大成景安短融债券型证券投资基金
2020年中期报告

2020年6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

送出日期：2020年8月28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。本中期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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.8 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 15

§5 托管人报告 15

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16

6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 20

§7 投资组合报告 38

7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
7.3 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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 39
7.6 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 39

7.7 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 39
7.8 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 39
7.9 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 39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 40
7.11 投资组合报告附注 40

§8 基金份额持有人信息 41

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
8.3 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 42

§9 开放式基金份额变动 42

§10 重大事件揭示 43

10.1 基金份额持有人大会决议 43
10.2 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 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 43
10.8 其他重大事件 46

§11 影响投资者决策的其他重要信息 47

11.1 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 47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 48

§12 备查文件目录 48

12.1 备查文件目录 48
12.2 存放地点 48
12.3 查阅方式 48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	大成景安短融债券型证券投资基金		
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		
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		
报告期末基金份额总额	5,135,551,033.30 份		
基金合同存续期	不定期		
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	2,092,254,733.90 份	1,110,905,227.50 份	1,932,391,071.90 份

2.2 基金产品说明

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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵冰	贺倩
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031

法定代表人	吴庆斌	周慕冰

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	大成基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 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
本期已实现收益	14,057,305.27	10,549,961.63	8,121,647.48
本期利润	14,313,618.29	7,414,839.71	9,105,984.61
加权平均基金份额本期利润	0.0194	0.0132	0.0254
本期加权平均净值利润率	1.54%	1.02%	2.00%
本期基金份额净值增长率	1.76%	1.90%	1.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	471,146,003.77	282,336,633.14	458,332,127.46

期末可供分配基金份额利润	0.2252	0.2542	0.2372
期末基金资产净值	2,649,874,051.23	1,439,393,750.13	2,470,371,632.80
期末基金份额净值	1.2665	1.2957	1.2784
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	37.81%	40.79%	17.46%

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。

4.根据我公司 2016 年 01 月 12 日《关于大成景安短融债券型证券投资基金增设基金份额类别、变更基金份额净值计算位数并相应修订基金合同和托管协议的公告》，自 2016 年 01 月 12 日起，大成景安短融债券型证券投资基金增设 E 类份额。本报告关于 E 类份额的指标计算起始日为 E 类份额的初始申购确认日。

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
过去一个月	-0.08%	0.03%	0.02%	0.02%	-0.10%	0.01%
过去三个月	0.40%	0.03%	0.46%	0.02%	-0.06%	0.01%
过去六个月	1.76%	0.04%	1.47%	0.02%	0.29%	0.02%
过去一年	3.46%	0.03%	3.28%	0.02%	0.18%	0.01%
过去三年	12.48%	0.03%	13.01%	0.02%	-0.53%	0.01%
自基金合同生效起至今	37.81%	0.05%	35.21%	0.02%	2.60%	0.03%

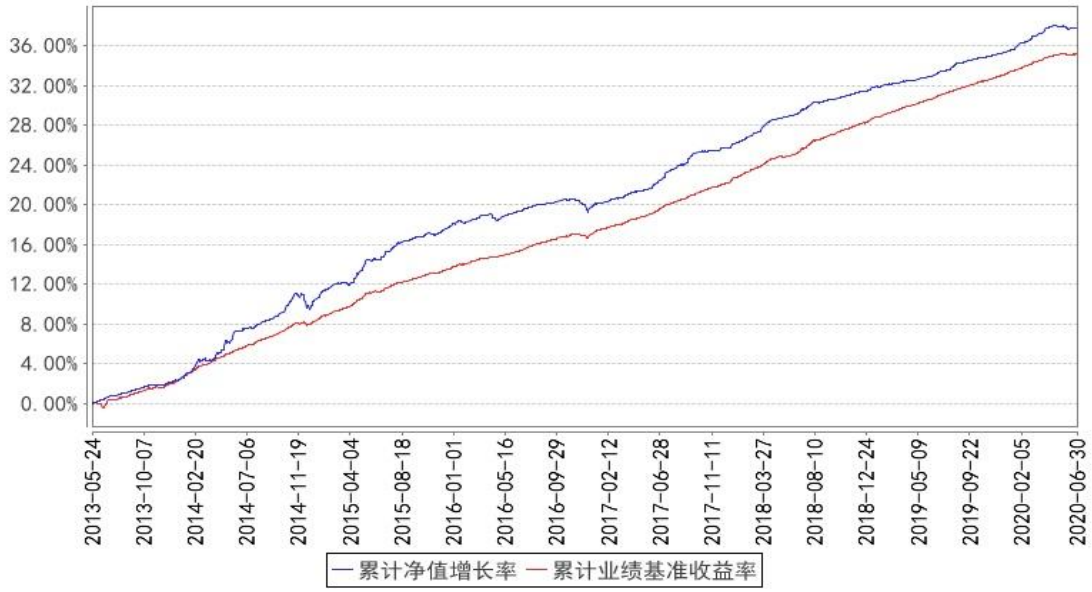
大成景安短融债券 B						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.05%	0.03%	0.02%	0.02%	-0.07%	0.01%
过去三个月	0.47%	0.03%	0.46%	0.02%	0.01%	0.01%
过去六个月	1.90%	0.04%	1.47%	0.02%	0.43%	0.02%
过去一年	3.76%	0.03%	3.28%	0.02%	0.48%	0.01%
过去三年	13.47%	0.03%	13.01%	0.02%	0.46%	0.01%
自基金合同生效起至今	40.79%	0.05%	35.21%	0.02%	5.58%	0.03%

大成景安短融债券 E

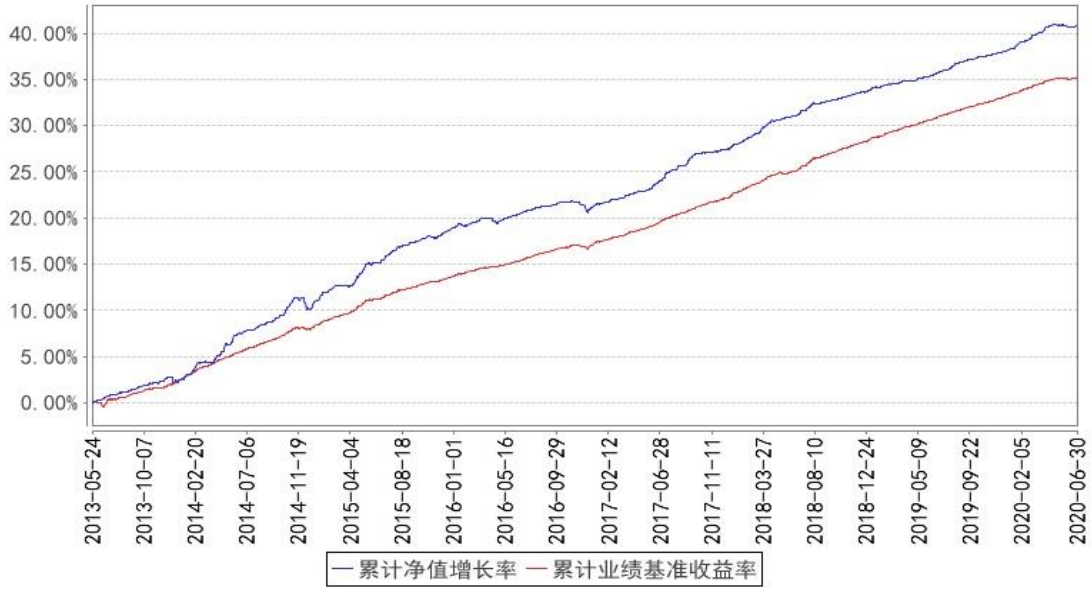
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.07%	0.03%	0.02%	0.02%	-0.09%	0.01%
过去三个月	0.44%	0.03%	0.46%	0.02%	-0.02%	0.01%
过去六个月	1.85%	0.04%	1.47%	0.02%	0.38%	0.02%
过去一年	3.66%	0.03%	3.28%	0.02%	0.38%	0.01%
过去三年	13.16%	0.03%	13.01%	0.02%	0.15%	0.01%
自基金合同生效起至今	17.46%	0.03%	18.64%	0.02%	-1.18%	0.01%

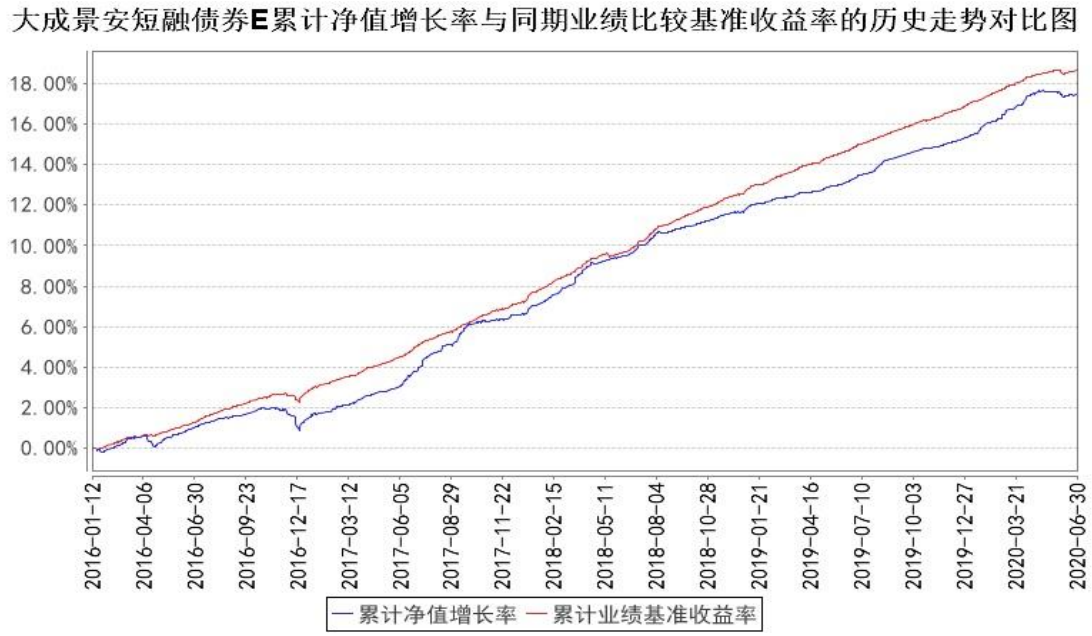
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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





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.截至报告期末，本基金因规模变动导致对债券的投资比例被动低于基金资产的 80%，对短期融资券、超级短期融资券和剩余期限在 1 年之内的中期票据、公司债、企业债的投资比例合计被动低于非现金基金资产的 80%。除此之外，报告期内本基金的其他各项投资比例符合基金合同的约定。

3.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%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过十多年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2020 年 6 月 30 日，公司管理公募基金产品数量共 103 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		
欧阳亮	本基金基金经理	2019 年 1 月 25 日	2020 年 6 月 15 日	11 年	管理学硕士。2009 年 9 月至 2011 年 7 月曾任华泰联合证券研究所研究员。2011 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾担任产品研发与金融工程部高级产品设计师、固定收益总部助理研究员、大成丰财宝货币市场基金、大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成优选混合型证券投资基金（LOF）、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、大成积极成长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。2019 年 1 月 25 日至 2020 年 7 月 8 日起任大成慧成货币市场基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金、大成惠祥纯债债券型证券投资基金(原大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金转型）基金经理。2019 年 1 月 25 日至 2020 年 6 月 15 日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基金经理。2019 年 9 月 20 日至 2020 年 7 月 8 日任大成添益交易型货币市场基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
张俊杰	本基金基金经理助理	2019 年 3 月 25 日	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。具有基金从业资格。国籍：中国
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。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。

4.1.3 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。

4.2 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 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 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 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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 1 笔同日反向交易，原因为组合流动性需要。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 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

2020 年上半年，国内经济遭受新冠疫情的巨大冲击，一季度 GDP 增速跌至-6.8%，二季度显著回升至 3.2%。受新冠疫情的影响，国内经济在 1 月下旬至 2 月上旬几乎处于停摆的状态，随着全国实施严格果断的疫情防控措施，到 2 月中国内迅速控制住疫情并逐步开始复工复产，经济开始快速回升。但新冠疫情从 2 月下旬开始在海外迅速蔓延，逐渐发展成为全球性的重大公共卫生危机，海外经济同样遭受巨大冲击。受此影响，全球金融市场剧烈震荡，欧美央行启动史无前例的宽松措施。

为应对疫情冲击，稳定经济基本盘，人民银行上半年累计下调 MLF 和 OMO 利率 30bp，并通过定向降准、再贷款等政策工具释放流动性，在 4 月初下调超额准备金利率 37bp。4 月份之前流动

性非常宽松，隔夜回购利率一度跌至 1%以下，债券市场收益率大幅下行。4 月份之后随着经济逐步恢复，货币政策边际收紧，流动性转向紧平衡状态，隔夜回购利率回到 2%附近，债券市场收益率从低点大幅回升。从上半年的情况来看，各期限债券收益率呈现“V”型走势，到 6 月底基本回到了年初的水平。

2020 年上半年，本基金主要采取“哑铃型”策略，通过灵活调整久期来获取超额收益。在 4 月份之前，维持相对较长的久期，获取了不错的收益。在 5 月下旬之后，缩短久期进行防守，在利率大幅上行的过程中较好的控制了净值回撤。在信用策略上，本基金主要投资 AAA 短融，规避信用风险。

4.4.2 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 1.2665 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.76%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%；截至本报告期末大成景安短融债券 B 的基金份额净值为 1.2957 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.90%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%；截至本报告期末大成景安短融债券 E 的基金份额净值为 1.2784 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济将继续复苏，但由于海外疫情形势依然严峻，且中美关系面临较大的不确定性，我国面临的外部环境依然复杂。财政政策和货币政策仍将以“六个保”为目标，预计下半年发生明显转向的概率不大。债券市场经过调整之后，收益率已经基本回到年初的水平，进一步上行的空间有限，预计下半年大概率呈现震荡走势。在投资策略上，我们将继续采取稳健的投资策略，选择较好的配置时点进行资产配置，以获取票息收益为主，在保持净值稳健增长的同时力争控制回撤。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—大成基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成景安短融债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	179,554,978.89	1,973,493.09
结算备付金		-	39,331.57
存出保证金		-	811.28
交易性金融资产	6.4.7.2	4,269,295,408.00	2,224,790,235.10
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,269,295,408.00	2,224,790,235.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,025,360,683.30	1,229,551,124.31
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	49,869,978.45	27,359,478.28
应收股利		-	-
应收申购款		37,868,680.87	198,215,848.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,561,949,729.51	3,681,930,321.68
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末**	**上年度末**

		2020 年 6 月 30 日	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,028,554.53	617,783.54
应付托管费		359,994.06	216,224.22
应付销售服务费		348,792.62	296,464.62
应付交易费用	6.4.7.7	82,469.08	56,316.93
应交税费		255,258.92	165,359.74
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	235,226.14	220,800.00
负债合计		2,310,295.35	1,572,949.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,135,551,033.30	2,944,849,280.32
未分配利润	6.4.7.10	1,424,088,400.86	735,508,092.31
所有者权益合计		6,559,639,434.16	3,680,357,372.63
负债和所有者权益总计		6,561,949,729.51	3,681,930,321.68

注： 报告截止日 2020 年 06 月 30 日,基金份额总额 5,135,551,033.30 份，其中大成景安短融债券 A 基金份额总额为 2,092,254,733.90 份，基金份额净值 1.2665 元。大成景安短融债券 B 基金份额总额为 1,110,905,227.50 份，基金份额净值 1.2957 元。大成景安短融债券 E 基金份额总额为 1,932,391,071.90 份，基金份额净值 1.2784 元。

6.2 利润表

会计主体：大成景安短融债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		42,476,387.58	52,275,640.21
1.利息收入		41,322,079.27	66,586,000.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,260.98	21,716.03
债券利息收入		39,864,212.68	65,778,951.45
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		1,428,605.61	785,333.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,477,763.26	-12,354,347.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,477,763.26	-12,354,347.62
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,894,471.77	-2,697,547.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	571,016.82	741,534.46
减：二、费用		11,641,944.97	16,394,298.85
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,284,551.97	5,279,779.62
2．托管费	6.4.10.2.2	1,499,593.17	1,847,922.89
3．销售服务费	6.4.10.2.3	1,689,704.68	1,784,338.65
4．交易费用	6.4.7.19	66,570.00	60,717.94
5．利息支出		3,819,432.73	7,055,448.60
其中：卖出回购金融资产支出		3,819,432.73	7,055,448.60
6．税金及附加		125,194.43	204,463.92
7．其他费用	6.4.7.20	156,897.99	161,627.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,834,442.61	35,881,341.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,834,442.61	35,881,341.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成景安短融债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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)	2,944,849,280.32	735,508,092.31	3,680,357,372.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,834,442.61	30,834,442.61
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）	2,190,701,752.98	657,745,865.94	2,848,447,618.92
其中：1.基金申购款	5,945,437,045.25	1,630,738,517.76	7,576,175,563.01
2.基金赎回款	-3,754,735,292.27	-972,992,651.82	-4,727,727,944.09
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)	5,135,551,033.30	1,424,088,400.86	6,559,639,434.16
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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)	3,150,948,014.75	677,969,014.95	3,828,917,029.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,881,341.36	35,881,341.36
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）	-980,528,058.61	-203,193,894.35	-1,183,721,952.96
其中：1.基金申购款	3,397,426,875.79	760,993,214.36	4,158,420,090.15
2.基金赎回款	-4,377,954,934.40	-964,187,108.71	-5,342,142,043.11
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)	2,170,419,956.14	510,656,461.96	2,681,076,418.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

1.增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，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；

转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

证券投资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，股权的股息、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。

2.个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得债券的利息收入及储蓄利息收入，由债券发行企业及金融机构在向基金派发的债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	159,554,978.89
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	20,000,000.00
合计	179,554,978.89

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	6,180,218.68	6,166,508.00	-13,710.68
	银行间市场	4,265,439,631.20	4,263,128,900.00	-2,310,731.20
	合计	4,271,619,849.88	4,269,295,408.00	-2,324,441.88
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	4,271,619,849.88	4,269,295,408.00	-2,324,441.88

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,025,360,683.30	-
合计	2,025,360,683.30	-

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,688.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,222.22
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	48,718,597.30
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,139,469.95
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	-
合计	49,869,978.45

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	82,469.08
合计	82,469.08

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	233,426.14
应付银行划款手续费	1,800.00
合计	235,226.14

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

大成景安短融债券 A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,207,338,052.04	2,207,338,052.04
本期申购	2,619,457,820.63	2,619,457,820.63
本期赎回（以“-”号填列）	-2,734,541,138.77	-2,734,541,138.77
本期末	2,092,254,733.90	2,092,254,733.90

大成景安短融债券 B

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	449,669,156.92	449,669,156.92
本期申购	1,150,129,440.30	1,150,129,440.30
本期赎回（以“-”号填列）	-488,893,369.72	-488,893,369.72
本期末	1,110,905,227.50	1,110,905,227.50

大成景安短融债券 E

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	287,842,071.36	287,842,071.36
本期申购	2,175,849,784.32	2,175,849,784.32
本期赎回（以“-”号填列）	-531,300,783.78	-531,300,783.78

本期末	1,932,391,071.90	1,932,391,071.90

注：1.申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)、级别调整入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)、级别调整出份额(如有)。

2.自 2018 年 10 月 16 日起，本基金 A 级和 B 级取消基金份额自动升降级业务。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

大成景安短融债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	451,643,929.41	88,319,134.71	539,963,064.12
本期利润	14,057,305.27	256,313.02	14,313,618.29
本期基金份额交易产生的变动数	5,444,769.09	-2,102,134.17	3,342,634.92
其中：基金申购款	579,998,351.42	110,748,042.73	690,746,394.15
基金赎回款	-574,553,582.33	-112,850,176.90	-687,403,759.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	471,146,003.77	86,473,313.56	557,619,317.33
大成景安短融债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	103,995,292.07	18,094,282.51	122,089,574.58
本期利润	10,549,961.63	-3,135,121.92	7,414,839.71
本期基金份额交易产生的变动数	167,791,379.44	31,192,728.90	198,984,108.34
其中：基金申购款	286,705,410.37	52,033,392.35	338,738,802.72
基金赎回款	-118,914,030.93	-20,840,663.45	-139,754,694.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	282,336,633.14	46,151,889.49	328,488,522.63
大成景安短融债券 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	61,964,948.65	11,490,504.96	73,455,453.61
本期利润	8,121,647.48	984,337.13	9,105,984.61
本期基金份额交易产生的变动数	388,245,531.33	67,173,591.35	455,419,122.68
其中：基金申	510,654,549.65	90,598,771.24	601,253,320.89

购款			
基金赎回款	-122,409,018.32	-23,425,179.89	-145,834,198.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	458,332,127.46	79,648,433.44	537,980,560.90

6.4.3.11 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	28,031.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,222.22
结算备付金利息收入	3.54
其他	3.80
合计	29,260.98

6.4.3.12 股票投资收益

无。

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,648,793,750.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,575,401,022.37
减：应收利息总额	70,914,964.53
买卖债券差价收入	2,477,763.26

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

无。

6.4.3.16 股利收益

无。

6.4.3.17 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 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,894,471.77
股票投资	-
债券投资	-1,894,471.77
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	-1,894,471.77

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	569,846.29
基金转换费收入	1,170.53
合计	571,016.82

注：1）本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额计入基金资产。

2）本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	66,570.00
合计	66,570.00

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

银行划款手续费	33,871.85
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	156,897.99

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）

光大证券	-	-	60,000,000.00	100.00

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,284,551.97	5,279,779.62
其中：支付销售机构的客户维护费	943,816.17	1,344,719.92

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.40%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.40%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,499,593.17	1,847,922.89

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.14%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.14%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	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	合计
大成基金	446,778.51	33,605.35	3,217.45	483,601.31
光大证券	27.75	-	-	27.75
中国农业银行	44,233.99	28.09	-	44,262.08
合计	491,040.25	33,633.44	3,217.45	527,891.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	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	合计
光大证券	10.16	-	-	10.16
中国农业银行	251,601.43	289.51	-	251,890.94
大成基金	79,069.29	63,107.40	295.99	142,472.68
合计	330,680.88	63,396.91	295.99	394,373.78

注：本基金分设三级基金份额：A 级基金份额、B 级基金份额和 E 类基金份额。本基金对各类基金份额设置不同的销售服务费率。本基金 A 级基金份额的销售服务年费率为 0.30%，B 级基金份额的年费率为 0.01%，E 级基金份额的年费率为 0.10%。在通常情况下，某级的销售服务费按前一日该级基金资产净值计提。计算方法如下：

H=E×R/当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金财产净值

R 为该级基金对应的销售服务费年费率

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

中国农业银行	20,309,235.08	-	-	-	348,300,000.00	158,724.57
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	91,426,971.09	-	-	-	2,039,645,000.00	414,221.80

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 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
基金合同生效日（2013 年 5 月 24 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	84,419,761.39	-
报告期间申购/买入总份额	-	77,250,438.01	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	0.00	-

报告期末持有的基金份额	-	161,670,199.40	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	3.1500%	-
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 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
基金合同生效日（2013年5月24日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	52,073,004.15	-
报告期间申购/买入总份额	-	32,346,757.24	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	84,419,761.39	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	3.8896%	-

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	159,554,978.89	28,031.42	3,915,214.85	20,212.78

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。

6.4.9.2 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，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	490,536,000.00	230,677,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	2,619,448,200.00	1,170,791,000.00
合计	3,109,984,200.00	1,401,468,000.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为债券期限在一年及一年以内的短期融资券、政策性金融债。

3.债券投资以净价列示。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	177,539,000.00	29,775,000.00
合计	177,539,000.00	29,775,000.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.债券投资以净价列示。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	205,841,300.00	249,086,400.00
AAA 以下	447,328,908.00	544,460,835.10
未评级	328,602,000.00	-
合计	981,772,208.00	793,547,235.10

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为债券期限大于一年的国债、政策性金融债。

3.债券投资以净价列示。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指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。

6.4.9.3.1 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，约定在非正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。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约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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	179,554,978.89	-	-	-	179,554,978.89
交易性金融资产	3,997,357,108.00	174,058,300.00	97,880,000.00	-	4,269,295,408.00
买入返售金融资产	2,025,360,683.30	-	-	-	2,025,360,683.30
应收利息	-	-	-	49,869,978.45	49,869,978.45
应收申购款	-	-	-	37,868,680.87	37,868,680.87
资产总计	6,202,272,770.19	174,058,300.00	97,880,000.00	87,738,659.32	6,561,949,729.51
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,028,554.53	1,028,554.53
应付托管费	-	-	-	359,994.06	359,994.06
应付销售服务费	-	-	-	348,792.62	348,792.62
应付交易费用	-	-	-	82,469.08	82,469.08
应交税费	-	-	-	255,258.92	255,258.92
其他负债	-	-	-	235,226.14	235,226.14
负债总计	-	-	-	2,310,295.35	2,310,295.35
利率敏感度缺口	6,202,272,770.19	174,058,300.00	97,880,000.00	85,428,363.97	6,559,639,434.16
上年度末 2019 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	1,973,493.09	-	-	-	1,973,493.09
结算备付金	39,331.57	-	-	-	39,331.57
存出保证金	811.28	-	-	-	811.28
交易性金融资产	1,990,662,112.70	234,128,122.40	-	-	2,224,790,235.10
买入返售金融资产	1,229,551,124.31	-	-	-	1,229,551,124.31
应收利息	-	-	-	27,359,478.28	27,359,478.28
应收申购款	-	-	-	198,215,848.05	198,215,848.05
资产总计	3,222,226,872.95	234,128,122.40	-	225,575,326.33	3,681,930,321.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	617,783.54	617,783.54
应付托管费	-	-	-	216,224.22	216,224.22
应付销售服务费	-	-	-	296,464.62	296,464.62
应付交易费用	-	-	-	56,316.93	56,316.93
应交税费	-	-	-	165,359.74	165,359.74
其他负债	-	-	-	220,800.00	220,800.00
负债总计	-	-	-	1,572,949.05	1,572,949.05

利率敏感度缺口	3,222,226,872.95	234,128,122.40		-224,002,377.28	3,680,357,372.63

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 6 月 30 日）	上年度末 （2019 年 12 月 31 日 ）
分析	利率上升 25 个基准点	-6,510,200.00	-2,350,000.00
	利率下降 25 个基准点	6,682,900.00	2,360,000.00

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置范围为：对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金对短期融资券、超级短期融资券和剩余期限在 1 年之内的中期票据、公司债、企业债的投资比例合计不低于非现金基金资产的 80%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金未持有交易性权益类投资（上年度末：同），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,269,295,408.00	65.06
	其中：债券	4,269,295,408.00	65.06
	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	2,025,360,683.30	30.87
	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	179,554,978.89	2.74
8	其他各项资产	87,738,659.32	1.34
9	合计	6,561,949,729.51	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

无。

7.4.2 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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	197,790,000.00	3.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	240,195,000.00	3.66
	其中：政策性金融债	240,195,000.00	3.66
4	企业债券	27,600,908.00	0.42
5	企业短期融资券	3,000,601,200.00	45.74
6	中期票据	625,569,300.00	9.54
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	177,539,000.00	2.71
9	其他	-	-
10	合计	4,269,295,408.00	65.08

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	012000404	20 中航租赁 SCP002	1,100,000	110,132,000.00	1.68
2	011902945	19 桂投资 SCP007	1,000,000	100,500,000.00	1.53
3	170209	17 国开 09	1,000,000	100,460,000.00	1.53
4	012000361	20 齐鲁交通 SCP002	1,000,000	100,220,000.00	1.53
5	072000157	20 东吴证券 CP007	1,000,000	100,010,000.00	1.52

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,869,978.45
5	应收申购款	37,868,680.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,738,659.32

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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（%）
大成景安短融债券A	178,809	11,701.06	1,425,275,465.70	68.12	666,979,268.20	31.88
大成景安短融债券B	33	33,663,794.77	1,110,420,199.77	99.96	485,027.73	0.04
大成景安短融债券E	159,877	12,086.74	1,070,521,287.26	55.40	861,869,784.64	44.60
合计	338,719	15,161.69	3,606,216,952.73	70.22	1,529,334,080.57	29.78

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	大成景安短融债券 A	20,952.23	0.0010
	大成景安短融债券 B	0.00	0.0000
	大成景安短融债券 E	38,753.90	0.0020
	合计	59,706.13	0.0012

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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	份额级别	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	大成景安短融债券 A	0~10
	大成景安短融债券 B	0
	大成景安短融债券 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成景安短融债券 A	0
	大成景安短融债券 B	0
	大成景安短融债券 E	0
	合计	0

§9 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
基金合同生效日（2013 年 5 月 24 日）基金份额总额	2,674,262,264.64	1,780,127,988.33	-
本报告期期初基金份额总额	2,207,338,052.04	449,669,156.92	287,842,071.36
本报告期基金总申购份额	2,619,457,820.63	1,150,129,440.30	2,175,849,784.32
减：本报告期基金总赎回份额	2,734,541,138.77	488,893,369.72	531,300,783.78
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	2,092,254,733.90	1,110,905,227.50	1,932,391,071.90

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 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

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。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。

10.6 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、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	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：

（1）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；

（2）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；

（3）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；

（4）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；

（5）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；

（6）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专用席位。

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：

本报告期内退租交易单元：长城证券；

本报告期内新增交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 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	大成景安短融债券型证券投资基金更新招募说明书及摘要	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 24 日
2	关于大成景安短融债券型证券投资基金 A 类份额增加江海证券有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 22 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 22 日
4	关于大成景安短融债券型证券投资基金 E 类份额增加诺亚正行基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 17 日
5	大成景安短融债券型证券投资基金更新招募说明书及摘要	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 17 日
6	大成景安短融债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 16 日
7	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 6 月 5 日
8	关于大成景安短融债券型证券投资基金 E 类份额增加兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 26 日
9	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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 22 日
10	关于大成景安短融债券型证券投资基金 E 类份额增加奕丰基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 13 日
11	大成景安短融债券型证券投资基金更新招募说明书及摘要	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 5 月 8 日
12	大成景安短融债券型证券投资基金增聘基金经理的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本	2020 年 5 月 7 日

		公司网站	
13	大成景安短融债券型证券投资基金 2019 年年度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 29 日
14	大成基金管理有限公司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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 25 日
15	大成景安短融债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 4 月 22 日
16	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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 25 日
17	大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 21 日
18	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 3 月 13 日
19	大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 29 日
20	大成基金管理有限公司关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 2 月 26 日
21	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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 30 日
22	大成景安短融债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2020 年 1 月 17 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20200312-20200327	-	291,519,820.34	240,000,000.00	51,519,820.34	1.00
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 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 8 月 28 日