

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 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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 2020 年 8 月 27 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人及基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	35
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末上市基金前十名持有人	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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情况	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
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
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 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
基金简称	大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100ETF
场内简称	MSCI 价值 100ETF
基金主代码	515520
交易代码	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	121,866,811.00 份
基金合同存续期	不定期
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

2.2 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	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
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	周慕冰

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	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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	20,927,584.56
本期利润	12,066,763.36
加权平均基金份额本期利润	0.0491
本期加权平均净值利润率	4.81%
本期基金份额净值增长率	7.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,060,898.25
期末可供分配基金份额利润	0.0908
期末基金资产净值	135,340,004.70
期末基金份额净值	1.1106
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.06%

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

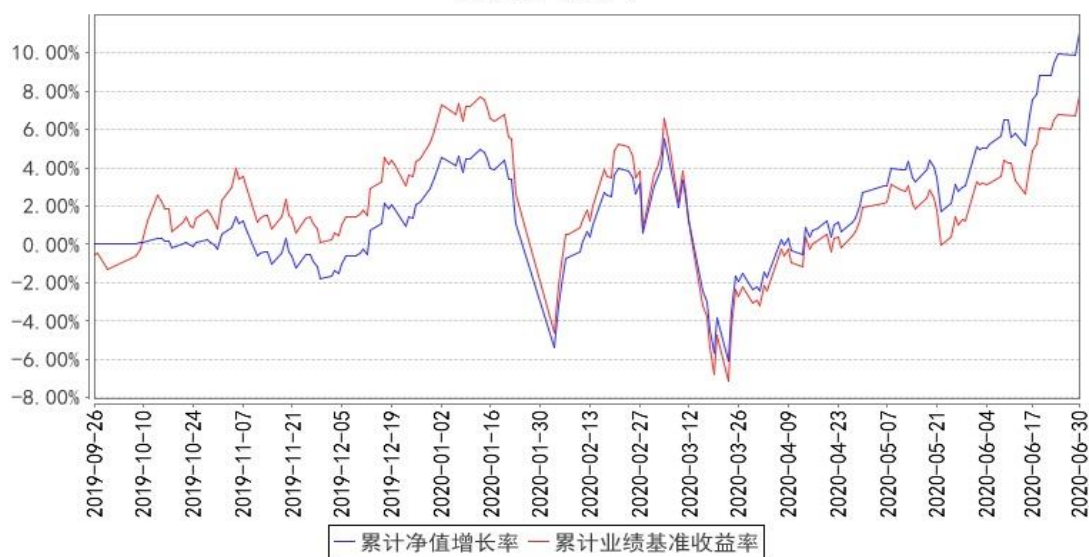
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	7.75%	0.67%	6.44%	0.68%	1.31%	-0.01%
过去三个月	13.57%	0.68%	11.01%	0.71%	2.56%	-0.03%
过去六个月	7.34%	1.15%	1.69%	1.29%	5.65%	-0.14%
自基金合同生效起至今	11.06%	0.96%	7.76%	1.10%	3.30%	-0.14%

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中国A股质优价值100ETF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：1、本基金合同生效日为 2019 年 9 月 26 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。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 2020 年 6 月 30 日，公司管理公募基金产品数量共 103 只。

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	-	10 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
黎 新 平	本基金基 金经理， 数量与指 数投资部	2019 年 9 月 26 日	-	12 年	经济学博士。2008 年 7 月至 2015 年 6 月历任 Aristeia capital 量化投资部资深策略师、投资经理。2015 年 7 月加入大成基金管理有限公司，现任数量与指数投资部

	总监				总监。2016 年 9 月 20 日起任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月 18 日起任大成绝对收益策略混合型发起式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	本基金基金经理助理	2019 年 10 月 29 日	2020 年 6 月 29 日	12 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。具备基金从业资格。国籍：中国
刘淼	本基金基金经理	2020 年 6 月 29 日	-	12 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。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。

3、本基金经理张钟玉自 2020 年 6 月 29 日起休产假。在产假期间，由本公司基金经理苏秉毅先生代为管理本基金。上述事项已按有关法规进行披露并向中国证监会深圳证监局备案。

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和工具，对旗下所有投资组合连续 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存在 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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

上半年，由于史无前例的疫情，宏观经济运行偏离了既有轨道，外部环境也面临巨大变局。尽管疫情已经得到一定控制，但短时间内仍无法根治，持续影响社会运作。巨震之下，保障民生、维持社会稳定是政府的首要目标，宽松的货币政策和积极的财政政策成为必然选择。相对于国内形势，海外疫情更为严重，世界格局也发生了一定程度的变化。

股票市场同样波动极大。以春节前后新冠肺炎的爆发为转折点，节后市场一度暴跌，相关部门及时出手，股市从流动性危机的边缘被挽救回来，并在流动性和情绪驱动下走出一波反弹行情。三月份海外疫情进一步蔓延并引发了各类资产的史诗级波动，也导致了 A 股产生系统性调整，随后市场利空出尽站稳，并走出了一波可观的普涨行情。

经过反复剧烈波动，上半年市场基准沪深 300 指数小幅上涨 1.64%。行业和风格分化较大，机构持仓较为集中的板块优势明显。成长风格大幅领先价值风格，创业板指成为上半年表现最为优异的主流宽基指数。在行业板块方面，医药生物一枝独秀，消费、科技依然表现较好，“赛道”优势淋漓尽致；而采掘、银行等传统行业则表现较弱。

本基金标的指数 MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数上涨 1.69%，涨幅略微高于大盘。上半年，本基金完成了建仓，之后基本保持满仓运作，严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1106 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.34%，业绩比较基准收益率为 1.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济局面依然严峻。新冠疫情已经给世界经济带来了巨大的损失，在短期

内也难以看到问题解决的曙光。雪上加霜的是，由此引起的全球范围社会撕裂，形成了经济复苏的巨大障碍。

对于股票市场，我们持总体中性、略偏乐观的观点。尽管基本面并不理想，股票市场走势却并不仅仅反映当前经济形势，有望展现出更强的韧性。近年来，股票市场得到国家层面前所未有的重视，在当前局面下有望成为支持经济、发展科技、推动改革的抓手。股市下半年有望继续平稳运行，系统性大幅上涨或下跌的可能性都较小，且不乏结构性的机会，风格切换可能较为频繁。

另一方面，即便市场平稳运行，也不排除会有阶段性、局部回撤。当前部分股票估值已非常高，连乐观的未来增长预期也不足以支撑其估值水平，若出现流动性边际收紧等利空，股价开始回归合理区间的话，跌幅将相当可观。此外，国际形势不稳，我们也要警惕小概率高烈度风险事件的发生，不可过度乐观。

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，按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合，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

无。

§ 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《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一大成基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 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《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，未发现有关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

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.3.1	5,169,562.27	61,297,988.19
结算备付金		358,423.67	4,746,441.40
存出保证金		84,526.92	188,442.52
交易性金融资产	6.4.3.2	131,627,987.06	470,462,764.61
其中：股票投资		131,627,987.06	470,462,764.61
基金投资		-	-
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		628,848.52	5,451,681.91
应收利息	6.4.3.5	2,027.88	14,907.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		137,871,376.32	542,162,226.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,668,278.89	7,619,566.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,112.60	292,505.65
应付托管费		12,422.52	58,501.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	116,367.82	1,039,151.22
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	672,189.79	1,434,447.62
负债合计		2,531,371.62	10,444,171.95
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	121,866,811.00	513,866,811.00
未分配利润	6.4.3.10	13,473,193.70	17,851,243.28
所有者权益合计		135,340,004.70	531,718,054.28
负债和所有者权益总计		137,871,376.32	542,162,226.23

注： 报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1106 元，基金份额总额 121,866,811.00 份。

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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		13,541,295.40
1. 利息收入		102,043.14
其中：存款利息收入	6.4.3.11	102,043.14
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）		21,883,590.93
其中：股票投资收益	6.4.3.12	20,131,151.08
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-
股利收益	6.4.3.16	1,752,439.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-8,860,821.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	416,482.53
减：二、费用		1,474,532.04
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	631,619.12
2. 托管费	6.4.6.2.2	126,323.78

3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6. 4. 3. 19	537, 920. 36
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. 3. 20	178, 668. 78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12, 066, 763. 36
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		12, 066, 763. 36

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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	513, 866, 811. 00	17, 851, 243. 28	531, 718, 054. 28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12, 066, 763. 36	12, 066, 763. 36
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)	-392, 000, 000. 00	-16, 444, 812. 94	-408, 444, 812. 94
其中：1. 基金申购款	47, 000, 000. 00	-1, 269, 686. 77	45, 730, 313. 23
2. 基金赎回款	-439, 000, 000. 00	-15, 175, 126. 17	-454, 175, 126. 17
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)	121, 866, 811. 00	13, 473, 193. 70	135, 340, 004. 70

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	5,169,562.27
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	5,169,562.27

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	121,922,033.83	131,627,987.06	9,705,953.23
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	—	—	—
其他	—	—	—
合计	121,922,033.83	131,627,987.06	9,705,953.23

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,848.42
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	145.17
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	34.29
合计	2,027.88

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	116,367.82
银行间市场应付交易费用	—
合计	116,367.82

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,481.66
应付指数使用费	35,397.50
应退替代款	542,310.63
合计	672,189.79

注：应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	513,866,811.00	513,866,811.00
本期申购	47,000,000.00	47,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-439,000,000.00	-439,000,000.00
- 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	121,866,811.00	121,866,811.00

注：申购含红利再投份额(如有)。

6.4.3.10 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	3,800,464.38	14,050,778.90	17,851,243.28
本期利润	20,927,584.56	-8,860,821.20	12,066,763.36
本期基金份额交易产生的变动数	-13,667,150.69	-2,777,662.25	-16,444,812.94
其中：基金申购款	2,218,894.68	-3,488,581.45	-1,269,686.77
基金赎回款	-15,886,045.37	710,919.20	-15,175,126.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,060,898.25	2,412,295.45	13,473,193.70

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	97,626.48
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	2,864.21
其他	1,552.45

合计	102,043.14
----	------------

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	16,829,744.91
股票投资收益——赎回差价收入	3,301,406.17
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	20,131,151.08

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	194,350,444.21
减：卖出股票成本总额	177,520,699.30
买卖股票差价收入	16,829,744.91

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	454,175,126.17
减：现金支付赎回款总额	137,796,873.17
减：赎回股票成本总额	313,076,846.83
赎回差价收入	3,301,406.17

6.4.3.13 债券投资收益

无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,752,439.85
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	1,752,439.85

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,860,821.20
股票投资	-8,860,821.20
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-8,860,821.20

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	416,482.53
合计	416,482.53

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	537,920.36
银行间市场交易费用	—
合计	537,920.36

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
银行划款手续费	6,583.35
指数使用费	77,603.77
合计	178,668.78

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 0.01% 的季费率计提，逐日累计，按季支付。指数许可使用费收取下限为每季度 5000 美元。

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、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
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联接基金（“大成 MSCI 价值 100ETF 联接”）	本基金的联接基金

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 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 (%)
光大证券	133,094,614.97	41.99

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 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	121,288.88	41.98	58,792.14	50.52

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 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	631,619.12
其中：支付销售机构的客户维护费	—

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 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	126,323.78

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 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
大成 MSCI 价值 100ETF 联接	45,000,000.00	36.9300	122,000,000.00	23.7400

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	5,169,562.27	97,626.48

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

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2020 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

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特 智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未 上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝 股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未 上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安	2020 年	2020	新股未	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-

	高科	6月24日	2020年7月3日	上市						
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	1,084	39,219.12	39,219.12	-
688085	三友医疗	2020年3月30日	2020年10月9日	新股锁定	20.96	67.62	5,226	109,536.96	353,382.12	-
688090	瑞松科技	2020年2月7日	2020年8月17日	新股锁定	27.55	59.45	3,013	83,008.15	179,122.85	-
688158	优刻得	2020年1月10日	2020年7月20日	新股锁定	33.23	68.38	16,215	538,824.45	1,108,781.70	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	4,189	50,435.56	50,435.56	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股未上市	16.42	16.42	2,387	39,194.54	39,194.54	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	3,751	42,498.83	42,498.83	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	3,443	55,811.03	55,811.03	-
688588	凌志软件	2020年4月28日	2020年11月11日	新股锁定	11.49	33.33	17,277	198,512.73	575,842.41	-

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

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

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 MSCI 中国 A 股质优价值 100 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。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，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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，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。

于本期末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

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 2020 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	5,169,562.27	-	-	-	5,169,562.27
结算备付金	358,423.67	-	-	-	358,423.67
存出保证金	84,526.92	-	-	-	84,526.92
交易性金融资产	-	-	-	131,627,987.06	131,627,987.06
应收利息	-	-	-	2,027.88	2,027.88
应收证券清算款	-	-	-	628,848.52	628,848.52
资产总计	5,612,512.86	-	-	132,258,863.46	137,871,376.32
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	62,112.60	62,112.60
应付托管费	-	-	-	12,422.52	12,422.52
应付证券清算款	-	-	-	1,668,278.89	1,668,278.89

应付交易费用	-	-	-	116,367.82	116,367.82
其他负债	-	-	-	672,189.79	672,189.79
负债总计	-	-	-	2,531,371.62	2,531,371.62
利率敏感度缺口	5,612,512.86	-	-	-129,727,491.84	135,340,004.70
上年度末 2019 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	61,297,988.19	-	-	-	61,297,988.19
结算备付金	4,746,441.40	-	-	-	4,746,441.40
存出保证金	188,442.52	-	-	-	188,442.52
交易性金融资产	-	-	-	-470,462,764.61	470,462,764.61
应收利息	-	-	-	14,907.60	14,907.60
应收证券清算款	-	-	-	5,451,681.91	5,451,681.91
资产总计	66,232,872.11	-	-	-475,929,354.12	542,162,226.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	292,505.65	292,505.65
应付托管费	-	-	-	58,501.13	58,501.13
应付证券清算款	-	-	-	7,619,566.33	7,619,566.33
应付交易费用	-	-	-	1,039,151.22	1,039,151.22
其他负债	-	-	-	1,434,447.62	1,434,447.62
负债总计	-	-	-	10,444,171.95	10,444,171.95
利率敏感度缺口	66,232,872.11	-	-	-465,485,182.17	531,718,054.28

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

本基金采用完全复制法跟踪 MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数，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，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，MSCI 中国 A 股质优价值 100 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金资产的 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。此外，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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	131,627,987.06	97.26	470,462,764.61	88.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	131,627,987.06	97.26	470,462,764.61	88.48

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	3,320,000.00	18,880,000.00
	业绩比较基准下降	-3,320,000.00	-18,880,000.00

	5%		
--	----	--	--

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	131,627,987.06	95.47
	其中：股票	131,627,987.06	95.47
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	5,527,985.94	4.01
8	其他各项资产	715,403.32	0.52
9	合计	137,871,376.32	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,271,136.00	2.42
B	采矿业	8,711,244.00	6.44
C	制造业	64,923,920.70	47.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,350,741.42	5.43
E	建筑业	846,198.00	0.63
F	批发和零售业	4,896,966.00	3.62
G	交通运输、仓储和邮政业	6,268,354.22	4.63
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,579,326.00	1.17
J	金融业	25,526,438.16	18.86
K	房地产业	1,424,630.00	1.05

L	租赁和商务服务业	1,078,210.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	1,519,544.00	1.12
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	1,584,315.00	1.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	128,981,023.50	95.30

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	765,851.33	0.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,868,345.91	1.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,646,963.56	1.96

7.2.3 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	860,400	4,413,852.00	3.26
2	600519	贵州茅台	2,800	4,096,064.00	3.03
3	601939	建设银行	610,400	3,851,624.00	2.85
4	600887	伊利股份	118,200	3,679,566.00	2.72
5	600016	民生银行	564,288	3,199,512.96	2.36
6	600009	上海机场	41,346	2,979,806.22	2.20
7	000895	双汇发展	64,500	2,972,805.00	2.20
8	600900	长江电力	145,110	2,748,383.40	2.03
9	601006	大秦铁路	389,000	2,738,560.00	2.02
10	600547	山东黄金	71,800	2,629,316.00	1.94
11	601398	工商银行	525,000	2,614,500.00	1.93
12	601318	中国平安	36,143	2,580,610.20	1.91
13	601169	北京银行	515,100	2,523,990.00	1.86
14	601899	紫金矿业	570,800	2,511,520.00	1.86
15	600872	中炬高新	36,600	2,142,198.00	1.58
16	601818	光大银行	590,200	2,112,916.00	1.56
17	600585	海螺水泥	39,900	2,111,109.00	1.56
18	002007	华兰生物	41,490	2,079,063.90	1.54
19	600201	生物股份	73,300	2,040,672.00	1.51
20	600660	福耀玻璃	91,865	1,917,222.55	1.42
21	600276	恒瑞医药	20,280	1,871,844.00	1.38
22	002475	立讯精密	34,749	1,784,361.15	1.32
23	000538	云南白药	18,900	1,773,009.00	1.31
24	002415	海康威视	54,900	1,666,215.00	1.23
25	300498	温氏股份	76,320	1,663,776.00	1.23
26	600031	三一重工	88,500	1,660,260.00	1.23
27	600886	国投电力	207,437	1,630,454.82	1.20
28	600763	通策医疗	9,500	1,584,315.00	1.17
29	601166	兴业银行	99,500	1,570,110.00	1.16
30	300012	华测检测	76,900	1,519,544.00	1.12
31	002179	中航光电	36,800	1,509,168.00	1.12
32	002236	大华股份	77,900	1,496,459.00	1.11
33	601933	永辉超市	152,400	1,429,512.00	1.06

34	600036	招商银行	42,300	1,426,356.00	1.05
35	000002	万 科 A	54,500	1,424,630.00	1.05
36	600089	特变电工	207,000	1,401,390.00	1.04
37	300408	三环集团	50,440	1,397,188.00	1.03
38	600085	同仁堂	47,200	1,280,064.00	0.95
39	600298	安琪酵母	24,800	1,227,104.00	0.91
40	600489	中金黄金	131,700	1,203,738.00	0.89
41	000963	华东医药	47,000	1,189,100.00	0.88
42	600498	烽火通信	40,840	1,180,684.40	0.87
43	600600	青岛啤酒	15,200	1,162,800.00	0.86
44	601607	上海医药	61,100	1,123,018.00	0.83
45	600315	上海家化	23,100	1,106,490.00	0.82
46	000513	丽珠集团	22,800	1,094,628.00	0.81
47	000725	京东方 A	231,700	1,082,039.00	0.80
48	601888	中国中免	7,000	1,078,210.00	0.80
49	000423	东阿阿胶	29,100	1,042,071.00	0.77
50	002511	中顺洁柔	45,800	1,021,340.00	0.75
51	600028	中国石化	252,000	985,320.00	0.73
52	600674	川投能源	100,860	934,972.20	0.69
53	000623	吉林敖东	58,800	924,924.00	0.68
54	002138	顺络电子	36,600	913,170.00	0.67
55	002555	三七互娱	19,300	903,240.00	0.67
56	300146	汤臣倍健	44,700	880,143.00	0.65
57	000630	铜陵有色	450,100	868,693.00	0.64
58	002396	星网锐捷	24,160	853,572.80	0.63
59	601668	中国建筑	177,400	846,198.00	0.63
60	002299	圣农发展	29,000	841,000.00	0.62
61	600690	海尔智家	46,700	826,590.00	0.61
62	000651	格力电器	14,400	814,608.00	0.60
63	600196	复星医药	23,600	798,860.00	0.59
64	600642	申能股份	131,200	775,392.00	0.57
65	601988	中国银行	220,400	766,992.00	0.57
66	600598	北大荒	47,600	766,360.00	0.57
67	002304	洋河股份	7,000	735,980.00	0.54
68	600023	浙能电力	207,900	729,729.00	0.54
69	002241	歌尔股份	24,200	710,512.00	0.52
70	600511	国药股份	17,200	699,524.00	0.52
71	002195	二三四五	240,600	676,086.00	0.50
72	300294	博雅生物	18,000	674,820.00	0.50
73	600567	山鹰纸业	228,200	673,190.00	0.50
74	002151	北斗星通	21,000	672,630.00	0.50
75	000999	华润三九	22,900	668,451.00	0.49

76	600597	光明乳业	42,100	625,606.00	0.46
77	002233	塔牌集团	51,100	614,733.00	0.45
78	002422	科伦药业	28,800	604,800.00	0.45
79	600066	宇通客车	48,700	594,140.00	0.44
80	600873	梅花生物	130,600	592,924.00	0.44
81	000581	威孚高科	27,181	562,103.08	0.42
82	000089	深圳机场	71,800	549,988.00	0.41
83	600282	南钢股份	169,400	547,162.00	0.40
84	600572	康恩贝	98,200	540,100.00	0.40
85	600027	华电国际	155,500	531,810.00	0.39
86	600566	济川药业	18,597	473,479.62	0.35
87	601601	中国太保	17,100	465,975.00	0.34
88	002506	协鑫集成	177,800	464,058.00	0.34
89	603228	景旺电子	13,080	460,285.20	0.34
90	600729	重庆百货	14,600	455,812.00	0.34
91	601699	潞安环能	80,000	445,600.00	0.33
92	002701	奥瑞金	100,700	421,933.00	0.31
93	600062	华润双鹤	31,900	421,718.00	0.31
94	002436	兴森科技	32,600	418,258.00	0.31
95	601717	郑煤机	68,300	402,287.00	0.30
96	002203	海亮股份	42,100	368,375.00	0.27
97	002128	露天煤业	44,800	347,200.00	0.26
98	600348	阳泉煤业	73,700	311,014.00	0.23
99	000975	银泰黄金	17,700	277,536.00	0.21

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

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	688158	优刻得	16,215	1,108,781.70	0.82
2	688588	凌志软件	17,277	575,842.41	0.43
3	688085	三友医疗	5,226	353,382.12	0.26
4	688090	瑞松科技	3,013	179,122.85	0.13
5	688078	龙软科技	2,811	115,813.20	0.09
6	688568	中科星图	3,443	55,811.03	0.04
7	688277	天智航	4,189	50,435.56	0.04
8	603087	甘李药业	473	47,441.90	0.04
9	688528	秦川物联	3,751	42,498.83	0.03
10	688027	国盾量子	1,084	39,219.12	0.03
11	688377	迪威尔	2,387	39,194.54	0.03
12	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
13	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01

14	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
15	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
16	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

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	600009	上海机场	5,553,582.00	1.04
2	000538	云南白药	4,433,363.40	0.83
3	002304	洋河股份	4,157,400.00	0.78
4	600900	长江电力	3,655,198.00	0.69
5	600872	中炬高新	3,114,061.00	0.59
6	000895	双汇发展	3,102,829.00	0.58
7	600547	山东黄金	2,879,632.52	0.54
8	600887	伊利股份	2,727,021.72	0.51
9	601318	中国平安	2,603,865.00	0.49
10	002179	中航光电	2,551,212.50	0.48
11	002007	华兰生物	2,517,692.00	0.47
12	002415	海康威视	2,448,941.00	0.46
13	300498	温氏股份	2,396,765.56	0.45
14	600036	招商银行	2,242,143.00	0.42
15	600016	民生银行	2,140,945.00	0.40
16	600089	特变电工	2,040,235.00	0.38
17	601933	永辉超市	2,014,538.63	0.38
18	601006	大秦铁路	1,866,024.00	0.35
19	600660	福耀玻璃	1,790,485.00	0.34
20	002236	大华股份	1,750,165.00	0.33

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	600519	贵州茅台	9,598,547.69	1.81
2	000895	双汇发展	9,296,478.85	1.75
3	000538	云南白药	7,589,906.61	1.43
4	601988	中国银行	6,042,219.00	1.14
5	000002	万科A	6,031,432.00	1.13
6	002007	华兰生物	5,542,400.37	1.04
7	000423	东阿阿胶	4,817,310.54	0.91
8	002415	海康威视	4,724,620.94	0.89

9	002304	洋河股份	4,629,097.00	0.87
10	300012	华测检测	4,515,902.11	0.85
11	000858	五 粮 液	4,439,944.00	0.84
12	300408	三环集团	4,018,002.00	0.76
13	002475	立讯精密	3,965,956.49	0.75
14	000630	铜陵有色	3,952,996.00	0.74
15	000725	京东方 A	3,918,353.00	0.74
16	000623	吉林敖东	3,793,642.33	0.71
17	000975	银泰黄金	3,788,794.00	0.71
18	000581	威孚高科	3,658,630.30	0.69
19	002179	中航光电	3,519,273.00	0.66
20	000513	丽珠集团	3,349,386.93	0.63

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	128,991,089.33
卖出股票收入（成交）总额	194,350,444.21

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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建设银行（601939.SH）的发行主体中国建设银行股份有限公司于 2019 年 12 月 27 日因用于风险缓释的保证金管理存在漏洞等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2019〕22 号），于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕8 号）。建设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 2019 年 12 月 27 日因授信审批不审慎等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2019〕24 号），于 2020 年 4 月 20 日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕6 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民生银行（600016.SH）的发行主体中国民生银行股份有限公司于 2020 年 2 月 10 日因未按规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银罚字〔2020〕1 号）。民生银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

7.12.2 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

7.12.3 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	84,526.92
2	应收证券清算款	628,848.52

3	应收股利	—
4	应收利息	2,027.88
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	715,403.32

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688158	优刻得	1,108,781.70	0.82	新股锁定
2	688588	凌志软件	575,842.41	0.43	新股锁定
3	688085	三友医疗	353,382.12	0.26	新股锁定
4	688090	瑞松科技	179,122.85	0.13	新股锁定

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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
1,849	65,909.58	54,922,864.00	45.07	66,943,947.00	54.93

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
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	45,000,000.00	36.93

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	招商证券股份有限公司	5,002,081.00	4.10
2	中信建投证券股份有限公司	4,783,839.00	3.93
3	罗魁	2,380,000.00	1.95
4	李卫群	2,100,000.00	1.72
5	李林晖	1,600,000.00	1.31
6	刘翔	1,000,000.00	0.82
7	崔晓凯	1,000,000.00	0.82
8	肖范明	1,000,000.00	0.82
9	张丽君	800,000.00	0.66
10	韩秀英	667,000.00	0.55
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	45,000,000.00	36.93

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 9 月 26 日）	
基金份额总额	781,866,811.00
本报告期期初基金份额总额	513,866,811.00
本报告期基金总申购份额	47,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	439,000,000.00
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	121,866,811.00

§ 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

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无

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	
国泰君安	3	135,360,511.70	42.70%	123,359.72	42.70%	—
光大证券	2	133,094,614.97	41.99%	121,288.88	41.98%	—
中泰证券	2	48,548,110.26	15.31%	44,242.91	15.31%	—
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	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
宏源证券	1	—	—	—	—	—
红塔证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—
联讯证券	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	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
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：1、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：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）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；
- （三）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；
- （四）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；

(五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;

(六) 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交易单元。

2、本报告期内增加交易单元: 无。本报告期内退租交易单元: 长城证券。

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

无。

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	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更新招募说明书	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
2	关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
3	大成基金管理有限公司关于基金经理张钟玉女士因休产假暂停履行职务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
4	大成基金管理有限公司旗下部分基金新增中信证券华南股份有限公司申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 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 2019 年年度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
6	大成基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理相关销售业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 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 2020 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
8	大成基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
9	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
10	大成基金管理有限公司关于公司旗下上海证券交易所上市基金增加扩位简称的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
11	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及	2020 年 08 月 27 日

		本公司网站	
12	大成基金管理有限公司关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
13	大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
14	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 2019 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
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更新招募说明书	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
16	关于大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金根据沪市跨市场股票 ETF 交易结算模式调整相应修订基金招募说明书的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 日
17	关于大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 08 月 27 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
目标基金的联接基金	1	20200101-20200630	122,000,000.00	137,000,000.00	214,000,000.00	45,000,000.00	36.93
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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

2020 年 8 月 28 日