

# 大成景安短融债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 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：2020 年 10 月 28 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 2020 年 10 月 27 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 2020 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		
基金主代码	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	3,021,590,027.02 份		
投资目标	在严格控制风险并保持流动性的基础上，主要通过对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	790,348,665.83 份	1,986,695,413.29 份	244,545,947.90 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（2020 年 7 月 1 日-2020 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	2,205,936.55	5,606,747.59	1,427,775.60
2. 本期利润	3,010,797.66	7,218,889.40	1,889,779.60
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0054	0.0043
4. 期末基金资产净值	1,004,146,305.47	2,584,231,963.51	313,779,164.39
5. 期末基金份额净值	1.2705	1.3008	1.2831

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	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	0.32%	0.01%	0.69%	0.01%	-0.37%	0.00%
过去六个月	0.71%	0.02%	1.16%	0.01%	-0.45%	0.01%
过去一年	2.70%	0.03%	3.04%	0.02%	-0.34%	0.01%
过去三年	10.42%	0.03%	12.44%	0.02%	-2.02%	0.01%
过去五年	18.46%	0.03%	20.88%	0.02%	-2.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	38.24%	0.05%	36.14%	0.02%	2.10%	0.03%

大成景安短融债券 B

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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

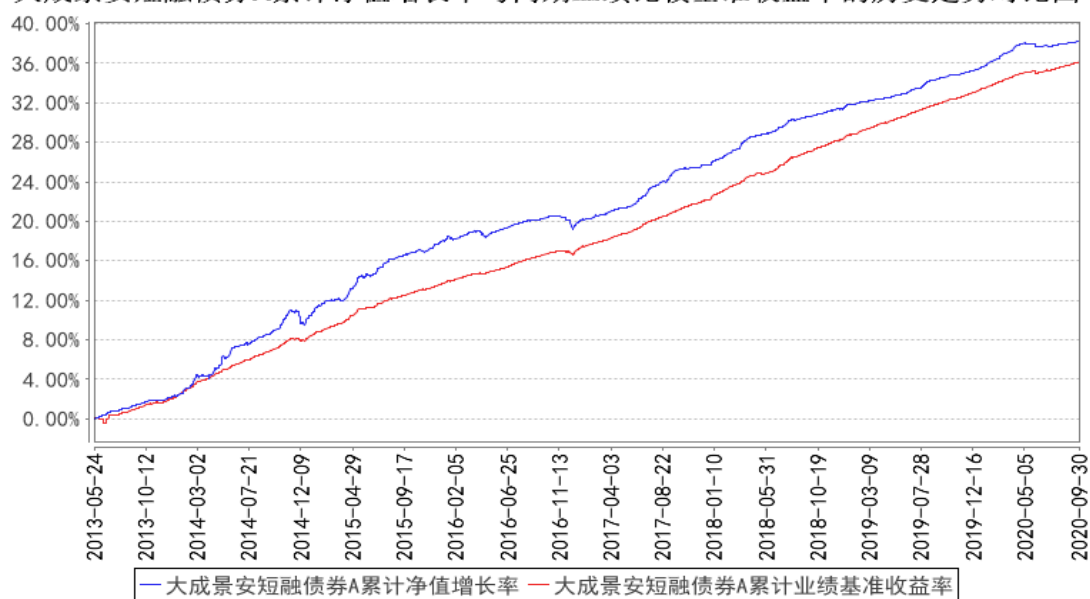
				④		
过去三个月	0.39%	0.01%	0.69%	0.01%	-0.30%	0.00%
过去六个月	0.86%	0.02%	1.16%	0.01%	-0.30%	0.01%
过去一年	3.00%	0.03%	3.04%	0.02%	-0.04%	0.01%
过去三年	11.39%	0.03%	12.44%	0.02%	-1.05%	0.01%
过去五年	20.29%	0.03%	20.88%	0.02%	-0.59%	0.01%
自基金合同 生效起至今	41.34%	0.05%	36.14%	0.02%	5.20%	0.03%

## 大成景安短融债券 E

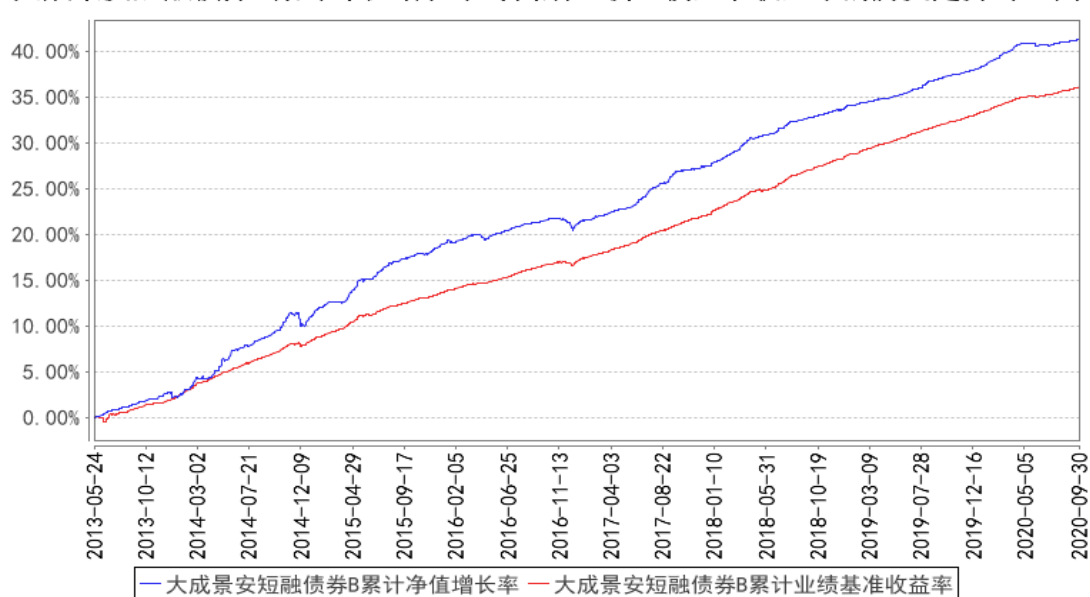
阶段	份额净值增长 率①	份额净值增长 率标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.37%	0.01%	0.69%	0.01%	-0.32%	0.00%
过去六个月	0.81%	0.02%	1.16%	0.01%	-0.35%	0.01%
过去一年	2.90%	0.03%	3.04%	0.02%	-0.14%	0.01%
过去三年	11.09%	0.03%	12.44%	0.02%	-1.35%	0.01%
自基金合同 生效起至今	17.89%	0.03%	19.46%	0.02%	-1.57%	0.01%

### 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

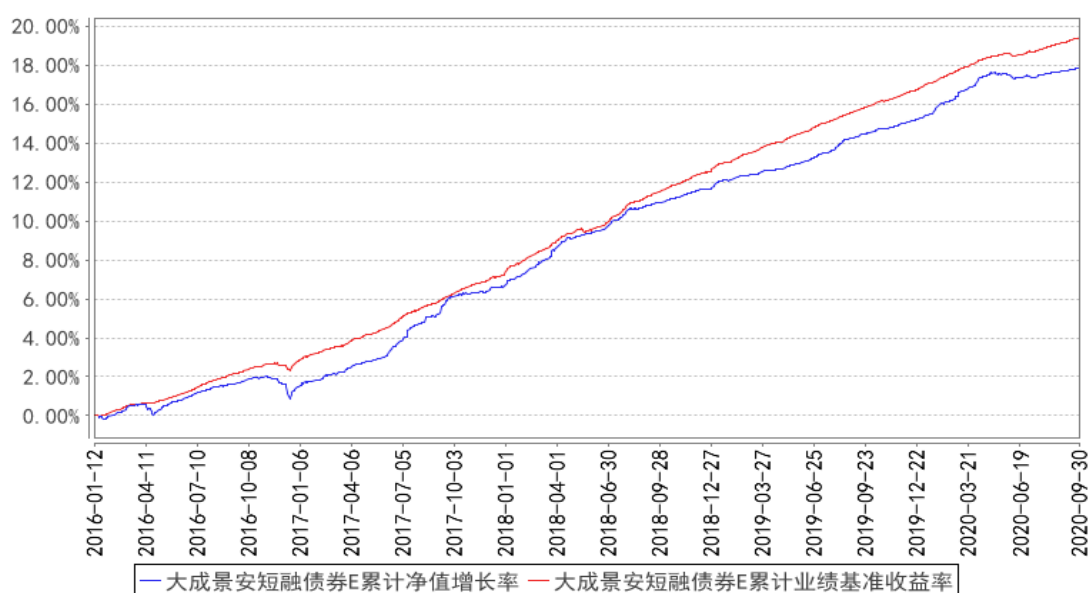
大成景安短融债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成景安短融债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成景安短融债券E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）。

## § 4 管理人报告

### 4.1 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		
张俊杰	本基金基金经理	2020年4月30日	-	13年	经济学硕士。曾任职于恒生银行广州分行。2007年7月至2013年4月就职于平安证券股份有限公司，历任衍生产品部研究员，固定收益事业部高级经理、债券研究员。2013年4月至2016年8月就职于金鹰基金管理有限公司，任固定收益部基金经理。2016年8月至2018年12月就职于华润元大基金管理有限公司，任固定收益投资部总经理、基金经理。2018年12月加入大成基金管理有限公司，就职于固定收益总部。2020年4月30日起任大成景安短融债券型证券投资基金、大成恒丰宝货币市场基金、大成添益交易型货币市场基金基金经理。2020年5月8日起任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年7月1日起任大成慧成货币市场基金基金经理。2020年7月7日起任大成现金宝场内实时申赎货币市

					场基金基金经理。2020 年 8 月 11 日起任大成安汇金融债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 18 日起任大成景安中短债债券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。

#### 4.1.1 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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 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 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 3 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 3 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度国内经济延续回升态势,7-9 月制造业 PMI 均在 51 以上,显示制造业持续扩张。工业增加值稳步上升,已经基本回到新冠疫情前的水平,消费缓步复苏,社零已经回到正增长区间。在国内疫情已经得到控制的情况下,预计经济增速将逐步回归正常。海外方面,虽然疫情出现反复,但较上半年亦明显好转。通胀方面,CPI 和 PPI 在三季度总体符合预期,表现平稳。

三季度人民银行维持稳健中性的货币政策取向,主要通过 MLF 和 OMO 调节市场流动性,三季度银行间流动性受到利率债供给较大的影响,资金面总体处于紧平衡的状态。此外,受到商业银行压降结构性存款的影响,中小银行负债端面临较大压力,同业存单发行利率大幅上行,导致债券短端收益率上行幅度较大。

由于对债市保持谨慎,本基金在三季度采取相对保守的投资策略,久期维持在较短的水平,主要以获取票息为主。在资金利率较低的时候,基金通过杠杆赚取息差,提高组合收益。

#### 4.5 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 的基金份额净值为 1.2705 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.32%;截至本报告期末大成景安短融债券 B 的基金份额净值为 1.3008 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.39%;截至本报告期末大成景安短融债券 E 的基金份额净值为 1.2831 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.37%。同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,159,054,653.40	98.66
	其中:债券	4,159,054,653.40	98.66
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-



7	银行存款和结算备付金合计	1,416,115.05	0.03
8	其他资产	55,103,755.65	1.31
9	合计	4,215,574,524.10	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 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

无。

## 5.4 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	139,142,000.00	3.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,618,000.00	1.53
	其中：政策性金融债	59,618,000.00	1.53
4	企业债券	47,433,253.40	1.22
5	企业短期融资券	3,264,442,000.00	83.66
6	中期票据	482,011,400.00	12.35
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	166,408,000.00	4.26
9	其他	-	-
10	合计	4,159,054,653.40	106.58

## 5.5 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	012002813	20 南新工 SCP002	1,200,000	119,256,000.00	3.06
2	072000237	20 财通证券 CP009	1,000,000	100,020,000.00	2.56
3	072000234	20 浙商证券 CP009	1,000,000	100,010,000.00	2.56

3	072000236	20 国元证券 CP006	1,000,000	100,010,000.00	2.56
5	012002330	20 赣州发展 SCP001	1,000,000	99,950,000.00	2.56

#### 5.6 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

无。

#### 5.7 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

无。

#### 5.8 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

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

##### 5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

#### 5.10 投资组合报告附注

##### 5.10.1 本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

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。

##### 5.10.2 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中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,600,464.70
5	应收申购款	16,503,290.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,103,755.65

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.10.6 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。

## § 6 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	2,092,254,733.90	1,110,905,227.50	1,932,391,071.90
报告期期间基金总申购份额	499,877,572.92	1,128,725,586.52	342,866,515.71
减：报告期期间基金总赎回份额	1,801,783,640.99	252,935,400.73	2,030,711,639.71
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	790,348,665.83	1,986,695,413.29	244,545,947.90

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	161,670,199.40	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	161,670,199.40	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	5.35	-

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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。

### 9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 9.3 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 10 月 28 日