

# 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 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39

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 .....	39
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 .....	39
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 .....	39
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	39
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	39
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
7.13 投资组合报告附注 .....	39
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4 基金投资策略的改变 .....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	47
12.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成 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	
基金简称	大成 MSCI 价值 100ETF 联接	
基金主代码	007782	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 9 月 26 日	
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	
报告期末基金份额总额	11,498,764.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C
下属分级基金的交易代码	007782	007783
报告期末下属分级基金的份额总额	8,185,716.26 份	3,313,048.06 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	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
基金主代码	515520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 26 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 11 月 18 日
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	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。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标 ETF。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与业绩比较基准的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。
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	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。
--------	--

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来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。
业绩比较基准	本基金的标的指数为 MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

### 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	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

### § 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(2021年1月1日-2021年6月30日)		
	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C	
本期已实现收益	1,459,655.85	597,748.70	
本期利润	104,727.82	62,973.34	
加权平均基金份额本期利润	0.0113	0.0169	
本期加权平均净值利润率	0.82%	1.23%	
本期基金份额净值增长率	0.31%	0.26%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		
	期末可供分配利润	3,045,087.27	1,224,142.46
	期末可供分配基金份额利润	0.3720	0.3695
	期末基金资产净值	11,230,803.53	4,537,190.52
	期末基金份额净值	1.3720	1.3695
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)		
	基金份额累计净值增长率	37.20%	36.95%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A

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	-1.95%	0.51%	-3.02%	0.52%	1.07%	-0.01%
过去三个月	0.73%	0.61%	-1.17%	0.63%	1.90%	-0.02%
过去六个月	0.31%	0.89%	-0.96%	0.90%	1.27%	-0.01%
过去一年	23.05%	0.99%	13.07%	1.03%	9.98%	-0.04%
自基金合同生效起至今	37.20%	0.96%	21.47%	1.03%	15.73%	-0.07%

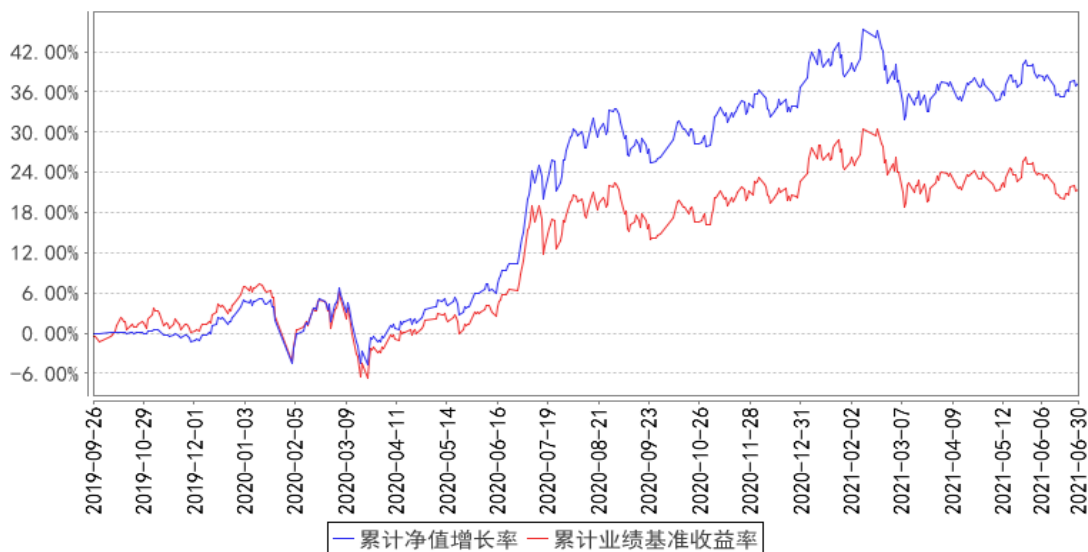
大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C

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	-1.95%	0.51%	-3.02%	0.52%	1.07%	-0.01%
过去三个月	0.71%	0.61%	-1.17%	0.63%	1.88%	-0.02%
过去六个月	0.26%	0.89%	-0.96%	0.90%	1.22%	-0.01%
过去一年	22.92%	0.99%	13.07%	1.03%	9.85%	-0.04%
自基金合同生效起至今	36.95%	0.96%	21.47%	1.03%	15.48%	-0.07%

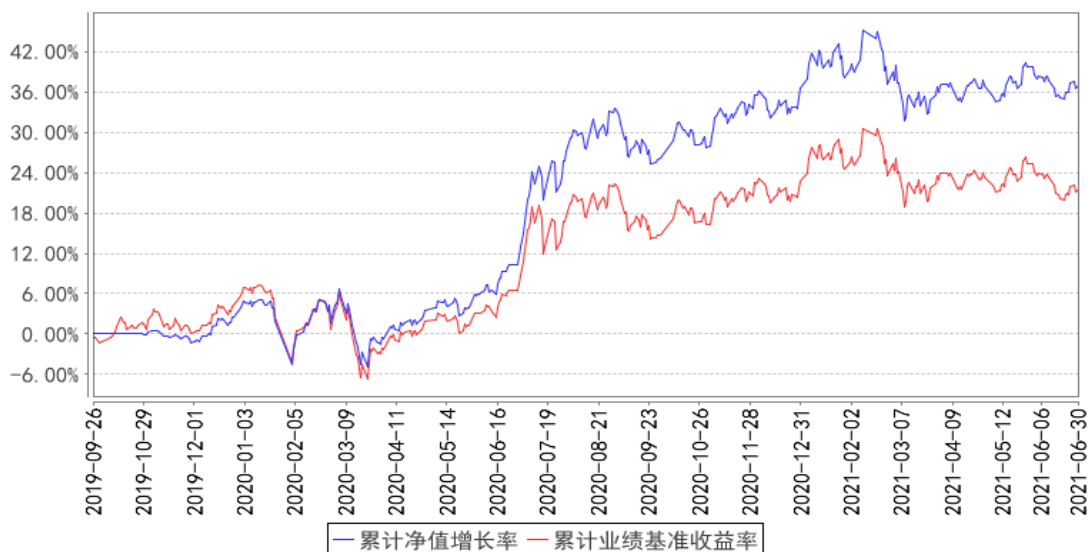


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本2亿元人民币，注册地

广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张钟玉	本基金基金经理	2019 年 9 月 26 日	-	11 年	会计学硕士。2010 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、数量与指数投资部数量分析师、基金经理助理。2015 年 2 月 28 日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理（更名前为大成核心双动力股票型证券投资基金）。2015 年 5 月 23 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、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、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 26 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日起任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金、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经理。具有基金从业资格。国籍：中国
刘淼	本基金基金经理	2020 年 6 月 29 日	-	13 年	工商管理硕士。2008 年 4 月至 2011 年 5 月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、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、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经理助理。2017 年 9 月 14 日起任大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2020 年 6 月 29 日起任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数联接基金、大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、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、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经理。2021 年 4 月 30 日起任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统

计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易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% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年国内经济延续新冠疫情后的复苏态势，一季度 GDP 同比增长 18.3%，二季度 GDP 同比增长 7.9%，经济逐渐由强劲反弹过渡到平稳复苏阶段，经济增速放缓，重新回到长期结构优化轨道。上半年 A 股板块轮动，分化剧烈，PPI 上涨推动的顺周期行情和光伏、新能源汽车、芯片等热点板块是上半年的投资热点。上半年沪深 300 上涨 0.2%，创业板上涨 17.2%，中小盘股票表现明显好于大盘股。行业方面，基础化工、钢铁、煤炭和新能源涨幅居前，地产、军工、家电和非银行金融跌幅较大。

报告期内我们严格遵守基金合同约定，保持目标 ETF 份额不低于基金资产净值的 90%，使联接基金和目标 ETF 的走势基本一致，力争实现紧密跟踪标的指数的投资目标。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A 的基金份额净值为 1.3720 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.31%，同期业绩比较基准收益率为-0.96%；截至本报告期末大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C 的基金份额净值为 1.3695 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准收益率为-0.96%。

## 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 2021 下半年，经济恢复性增长高点已过，经济增速趋于下行，国内经济的重点将回到疫情前的调结构上。地产高压政策持续，投资增长受限，随国外疫情好转生产恢复，出口也将下行，消费有望随国内服务性行业复苏进一步增长。虽然下半年经济承压，但 PPI 仍处高位的环境下，货币政策放松幅度可能有限，A 股行情仍以结构性为主。一方面，我国经济在本次疫情中表现出来的良好韧性，不断吸引海外资本投资，利好各行业具有长期竞争优势的龙头白马。另一方面，碳中和、新能源、高端制造等赛道成长空间大，值得长期关注，但需警惕短期板块估值过高的回

调风险。

组合管理上，我们将严格按照基金合同的相关约定，紧密跟踪标的指数，努力实现努力实现跟踪误差的最小化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：大成 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

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	1,113,657.67	1,264,485.73
结算备付金		-	3,684.24
存出保证金		2,282.09	14,992.46

交易性金融资产	6.4.3.2	14,607,958.20	21,312,586.96
其中：股票投资		352,712.00	57,463.00
基金投资		14,255,246.20	21,255,123.96
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	206,090.72
应收利息	6.4.3.5	182.36	280.45
应收股利		-	-
应收申购款		7,359.56	28,444.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	65,795.72	-
资产总计		15,797,235.60	22,830,564.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,103.11	246,404.30
应付管理人报酬		449.49	627.57
应付托管费		89.89	125.54
应付销售服务费		380.06	569.17
应付交易费用	6.4.3.7	493.87	9,257.27
应交税费		1,881.80	18,324.53
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	19,843.33	120,532.56
负债合计		29,241.55	395,840.94
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	11,498,764.32	16,408,805.19
未分配利润	6.4.3.10	4,269,229.73	6,025,918.45
所有者权益合计		15,767,994.05	22,434,723.64
负债和所有者权益总计		15,797,235.60	22,830,564.58

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 11,498,764.32 份，其中大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A 基金份额总额为 8,185,716.26 份，基金份额净值 1.3720 元。大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C 基金份额总额为 3,313,048.06 份，基金份额净值 1.3695 元。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		203,791.28	4,209,812.60
1. 利息收入		4,031.94	27,337.97
其中：存款利息收入	6.4.3.11	4,031.94	27,337.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,084,362.95	6,147,440.55
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-3,222.48	712,596.87
基金投资收益	6.4.3.13	2,085,938.62	5,411,663.80
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	1,646.81	23,179.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-1,889,703.39	-2,152,768.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	5,099.78	187,802.68
减：二、费用		36,090.12	463,995.78
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	2,933.43	79,439.33
2. 托管费	6.4.6.2.2	586.60	15,887.91
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	2,559.69	7,530.78
4. 交易费用	6.4.3.20	6,780.90	271,959.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,288.71	-
7. 其他费用	6.4.3.21	20,940.79	89,178.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		167,701.16	3,745,816.82



减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		167,701.16	3,745,816.82

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	16,408,805.19	6,025,918.45	22,434,723.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	167,701.16	167,701.16
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）	-4,910,040.87	-1,924,389.88	-6,834,430.75
其中：1. 基金申购款	2,256,681.08	862,435.11	3,119,116.19
2. 基金赎回款	-7,166,721.95	-2,786,824.99	-9,953,546.94
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）	11,498,764.32	4,269,229.73	15,767,994.05
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	209,753,905.18	8,092,006.47	217,845,911.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期	-	3,745,816.82	3,745,816.82

利润)			
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)	-161,120,424.02	-6,250,400.11	-167,370,824.13
其中：1. 基金申购款	6,996,011.37	235,932.75	7,231,944.12
2. 基金赎回款	-168,116,435.39	-6,486,332.86	-174,602,768.25
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)	48,633,481.16	5,587,423.18	54,220,904.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务

操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,113,657.67
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	1,113,657.67

## 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	363,951.46	352,712.00	-11,239.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	10,661,523.18	14,255,246.20	3,593,723.02
其他	-	-	-
合计	11,025,474.64	14,607,958.20	3,582,483.56

## 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.3.4 买入返售金融资产

## 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	181.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.90
合计	182.36

## 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	-
应收退补款	65,795.72
合计	65,795.72

## 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	493.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	493.87

## 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.54
应付证券出借违约金	-
预提费用	19,835.79
合计	19,843.33

## 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	11,497,612.68	11,497,612.68
本期申购	1,066,464.97	1,066,464.97
本期赎回(以“-”号填列)	-4,378,361.39	-4,378,361.39
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	8,185,716.26	8,185,716.26

## 大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,911,192.51	4,911,192.51
本期申购	1,190,216.11	1,190,216.11
本期赎回（以“-”号填列）	-2,788,360.56	-2,788,360.56
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,313,048.06	3,313,048.06

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

## 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

## 大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,284,135.18	-55,534.91	4,228,600.27
本期利润	1,459,655.85	-1,354,928.03	104,727.82
本期基金份额交易产生的变动数	-1,460,870.71	172,629.89	-1,288,240.82
其中：基金申购款	482,578.88	-69,681.40	412,897.48
基金赎回款	-1,943,449.59	242,311.29	-1,701,138.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,282,920.32	-1,237,833.05	3,045,087.27

## 大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,820,836.54	-23,518.36	1,797,318.18
本期利润	597,748.70	-534,775.36	62,973.34
本期基金份额交易产生的变动数	-694,336.34	58,187.28	-636,149.06
其中：基金申	554,977.82	-105,440.19	449,537.63

购款			
基金赎回款	-1,249,314.16	163,627.47	-1,085,686.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,724,248.90	-500,106.44	1,224,142.46

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,969.55
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	16.50
其他	45.89
合计	4,031.94

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,255,155.06
减：卖出股票成本总额	3,258,377.54
买卖股票差价收入	-3,222.48

#### 6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	7,768,005.61
减：卖出/赎回基金成本总额	5,682,066.99
基金投资收益	2,085,938.62

#### 6.4.3.14 债券投资收益

无。

#### 6.4.3.15 贵金属投资收益

无。

## 6.4.3.16 衍生工具收益

无。

## 6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,646.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,646.81

## 6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,889,703.39
股票投资	-16,918.46
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-1,872,784.93
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,889,703.39

## 6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,942.99
基金转换费收入	156.79
合计	5,099.78

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. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。



## 6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	6,566.58
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	214.32
其中：申购费	-
赎回费	80.87
场内交易费	-
交易费	133.45
合计	6,780.90

## 6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,105.00
合计	20,940.79

## 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.4.1 或有事项

无。

## 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.5 关联方关系

## 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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（“大成 MSCI 价值 100ETF”）	本基金的目标基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
光大证券	3,311,205.06	100.00	120,276,249.30	92.05

###### 6.4.6.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.6.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
光大证券	2,955,174.30	100.00	-	-

###### 6.4.6.1.5 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
光大证券	3,017.80	100.00	493.87	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
光大证券	109,609.29	92.05	28,344.37	99.21

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,933.43	79,439.33
其中：支付销售机构的客户维护费	17,569.34	131,436.51

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的 0.50%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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产)× 0.50% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	586.60	15,887.91

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的 0.10%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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产)× 0.10% / 当年天数。

## 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C	合计
大成基金	-	320.49	320.49
中国农业银行	-	401.62	401.62
合计	-	722.11	722.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C	合计
大成基金	-	435.68	435.68
中国农业银行	-	1,572.64	1,572.64
合计	-	2,008.32	2,008.32

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

## 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国农业银行	1,113,657.67	3,969.55	3,802,830.27	25,914.09

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有 10,248,200.00 份目标 ETF 基金份额（上期末：15,382,200.00 份），占其总份额的比例为 29.39%（上期末：23.35%）。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，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。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过

定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产

的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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、结算备付金和存出保证金等。



## 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,113,657.67	-	-	-	1,113,657.67
存出保证金	2,282.09	-	-	-	2,282.09
交易性金融资产	-	-	-	14,607,958.20	14,607,958.20
应收利息	-	-	-	182.36	182.36
应收申购款	-	-	-	7,359.56	7,359.56
其他资产	-	-	-	65,795.72	65,795.72
资产总计	1,115,939.76	-	-	14,681,295.84	15,797,235.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,103.11	6,103.11
应付管理人报酬	-	-	-	449.49	449.49
应付托管费	-	-	-	89.89	89.89
应付销售服务费	-	-	-	380.06	380.06
应付交易费用	-	-	-	493.87	493.87
应交税费	-	-	-	1,881.80	1,881.80
其他负债	-	-	-	19,843.33	19,843.33
负债总计	-	-	-	29,241.55	29,241.55
利率敏感度缺口	1,115,939.76	-	-	14,652,054.29	15,767,994.05
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,264,485.73	-	-	-	1,264,485.73
结算备付金	3,684.24	-	-	-	3,684.24
存出保证金	14,992.46	-	-	-	14,992.46
交易性金融资产	-	-	-	21,312,586.96	21,312,586.96
应收利息	-	-	-	280.45	280.45
应收申购款	-	-	-	28,444.02	28,444.02
应收证券清算款	-	-	-	206,090.72	206,090.72
资产总计	1,283,162.43	-	-	21,547,402.15	22,830,564.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	246,404.30	246,404.30
应付管理人报酬	-	-	-	627.57	627.57
应付托管费	-	-	-	125.54	125.54
应付销售服务费	-	-	-	569.17	569.17
应付交易费用	-	-	-	9,257.27	9,257.27
应交税费	-	-	-	18,324.53	18,324.53
其他负债	-	-	-	120,532.56	120,532.56
负债总计	-	-	-	395,840.94	395,840.94
利率敏感度缺口	1,283,162.43	-	-	21,151,561.21	22,434,723.64

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 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。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。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。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	352,712.00	2.24	57,463.00	0.26
交易性金融资产—基金投资	14,255,246.20	90.41	21,255,123.96	94.74
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	14,607,958.20	92.64	21,312,586.96	95.00

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	697,895.60	995,968.65
	业绩比较基准下降5%	-697,895.60	-995,968.65

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	352,712.00	2.23
	其中：股票	352,712.00	2.23
2	基金投资	14,255,246.20	90.24
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	1,113,657.67	7.05
8	其他各项资产	75,619.73	0.48
9	合计	15,797,235.60	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	24,429.00	0.15
B	采矿业	18,845.00	0.12
C	制造业	128,859.00	0.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,316.00	0.24
E	建筑业	15,810.00	0.10
F	批发和零售业	6,591.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	6,580.00	0.04
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	114,282.00	0.72
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	352,712.00	2.24

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	6,300	30,870.00	0.20

2	600660	福耀玻璃	500	27,925.00	0.18
3	600900	长江电力	1,200	24,768.00	0.16
4	300498	温氏股份	1,700	24,429.00	0.15
5	600887	伊利股份	600	22,098.00	0.14
6	601169	北京银行	4,500	21,915.00	0.14
7	600585	海螺水泥	500	20,525.00	0.13
8	600276	恒瑞医药	300	20,391.00	0.13
9	601398	工商银行	3,700	19,129.00	0.12
10	601668	中国建筑	3,400	15,810.00	0.10
11	601166	兴业银行	600	12,330.00	0.08
12	600016	民生银行	2,100	9,261.00	0.06
13	601939	建设银行	1,300	8,645.00	0.05
14	600028	中国石化	1,800	7,848.00	0.05
15	601818	光大银行	1,800	6,804.00	0.04
16	601006	大秦铁路	1,000	6,580.00	0.04
17	600031	三一重工	200	5,814.00	0.04
18	600547	山东黄金	300	5,766.00	0.04
19	600089	特变电工	400	5,140.00	0.03
20	600886	国投电力	500	4,805.00	0.03
21	601607	上海医药	200	4,226.00	0.03
22	600674	川投能源	300	3,699.00	0.02
23	600867	通化东宝	300	3,582.00	0.02
24	600201	生物股份	200	3,490.00	0.02
25	600177	雅戈尔	500	3,295.00	0.02
26	601997	贵阳银行	400	2,864.00	0.02
27	601857	中国石油	500	2,645.00	0.02
28	600489	中金黄金	300	2,586.00	0.02
29	601988	中国银行	800	2,464.00	0.02
30	601933	永辉超市	500	2,365.00	0.01
31	601717	郑煤机	200	2,326.00	0.01
32	600023	浙能电力	600	2,202.00	0.01
33	600808	马钢股份	500	2,145.00	0.01
34	600567	山鹰国际	600	2,070.00	0.01
35	603077	和邦生物	900	1,872.00	0.01
36	600642	申能股份	300	1,842.00	0.01
37	600282	南钢股份	500	1,780.00	0.01
38	600873	梅花生物	300	1,680.00	0.01
39	600782	新钢股份	300	1,674.00	0.01
40	600022	山东钢铁	900	1,548.00	0.01
41	600688	上海石化	400	1,504.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	56,050.00	0.25
2	605098	行动教育	27,580.00	0.12

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	201,578.00	0.90
2	600887	伊利股份	144,825.00	0.65
3	600660	福耀玻璃	143,124.00	0.64
4	600016	民生银行	115,008.00	0.51
5	600900	长江电力	112,630.00	0.50
6	600031	三一重工	110,714.00	0.49
7	601398	工商银行	108,605.00	0.48
8	601939	建设银行	104,913.00	0.47
9	600585	海螺水泥	97,311.00	0.43
10	601328	交通银行	93,837.00	0.42
11	601318	中国平安	88,266.00	0.39
12	601818	光大银行	82,326.00	0.37
13	600009	上海机场	81,758.00	0.36
14	601006	大秦铁路	79,365.00	0.35
15	600547	山东黄金	77,941.00	0.35
16	600089	特变电工	77,176.00	0.34
17	600763	通策医疗	74,438.00	0.33
18	601169	北京银行	69,718.00	0.31
19	600872	中炬高新	64,796.00	0.29
20	601166	兴业银行	61,113.00	0.27

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	83,630.00
卖出股票收入（成交）总额	3,255,155.06

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

无。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

无。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

无。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	大成基金管理有限公司	14,255,246.20	90.41

**7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

无。

**7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

无。

**7.13 投资组合报告附注****7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

1. 本基金投资的前十名证券之一北京银行(601169.SH)的发行主体北京银行股份有限公司于 2021 年 2 月 5 日因未能确保交易信息的真实性、完整性、可追溯性以及支付全流程中的一致性

等，受到中国人民银行营业管理部处罚（银管罚〔2021〕4号）。北京银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

2. 本基金投资的前十名证券之一交通银行（601328.SH）的发行主体交通银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日因理财业务和同业业务制度不健全等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2021〕28号），于 2021 年 8 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到中国人民银行处罚（银罚字〔2021〕23号）。交通银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

3. 本基金投资的前十名证券之一工商银行（601398.SH）的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2020 年 12 月 25 日因未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕71号）。工商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,282.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	182.36
5	应收申购款	7,359.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	65,795.72
9	合计	75,619.73

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。



### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	919	8,907.20	-	-	8,185,716.26	100.00
大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C	1,020	3,248.09	-	-	3,313,048.06	100.00
合计	1,939	5,930.25	-	-	11,498,764.32	100.00

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 8.2 期末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	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	0.00	0.0000
	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C	304,855.10	9.2017
	合计	304,855.10	2.6512

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	0
	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	0
	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 A	大成 MSCI 价值 100ETF 联接基金 C
基金合同生效日 (2019 年 9 月 26 日) 基金份额总额	332,453,566.37	223,937,562.05
本报告期期初基金份额总额	11,497,612.68	4,911,192.51
本报告期基金总申购份额	1,066,464.97	1,190,216.11
减：本报告期基金总赎回份额	4,378,361.39	2,788,360.56
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,185,716.26	3,313,048.06

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人报告期内无重大人事变动。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

无。

**10.4 基金投资策略的改变**

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	3,311,205.06	100.00%	3,017.80	100.00%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西 部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证	4	-	-	-	-	-

券						
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- (1) 财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- (3) 研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- (4) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- (5) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- (6) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用席位。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内增加交易单元：无。本报告期内退租交易单元：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券 成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券回购 成交总 额的比例	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比例	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例
光大证 券	-	-	-	-	-	-	2,955,174.30	100.00%

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 6 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 27 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 13 日
4	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 5 月 12 日
5	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第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 22 日
6	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 4 月 12 日
7	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更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
8	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产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
9	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产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
10	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 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
11	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 30 日
12	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 23 日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 3 月 11 日
14	大成基金管理有限公司关于基金经理	中国证监会基金电子披	2021 年 1 月 25 日

	张钟玉女士恢复履行职务的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
15	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第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2021 年 1 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成 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的文件；

2、《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》；

3、《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》；

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日