

大成安汇金融债债券型证券投资基金(原 大成月月盈短期理财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。

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会于 2020 年 5 月 19 日起，至 2020 年 6 月 11 日以通讯方式召开，本次基金份额持有人大会于 2020 年 6 月 12 日决议通过了《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金转型相关事项的议案》，正式实施日为 2020 年 8 月 4 日，具体详见 2020 年 6 月 13 日公告。

根据《大成基金管理有限公司关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的转型选择期为 2020 年 6 月 15 日（含该日）至 2020 年 8 月 3 日（含该日）。自持有人大会决议生效后，选择期结束之日的次日（即 2020 年 8 月 4 日）起，《大成安汇金融债债券型证券投资基金基金合同》生效，原《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》同日起失效，大成月月盈短期理财债券型证券投资基金正式变更为大成安汇金融债债券型证券投资基金。

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

2.1 基金基本情况（转型后）

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	111,764,016.85 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	58,822.87 份	46,112,405.86 份	65,592,788.12 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	大成月月盈短期理财债券		
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	2014 年 9 月 12 日		
报告期末基金份额总额	2,819,352,049.60 份		
投资目标	以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。		
投资策略	本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他衍生工具投资策略四个层次进行投资管理，以实现超越投资基准的投资目标。		
业绩比较基准	七天通知存款税后利率		
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，及普通债券型证券投资基金。		
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	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E
下属分级基金的交易代码	090023	091023	001516
报告期末下属分级基金的份额总额	52,142,274.56 份	2,697,574,977.57 份	69,634,797.47 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 8 月 4 日-2020 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	-1,343.14	143,453.16	176,867.59
2. 本期利润	7,582.85	166,649.32	207,445.44
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0001	0.0034	0.0030
4. 期末基金资产净值	59,027.71	46,268,029.75	65,793,302.65
5. 期末基金份额净值	1.0035	1.0034	1.0031

注：1、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。

2、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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 7 月 1 日-2020 年 8 月 3 日）		
	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E
1. 本期已实现收益	96,664.96	10,437,138.94	130,343.08
2. 本期利润	96,664.96	10,437,138.94	130,343.08
3. 期末基金资产净值	52,142,274.56	2,697,574,977.57	69,634,797.47

注：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。由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

大成安汇金融债债券 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
自基金合同生效起至今	0.35%	0.05%	-0.16%	0.07%	0.51%	-0.02%

大成安汇金融债债券 C

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

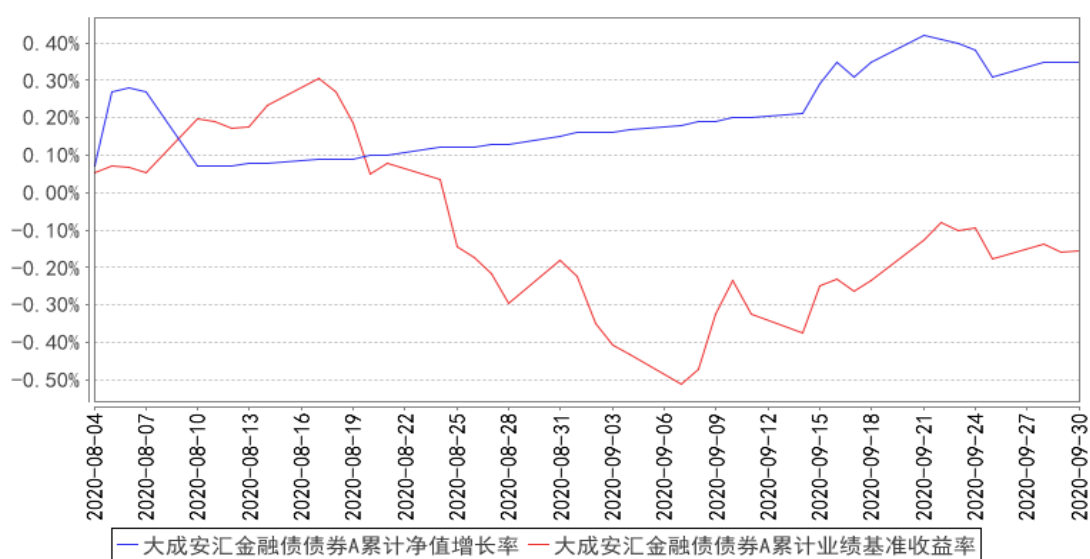
				④		
自基金合同 生效起至今	0.34%	0.03%	-0.16%	0.07%	0.50%	-0.04%

大成安汇金融债债券 E

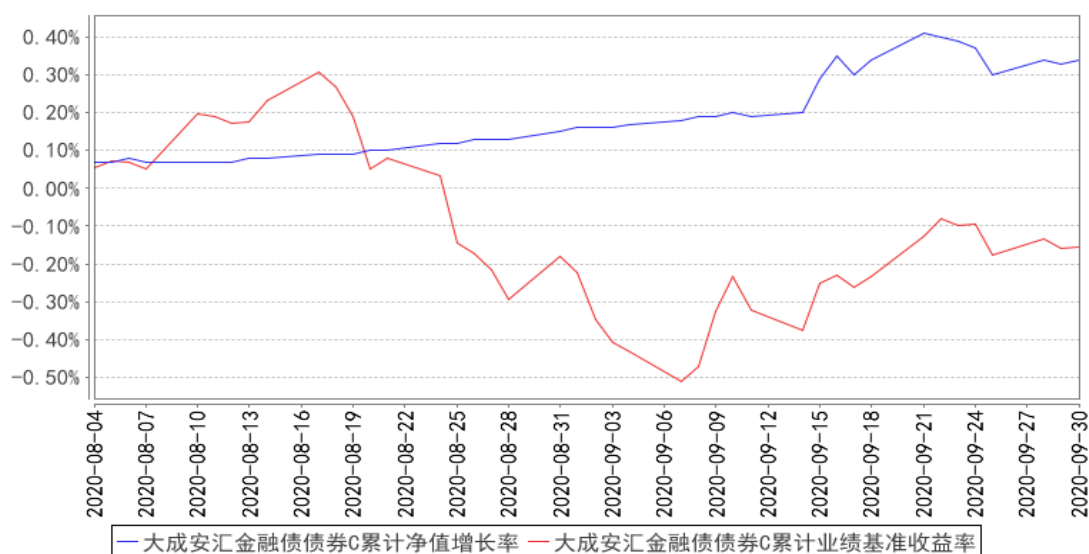
阶段	份额净值增长 率①	份额净值增长 率标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	0.31%	0.03%	-0.16%	0.07%	0.47%	-0.04%

3.2.2 自基金转型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

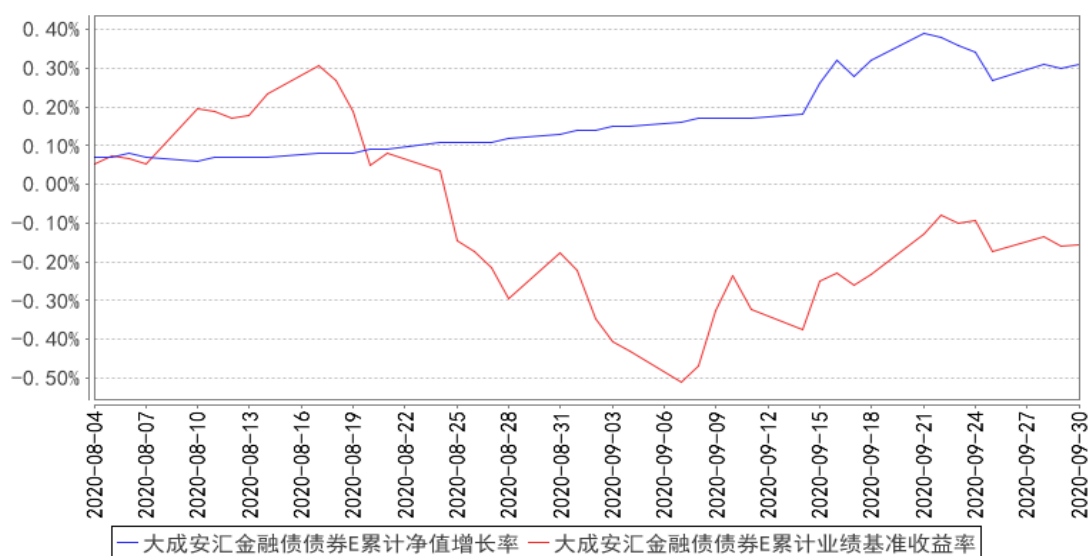
大成安汇金融债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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、本基金合同生效日为 2020 年 8 月 4 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（暨基金转型）日 2020 年 8 月 4 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。截至报告期末，本基金处于建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

大成月月盈短期理财债券 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.1962%	0.0030%	0.1254%	0.0000%	0.0708%	0.0030%

过去六个月	0.6139%	0.0018%	0.4611%	0.0000%	0.1528%	0.0018%
过去一年	1.8854%	0.0017%	1.1370%	0.0000%	0.7484%	0.0017%
过去三年	9.0780%	0.0027%	3.8370%	0.0000%	5.2410%	0.0027%
过去五年	16.7865%	0.0039%	6.5370%	0.0000%	10.2495%	0.0039%
自基金合同生效起至今	22.9308%	0.0083%	7.9573%	0.0000%	14.9735%	0.0083%

大成月月盈短期理财债券 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.2287%	0.0030%	0.1254%	0.0000%	0.1033%	0.0030%
过去六个月	0.7196%	0.0018%	0.4611%	0.0000%	0.2585%	0.0018%
过去一年	2.1408%	0.0017%	1.1370%	0.0000%	1.0038%	0.0017%
过去三年	9.9861%	0.0027%	3.8370%	0.0000%	6.1491%	0.0027%
过去五年	18.4376%	0.0039%	6.5370%	0.0000%	11.9006%	0.0039%
自基金合同生效起至今	25.0452%	0.0083%	7.9573%	0.0000%	17.0879%	0.0083%

大成月月盈短期理财债券 E

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.1869%	0.0030%	0.1254%	0.0000%	0.0615%	0.0030%
过去六个月	0.6016%	0.0018%	0.4611%	0.0000%	0.1405%	0.0018%
过去一年	1.8713%	0.0017%	1.1370%	0.0000%	0.7343%	0.0017%
过去三年	9.0556%	0.0027%	3.8370%	0.0000%	5.2186%	0.0027%
过去五年	16.7737%	0.0039%	6.5370%	0.0000%	10.2367%	0.0039%
自基金合同生效起至今	18.1334%	0.0049%	6.9217%	0.0000%	11.2117%	0.0049%

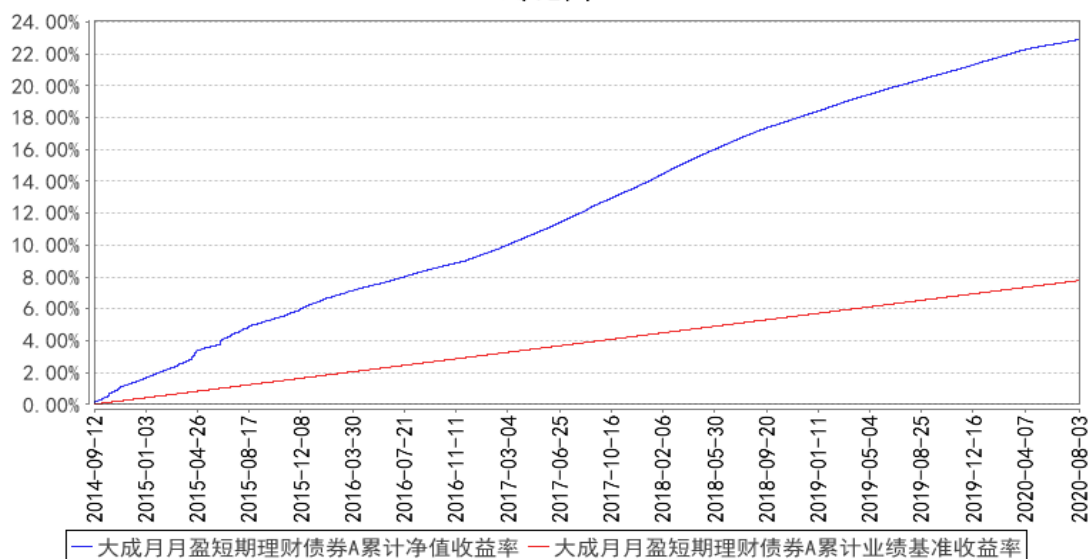
注：1、本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期，是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

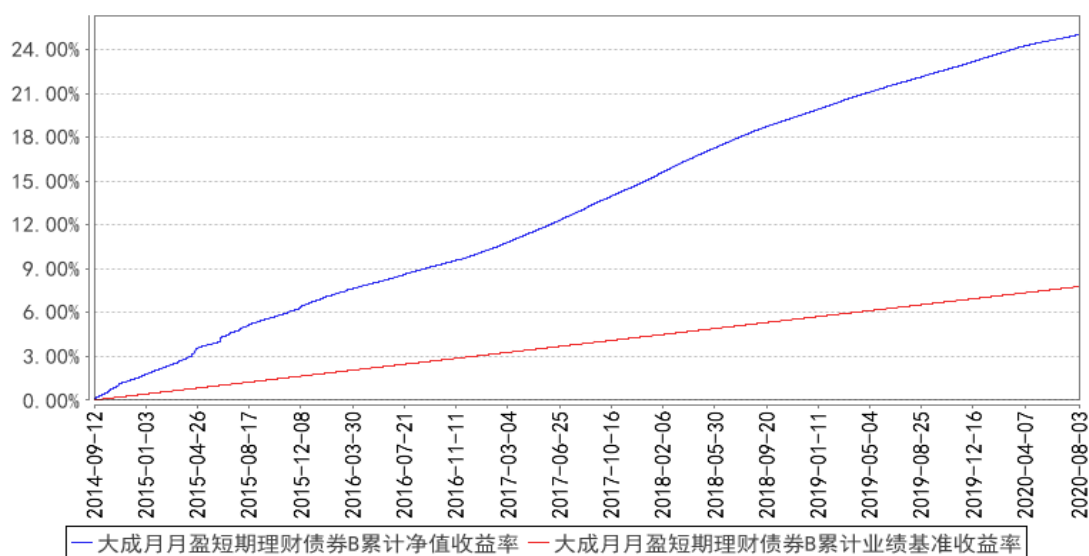
3、本基金自 2015 年 6 月 19 日起，新增 E 类份额。

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

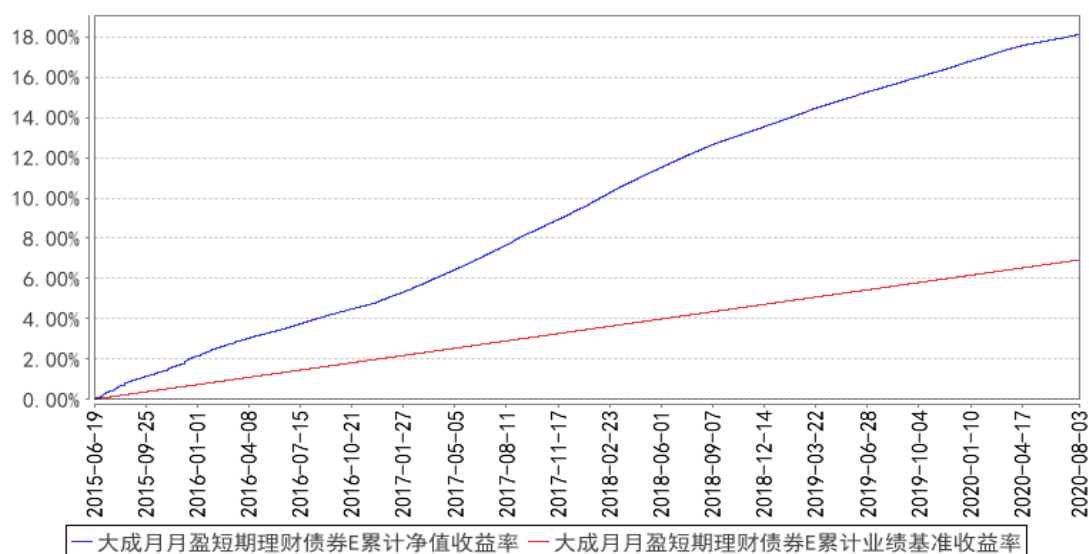
大成月月盈短期理财债券A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势
对比图



大成月月盈短期理财债券B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势
对比图



大成月月盈短期理财债券E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	—	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 日起任大成景优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
李富强	本基金基金经理	2018 年 7 月 16 日	2020 年 8 月 12 日	6 年	经济学硕士。2009 年 7 月至 2013 年 12 月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014 年 1 月至 2017 年 7 月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017 年 7 月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 9 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 2 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 3 月 11 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 9 月 29 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 8 月 12 日任大成安汇金融债债券型证券投资基金（转型前大成月月盈短期理财债券型证券投资基金）。2018 年 7 月 16 日起任大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月 16 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 12 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日起任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019 年 11 月 25 日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 9 日起任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 22 日起任大成惠兴一年定期开放债券型发起式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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
李富强	本基金基金经理	2018 年 7 月 16 日	—	6 年	经济学硕士。2009 年 7 月至 2013 年 12 月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014 年 1 月至 2017 年 7 月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017 年 7 月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 9 日任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 3 月 2 日任大成景利混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 3 月 11 日任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2019 年 9 月 29 日任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2018 年 7 月 16 日至 2020 年 8 月 12 日任大成安汇金融债债券型证券投资基金（转型前大成月月盈短期理财债券型证券投资基金）。2018 年 7 月 16 日起任大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月 16 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 12 日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月 26 日起任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2019 年 11 月 25 日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 9 日起任大成惠嘉一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 22 日起任大成惠兴一年定期开放债券型发起式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。

4.2 管理人对报告期内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 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。

本基金在 8 月 4 日由理财型债基转型为主要投资商业银行债券的基金，由于对三季度债市偏谨慎，本基金在 9 月中旬之间主要以短期流动性管理为主，9 月中旬逐步配置 2-3 年政策性金融

债，拉长组合久期，获取超额收益，业绩表现较好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后：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 1.0035 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.35%；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 1.0034 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.34%；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 1.0031 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.31%。同期业绩比较基准收益率为-0.16%。

转型前：本报告期大成月月盈短期理财债券 A 的基金份额净值收益率为 0.1962%，本报告期大成月月盈短期理财债券 B 的基金份额净值收益率为 0.2287%，本报告期大成月月盈短期理财债券 E 的基金份额净值收益率为 0.1869%，同期业绩比较基准收益率为 0.1254%。

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（转型后）

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	108,226,000.00	96.24
	其中：债券	108,226,000.00	96.24
	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	3,572,964.52	3.18
8	其他资产	657,738.40	0.58
9	合计	112,456,702.92	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	9,943,000.00	8.87
2	央行票据	—	—
3	金融债券	98,283,000.00	87.66
	其中：政策性金融债	98,283,000.00	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	108,226,000.00	96.53

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	200207	20 国开 07	500,000	49,620,000.00	44.26
2	200202	20 国开 02	400,000	38,676,000.00	34.50
3	200216	20 国开 16	100,000	9,987,000.00	8.91
4	209942	20 贴现国债 42	100,000	9,943,000.00	8.87

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

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。

无。

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	8,738.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	604,900.08
5	应收申购款	44,100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	657,738.40

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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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	固定收益投资	20,009,790.98	0.71
	其中：债券	20,009,790.98	0.71
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	1,001,120,860.56	35.36
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备 付金合计	1,809,474,198.81	63.91
4	其他资产	707,553.84	0.02
5	合计	2,831,312,404.19	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.21	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	0
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	30
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 150 天”。本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产 净值的比例（%）	各期限负债占基金资 产净值的比例（%）
----	--------	------------------------	------------------------

1	30 天以内	100.40	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天（含）—60 天	—	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天（含）—90 天	—	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天（含）—120 天	—	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天（含）—397 天（含）	—	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		100.40	—

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,998,348.07	0.35
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	10,011,442.91	0.36
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	20,009,790.98	0.71
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	—	—

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101564035	15 申江两岸 MTN001	100,000	10,011,442.91	0.36
2	209920	20 贴现国债 20	100,000	9,998,348.07	0.35

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0637%

报告期内偏离度的最低值	0.0031%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0344%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。

5.9.2 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。

5.9.3 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	应收利息	707,553.84
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	707,553.84

5.9.4 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(转型后)

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
基金合同生效日(2020 年 8 月 4 日)基金份额总额	2,697,574,977.57	52,142,274.56	69,634,797.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	92,466.79	836,430.45	4,553,001.05
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,697,608,621.49	6,866,299.15	8,595,010.40
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-	-
报告期期末基金份额总额	58,822.87	46,112,405.86	65,592,788.12

注：根据《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，转型后的基金名称将变更为大成安汇金融债债券型证券投资基金，基金简称变更为大成安汇金融债债券，投资者未赎回或转出的本基金 A 类基金份额（基金代码 090023）、B 类基金份额（基金代码 091023）、E 类基金份额（基金代码 001516）将分别转为转型后基金（大成安汇金融债债券型证券投资基金）的 C 类基金份额（基金代码 090023）、A 类基金份额（基金代码 091023）、E 类基金份额（基金代码 001516）。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E
报告期期初基金份额总额	59,981,296.10	8,285,379,281.27	82,252,293.66
报告期期间基金总申购份额	3,502.00	-	2,201.00
报告期期间基金总赎回份额	7,842,523.54	5,587,804,303.70	12,619,697.19
报告期期末基金份额总额	52,142,274.56	2,697,574,977.57	69,634,797.47

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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

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	20200701-20200803	2,676,412,728.11	-	2,676,412,728.11	-	-
	2	20200701-20200702	2,202,658,079.75	-	2,202,658,079.75	-	-
	3	20200706-20200723	1,161,437,520.29	-	1,161,437,520.29	-	-
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。							

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、《关于大成月月盈短期理财债券型证券投资基金份额持有人大会决议生效的公告》；
- 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、《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》；

- 5、《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金托管协议》；
- 6、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 7、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