大成安汇金融债债券型证券投资基金
2021年第3季度报告

2021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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成安汇金融债		
基金主代码	090023		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 8 月 4 日		
报告期末基金份额总额	76,692,857.81 份		
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳定增值。		
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。		
业绩比较基准	中债金融债总财富指数收益率		
风险收益特征	本基金为债券型基金，一般而言，其长期预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	大成安汇金融债债券 A	大成安汇金融债债券 C	大成安汇金融债债券 E
下属分级基金的交易代码	091023	090023	001516
报告期末下属分级基金的份额总额	14,567.28 份	29,760,288.07 份	46,918,002.46 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）		
	大成安汇金融债债券 A	大成安汇金融债债券 C	大成安汇金融债债券 E
1.本期已实现收益	299.99	672,254.82	1,027,050.00
2.本期利润	268.59	623,497.39	948,348.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0197	0.0203	0.0196
4.期末基金资产净值	15,228.93	31,082,964.66	48,889,526.02
5.期末基金份额净值	1.0454	1.0444	1.0420

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 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

大成安汇金融债债券 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	1.99%	0.10%	1.82%	0.07%	0.17%	0.03%
过去六个月	2.17%	0.09%	3.28%	0.06%	-1.11%	0.03%
过去一年	4.18%	0.08%	5.79%	0.06%	-1.61%	0.02%
自基金合同生效起至今	4.54%	0.07%	5.63%	0.06%	-1.09%	0.01%

大成安汇金融债债券 C

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	1.96%	0.10%	1.82%	0.07%	0.14%	0.03%
过去六个月	2.12%	0.09%	3.28%	0.06%	-1.16%	0.03%
过去一年	4.09%	0.08%	5.79%	0.06%	-1.70%	0.02%

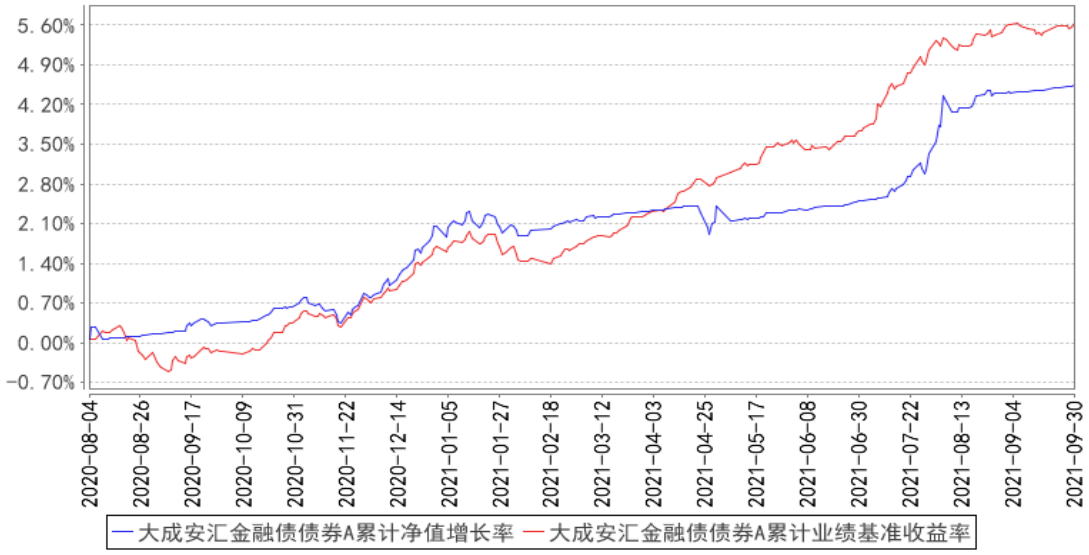
自基金合同生效起至今	4.44%	0.07%	5.63%	0.06%	-1.19%	0.01%

大成安汇金融债债券 E

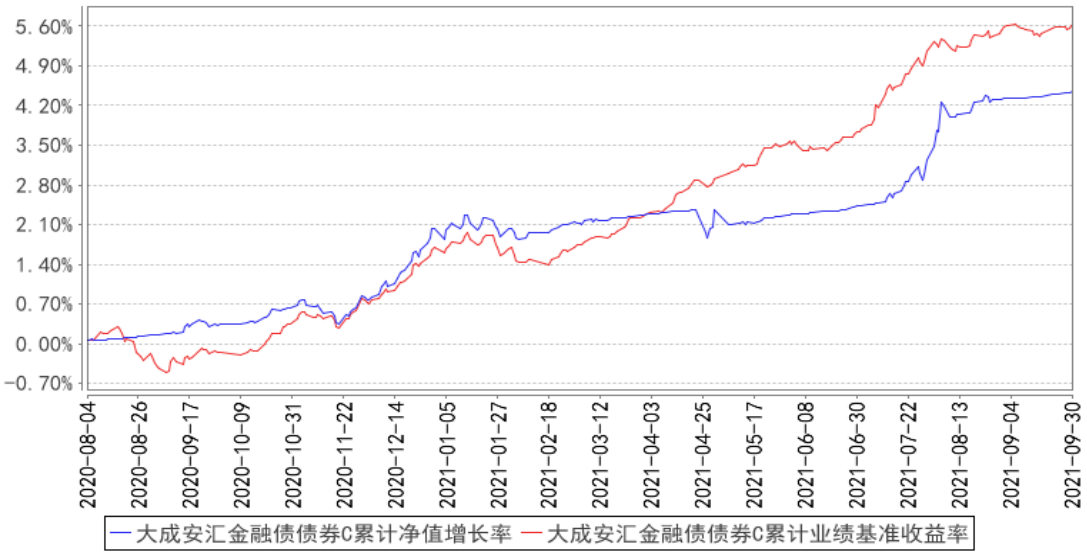
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.92%	0.10%	1.82%	0.07%	0.10%	0.03%
过去六个月	2.02%	0.09%	3.28%	0.06%	-1.26%	0.03%
过去一年	3.88%	0.08%	5.79%	0.06%	-1.91%	0.02%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.07%	5.63%	0.06%	-1.43%	0.01%

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

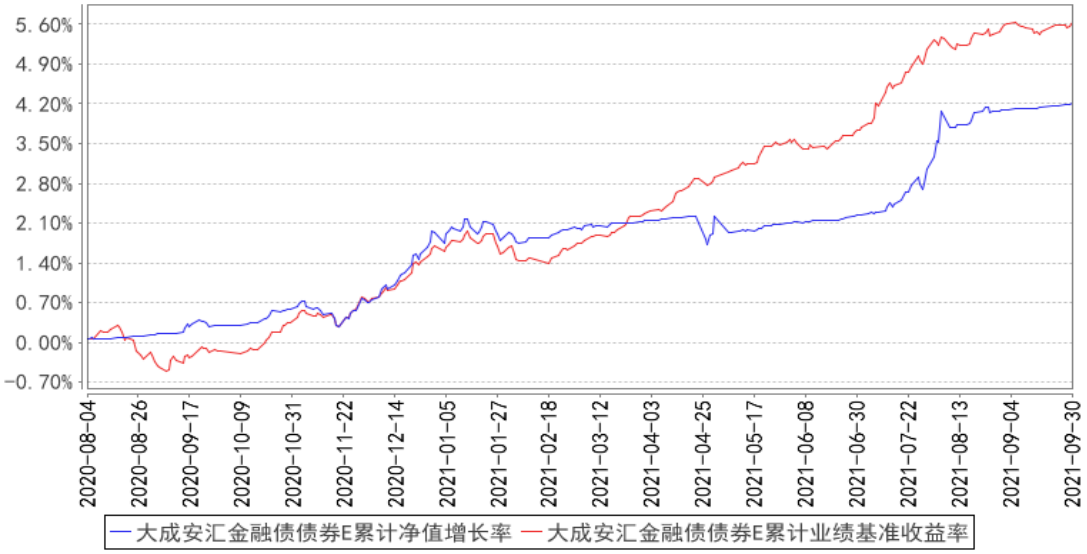
大成安汇金融债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成安汇金融债债券C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



大成安汇金融债债券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有关约定。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 2020 年 8 月 4 日由大成月月盈短期理财债券型证券投资基金转型而来。

§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 8 月 11 日	-	14 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，现任固定收益总部总监助理。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 日至 2021 年 8 月 13 日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 日起任大成景优中短债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 7 月 29 日起任大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金（原大成月添利理财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遵规守信情况的说明

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，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3日、5日、10日）反向交易和同向交易价差监控的分析。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投资策略差异、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，同时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2笔同日反向交易，原因为组合合规比例调整。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4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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年三季度国内经济总体较为平稳，但受到部分地区疫情反复、极端天气以及能耗双控等因素的影响，经济增长速度有所下滑。从制造业PMI来看，三季度逐月下滑，9月份跌破50的荣枯线，显示经济下行压力增大。工业增加值亦明显下滑，8月份同比增速为5.3%，较7月份下滑1.1个百分点。受多地疫情反复影响，消费下滑速度相对更快，8月份社会零售品销售总额同比增速仅2.5%，创下自去年9月份以来的新低。出口仍然较为坚挺，是支撑经济的最大力量。物价方面，PPI依然高企，8月份PPI创出了9.5%的新高，而CPI受猪肉价格下跌影响，依然较低，8月份CPI仅0.8%，CPI和PPI的剪刀差进一步扩大。

三季度人民银行继续实施稳健的货币政策，流动性保持合理充裕。7月初意外下调存款准备金率0.5%，意在对冲部分到期的MLF。银行间资金面较为宽松，但隔夜回购利率基本维持在2%附近。受降准影响，三季度初债市利率快速下行，10年国债收益率一度下行至2.8%以下，但进一步下行压力较大，呈现底部震荡的走势。

2021年三季度，本基金主要通过长久期利率债的波段操作，增厚了组合收益。在利率底部震荡行情中，基金保持较低的组合久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成安汇金融债债券A的基金份额净值为1.0454元，本报告期基金份额净值

增长率为 1.99%;截至本报告期末大成安汇金融债债券 C 的基金份额净值为 1.0444 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.96%;截至本报告期末大成安汇金融债债券 E 的基金份额净值为 1.0420 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.92%。同期业绩比较基准收益率为 1.82%。

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	70,114,000.00	87.44
	其中：债券	70,114,000.00	87.44
	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	7,840,131.76	9.78
	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	767,832.90	0.96
8	其他资产	1,460,701.71	1.82
9	合计	80,182,666.37	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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。

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,114,000.00	87.66
	其中：政策性金融债	70,114,000.00	87.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,114,000.00	87.66

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	210401	21 农发 01	500,000	50,080,000.00	62.61
2	180412	18 农发 12	200,000	20,034,000.00	25.05

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	1,459,407.67
5	应收申购款	1,294.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,460,701.71

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	大成安汇金融债债券 A	大成安汇金融债债券 C	大成安汇金融债债券 E
报告期期初基金份额总额	13,138.23	31,672,659.73	49,364,646.92
报告期期间基金总申购份额	2,488.00	692,987.64	1,270,688.00
减:报告期期间基金总赎回份额	1,058.95	2,605,359.30	3,717,332.46
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	14,567.28	29,760,288.07	46,918,002.46

§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

无。

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

2021 年 9 月 3 日，召开公司 2021 年第四次临时股东会审议通过选举陈勇先生担任公司股东监事，许国平先生不再担任公司股东监事、监事会主席；

2021 年 9 月 3 日，召开公司第七届监事会第六次会议审议通过选举陈勇先生担任公司第七届监事会主席。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《关于准予大成月月盈短期理财债券型证券投资基金变更注册的批复》；

2、《大成安汇金融债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《大成安汇金融债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、本报告期内在规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

2021年10月27日