鑫元合丰纯债债券型证券投资基金
2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 日

§1 重要提示

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。本半年度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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

根据基金合同的规定，本基金于 2016 年 12 月 27 日转型为开放式债券型证券投资基金，即“鑫元合丰纯债债券型证券投资基金”，份额分级运作终止，转型后基金的投资管理，包括投资范围、投资策略等均保持不变。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鑫元合丰纯债	
基金主代码	000911	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 27 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,608,616,337.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	鑫元合丰纯债 A	鑫元合丰纯债 C
下属分级基金的交易代码：	000911	000910
报告期末下属分级基金的份额总额	1,598,607,671.99 份	10,008,665.48 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保证适当流动性的前提下，通过合理配置债券等固定收益类金融工具并进行积极主动的投资管理，力争取得超越基金业绩比较基准的收益，为投资者创造稳定的投资收益。
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，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，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	二年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金、但高于货币市场基金。

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		鑫元基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	胡波
	联系电话	021-20892000 转	021-61618888
	电子邮箱	service@xyamc.com	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4006066188	95528
传真		021-20892111	021-63602540

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xyamc.com
基金半年度报告备置地点	上海市静安区中山北路 909 号 12 层 鑫元基金管理有限公司

§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

基金级别	鑫元合丰纯债 A	鑫元合丰纯债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	33,394,710.92	171,090.34
本期利润	24,067,638.59	139,486.03
加权平均基金份额本期利润	0.0127	0.0139
本期基金份额净值增长率	1.42%	1.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1808	0.1790
期末基金资产净值	1,637,414,543.01	10,223,812.83
期末基金份额净值	1.0243	1.0215

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认购或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）期末可供分配利润为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。

（4）2016 年 12 月 27 日鑫元合丰分级债券型证券投资基金转型为鑫元合丰纯债债券型证券投资基金。

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

鑫元合丰纯债 A

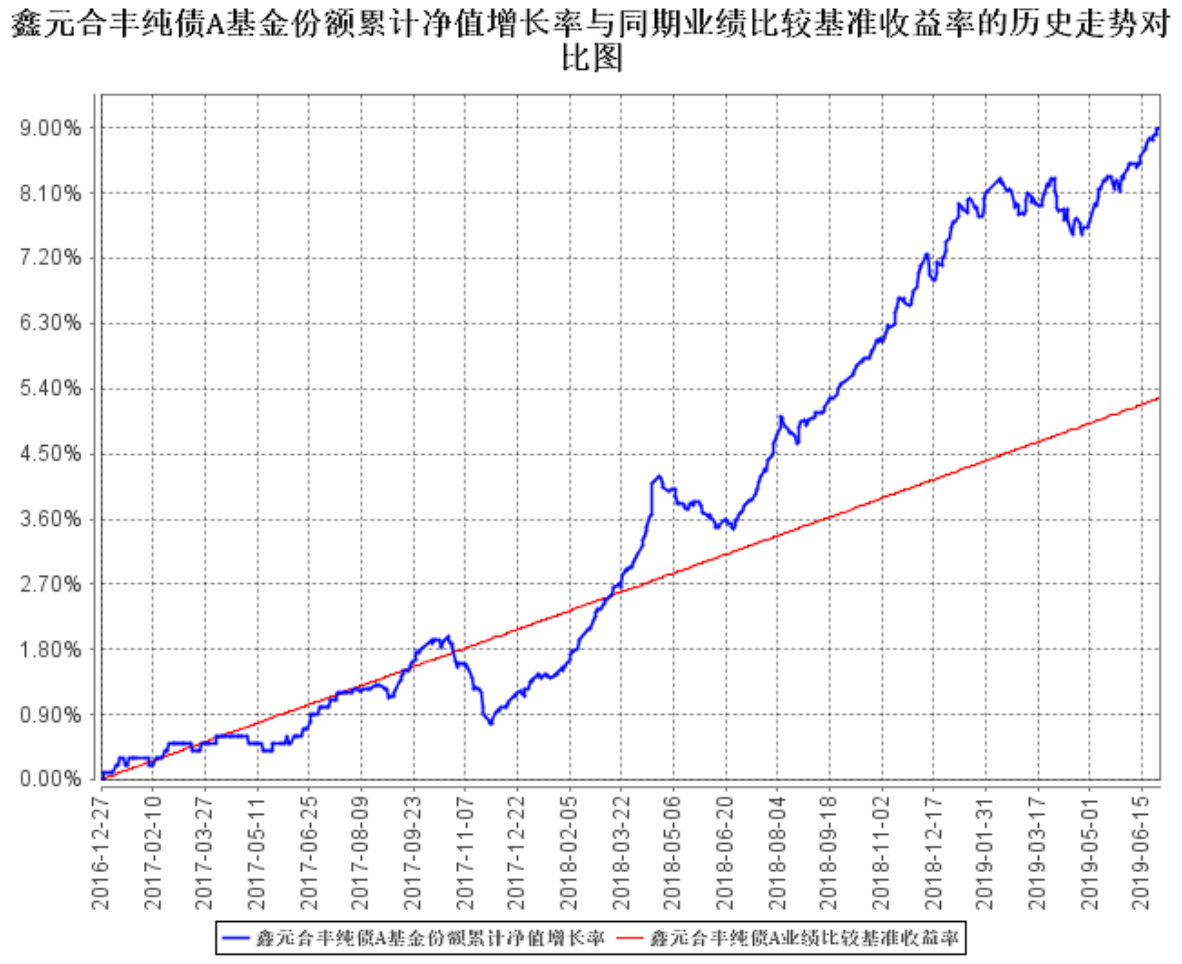
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.60%	0.04%	0.17%	0.01%	0.43%	0.03%
过去三个月	0.64%	0.08%	0.52%	0.01%	0.12%	0.07%
过去六个月	1.42%	0.07%	1.04%	0.01%	0.38%	0.06%
过去一年	5.22%	0.06%	2.10%	0.01%	3.12%	0.05%

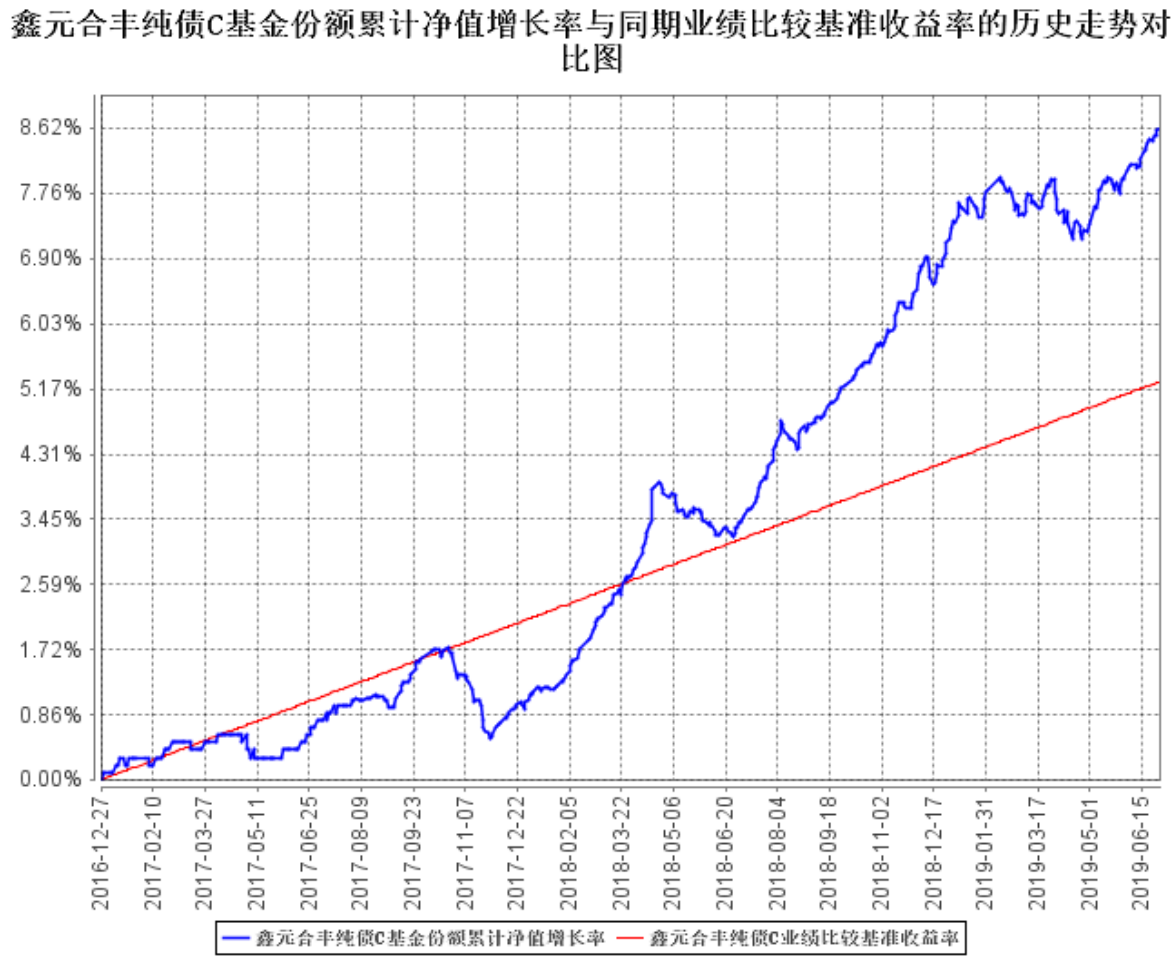
自基金合同生效起至今	9.00%	0.06%	5.27%	0.01%	3.73%	0.05%

鑫元合丰纯债 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
过去一个月	0.59%	0.04%	0.17%	0.01%	0.42%	0.03%
过去三个月	0.61%	0.08%	0.52%	0.01%	0.09%	0.07%
过去六个月	1.37%	0.07%	1.04%	0.01%	0.33%	0.06%
过去一年	5.11%	0.06%	2.10%	0.01%	3.01%	0.05%
自基金合同生效起至今	8.62%	0.06%	5.27%	0.01%	3.35%	0.05%

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





注：1. 鑫元合丰分级债券型证券投资基金的合同生效日为 2014 年 12 月 16 日。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

2. 2016 年 12 月 27 日鑫元合丰分级债券型证券投资基金转型为鑫元合丰纯债债券型证券投资基金。

§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

本基金管理人为鑫元基金管理有限公司，本公司经中国证监会证监许可[2013]1115 号文批准于 2013 年 8 月成立，由南京银行股份有限公司发起，与南京高科股份有限公司联合组建；注册资本金 17 亿元人民币，总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理（包括特定对象投资咨询）和中国证监会许可的其他业务。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司旗下管理 34 只证券投资基金——鑫元货币市场基金、鑫元恒鑫收益增强债券型证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元合享纯债债券型证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元添利债券型证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金、鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元臻利债券型证券投资基金、鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元永利债券型证券投资基金。

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		
颜昕	鑫元安鑫宝货	2016 年 3 月 2 日	-	10 年	学历：工商管理，硕士。相关业务资格：证券投资

	币市场基金、鑫元货币市场基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元瑞利				基金从业资格。从业经历：2009 年 8 月，任职于南京银行股份有限公司，担任交易员。2013 年 9 月加入鑫元基金担任交易员，2014 年 2 月至 8 月担任鑫元基金交易室主管，2014 年 9 月担任鑫元货币市场基金的基金经理助理，2015 年 6 月 26 日起担任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理，2015 年 7 月 15 日起担任鑫元货币市场基金的基金经理，2016 年 1 月 13 日起担任鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金（原鑫元兴利债券型证券投资基金）的基金经理，2016 年 3 月 2 日至 2019 年 1 月 21 日担任鑫元合享纯债债券型证券投资基金（原鑫元合享分级债券型证券投资基金）的基金经理，2016 年 3 月 2 日起担任鑫元合丰纯债债券型证券投资基金（原鑫元合丰分级债券型证券投资基金）的基金经理，2016 年 3 月 9 日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 6 月 3 日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 7 月 13 日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月 17 日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月 27 日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月 22 日起担任鑫元招利债券型证券投资

	定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元添利债券型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元荣				基金的基金经理，2017 年 3 月 13 日起担任鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金（原鑫元瑞利债券型证券投资基金）的基金经理，2017 年 3 月 17 日起担任鑫元添利债券型证券投资基金的基金经理，2017 年 12 月 13 日起担任鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018 年 3 月 22 日起担任鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018 年 4 月 19 日起担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月 25 日起担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018 年 7 月 11 日起担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2019 年 1 月 24 日起担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2019 年 3 月 1 日起担任鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月 30 日起担任鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2019 年 5 月 9 日起担任鑫元永利债券型证券投资基金的基金经理。

	利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元永利债券型证券投资基金的基金经理				
王海燕	鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元合享纯债债券型证券投资基金的基金经理；兼任固定收益部总监、首席固收投资官、	2018 年 10 月 19 日	-	22 年	学历：高级管理人员工商管理硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：1997 年 7 月至 2005 年 9 月在中信证券股份有限公司任职，2005 年 10 月至 2011 年 11 月任北京高华证券有限责任公司执行董事，2011 年 12 月至 2018 年 3 月任湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司固定收益投资总监。2018 年 4 月加入鑫元基金担任固定收益部总监兼首席固收投资官，2018 年 10 月 19 日起担任鑫元合丰纯债债券型证券投资

	基金投资决策委员会委员				基金的基金经理，2019 年 1 月 21 日起担任鑫元合享纯债债券型证券投资基金的基金经理；同时兼任基金投资决策委员会委员。

注：1. 基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离职日期为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任基金经理，任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

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，本公司继续严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易管理的各项制度规范，进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现有违公平交易要求的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制订《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，通过系统和人工相结合的方式进行基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，未出现涉及本基金的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证券当日成交量 5%的情况。

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

本基金当前执行纯利率债配置策略，投资范围仅限于国债、地方政府债、央票、政策性金融债等利率债品种。报告期内考虑到债市延续牛市的政策判断大前提“稳中调结构，政策有定力，时间换空间”没有改变，政策面仍是结构性宽信用政策，操作中整体采取中性久期策略。操作上主要根据产品规模的变化、利率走势的变化动态调整组合久期和杠杆比例。本基金将延续纯利率债配置策略，根据收益率走势的判断灵活调整组合久期，并合理安排流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元合丰纯债 A 的基金份额净值增长率为 1.42%；鑫元合丰纯债 C 的基金份额净值增长率为 1.37%；同期业绩比较基准收益率为 1.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、宏观基本面：继续小幅探底但失速下滑的可能性较小。

房地产投资已现疲态，宽财政政策推动下半年基建投资托底；通胀压力整体可控，对政策制约有限；贸易战对经济基本面的影响是重要变量。

2、财政政策面：逆周期调节仍是主线，但该来的还是会来。

回顾今年整体央行的操作来看，相较于 2018 年的全面宽松而言，今年货币政策回归至“稳货币”的政策取向，由于货币政策受制于多目标的平衡，风格更倾向于逆周期调节相机抉择。在 1 季度社融数据和经济数据企稳之后，央行在 4 月份已转向边际收紧，但 5 月份贸易战重启之后经济急转直下，叠加 5 月底以来的流动性分层又导致央行再度投放流动性对冲。即使贸易战导致的不确定性上升，我们认为下半年货币政策仍有一些较为确定性的东西，该来的还是会来：第一，进一步定向降准或全面降准。第二，“利率两轨并一轨”提上日程，进一步降低实体融资成本。第三，针对中小银行提供定向流动性支持，避免金融供给侧改革过程中信用收缩带来的系统性风险。

3、市场供求分析：需求才是主导趋势的核心。

其实纵观过去的几轮债券牛市，市场经常出现“供需两旺”的情形，由于债券的供给有内生调节特点（需求少时市场发行自然会缩量），供给更多影响的是波动节奏，而需求的变化才是影响趋势的核心因素。下半年，我们应着重观测影响市场真实需求的几个重要变量：第一，基本面预期和市场风险偏好的变动带来需求变化。第二，机构自身需求的萎缩与分化。金融供给侧改革中，

中小金融机构破刚兑是一件长期的事情，而市场容易将长期问题短期化从而带来大幅波动，这与目前的政策维稳降低融资成本取向不相符。所以虽然同业负债依存度较高的中小银行有缩表压力，但短期内起码今年并不会表现得很迅速，更值得关注的是负债成本分化引发的需求问题。从这个角度来看，大型银行对利率债和高评级信用债的配置需求几乎不受此影响，中小银行的需求会分化得更明显，一方面体现在对高流动性资产的需求上升，另一方面体现在对低评级信用资产要求更高的流动性溢价补偿。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。成员包括公司总经理、基金运营部分管领导、固定收益部和权益投研部分管领导、督察长、固定收益部负责人、权益投研部负责人、监察稽核部负责人、交易部负责人、基金运营部负责人等，对公司依法受托管理资产的投资品种估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。本公司的基金估值和会计核算由基金运营部负责实施，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金运营部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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，由其按约定分别提供银行间债券市场及证券交易所上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律和基金合同以及基金实际运作情况，2019 年 2 月 15 日本基金 A 类基金份额每 10 份派发红利 0.190 元，C 类基金份额每 10 份派发红利 0.190 元。截止报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鑫元合丰纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对鑫元合丰纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行一次利润分配，合丰纯债 A 分配金额为 41,374,105.72 元，合丰纯债 C 分配金额为 190,283.32 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由鑫元基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：鑫元合丰纯债债券型证券投资基金

报告截止日： 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	509,113.88	31,254,679.93
结算备付金		-	145,706.98
存出保证金		1,839.42	4,663.53
交易性金融资产	6.4.7.2	1,761,400,739.30	857,538,220.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,761,400,739.30	857,538,220.40
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	-	505,793,118.68
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	29,701,642.68	21,590,609.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,791,613,335.28	1,416,326,999.34
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019 年 6 月 30 日**	**上年度末 2018 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		143,249,465.12	-
应付证券清算款		-	12,342,416.22
应付赎回款		299.87	-
应付管理人报酬		404,966.23	197,698.31
应付托管费		134,988.73	65,899.43
应付销售服务费		837.70	870.46
应付交易费用	6.4.7.7	12,317.80	20,890.23

应交税费		-	-
应付利息		62,171.97	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,932.02	249,000.00
负债合计		143,974,979.44	12,876,774.65
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,356,741,643.63	1,150,609,178.25
未分配利润	6.4.7.10	290,896,712.21	252,841,046.44
所有者权益合计		1,647,638,355.84	1,403,450,224.69
负债和所有者权益总计		1,791,613,335.28	1,416,326,999.34

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,608,616,337.47 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0243 元，份额总额 1,598,607,671.99 份；下属 C 类基金份额净值 1.0215 元，份额总额 10,008,665.48 份。

6.2 利润表

会计主体：鑫元合丰纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		28,819,958.74	8,260,716.24
1.利息收入		39,222,577.18	7,359,304.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	197,897.15	140,405.51
债券利息收入		37,404,665.89	7,170,873.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,620,014.14	48,025.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,099,599.44	188,240.41
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	-1,099,599.44	188,240.41
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	-9,358,676.64	713,171.37
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	55,657.64	0.10
减：二、费用		4,612,834.12	1,345,912.13
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,905,150.31	453,579.07
2．托管费	6.4.10.2.2	968,383.41	151,193.00
3．销售服务费	6.4.10.2.3	5,054.29	82.90
4．交易费用	6.4.7.19	19,261.70	3,675.00
5．利息支出		547,238.45	569,871.43
其中：卖出回购金融资产支出		547,238.45	569,871.43
6．税金及附加		-	19,209.37
7．其他费用	6.4.7.20	167,745.96	148,301.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,207,124.62	6,914,804.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,207,124.62	6,914,804.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元合丰纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,150,609,178.25	252,841,046.44	1,403,450,224.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,207,124.62	24,207,124.62
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）	206,132,465.38	55,412,930.19	261,545,395.57
其中：1.基金申购款	695,084,312.17	155,705,270.51	850,789,582.68
2.基金赎回款	-488,951,846.79	-100,292,340.32	-589,244,187.11

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）	-	-41,564,389.04	-41,564,389.04
五、期末所有者权益（基金净值）	1,356,741,643.63	290,896,712.21	1,647,638,355.84
项目	**上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	249,241,619.34	50,930,559.15	300,172,178.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,914,804.11	6,914,804.11
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）	-25,308.15	-7,789.71	-33,097.86
其中：1.基金申购款	894,844.18	197,765.12	1,092,609.30
2.基金赎回款	-920,152.33	-205,554.83	-1,125,707.16
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）	249,216,311.19	57,837,573.55	307,053,884.74

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：

张乐赛　　陈宇　　包颖

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 基金基本情况

鑫元合丰纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原鑫元合丰分级债券型证券投

资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]1194 号《关于核准鑫元合丰分级债券型证券投资基金注册的批复》核准,由鑫元基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元合丰分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 232,714,295.48 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 773 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鑫元合丰分级债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 232,724,316.98 份,其中认购资金利息折合 10,021.50 份基金份额。原基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《鑫元合丰分级债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，原基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即合丰 A 基金份额(基金份额简称“合丰 A”)与合丰 B 基金份额(基金份额简称“合丰 B”)。

根据《鑫元合丰分级债券型证券投资基金基金合同》以及鑫元基金管理有限公司披露的《鑫元基金管理有限公司关于鑫元合丰分级债券型证券投资基金第一个分级运作周期到期申购、赎回结果及转型为鑫元合丰纯债债券型证券投资基金的公告》，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金无需召开基金份额持有人大会，于 2016 年 12 月 27 日直接转型为普通开放式债券型证券投资基金，份额分级运作终止，转型后基金的投资管理，包括投资范围、投资策略等均保持不变。原合丰 A 转为转型后基金的 C 类份额(基金份额简称“合丰纯债 C”)，并适用 C 类份额费率结构及收费方式，即转型后的合丰纯债 C 收取销售服务费而不收取申购费；原合丰 B 转为转型后基金的 A 类份额(基金份额简称“合丰纯债 A”)，并适用 A 类份额费率结构及收费方式，即转型后的合丰纯债 A 收取申购费而不收取销售服务费。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，基金管理人对基金合同进行了修订，并对赎回费相关规则进行了调整。该修订自 2018 年 3 月 31 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元合丰纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、银行存款等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中

国证监会相关规定)。本基金不参与买入股票和权证。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。现金或者到期日在一年内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：二年期银行定期存款收益率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 增值税

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]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内不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。

6.4.7.2 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
鑫元基金管理有限公司（“鑫元基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
南京银行股份有限公司（“南京银行”）	基金管理人股东
鑫沅资产管理有限公司（“鑫沅资产”）	基金管理人子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：无。

6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,905,150.31	453,579.07
其中：支付销售机构的客户维护费	24.81	96.10

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 0.30%的年费率计提。其计算公式为：

H=E×0.30%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	968,383.41	151,193.00

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3 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 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		
	鑫元合丰纯债 A	鑫元合丰纯债 C	合计
鑫元基金	-	5,037.36	5,037.36
合计	-	5,037.36	5,037.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元合丰纯债 A	鑫元合丰纯债 C	合计
鑫元基金	-	18.17	18.17
合计	-	18.17	18.17

注：基金的销售服务费按前一日的合丰纯债 C 类基金份额对应的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

H=E×0.10%÷当年天数

H 为合丰纯债 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为合丰纯债 C 类份额前一日的基金资产净值

6.4.8.3 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 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
浦发银行	41,507,129.86	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.8.4.2 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

份额单位：份

鑫元合丰纯债 A				
关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南京银行	676,228,103.41	42.0379%	676,228,103.41	49.5696%

份额单位：份

鑫元合丰纯债 C				
关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
鑫沅资产	9,959,167.41	0.6191%	9,959,167.41	0.7300%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
浦发银行	509,113.88	197,444.92	16,318,359.61	131,542.03

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 143,249,465.12 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170205	17 国开 05	2019 年 7 月 3 日	100.88	250,000	25,220,000.00
180409	18 农发 09	2019 年 7 月 3 日	102.04	435,000	44,387,400.00
180202	18 国开 02	2019 年 7 月 3 日	101.12	800,000	80,896,000.00
合计				1,485,000	150,503,400.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 公允价值

6.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 1,761,400,739.30 元，无划分为第一层次和第三层次的余额。（于 2018 年 12 月 31 日，属于第二层次的余额为人民币 857,538,220.40 元，无划分为第一层次和第三层次的余额。）

6.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

6.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 8 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§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	1,761,400,739.30	98.31
	其中：债券	1,761,400,739.30	98.31
	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	509,113.88	0.03
8	其他各项资产	29,703,482.10	1.66
9	合计	1,791,613,335.28	100.00

7.2 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

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,761,400,739.30	106.90
	其中：政策性金融债	1,761,400,739.30	106.90
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	1,761,400,739.30	106.90

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	180208	18 国开 08	2,900,000	295,104,000.00	17.91
2	180205	18 国开 05	2,700,000	290,277,000.00	17.62
3	180204	18 国开 04	2,600,000	271,674,000.00	16.49
4	180212	18 国开 12	2,600,000	262,912,000.00	15.96
5	160206	16 国开 06	1,300,000	129,766,000.00	7.88

7.7 期末按公允价值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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：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

7.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	1,839.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,701,642.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,703,482.10

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§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
鑫元合丰纯债A	110	14,532,797.02	1,598,546,521.24	100.00%	61,150.75	0.00%
鑫元合丰纯债C	123	81,371.26	9,959,167.41	99.51%	49,498.07	0.49%
合计	233	6,903,932.78	1,608,505,688.65	99.99%	110,648.82	0.01%

注：目前系统仅能保留四位小数。期末鑫元合丰纯债 A 类基金份额的机构投资者占鑫元合丰纯债 A 类基金份额总额比例实际为 99.9962%，个人投资者占鑫元合丰纯债 A 类基金份额总额比例实际为 0.0038%。

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	鑫元合丰纯债 A	54,754.31	0.0034%
	鑫元合丰纯债 C	7,842.51	0.0784%
	合计	62,596.82	0.0039%

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的情况

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	鑫元合丰纯债 A	0~10
	鑫元合丰纯债 C	0~10
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元合丰纯债 A	0~10
	鑫元合丰纯债 C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元合丰纯债 A	鑫元合丰纯债 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 27 日）基金份额总额	25,000,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	1,354,182,545.11	10,015,324.29
本报告期期间基金总申购份额	824,132,616.12	872.40
减:本报告期期间基金总赎回份额	579,707,489.24	7,531.21
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,598,607,671.99	10,008,665.48

注：2016 年 12 月 27 日鑫元合丰分级债券型证券投资基金转型为鑫元合丰纯债债券型证券投资基金。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2019 年 5 月 9 日鑫元合丰纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议通过了《关于鑫元合丰纯债债券型证券投资基金调整基金赎回费率有关事项的议案》，审议内容为调整基金赎回费率。大会决议自该日起生效，调整后的基金赎回费率自基金份额持有人大会决议生效后的次日即 2019 年 5 月 10 日起正式实施。详情请见基金管理人于指定媒介上披露的相关公告。

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

1、本报告期内，基金管理人副总经理李雁因个人原因，不能正常履职。基金管理人已于第一时间指定专人负责其工作。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

1、本报告期内，基金管理人副总经理李雁因个人原因，不能正常履职。基金管理人已于第一时间指定专人负责其工作。

2、本报告期内，基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
天风证券	2	-	-	648.97	100.00%	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

注：（1）交易单元的主要选择标准：

1）财务状况良好，经营行为规范；

2）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；

3）具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；

4）收取的交易佣金费率合理。

（2）交易单元的选择程序：

1）投资研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；

2）交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。

（3）报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	5,593,470.70	100.00%	59,300,000.00	100.00%	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

§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	20190101-20190630	676,228,103.41	0.00	0.00	676,228,103.41	42.04%
	2	20190101-20190108	292,368,190.23	0.00	0.00	292,368,190.23	18.18%
	3	20190101-20190108	297,677,118.48	0.00	297,677,118.48	0.00	0.00%
	4	20190129-20190630	0.00	484,589,067.65	0.00	484,589,067.65	30.12%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险
本基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的 20%，中小投资者在投资本基金时可能面临以下风险： （一）赎回申请延期办理或暂停赎回的风险 单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，因此当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。 （二）基金净值大幅波动的风险 单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。 （三）基金投资目标偏离的风险 单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。 （四）基金合同提前终止或其它相关风险 《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情况的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。因此，在极端情况下，当单一投资者大量赎回本基金后，可能造成基金资产净值大幅缩减，对本基金的继续存续产生决定性影响。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019 年 5 月 9 日，鑫元合丰纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议通过了《关于鑫元合丰纯债债券型证券投资基金调整基金赎回费率有关事项的议案》，审议内容为调整基金赎回费率。大会决议自该日起生效，调整后的基金赎回费率自基金份额持有人大会决议生效后的次日即 2019 年 5 月 10 日起正式实施。详情请见基金管理人于指定媒介上披露的相关公告。

鑫元基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日