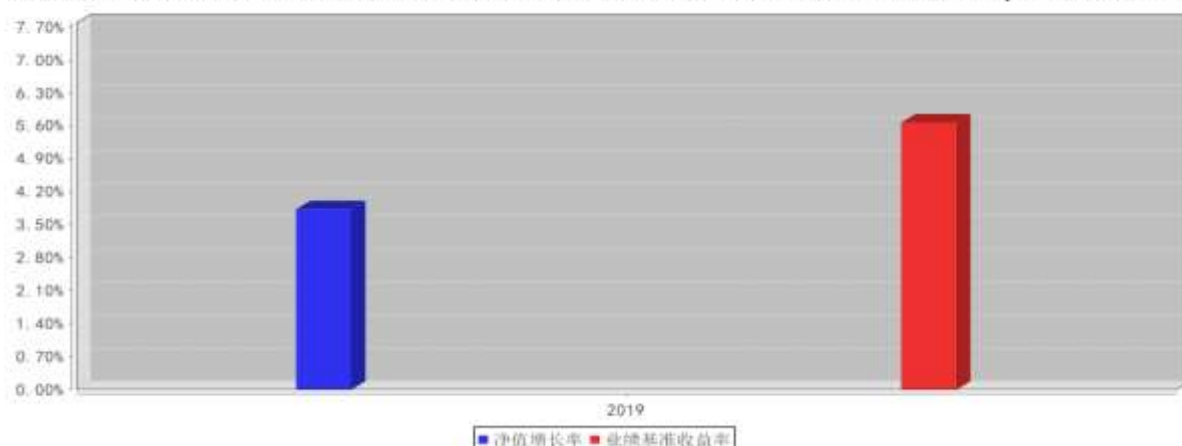
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2020年9月30日)



(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2019 年 12 月 31 日)



- 注:1、基金的过往业绩不代表未来表现。
2、如合同生效当年不满完整自然年度的,按实际期限计算净值增长率。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.5% |
| | 7 天 ≤ N < 30 天 | 0.1% |
| | N ≥ 30 天 | 0.0 |

注:本基金份额不收取认购费、申购费。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

| 费用类别 | 收费方式/年费率 |
|-------|--|
| 管理费 | 0.5% |
| 托管费 | 0.1% |
| 销售服务费 | 0.1% |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费、仲裁费和诉讼费;基金份额持有人大会费用;因基金的证券/期货交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、融资融券费、证券相关账户费用及其他类似性质的费用等);基金财产投资运营过程中的增值税;基金的银行汇划费用;基金的开户费用、账户维护费用;按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。管理费、托管费按照基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分计提,若为负数,则计提基数为 0。 |

注:本基金交易证券等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金的特定风险

(1) 目标 ETF 的风险：本基金为 ETF 联接基金，主要投资对象是目标 ETF，因此目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险。(2) 指数下跌风险：本基金紧密跟踪标的指数，份额净值增长率与标的指数增长率相似。标的指数成份股票下跌可能造成指数下跌，相应地，本基金份额净值也存在下跌风险。

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。(4) 投资股指期货的风险。(5) 投资国债期货的风险。(6) 股票期权投资风险：股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率水平等因素的影响。因此，投资股票期权主要存在 Delta 风险、Gamma 风险、Vega 风险、Theta 风险以及 Rho 风险。同时，进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。(7) 投资流通受限证券的风险：本基金可参与流通受限证券投资，包括但不限于由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

2、本基金还面临证券投资基金投资共有的风险，如市场风险、信用风险、流动性风险、操作或技术风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、不可抗力风险、其他风险等。3、投资存托凭证的相关风险。

(二) 重要提示

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 4 月 11 日证监许可【2019】724 号文予以注册。

中国证监会对本基金募集的注册或核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.dcfund.com.cn]客服电话[4008885558]

1. 大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议、大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书

2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料