

大成中小盘混合型证券投资基金(LOF) 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年03月29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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2020年01月01日起至12月31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 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49

8.3 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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
8.6 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	59
8.7 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	59
8.8 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	59
8.9 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	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	59
§ 9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末上市基金前十名持有人	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.4 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	61
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	61
§ 10 开放式基金份额变动	61
§ 11 重大事件揭示	61
11.1 基金份额持有人大会决议	61
11.2 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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	65
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	68
12.1 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	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	大成中小盘混合(LOF)
场内简称	大成小盘
基金主代码	160918
交易代码	160918
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2014年4月10日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	429,642,284.04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	2014年4月30日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于股票市场中具有较高成长性的中小盘股票，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，进行自上而下的资产配置和组合管理，同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票进行投资。1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中证700指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险收益特征的开放式基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰	许俊
	联系电话	0755-83183388	010-66594319
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008885558	95566
传真		0755-83199588	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		深圳市福田区深南大道7088号招	北京市西城区复兴门内大街1号

	商银行大厦 32 层	
邮政编码	518040	100818
法定代表人	吴庆斌	刘连舸

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	312,751,286.86	183,176,649.08	-55,041,158.99
本期利润	537,610,639.48	261,267,387.36	-91,767,838.14
加权平均基金份额本期利润	1.6913	0.6820	-0.3158
本期加权平均净值利润率	53.87%	36.49%	-16.66%
本期基金份额净值增长率	78.30%	43.23%	-13.19%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	944,953,968.96	242,587,304.69	290,917,748.34
期末可供分配基金份额利润	2.1994	1.1142	0.5704
期末基金	1,672,826,343.02	475,482,195.86	800,953,089.51

资产净值			
期末基金份额净值	3.894	2.184	1.570
3.1.3 累计期末指标	2020年末	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	423.36%	193.54%	104.94%

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。

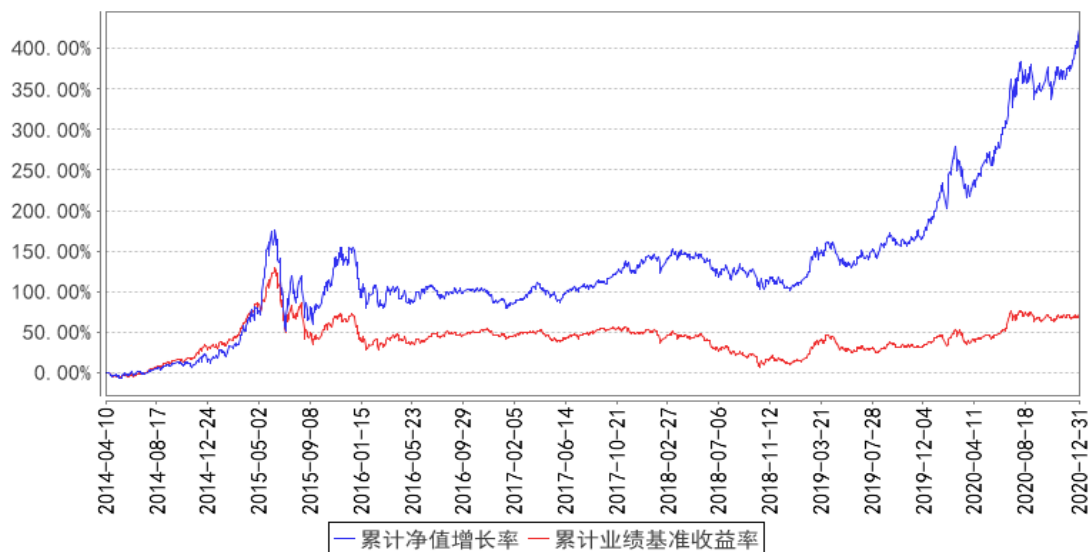
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	15.72%	1.34%	5.37%	0.92%	10.35%	0.42%
过去六个月	27.30%	1.53%	11.91%	1.18%	15.39%	0.35%
过去一年	78.30%	1.73%	23.05%	1.29%	55.25%	0.44%
过去三年	121.70%	1.42%	15.62%	1.20%	106.08%	0.22%
过去五年	108.70%	1.45%	2.85%	1.17%	105.85%	0.28%
自基金合同生效起至今	423.36%	1.75%	72.93%	1.36%	350.43%	0.39%

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

大成中小盘混合（LOF）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

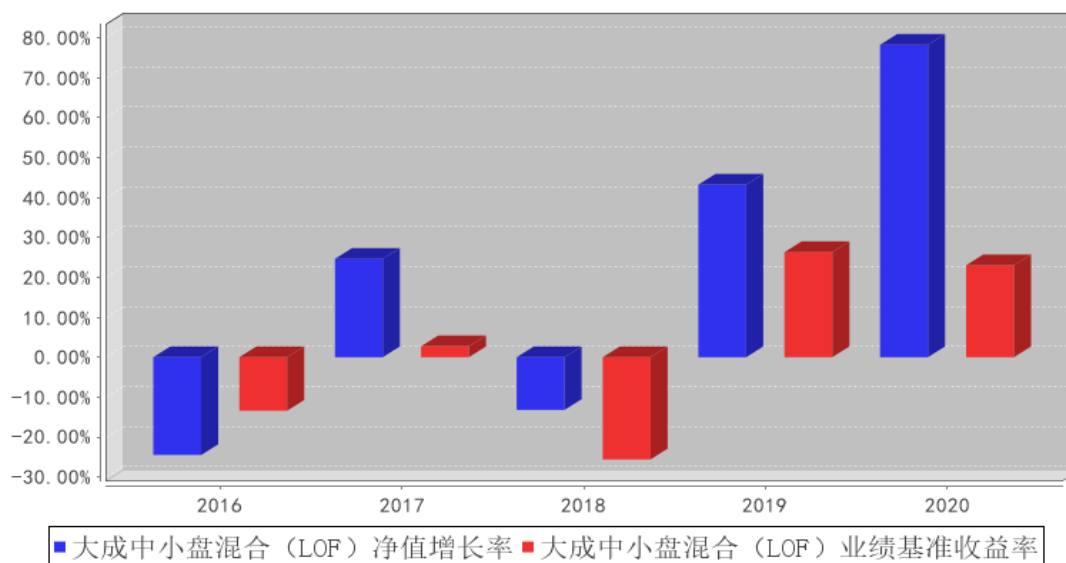


注：1、本基金于自 2014 年 4 月 10 日起由景宏证券投资基金转型为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)，本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2、本基金于 2015 年 7 月 24 日起由大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)更名为大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成中小盘混合（LOF）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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	0.610	9,681,259.91	4,525,092.74	14,206,352.65	-
2018 年	1.688	64,155,467.18	18,005,082.51	82,160,549.69	-
合计	2.298	73,836,727.09	22,530,175.25	96,366,902.34	-

§ 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%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经 21 年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 115 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		
魏庆国	本基金基金经理	2015 年 4 月 7 日	-	10 年	经济学硕士。2010 年 7 月至 2012 年 11 月任华夏基金管理有限公司研究部研究员。2012 年 12 月至 2013 年 3 月任平安大华基金研究部研究员。2013 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金基金经理助理，现任股票投资部总监助理。2015 年 4 月 7 日起任大成中小盘混合型证券投资基金(LOF) 基金经理(更名前为大成中小盘

					股票型证券投资基金 (LOF))。2015 年 4 月 7 日至 2016 年 8 月 19 日任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 28 日至 2016 年 8 月 19 日任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2016 年 3 月 22 日至 2020 年 5 月 18 日任大成趋势回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 1 月 2 日起任大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 23 日起任大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理。2020 年 4 月 29 日起任大成科技创新混合型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月 16 日起任大成科技消费股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
邹建	本基金基金经理助理	2020 年 7 月 19 日	-	4 年	工学硕士。2016 年 7 月加入大成基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、基金经理助理、基金经理，期间曾担任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成科技创新混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金、大成科技消费股票型证券投资基金基金经理助理。2021 年 1 月 26 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
王帅	本基金基金经理助理	2020 年 10 月 19 日	-	3 年	工程硕士。2017 年 3 月至 2019 年 9 月任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员。2019 年 9 月加入大成基金管理有限公司，现任研究部研究员。2020 年 10 月 19 日起任大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金、大成科技消费股票型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
孙丹	本基金基	2020 年	-	12 年	经济学硕士。2008 年至 2012 年任景顺长

	金经理助理	11月6日			<p>城产品开发部产品经理。2012 年至 2014 年任华夏基金机构债券投资部研究员。2014 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任固定收益总部信用策略及宏观利率研究员、大成景辉灵活配置混合型证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任固定收益总部总监助理。2018 年 3 月 12 日起任大成策略回报混合型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF)、大成积极成长混合型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成景阳领先混合型证券投资基金、大成竞争优势混合型证券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2020 年 7 月 1 日起任大成价值增长证券投资基金、大成多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、大成一带一路灵活配置混合型证券投资基金、大成内需增长混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、大成国企改革灵活配置混合型证券投资基金、大成行业轮动混合型证券投资基金、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、大成健康产业混合型证券投资基金、大成正向回报灵活配置混合型证券投资基金、大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成新锐产业混合型证券投资基金、大成消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 6 日起任大成科技消费股票型证券投资基金、大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、大成中小盘混合型证券投资基金 (LOF)、大成睿享混合型证券投资基金、大成行业先锋混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 5 月 8 日起任大成景尚灵活配置混合型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2017 年 5 月 8 日至 2019 年 10 月 31 日任大成景荣债券型证券投资基金 (原大成景荣保本混合型证</p>
--	-------	-------	--	--	--

				券投资基金转型)基金经理。2017年5月31日至2020年10月20日任大成惠裕定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2018年11月19日任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2018年12月8日任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月2日至2019年6月15日任大成景秀灵活配置混合型证券投资基金。2017年6月6日至2019年9月29日任大成惠明定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年11月30日任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年11月30日任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日至2018年7月20日任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理。2019年7月31日至2020年5月23日任大成景丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理。2020年2月27日起任大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年3月5日起任大成恒享混合型证券投资基金基金经理。2020年3月31日起任大成民稳增长混合型证券投资基金基金经理。2020年4月26日起任大成景瑞稳健配置混合型证券投资基金基金经理。2020年8月21日起任大成景和债券型证券投资基金基金经理。2020年9月3日起任大成汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020年9月23日起任大成尊享18个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020年11月16日起任大成卓享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020年11月18日起任大成丰享回报混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。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、因工作调整,邹建先生自2021年1月26日起不再担任基金经理助理

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

4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 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些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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

4.3.3 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 7 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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 5 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。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

从申万一级行业指数来看，28 个一级行业中前 10 个领涨的板块如下表所示，主要是 4 个主线：1) 光伏和新能源汽车，电气设备、汽车和有色都跟新能源产业链相关，反应的是中美欧三大经济体共同推进碳中和大变局下的机会；2) 医药生物：器械、生物制品、服务和化药，部分受益于疫情，部分本身就是优质赛道；3) 内循环：免税品（休闲服务）和食品饮料尤其是高端白酒，在财富向头部 2% 的人急剧集中的大趋势下，奢侈品大幅受益；4) 国防军工：十四五规划首次提出建军百年奋斗目标，军工真正从过去重组和题材驱动变成内需驱动，强国必先强军。

证券简称	涨跌幅
1 休闲服务	99.4
2 电气设备	94.7
3 食品饮料	85.0
4 国防军工	58.0
5 医药生物	51.1
6 汽车	45.8
7 电子	36.1
8 化工	35.0
9 有色金属	34.8
10 家用电器	31.1

本基金抓住了医药生物、光伏和新能源汽车、国防军工的机会，但错过了内循环主线的半导体和免税，主要原因是工作方法和思考深度不足，边缘品种分散了主线品种的研究精力。检讨过去 1 年乃至过去 6 年或者过去 10 年，我觉得犯的最大的错在于“不聚焦”，事实上机会是极其稀缺的，大部分都是扰动，要把所有的时间都聚焦到极少数能够创造长期机会的好赛道上好企业上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成中小盘混合(LOF)的基金份额净值为 3.894 元，本报告期基金份额净值增长率为 78.30%，同期业绩比较基准收益率为 23.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们将继续执行既定的投资策略：

1、坚信大国复兴：中国的体系化竞争力已经遥遥领先于其他国家，网络效应、基础设施、创新能力、互联网和 AI 能力等各个方面都让我们对整个国家的竞争力充满信心。疫情以来国外各种直升机撒钱，而国内一直坚持长期主义的宏观政策，就是底线思维、寻找国内外利益最大交集和坚持办好自己的事情。连续签下 RCEP 和中欧双边投资协定后，打破了美国孤立封锁的企图，以开放对孤立，经过特朗普 4 年压力测试，中国的竞争力已经充分证明。

2、重配幸运行业：只挖富矿，不挖贫矿，科技、消费和金融是诞生市值过 1000 亿美金巨头最多的幸运行业，做减法，应该把精力聚焦到这些幸运行业上。

3、抱紧先锋公司，只买王牌不买杂牌：具备行业定价权或者引导行业方向的先锋性公司是投资的重点，在信息化时代，头部企业实现了“一切业务数据化，一切数据业务化”，不仅战略决策上少犯错误，在精细化运营、消费者需求理解、供应链管理、人才管理等各个方面都更加科学合理，头部企业实现了降维打击。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对

基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了基金份额持有人的利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)(以下简称

	<p>“大成中小盘混合基金(LOF)”)的财务报表, 包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表, 2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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, 公允反映了大成中小盘混合基金(LOF) 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于大成中小盘混合基金(LOF), 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>大成中小盘混合基金(LOF)的基金管理人大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估大成中小盘混合基金(LOF)的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算大成中小盘混合基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督大成中小盘混合基金(LOF)的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险; 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能</p>

	<p>涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对大成中小盘混合基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成中小盘混合基金(LOF)不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 陈薇瑶
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	299,005,101.44	99,762,191.03
结算备付金		3,705,274.61	1,236,740.97
存出保证金		415,449.63	365,542.85
交易性金融资产	7.4.7.2	1,376,277,056.59	376,354,245.95
其中：股票投资		1,376,277,056.59	376,354,245.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,631,860.69
应收利息	7.4.7.5	24,132.38	19,053.43
应收股利		-	-
应收申购款		56,727,717.78	39,640.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,736,154,732.43	482,409,275.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		53,593,844.74	4,510,731.41
应付赎回款		4,859,815.66	160,265.80
应付管理人报酬		1,832,740.92	614,215.55
应付托管费		305,456.83	102,369.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,170,999.41	989,273.95
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	565,531.85	550,223.17
负债合计		63,328,389.41	6,927,079.14
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	429,642,284.04	217,720,842.26
未分配利润	7.4.7.10	1,243,184,058.98	257,761,353.60
所有者权益合计		1,672,826,343.02	475,482,195.86
负债和所有者权益总计		1,736,154,732.43	482,409,275.00

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.894 元，基金份额总额 429,642,284.04 份。

7.2 利润表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2020年1月1日至2020年 12月31日	2019年1月1日至2019年 12月31日
一、收入		568,045,792.56	292,701,534.97
1. 利息收入		825,806.67	1,247,405.08
其中：存款利息收入	7.4.7.11	825,806.67	1,247,405.08
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）		340,471,571.01	211,571,433.66
其中：股票投资收益	7.4.7.12	338,618,349.24	202,008,706.30
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,853,221.77	9,562,727.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	224,859,352.62	78,090,738.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,889,062.26	1,791,957.95
减：二、费用		30,435,153.08	31,434,147.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,800,087.67	10,755,104.70
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,466,681.26	1,792,517.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	12,877,701.73	18,606,551.91
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	7.4.7.20	290,682.42	279,973.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		537,610,639.48	261,267,387.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		537,610,639.48	261,267,387.36

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	217,720,842.26	257,761,353.60	475,482,195.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	537,610,639.48	537,610,639.48
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）	211,921,441.78	447,812,065.90	659,733,507.68
其中：1. 基金申购款	380,198,606.57	833,383,353.72	1,213,581,960.29
2. 基金赎回款	-168,277,164.79	-385,571,287.82	-553,848,452.61
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）	429,642,284.04	1,243,184,058.98	1,672,826,343.02
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	510,035,341.17	290,917,748.34	800,953,089.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	261,267,387.36	261,267,387.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-292,314,498.91	-280,217,429.45	-572,531,928.36

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	168,302,044.99	134,154,378.86	302,456,423.85
2. 基金赎回款	-460,616,543.90	-414,371,808.31	-874,988,352.21
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)	-	-14,206,352.65	-14,206,352.65
五、期末所有者权益(基金净值)	217,720,842.26	257,761,353.60	475,482,195.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由原景宏证券投资基金转型而来。根据《景宏证券投资基金招募说明书》，原景宏证券投资基金为契约型封闭式基金，存续期为 15 年。原景宏证券投资基金于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市交易。根据深交所深证上[2014]127 号《终止上市通知书》，原景宏证券投资基金于 2014 年 4 月 9 日终止上市权利登记，并于 2014 年 4 月 10 日终止上市。自 2014 年 4 月 10 日(基金合同生效日)起，原景宏证券投资基金自动转为上市开放式基金(LOF)，并更名为大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)，《大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于同日生效。本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

原景宏证券投资基金于 2014 年 4 月 9 日经基金管理人大成基金管理有限公司计算并经基金托管人中国银行股份有限公司确认的资产净值为 1,801,518,616.19 元，已于 2014 年 4 月 10 日全部转为本基金的基金资产净值。根据《大成基金管理有限公司关于景宏证券投资基金份额变更登记情况的公告》，本基金于 2014 年 4 月 11 日完成了份额变更登记。

经深交所深证上[2014]139 号文审核同意，本基金的 1,970,000,000 份基金份额于 2014 年 4 月 30 日在深交所挂牌交易。经本基金的基金管理人向深交所申请，原景宏证券投资基金发起人持

有的未上市部分 30,000,000 份基金份额于 2014 年 5 月 9 日转流通。

根据中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)的有关规定,经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,自 2015 年 7 月 24 日起本基金名称变更为“大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)”基金简称“大成中小盘”和基金代码“160918”不发生变更;基金类别变更为“混合型”。上述事项已报中国证监会备案。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)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,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中期票据)、权证、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%,债券、资产支持证券、债券逆回购等固定收益类资产和现金投资比例范围为基金资产的 5%-40%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资中小盘股票的资产不低于基金非现金资产的 80%。权证、股指期货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。本基金的业绩比较基准为:中证 700 指数收益率 \times 80%+中证综合债券指数收益率 \times 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累

计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	299,005,101.44	99,762,191.03
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	299,005,101.44	99,762,191.03

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,099,445,629.11	1,376,277,056.59	276,831,427.48
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	1,099,445,629.11	1,376,277,056.59	276,831,427.48
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	324,382,171.09	376,354,245.95	51,972,074.86
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	324,382,171.09	376,354,245.95	51,972,074.86

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	22,278.08	18,332.33
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	1,667.40	556.60
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	186.90	164.50
合计	24,132.38	19,053.43

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,170,999.41	989,273.95
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,170,999.41	989,273.95

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	5,531.85	223.17
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	310,000.00	300,000.00
合计	565,531.85	550,223.17

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	217,720,842.26	217,720,842.26
本期申购	380,198,606.57	380,198,606.57
本期赎回（以“-”号填列）	-168,277,164.79	-168,277,164.79
- 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	429,642,284.04	429,642,284.04

注：1. 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)。

2. 截至本期末，本基金于深交所上市的基金份额为 74,852,107.00 份(上年度末：81,910,435.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 354,790,177.04 份(上年度末：135,810,407.26 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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	242,587,304.69	15,174,048.91	257,761,353.60
本期利润	312,751,286.86	224,859,352.62	537,610,639.48
本期基金份额交易产生的变动数	389,615,377.41	58,196,688.49	447,812,065.90
其中：基金申购款	714,280,169.28	119,103,184.44	833,383,353.72
基金赎回款	-324,664,791.87	-60,906,495.95	-385,571,287.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	944,953,968.96	298,230,090.02	1,243,184,058.98

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	758,702.16	1,149,045.88
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	50,918.62	81,933.83
其他	16,185.89	16,425.37
合计	825,806.67	1,247,405.08

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	4,115,905,436.22	6,335,383,419.99
减：卖出股票成本总额	3,777,287,086.98	6,133,374,713.69
买卖股票差价收入	338,618,349.24	202,008,706.30

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,853,221.77	9,562,727.36
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, 853, 221. 77	9, 562, 727. 36
----	-----------------	-----------------

7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
1. 交易性金融资产	224, 859, 352. 62	78, 090, 738. 28
股票投资	224, 859, 352. 62	78, 090, 738. 28
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	224, 859, 352. 62	78, 090, 738. 28

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	1, 889, 062. 26	1, 791, 957. 95
合计	1, 889, 062. 26	1, 791, 957. 95

注：本基金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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	12, 877, 701. 73	18, 606, 551. 91
银行间市场交易费用	-	-
合计	12, 877, 701. 73	18, 606, 551. 91

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	90, 000. 00	80, 000. 00
信息披露费	120, 000. 00	120, 000. 00

证券出借违约金	-	-
上市费	60,000.00	60,000.00
银行费用	20,682.42	19,973.62
合计	290,682.42	279,973.62

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据中国证监会证监许可[2020]3109号《关于准予大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)变更注册的批复》以及本基金的基金管理人大成基金管理有限公司于2020年12月28日发布的《大成基金管理有限公司关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，大成基金管理有限公司于2020年11月24日起至2020年12月24日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)修改基金合同等相关事项的议案》。自2021年1月26日起，本基金增设C类基金份额，修订后的《大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日生效。

7.4.9 关联方关系

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
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31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	1,592,392,956.93	18.45	657,979,183.87	5.40

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 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12月31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	1,451,173.62	18.45	192,003.62	8.84
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	599,618.31	5.40	33,620.27	3.40

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	14,800,087.67	10,755,104.70
其中:支付销售机构的客户维护费	1,762,647.17	741,263.23

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 1.50%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 × 1.50%/ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,466,681.26	1,792,517.38

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 × 0.25%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	299,005,101.44	758,702.16	99,762,191.03	1,149,045.88

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新股锁定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300867	圣元	2020	2021	新股锁	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-

	环保	年8月 12日	年3月 3日	定							
300868	杰美特	2020 年8月 12日	2021 年2月 24日	新股锁 定	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-	
300871	回盛生物	2020 年8月 13日	2021 年2月 24日	新股锁 定	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60	-	
300873	海晨股份	2020 年8月 14日	2021 年3月 2日	新股锁 定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-	
300877	金春股份	2020 年8月 17日	2021 年3月 3日	新股锁 定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-	
300878	维康药业	2020 年8月 17日	2021 年3月 3日	新股锁 定	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-	
300879	大叶股份	2020 年8月 25日	2021 年3月 1日	新股锁 定	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-	
300882	万胜智能	2020 年8月 27日	2021 年3月 10日	新股锁 定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-	
300884	狄耐克	2020 年11 月5日	2021 年5月 12日	新股锁 定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-	
300886	华业香料	2020 年9月 8日	2021 年3月 16日	新股锁 定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-	
300887	谱尼测试	2020 年9月 9日	2021 年3月 16日	新股锁 定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-	
300889	爱克股份	2020 年9月 9日	2021 年3月 16日	新股锁 定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-	
300890	翔丰华	2020 年9月 10日	2021 年3月 18日	新股锁 定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-	
300891	惠云钛业	2020 年9月 10日	2021 年3月 17日	新股锁 定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-	
300892	品渥食品	2020 年9月 11日	2021 年3月 30日	新股锁 定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-	

300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新股锁定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股锁定	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股锁定	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股锁定	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股锁定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股锁定	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-

300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股锁定	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股未上市	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股未上市	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新股锁定	25.70	88.29	6,133	157,618.10	541,482.57	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688185	康希诺	2020年8月4日	2021年2月18日	新股锁定	209.71	355.68	4,666	978,506.86	1,659,602.88	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2021年1月8日	新股锁定	16.42	18.68	7,894	129,619.48	147,459.92	-
688508	芯朋微	2020年7月15日	2021年1月22日	新股锁定	28.30	91.91	3,729	105,530.70	342,732.39	-
688513	苑东生物	2020年8月21日	2021年3月2日	新股锁定	44.36	46.25	3,847	170,652.92	177,923.75	-
688526	科前生物	2020年9月15日	2021年3月22日	新股锁定	11.69	39.24	14,620	170,907.80	573,688.80	-
688577	浙海德曼	2020年9月	2021年3月	新股锁定	33.13	42.01	1,503	49,794.39	63,141.03	-

		8 日	16 日							
688586	江航装备	2020年7月24日	2021年2月1日	新股锁定	10.27	30.20	16,436	168,797.72	496,367.20	-
688589	力合微	2020年7月15日	2021年1月22日	新股锁定	17.91	35.33	3,562	63,795.42	125,845.46	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688777	中控技术	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定	35.73	77.12	5,794	207,019.62	446,833.28	-
688981	中芯国际	2020年7月9日	2021年1月18日	新股锁定	27.46	56.57	222,615	6,113,007.90	12,593,330.55	-

注：1. 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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 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。本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票基金，高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险收益特征的开放式基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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相对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基金资产长期增值的目标。

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，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。

7.4.13.2 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)。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	299,005,101.44	-	-	-	299,005,101.44
结算备付金	3,705,274.61	-	-	-	3,705,274.61
存出保证金	415,449.63	-	-	-	415,449.63
交易性金融资产	-	-	-	1,376,277,056.59	1,376,277,056.59
应收利息	-	-	-	24,132.38	24,132.38
应收申购款	54,999,693.30	-	-	1,728,024.48	56,727,717.78
资产总计	358,125,518.98	-	-	1,378,029,213.45	1,736,154,732.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,859,815.66	4,859,815.66
应付管理人报酬	-	-	-	1,832,740.92	1,832,740.92
应付托管费	-	-	-	305,456.83	305,456.83
应付证券清算款	-	-	-	53,593,844.74	53,593,844.74
应付交易费用	-	-	-	2,170,999.41	2,170,999.41
其他负债	-	-	-	565,531.85	565,531.85
负债总计	-	-	-	63,328,389.41	63,328,389.41
利率敏感度缺口	358,125,518.98	-	-	1,314,700,824.04	1,672,826,343.02
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2019年12月31日					
资产					
银行存款	99,762,191.03	-	-	-	99,762,191.03
结算备付金	1,236,740.97	-	-	-	1,236,740.97
存出保证金	365,542.85	-	-	-	365,542.85
交易性金融资产	-	-	-	376,354,245.95	376,354,245.95
应收利息	-	-	-	19,053.43	19,053.43
应收申购款	369.88	-	-	39,270.20	39,640.08
应收证券清算款	-	-	-	4,631,860.69	4,631,860.69
资产总计	101,364,844.73	-	-	381,044,430.27	482,409,275.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	160,265.80	160,265.80
应付管理人报酬	-	-	-	614,215.55	614,215.55
应付托管费	-	-	-	102,369.26	102,369.26
应付证券清算款	-	-	-	4,510,731.41	4,510,731.41
应付交易费用	-	-	-	989,273.95	989,273.95
其他负债	-	-	-	550,223.17	550,223.17
负债总计	-	-	-	6,927,079.14	6,927,079.14
利率敏感度缺口	101,364,844.73	-	-	374,117,351.13	475,482,195.86

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。

7.4.13.4.1.2 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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”与“自下而上”相结合的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合

构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%；债券、资产支持证券、债券逆回购等固定收益类资产和现金投资比例范围为基金资产的5%-40%；本基金投资中小盘股票的资产不低于基金非现金资产的80%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	1,376,277,056.59	82.27	376,354,245.95	79.15
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	1,376,277,056.59	82.27	376,354,245.95	79.15

7.4.13.4.3.2 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12月31日)	上年度末(2019年12月31日)
分析	1. 业绩比较基准上	100,890,089.45	23,192,604.34

	升 5%		
	2. 业绩比较基准下		
	降 5%	-100,890,089.45	-23,192,604.34

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,358,102,887.34 元，属于第二层次的余额为 18,174,169.25 元，无属于第三层次的余额(上年度末：第一层次 365,738,503.85 元，第二层次 10,615,742.10 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,376,277,056.59	79.27
	其中：股票	1,376,277,056.59	79.27
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	302,710,376.05	17.44
8	其他各项资产	57,167,299.79	3.29
9	合计	1,736,154,732.43	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	30,462,839.00	1.82
C	制造业	1,062,474,849.61	63.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,072.88	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	107,175,118.26	6.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,169,003.85	7.78
J	金融业	45,734,300.00	2.73
K	房地产业	9,866.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	22,503.52	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	209,503.33	0.01
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	1,376,277,056.59	82.27

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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	002624	完美世界	3,334,509	98,368,015.50	5.88
2	600438	通威股份	2,543,500	97,772,140.00	5.84
3	002352	顺丰控股	973,608	85,901,433.84	5.14
4	300760	迈瑞医疗	170,585	72,669,210.00	4.34
5	300395	菲利华	1,149,296	68,762,379.68	4.11
6	000636	风华高科	2,003,700	67,524,690.00	4.04
7	300750	宁德时代	191,536	67,250,204.96	4.02
8	300595	欧普康视	739,052	60,543,139.84	3.62
9	688002	睿创微纳	513,457	56,993,727.00	3.41
10	600079	人福医药	1,620,000	54,885,600.00	3.28
11	600862	中航高科	1,734,900	52,220,490.00	3.12
12	688036	传音控股	317,963	48,374,890.82	2.89
13	300122	智飞生物	323,000	47,774,930.00	2.86
14	002049	紫光国微	352,600	47,181,406.00	2.82
15	300059	东方财富	1,475,300	45,734,300.00	2.73
16	300699	光威复材	437,187	38,931,502.35	2.33
17	000547	航天发展	1,347,700	37,061,750.00	2.22
18	300274	阳光电源	475,500	34,369,140.00	2.05
19	002025	航天电器	524,360	34,177,784.80	2.04
20	000860	顺鑫农业	464,736	33,711,949.44	2.02
21	000738	航发控制	1,416,510	32,480,574.30	1.94
22	300253	卫宁健康	1,762,958	30,851,765.00	1.84
23	601899	紫金矿业	3,279,100	30,462,839.00	1.82
24	300285	国瓷材料	606,600	27,363,726.00	1.64
25	688550	瑞联新材	262,304	22,586,997.44	1.35
26	605338	巴比食品	579,262	21,872,933.12	1.31
27	002928	华夏航空	1,679,968	21,251,595.20	1.27
28	688063	派能科技	77,604	20,069,946.48	1.20
29	688981	中芯国际	222,615	12,593,330.55	0.75

30	688185	康希诺	4,666	1,659,602.88	0.10
31	688526	科前生物	14,620	573,688.80	0.03
32	300999	金龙鱼	6,223	551,231.37	0.03
33	688686	奥普特	2,330	505,144.00	0.03
34	688586	江航装备	16,436	496,367.20	0.03
35	688777	中控技术	5,794	446,833.28	0.03
36	688508	芯朋微	3,729	342,732.39	0.02
37	300896	爱美客	547	333,860.76	0.02
38	688513	苑东生物	3,847	177,923.75	0.01
39	688377	迪威尔	7,894	147,459.92	0.01
40	688589	力合微	3,562	125,845.46	0.01
41	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
42	688466	金科环境	4,907	121,840.81	0.01
43	688577	浙海德曼	1,503	63,141.03	0.00
44	688618	三旺通信	1,117	59,938.22	0.00
45	300867	圣元环保	1,580	50,621.66	0.00
46	300919	中伟股份	693	44,303.86	0.00
47	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
48	300877	金春股份	586	29,832.78	0.00
49	300900	广联航空	882	29,283.51	0.00
50	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
51	300868	杰美特	625	27,093.84	0.00
52	300910	瑞丰新材	536	26,627.38	0.00
53	300871	回盛生物	671	26,032.89	0.00
54	300864	南大环境	251	23,032.00	0.00
55	300887	谱尼测试	298	22,503.52	0.00
56	300908	仲景食品	347	22,094.26	0.00
57	300873	海晨股份	533	22,089.22	0.00
58	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
59	300884	狄耐克	585	20,477.97	0.00
60	300891	惠云钛业	1,225	20,206.44	0.00
61	300878	维康药业	406	19,788.17	0.00
62	300909	汇创达	458	19,503.82	0.00
63	300898	熊猫乳品	553	19,081.26	0.00
64	300892	品渥食品	314	19,072.88	0.00
65	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
66	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
67	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.00
68	300890	翔丰华	354	17,581.22	0.00
69	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
70	300879	大叶股份	560	15,288.72	0.00
71	300895	铜牛信息	329	15,095.98	0.00

72	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00
73	300889	爱克股份	486	14,648.05	0.00
74	003027	同兴环保	349	14,008.86	0.00
75	300911	亿田智能	383	13,305.04	0.00
76	300882	万胜智能	494	12,823.42	0.00
77	300893	松原股份	356	12,803.68	0.00
78	300922	天秦装备	363	12,008.46	0.00
79	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
80	300918	南山智尚	1,126	10,253.55	0.00
81	300917	特发服务	303	9,866.14	0.00
82	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
83	300886	华业香料	164	7,534.59	0.00
84	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
85	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600438	通威股份	167,363,903.62	35.20
2	600690	海尔智家	107,902,989.43	22.69
3	002624	完美世界	102,218,768.33	21.50
4	000636	风华高科	101,736,723.95	21.40
5	601899	紫金矿业	86,786,414.02	18.25
6	300750	宁德时代	86,580,351.65	18.21
7	601888	中国中免	84,545,592.31	17.78
8	000860	顺鑫农业	84,326,793.68	17.74
9	601318	中国平安	82,944,736.95	17.44
10	300059	东方财富	79,847,039.80	16.79
11	300760	迈瑞医疗	74,103,168.04	15.58
12	600031	三一重工	72,104,964.99	15.16
13	002475	立讯精密	68,189,820.26	14.34
14	600079	人福医药	68,139,124.35	14.33
15	300253	卫宁健康	67,491,472.61	14.19
16	002352	顺丰控股	62,738,883.25	13.19
17	603883	老百姓	57,956,132.95	12.19
18	002025	航天电器	56,591,856.93	11.90
19	600887	伊利股份	56,122,158.31	11.80
20	000547	航天发展	55,444,282.83	11.66
21	002415	海康威视	55,263,221.28	11.62
22	600276	恒瑞医药	52,168,125.38	10.97
23	601877	正泰电器	51,754,567.38	10.88

24	603290	斯达半导	49,555,490.84	10.42
25	300274	阳光电源	46,045,359.15	9.68
26	600862	中航高科	44,619,383.10	9.38
27	300595	欧普康视	44,590,252.71	9.38
28	688550	瑞联新材	44,092,485.06	9.27
29	300122	智飞生物	43,334,508.61	9.11
30	688002	睿创微纳	42,975,118.09	9.04
31	002985	北摩高科	42,815,438.95	9.00
32	600038	中直股份	41,938,408.42	8.82
33	300395	菲利华	41,202,377.89	8.67
34	002049	紫光国微	40,997,520.00	8.62
35	000063	中兴通讯	40,754,383.00	8.57
36	600562	国睿科技	40,638,372.66	8.55
37	603259	药明康德	39,783,557.70	8.37
38	002643	万润股份	38,734,575.84	8.15
39	300450	先导智能	37,827,238.22	7.96
40	002182	云海金属	37,433,290.06	7.87
41	605099	共创草坪	35,199,365.32	7.40
42	300476	胜宏科技	34,818,442.23	7.32
43	600233	圆通速递	34,153,796.87	7.18
44	603712	七一二	33,935,150.92	7.14
45	002241	歌尔股份	32,736,757.49	6.88
46	002797	第一创业	32,038,106.38	6.74
47	688029	南微医学	31,915,434.96	6.71
48	300115	长盈精密	31,592,359.50	6.64
49	688095	福昕软件	30,467,985.91	6.41
50	688396	华润微	30,327,979.62	6.38
51	300285	国瓷材料	30,106,962.76	6.33
52	000738	航发控制	30,067,657.48	6.32
53	603258	电魂网络	29,781,861.00	6.26
54	002460	赣锋锂业	29,300,357.61	6.16
55	000733	振华科技	29,276,595.27	6.16
56	000710	贝瑞基因	29,243,290.00	6.15
57	000938	紫光股份	29,210,127.86	6.14
58	600732	爱旭股份	28,768,562.19	6.05
59	000913	钱江摩托	28,748,804.54	6.05
60	600073	上海梅林	28,719,239.00	6.04
61	002466	天齐锂业	28,669,662.47	6.03
62	603993	洛阳钼业	28,537,881.88	6.00
63	300166	东方国信	28,445,755.11	5.98
64	002602	世纪华通	28,329,668.63	5.96
65	002080	中材科技	28,255,665.91	5.94

66	688127	蓝特光学	27,957,555.54	5.88
67	600196	复星医药	27,854,452.30	5.86
68	600378	昊华科技	27,735,516.46	5.83
69	603392	万泰生物	26,870,047.43	5.65
70	603719	良品铺子	26,433,035.70	5.56
71	603369	今世缘	25,732,383.49	5.41
72	605338	巴比食品	25,601,761.49	5.38
73	300896	爱美客	25,511,047.80	5.37
74	300768	迪普科技	25,505,454.82	5.36
75	002332	仙琚制药	24,937,974.66	5.24
76	600893	航发动力	24,602,132.64	5.17
77	600316	洪都航空	24,407,011.43	5.13
78	002273	水晶光电	24,272,143.31	5.10
79	601689	拓普集团	24,042,570.30	5.06
80	002436	兴森科技	23,500,204.14	4.94
81	002982	湘佳股份	21,893,554.03	4.60
82	300144	宋城演艺	21,576,712.69	4.54
83	002382	蓝帆医疗	21,572,813.08	4.54
84	688036	传音控股	21,483,016.67	4.52
85	002558	巨人网络	21,174,062.29	4.45
86	603690	至纯科技	21,046,547.00	4.43
87	002928	华夏航空	20,230,923.44	4.25
88	688268	华特气体	19,972,520.96	4.20
89	002635	安洁科技	19,456,668.24	4.09
90	300458	全志科技	19,325,249.52	4.06
91	300729	乐歌股份	18,733,305.40	3.94
92	300699	光威复材	18,587,289.44	3.91
93	688085	三友医疗	18,429,811.16	3.88
94	002292	奥飞娱乐	17,789,722.20	3.74
95	300770	新媒股份	17,710,090.12	3.72
96	600110	诺德股份	17,602,934.00	3.70
97	002916	深南电路	17,136,849.30	3.60
98	600521	华海药业	17,125,400.16	3.60
99	300451	创业慧康	16,975,440.13	3.57
100	002007	华兰生物	16,652,271.30	3.50
101	600315	上海家化	16,616,958.92	3.49
102	002044	美年健康	16,577,622.00	3.49
103	300299	富春股份	15,244,213.24	3.21
104	688063	派能科技	15,047,609.27	3.16
105	300572	安车检测	14,914,020.04	3.14
106	000910	大亚圣象	14,368,813.62	3.02
107	000998	隆平高科	14,290,793.00	3.01

108	688981	中芯国际	14,194,061.35	2.99
109	688050	爱博医疗	13,757,909.91	2.89
110	300031	宝通科技	13,709,419.00	2.88
111	300855	图南股份	13,597,683.48	2.86
112	300624	万兴科技	13,398,070.00	2.82
113	300620	光库科技	13,277,884.20	2.79
114	300709	精研科技	12,851,247.00	2.70
115	002138	顺络电子	12,660,612.85	2.66
116	688139	海尔生物	12,462,335.65	2.62
117	600258	首旅酒店	12,204,899.10	2.57
118	300633	开立医疗	12,007,505.00	2.53
119	300054	鼎龙股份	12,007,175.50	2.53
120	688366	昊海生科	11,963,910.39	2.52
121	002262	恩华药业	11,775,194.00	2.48
122	002304	洋河股份	11,644,401.00	2.45
123	300657	弘信电子	11,501,720.17	2.42
124	300438	鹏辉能源	10,982,187.00	2.31
125	688378	奥来德	10,927,951.29	2.30
126	603590	康辰药业	10,332,052.62	2.17
127	603327	福蓉科技	10,207,425.00	2.15
128	300113	顺网科技	9,901,661.00	2.08
129	002970	锐明技术	9,830,116.00	2.07

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600690	海尔智家	132,880,883.60	27.95
2	600438	通威股份	96,871,687.28	20.37
3	601318	中国平安	80,483,287.68	16.93
4	601888	中国中免	78,527,452.32	16.52
5	600031	三一重工	71,845,615.12	15.11
6	002475	立讯精密	62,712,156.91	13.19
7	300274	阳光电源	55,958,229.29	11.77
8	300750	宁德时代	55,497,979.20	11.67
9	000860	顺鑫农业	55,431,026.53	11.66
10	603290	斯达半导	55,032,376.30	11.57
11	002415	海康威视	54,985,647.10	11.56
12	600887	伊利股份	54,606,538.75	11.48
13	601899	紫金矿业	53,172,627.14	11.18
14	000636	风华高科	51,569,700.28	10.85
15	600276	恒瑞医药	50,701,222.61	10.66

16	601877	正泰电器	50,087,448.34	10.53
17	603883	老百姓	48,993,370.29	10.30
18	603259	药明康德	48,319,432.88	10.16
19	300760	迈瑞医疗	47,685,630.82	10.03
20	300896	爱美客	47,094,709.00	9.90
21	300253	卫宁健康	43,724,827.83	9.20
22	002985	北摩高科	43,433,347.85	9.13
23	300476	胜宏科技	43,363,473.29	9.12
24	600079	人福医药	39,538,028.44	8.32
25	300450	先导智能	39,515,352.13	8.31
26	002182	云海金属	38,552,340.77	8.11
27	300115	长盈精密	38,541,276.00	8.11
28	002241	歌尔股份	38,177,873.32	8.03
29	300059	东方财富	37,957,223.88	7.98
30	600038	中直股份	37,830,485.77	7.96
31	002025	航天电器	37,095,543.00	7.80
32	000063	中兴通讯	37,004,268.00	7.78
33	600562	国睿科技	36,950,721.08	7.77
34	002466	天齐锂业	36,871,447.12	7.75
35	002797	第一创业	36,748,125.00	7.73
36	688029	南微医学	35,796,601.19	7.53
37	300451	创业慧康	35,717,908.86	7.51
38	002643	万润股份	35,593,374.70	7.49
39	603712	七一二	34,857,572.30	7.33
40	600893	航发动力	34,802,183.22	7.32
41	603369	今世缘	34,119,985.63	7.18
42	688396	华润微	33,759,675.37	7.10
43	605099	共创草坪	33,223,383.28	6.99
44	600196	复星医药	33,191,268.81	6.98
45	601689	拓普集团	32,506,406.55	6.84
46	002624	完美世界	31,342,057.00	6.59
47	000710	贝瑞基因	31,121,599.84	6.55
48	002635	安洁科技	31,036,078.84	6.53
49	002292	奥飞娱乐	30,681,689.18	6.45
50	600233	圆通速递	30,550,518.00	6.43
51	688085	三友医疗	30,550,440.31	6.43
52	688111	金山办公	30,448,344.37	6.40
53	002436	兴森科技	29,587,417.00	6.22
54	002332	仙琚制药	29,352,930.03	6.17
55	600378	昊华科技	28,979,929.67	6.09
56	002080	中材科技	28,304,918.11	5.95
57	688127	蓝特光学	28,212,212.64	5.93

58	603993	洛阳钼业	28,133,218.00	5.92
59	688095	福昕软件	27,870,103.18	5.86
60	600258	首旅酒店	27,862,993.01	5.86
61	603258	电魂网络	26,848,554.00	5.65
62	603719	良品铺子	26,846,802.81	5.65
63	002602	世纪华通	26,736,419.99	5.62
64	000733	振华科技	26,731,620.00	5.62
65	600316	洪都航空	26,305,603.00	5.53
66	600732	爱旭股份	26,113,552.97	5.49
67	688198	佰仁医疗	26,089,955.41	5.49
68	600073	上海梅林	25,939,004.00	5.46
69	002460	赣锋锂业	25,887,948.59	5.44
70	000913	钱江摩托	25,000,090.09	5.26
71	002273	水晶光电	24,997,654.33	5.26
72	603392	万泰生物	24,808,663.00	5.22
73	002555	三七互娱	24,707,506.14	5.20
74	002153	石基信息	24,707,444.73	5.20
75	300768	迪普科技	24,375,052.98	5.13
76	000596	古井贡酒	24,144,224.66	5.08
77	002982	湘佳股份	24,131,237.20	5.08
78	000547	航天发展	24,115,308.00	5.07
79	600521	华海药业	24,112,137.20	5.07
80	300166	东方国信	23,847,721.07	5.02
81	300408	三环集团	23,569,277.90	4.96
82	002558	巨人网络	23,549,917.00	4.95
83	688036	传音控股	23,149,505.84	4.87
84	300458	全志科技	23,087,863.13	4.86
85	002382	蓝帆医疗	22,418,893.04	4.71
86	688268	华特气体	22,303,686.75	4.69
87	000938	紫光股份	22,089,066.92	4.65
88	300144	宋城演艺	21,960,939.27	4.62
89	600110	诺德股份	21,773,537.67	4.58
90	000725	京东方A	21,132,628.00	4.44
91	300729	乐歌股份	21,014,458.40	4.42
92	600926	杭州银行	20,968,843.80	4.41
93	603690	至纯科技	19,880,752.00	4.18
94	002007	华兰生物	19,065,467.82	4.01
95	300285	国瓷材料	18,485,047.00	3.89
96	002916	深南电路	18,464,621.20	3.88
97	300299	富春股份	17,650,822.10	3.71
98	000823	超声电子	16,988,018.28	3.57
99	300770	新媒股份	16,871,955.00	3.55

100	600315	上海家化	16,593,120.80	3.49
101	002044	美年健康	16,534,664.83	3.48
102	000998	隆平高科	15,448,685.00	3.25
103	300572	安车检测	14,806,200.07	3.11
104	000910	大亚圣象	14,149,776.00	2.98
105	688050	爱博医疗	13,971,619.84	2.94
106	300633	开立医疗	13,921,373.18	2.93
107	603920	世运电路	13,675,471.00	2.88
108	002262	恩华药业	13,638,716.80	2.87
109	300699	光威复材	13,626,613.75	2.87
110	688020	方邦股份	13,557,184.58	2.85
111	688550	瑞联新材	13,510,483.81	2.84
112	300620	光库科技	12,896,184.00	2.71
113	300624	万兴科技	12,879,819.00	2.71
114	300855	图南股份	12,398,235.28	2.61
115	002304	洋河股份	11,997,636.21	2.52
116	688139	海尔生物	11,839,660.18	2.49
117	300709	精研科技	11,773,692.00	2.48
118	300054	鼎龙股份	11,707,621.95	2.46
119	688366	昊海生科	11,314,867.74	2.38
120	300438	鹏辉能源	11,125,420.00	2.34
121	603590	康辰药业	10,951,818.45	2.30
122	300788	中信出版	10,947,789.00	2.30
123	688157	松井股份	10,851,552.41	2.28
124	300657	弘信电子	10,751,574.41	2.26
125	300031	宝通科技	10,608,306.00	2.23
126	688378	奥来德	10,544,344.57	2.22
127	002480	新筑股份	10,164,850.45	2.14
128	300113	顺网科技	10,020,605.00	2.11
129	300136	信维通信	9,895,072.00	2.08
130	603327	福蓉科技	9,800,594.46	2.06
131	300033	同花顺	9,647,826.00	2.03

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	4,552,350,545.00
卖出股票收入（成交）总额	4,115,905,436.22

注：本项中“买入股票的成本(成交)总额”及“卖出股票的收入(成交)总额”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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	415,449.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,132.38
5	应收申购款	56,727,717.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,167,299.79

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
59,471	7,224.40	261,615,376.05	60.89	168,026,907.99	39.11

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

9.2 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	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,211,853.00	1.62
2	上海协通(集团)有限公司	1,032,300.00	1.38
3	金宗义	1,000,020.00	1.34
4	曹素清	642,800.00	0.86

5	马元璐	546,701.00	0.73
6	罗永禹	546,600.00	0.73
7	黄城	500,000.00	0.67
8	林景周	500,000.00	0.67
9	邱建娥	463,272.00	0.62
10	胡锐明	453,000.00	0.61

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	838,197.94	0.1951

9.4 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年4月10日） 基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	217,720,842.26
本报告期基金总申购份额	380,198,606.57
减：本报告期基金总赎回份额	168,277,164.79
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	429,642,284.04

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会以通讯方式自2020年11月24日起至2020年12月24日召开，本次基金份额持有人大会于2020年12月25日决议通过了《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》，正式实施日为2021年1月26日，具体详见2020年12月28日公告。

11.2 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

1. 2020 年 12 月 28 日, 经大成基金管理有限公司 2020 年第一次临时股东会审议通过, 选举林昌先生担任公司股东董事, 翟斌先生不再担任公司股东董事。

2. 2020 年 12 月 28 日, 经大成基金管理有限公司第七届董事会第八次会议审议通过, 选举林昌先生担任公司第七届董事会副董事长, 同时, 选举其担任第七届董事会合规与风险管理委员会委员, 第七届董事会审计委员会委员。翟斌先生不再担任公司第七届董事会副董事长、第七届董事会合规与风险管理委员会委员、第七届董事会审计委员会委员。

上述变更详见公司相关公告。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

2020 年 12 月 25 日基金份额持有人大会决议通过《关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF) 修改基金合同等相关事项的议案》, 对本基金基金合同进行修改, 包括对投资策略进行调整, 调整中小盘股票定义以及投资策略, 增加港股投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等。

11.5 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), 本年度支付的审计费用为 9 万元整。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。

11.6 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	1,592,392,956.93	18.45%	1,451,173.62	18.45%	-
华西证券	1	1,363,449,111.85	15.79%	1,242,538.02	15.79%	-
长江证券	2	938,679,762.72	10.87%	855,423.70	10.87%	-
申万宏源	1	740,715,765.89	8.58%	675,029.13	8.58%	-
中国中投证券	3	609,714,868.11	7.06%	555,633.25	7.06%	-
国泰君安	1	521,219,891.54	6.04%	474,992.38	6.04%	-
东方证券	1	520,110,605.89	6.02%	473,982.45	6.02%	-
中金公司	2	447,022,947.43	5.18%	407,368.39	5.18%	-
招商证券	3	429,673,895.62	4.98%	391,551.53	4.98%	-
中信证券	2	300,927,466.61	3.49%	274,232.07	3.49%	-
渤海证券	1	217,016,555.35	2.51%	197,775.23	2.51%	-
广发证券	1	191,158,734.38	2.21%	174,201.88	2.21%	-
华泰证券	2	168,244,129.24	1.95%	153,321.66	1.95%	-
财富证券	1	149,675,745.74	1.73%	136,392.06	1.73%	-
东海证券	1	128,116,616.44	1.48%	116,759.98	1.48%	-
广州证券	1	117,987,234.19	1.37%	107,524.85	1.37%	-
海通证券	2	75,063,191.05	0.87%	68,405.44	0.87%	-
民生证券	1	47,984,687.88	0.56%	43,730.57	0.56%	-
华福证券	1	37,671,840.42	0.44%	34,330.56	0.44%	-
东兴证券	1	35,751,175.16	0.41%	32,584.37	0.41%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 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：开源证券、招商证券；

本报告期内退租交易单元：九州证券、英大证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 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	关于再次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	2020年12月31日
2	大成基金管理有限公司关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月28日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险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	2020年12月25日
4	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月25日
5	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大同证券有限责任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	2020年12月23日
6	大成基金管理有限公司关于提示泰诚财富基金销售(大连)有限公司代销客户及时办理转托管业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月17日
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券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	2020年12月17日
8	关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)增加部分代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年12月16日
9	关于《大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成中小盘混合型证券	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2020年12月7日

	投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告》的补充公告	公司网站	
10	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年11月26日
11	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年11月25日
12	大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年11月24日
13	大成基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年11月4日
14	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年10月28日
15	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加交通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	2020年9月29日
16	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中航证券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	2020年9月14日
17	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)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	2020年8月27日
18	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年8月28日
19	关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)增加国泰君安证券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	2020年8月6日
20	大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020年7月21日
21	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国邮政储蓄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	2020年7月14日
22	关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)增加中山证券有限责任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	2020年7月14日
23	大成基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会基金电子披	2020年7月13日

	基金增加重庆银行股份有限公司为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站	
24	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信建投期货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	2020 年 7 月 13 日
25	关于再次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	2020 年 7 月 1 日
26	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加安信证券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	2020 年 6 月 18 日
27	关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)增加南京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	2020 年 6 月 18 日
28	关于大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)增加上海挖财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	2020 年 6 月 15 日
29	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳平安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	2020 年 6 月 5 日
30	大成中小盘(LOF)招募说明书摘要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 5 月 8 日
31	大成中小盘(LOF)招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 5 月 8 日
32	大成中小盘(LOF) 2019 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	2020 年 4 月 29 日
33	大成基金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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
34	大成中小盘(LOF) 2020 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 4 月 21 日
35	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
36	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
37	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 29 日

38	大成基金关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
39	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	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
40	大成中小盘 (LOF) 2019 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 17 日
41	大成中小盘 (LOF) 基金恢复大额申购 (含定期定额申购) 业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2020 年 1 月 4 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	1	20200101-20200313	44,929,422.98	8,549,159.30	9,000,000.00	44,478,582.28	10.35
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)的文件;
- 2、《大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

- 3、《大成中小盘混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;
- 4、《大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)变更基金名称、基金类别以及修订基金合同部分条款的公告》;
- 5、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;
- 6、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 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3月30日