

# 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

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2021 年 9 月 2 日

送出日期：2021 年 9 月 6 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 中国 A 股质优价值 100ETF	基金代码	515520
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
上市交易所及上市日期	上海证券交易所		2019 年 11 月 18 日
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
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

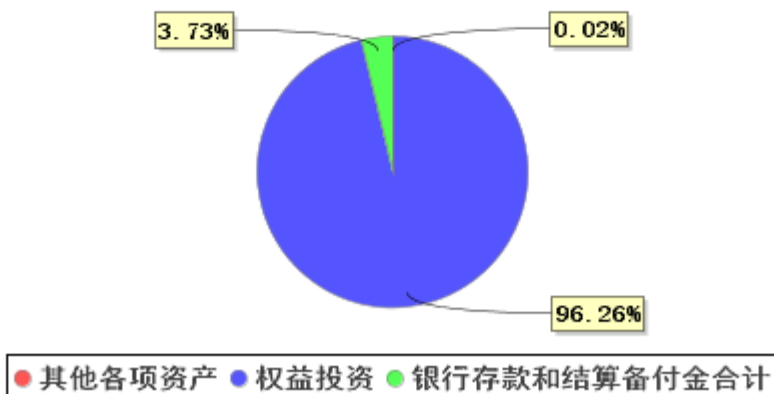
详见《大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第十一部分“基金的投资”。

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。
投资范围	本基金跟踪标的指数为：跟踪 MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数。 本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（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（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款）、同业存单、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的相关规定）。

	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。</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>
<b>主要投资策略</b>	<p>1、完全复制策略</p> <p>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。但因特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者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。</p> <p>特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>为有效管理投资组合，在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>2、衍生金融产品投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、融资及转融通证券出借投资策略。3、在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</p>
<b>业绩比较基准</b>	MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数收益率
<b>风险收益特征</b>	<p>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。</p>

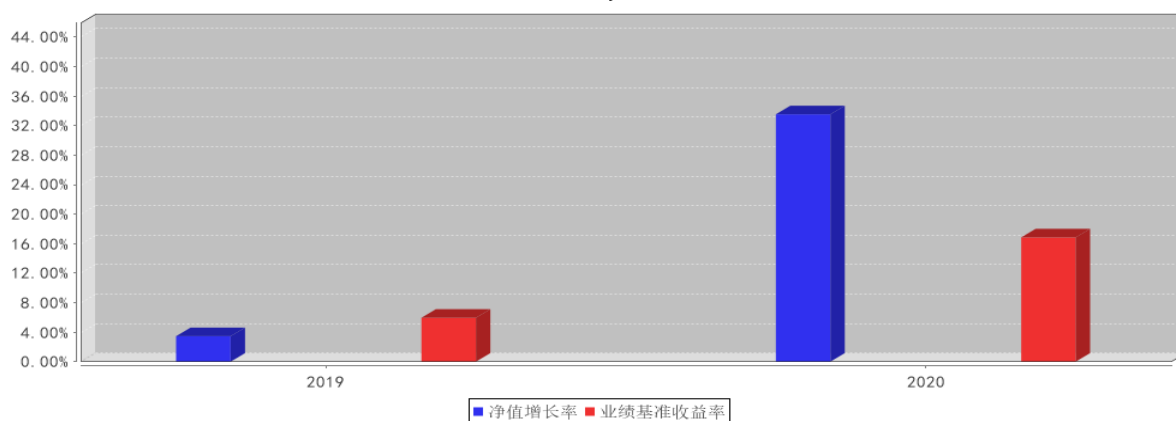
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

## 投资组合资产配置图表(2021年6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中国A股质优价值100ETF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(2020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
认购费	S<50万份	0.8%
	50万份≤S<100万份	0.5%
	S≥100万份	1,000元/笔

注:投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不高于0.5%的标准收取费用,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

场内交易费用以证券公司实际收取为准。

## (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%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，基金上市费及年费，基金的指数使用费，基金相关账户的开户及维护费用，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。

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) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。
- (2) 标的指数波动的风险。
- (3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。
- (4) 标的指数变更的风险。
- (5) 跟踪误差控制未达约定目标的风险。
- (6) 指数编制机构停止服务的风险。
- (7) 成份股停牌的风险。
- (8) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险。
- (9) IOPV 计算错误的风险。
- (10) 退市风险。
- (11) 投资者申购失败的风险。
- (12) 投资人赎回失败的风险。
- (13) 基金份额赎回对价的变现风险。
- (14) 套利风险。
- (15) 申购赎回清单差错风险。
- (16) 二级市场流动性风险。
- (17) 第三方机构服务的风险。
- (18) 退补现金替代方式的风险。
- (19) 资产支持证券投资风险
- (20) 投资股指期货的风险
- (21) 参与融资与转融通业务的风险
- (22) 股票期权投资风险
- (23) 投资流通受限证券的风险
- (24) 存托凭证投资风险

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、管理风险、流动性风险、其他风险等。

##### (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（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 4 月 11 日证监许可【2019】723 号文注册募集。

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。

本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数，该指数的样本空间、选样方法等信息详见本基金招募说明书。

## 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](http://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