

大成景安短融债券型证券投资基金  
2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 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

报告送出日期：2017 年 10 月 27 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2017 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	大成景安短融债券		
交易代码	000128		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 5 月 24 日		
报告期末基金份额总额	302,126,711.74 份		
投资目标	在严格控制风险并保持流动性的基础上，主要通过短期融资券和其他固定收益类证券的积极主动管理，力争超越同期银行定期存款利率、获取绝对回报。		
投资策略	本基金主要目标是在努力保持本金稳妥、高流动性特点的同时，通过适当延长基金投资组合的久期、更高比例的短期融资券以及其它期限较短信用债券的投资，争取获取更高的投资收益。		
业绩比较基准	中债短融总指数		
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E
下属分级基金的交易代码	000128	000129	002086
报告期末下属分级基金的份额总额	71,824,369.65 份	35,902,823.27 份	194,399,518.82 份

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日—2017年9月30日）		
	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E
1. 本期已实现收益	1,579,350.35	614,452.04	4,507,063.11
2. 本期利润	1,719,240.41	670,118.85	4,949,585.24
3. 加权平均基金份额 本期利润	0.0260	0.0272	0.0271
4. 期末基金资产净值	89,922,193.77	45,555,628.69	244,211,014.54
5. 期末基金份额净值	1.2520	1.2689	1.2562

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、所述基金业绩指标不包括持有人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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

## 大成景安短融债券 A

阶段	净值增长率①	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	2.19%	0.06%	1.20%	0.02%	0.99%	0.04%

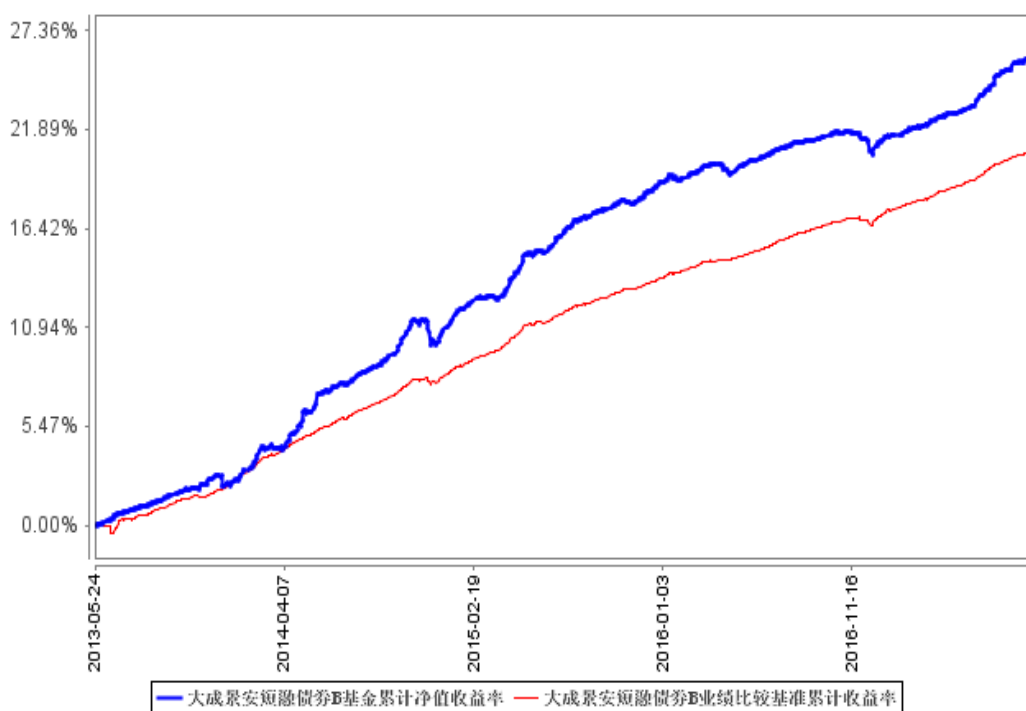
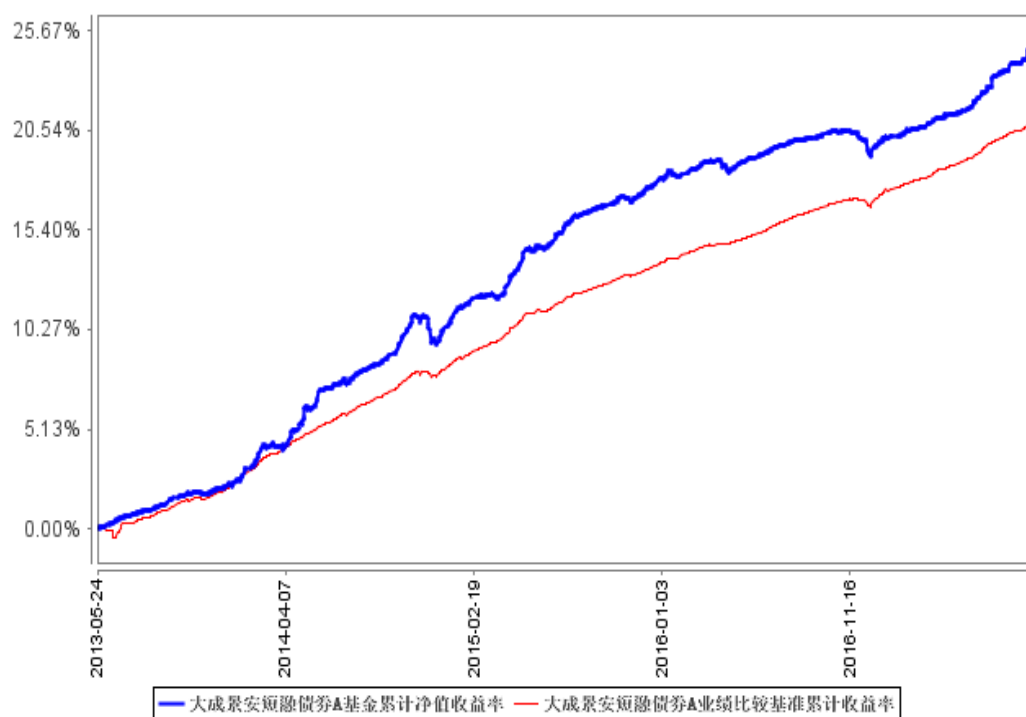
## 大成景安短融债券 B

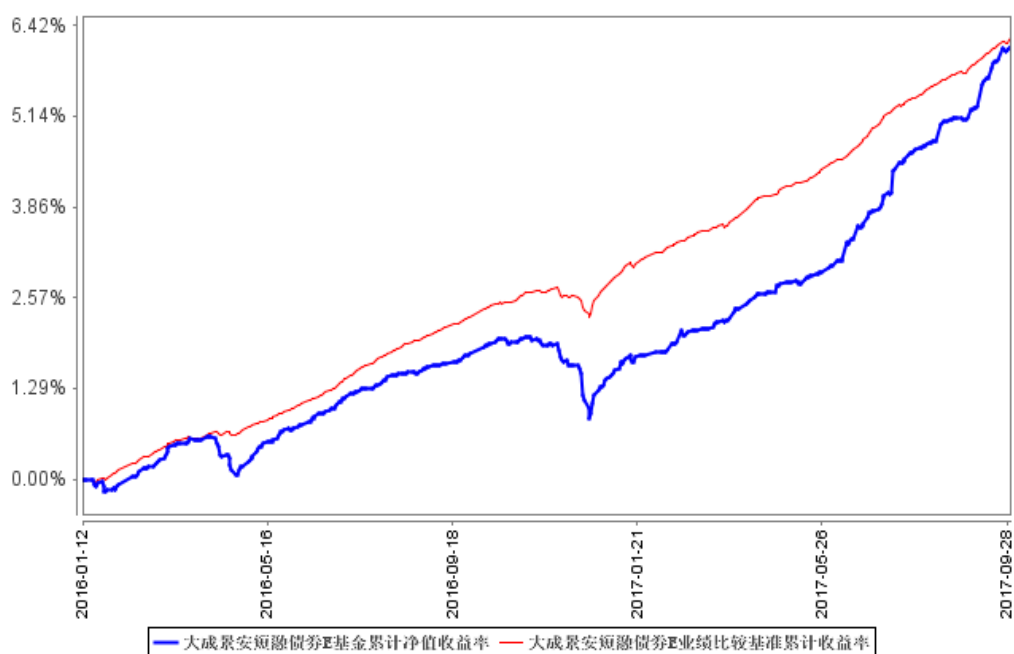
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.26%	0.06%	1.20%	0.02%	1.06%	0.04%

## 大成景安短融债券 E

阶段	净值增长率①	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	2.24%	0.06%	1.20%	0.02%	1.04%	0.04%

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金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





注：1. 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. 本基金自 2016 年 1 月 12 日起增设 E 类基金份额（E 类份额基金代码：002086）。

### §3 管理人报告

#### 3.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张文平先生	本基金基金经理	2016 年 9 月 6 日	-	6 年	<p>南京大学管理学硕士，注册会计师，2009 年 10 月至 2011 年 5 月就职于毕马威企业咨询有限公司南京分公司审计部；2011 年起加入大成基金管理有限公司，历任固定收益部助理研究员。2013 年 11 月 25 日至 2015 年 3 月 5 日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理助理。</p> <p>2015 年 3 月 7 日至 2016 年 11 月 18 日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015 年</p>

					<p>6 月 23 日起任大成景裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 7 月 1 日至 2017 年 3 月 18 日任大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。2015 年 7 月 1 日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2015 年 11 月 24 日起任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 6 日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 6 日起任大成景安短融债券型证券投资基金和大成现金增利货币市场基金基金经理。2016 年 9 月 20 日起任大成景辉灵活配置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。</p>
--	--	--	--	--	---

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。

### 3.2 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。

### 3.3 公平交易专项说明

#### 3.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

### 3.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2017 年 3 季度公司旗下主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易；主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5%的交易情形；投资组合间债券交易存在 3 笔同日反向交易，原因为投资策略；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；投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

### 3.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 三季度经济增长不温不火，虽然消费品和工业品价格有所上涨，但通胀水平仍然可控。货币政策维持稳定，货币市场资金价格总体中性偏紧，且波动较大。

债券市场方面，在 6 月份协调监管的消息传出后，市场的系统性风险有所缓和，收益率整体下行。随后，受偏紧的资金面和商品价格上涨的影响，收益率有所反弹。但随着 8 月经济增长数据低于市场预期，长期限债券收益率小幅下行。

操作上，三季度本组合久期保持稳定，纯债部分仍以票息策略为主。

### 3.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成景安短融债券 A 基金份额净值为 1.2520 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.19%；截至本报告期末大成景安短融债券 B 基金份额净值为 1.2689 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.26%；截至本报告期末大成景安短融债券 E 基金份额净值为 1.2562 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.24%；同期业绩比较基准收益率为 1.20%。

### 3.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §4 投资组合报告

### 4.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	0.00
	其中：股票	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	393,804,861.80	95.06
	其中：债券	393,804,861.80	95.06
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	13,808,190.98	3.33
8	其他资产	6,674,200.72	1.61
9	合计	414,287,253.50	100.00

### 4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,193,657.80	1.63
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	49,208,764.00	12.96
	其中：政策性金融债	49,208,764.00	12.96
4	企业债券	43,821,040.00	11.54
5	企业短期融资券	279,513,900.00	73.62
6	中期票据	15,067,500.00	3.97



7	可转债（可交换债）	-	0.00
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	393,804,861.80	103.72

#### 4.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	170215	17 国开 15	300,000	30,129,000.00	7.94
2	011762001	17 扬子大桥 SCP001	200,000	20,110,000.00	5.30
3	011755018	17 扬州经开 SCP001	200,000	20,096,000.00	5.29
4	041654063	16 国电长源 CP001	200,000	20,090,000.00	5.29
5	011761026	17 柯桥国资 SCP002	200,000	20,088,000.00	5.29

#### 4.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 4.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 4.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 4.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 4.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 4.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 4.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

**4.10 投资组合报告附注**

4.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

4.10.2 本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，本基金无备选股票库，无投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票的情形。

**4.10.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,854.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,363,947.65
5	应收申购款	2,307,398.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,674,200.72

**4.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**4.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**4.10.6 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。

**§5 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	大成景安短融债券 A	大成景安短融债券 B	大成景安短融债券 E
报告期期初基金份额总额	52,009,793.00	16,518,004.63	174,650,328.62
报告期期间基金总申购份额	168,464,942.14	26,611,268.29	75,018,100.64
减：报告期期间基金总赎回份额	148,650,365.49	7,226,449.65	55,268,910.44
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-	-
报告期期末基金份额总额	71,824,369.65	35,902,823.27	194,399,518.82

## §6 基金管理人运用自有资金投资本基金情况

### 6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

### 6.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

## §7 影响投资者决策的其他重要信息

### 7.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 7.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2017 年 8 月 12 日发布了《大成基金管理有限公司督察长任职公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第二十七次会议审议通过，赵冰女士自 2017 年 8 月 11 日担任公司督察长，总经理罗登攀不再代为履行督察长职务。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成景安短融债券型证券投资基金的文件；
- 2、《大成景安短融债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成景安短融债券型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。

### 8.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

### 8.3 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

2017 年 10 月 27 日