

# 鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>23</b>
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>60</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
8.3 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.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
8.6 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.....	76
8.7 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.....	76

8.8 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 .....	76
8.9 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 .....	77
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	77
8.12 投资组合报告附注 .....	77
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>79</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
9.3 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 .....	79
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	79
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>81</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>82</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	82
11.2 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 .....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	82
11.4 基金投资策略的改变 .....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	82
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	82
11.8 其他重大事件 .....	83
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>87</b>
12.1 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 .....	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	87
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>89</b>
13.1 备查文件目录 .....	89
13.2 存放地点 .....	89
13.3 查阅方式 .....	89

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金	
基金简称	鑫元核心资产	
基金主代码	006193	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 14 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	120,492,087.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C
下属分级基金的交易代码:	006193	006194
报告期末下属分级基金的份额总额	120,209,676.18 份	282,411.56 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在秉承价值投资理念的前提下，把握市场发展趋势并严格控制投资组合风险，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估中国 A 股、港股、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	郭明
	联系电话	021-20892000 转	(010) 66105799
	电子邮箱	service@xyamc.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006066188	95588
传真		021-20892111	(010) 66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区浦东大道1200号2层217室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市静安区中山北路909	北京市西城区复兴门内大街 55

	号 12 层	号
邮政编码	200070	100140
法定代表人	肖炎	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyamc.com">http://www.xyamc.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市静安区中山北路 909 号 12 层 鑫元基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	鑫元基金管理有限公司	上海市静安区中山北路 909 号 12 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2019 年		2018 年 11 月 14 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日		2017 年	
	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C
本期已实现收益	2,250,940.66	17,780.45	-97,502.45	-9,355.90	-	-
本期利润	9,010,082.40	84,355.26	-90,901.50	-8,804.25	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.2208	0.1359	-0.0066	-0.0076	-	-
本期加权平均净值利润率	20.88%	13.39%	-0.66%	-0.76%	-	-
本期基金份额净值增长率	13.27%	13.05%	-0.66%	-0.76%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期末可供分配利润	3,127,663.01	6,426.51	-97,502.45	-9,355.90	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0260	0.0228	-0.0070	-0.0081	-	-
期末基金资产净值	135,261,334.58	316,825.09	13,741,806.27	1,150,490.73	-	-
期末基金份额净值	1.1252	1.1219	0.9934	0.9924	-	-
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	12.52%	12.19%	-0.66%	-0.76%	-	-

注：1、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。

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、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。

### 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

鑫元核心资产 A

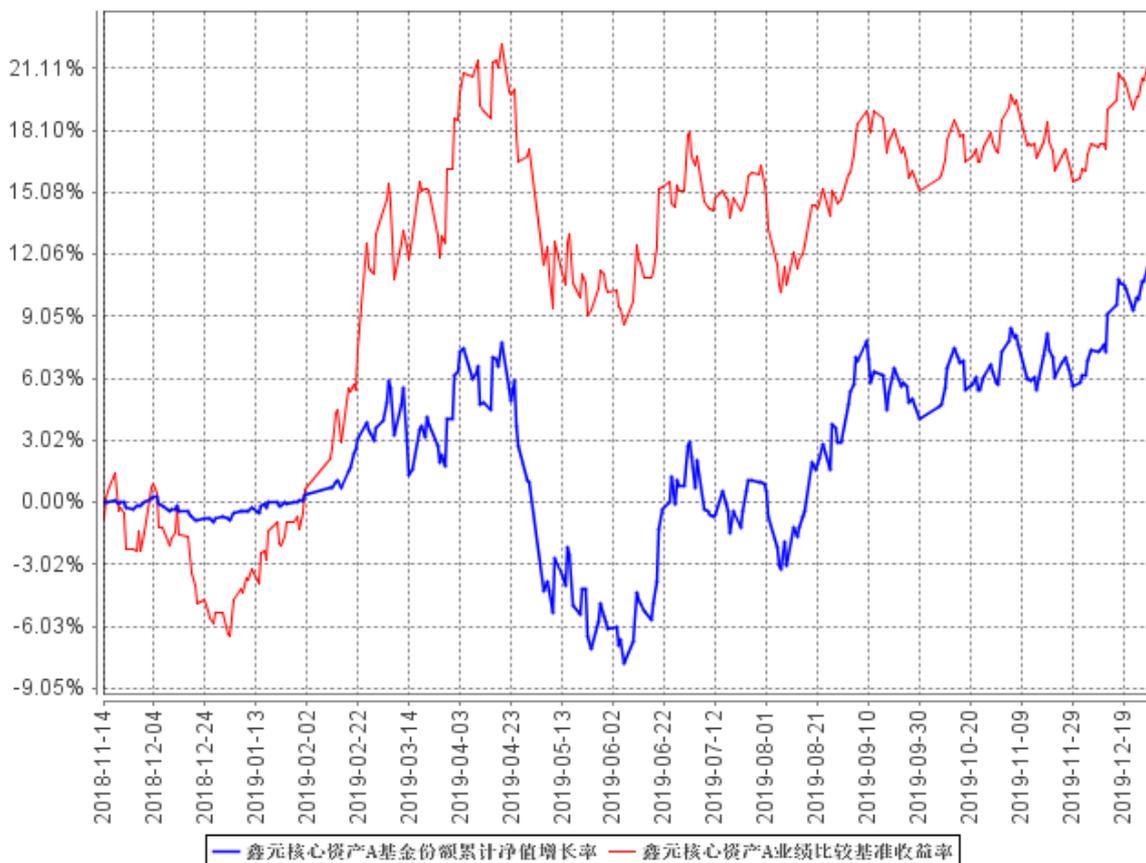
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.12%	0.65%	6.11%	0.59%	2.01%	0.06%
过去六个月	11.65%	0.83%	6.12%	0.69%	5.53%	0.14%
过去一年	13.27%	0.98%	29.73%	1.00%	-16.46%	-0.02%
自基金合同生效起至今	12.52%	0.92%	22.33%	0.99%	-9.81%	-0.07%

鑫元核心资产 C

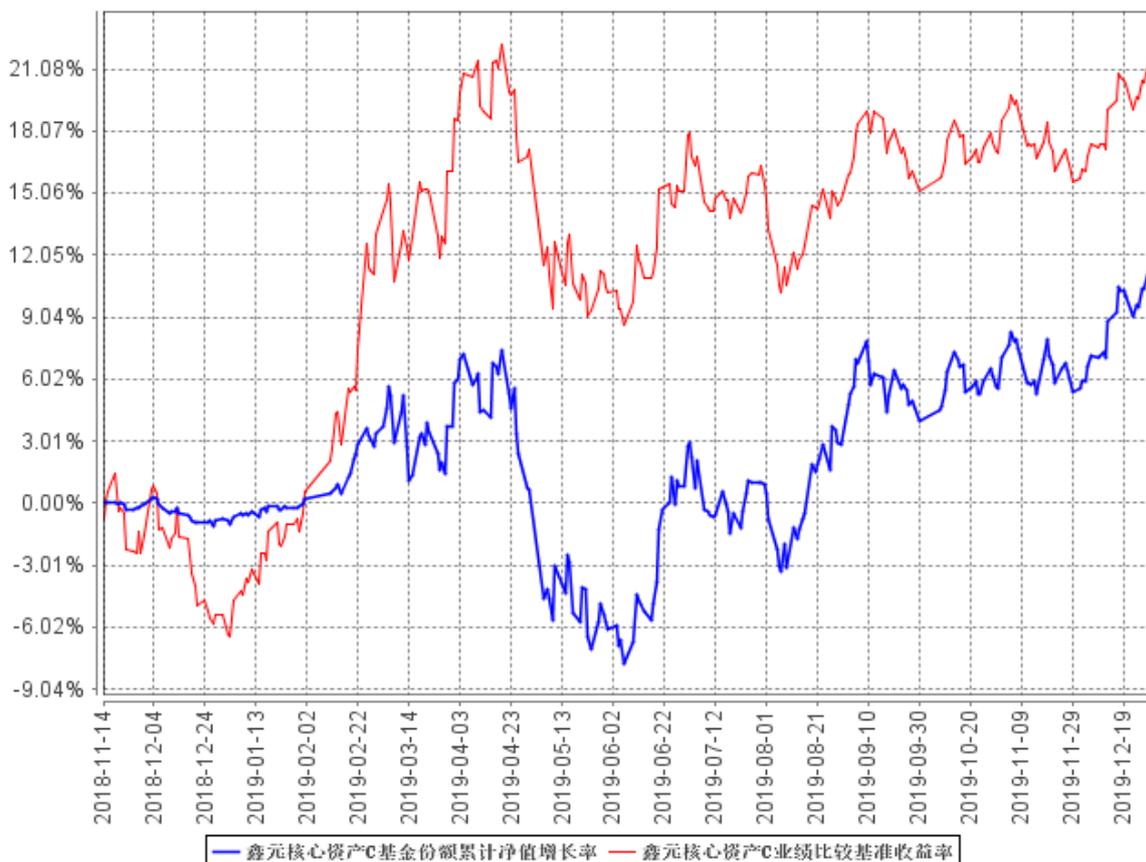
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.90%	0.65%	6.11%	0.59%	1.79%	0.06%
过去六个月	11.31%	0.83%	6.12%	0.69%	5.19%	0.14%
过去一年	13.05%	0.98%	29.73%	1.00%	-16.68%	-0.02%
自基金合同生效起至今	12.19%	0.92%	22.33%	0.99%	-10.14%	-0.07%

### 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

鑫元核心资产A基金份额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



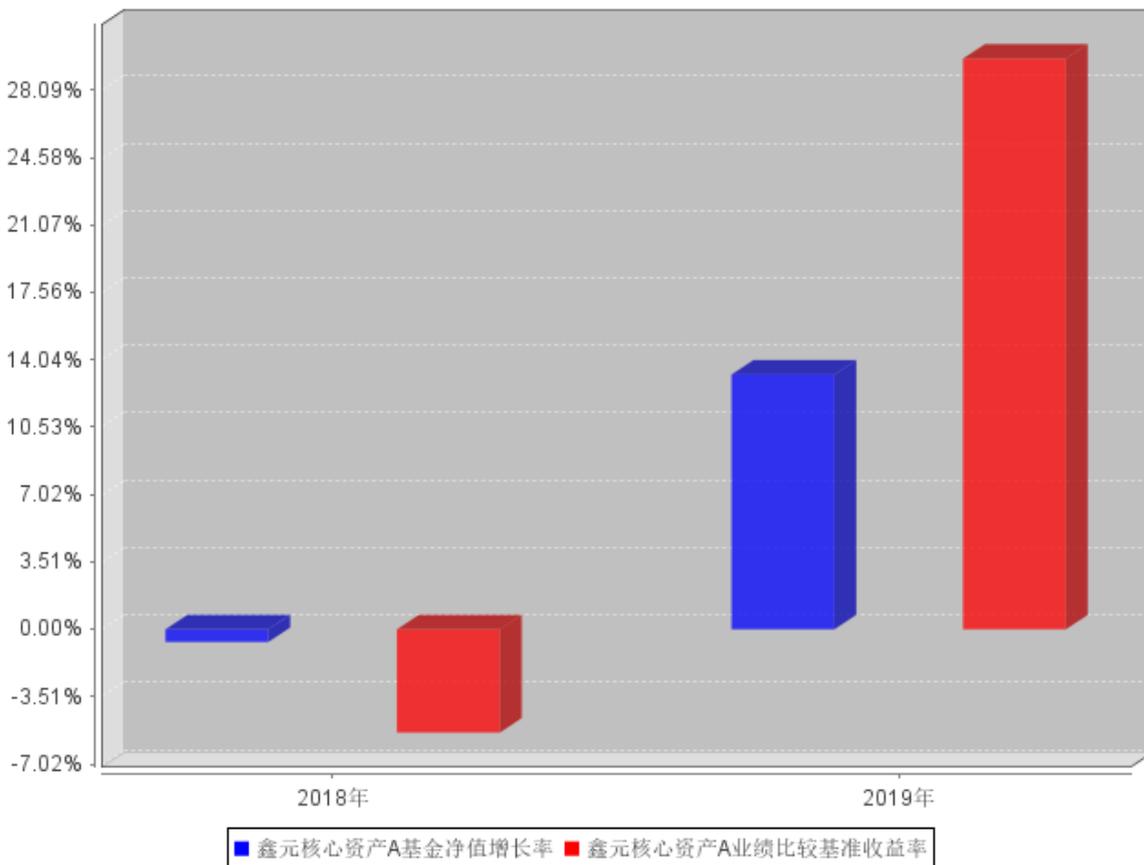
鑫元核心资产C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



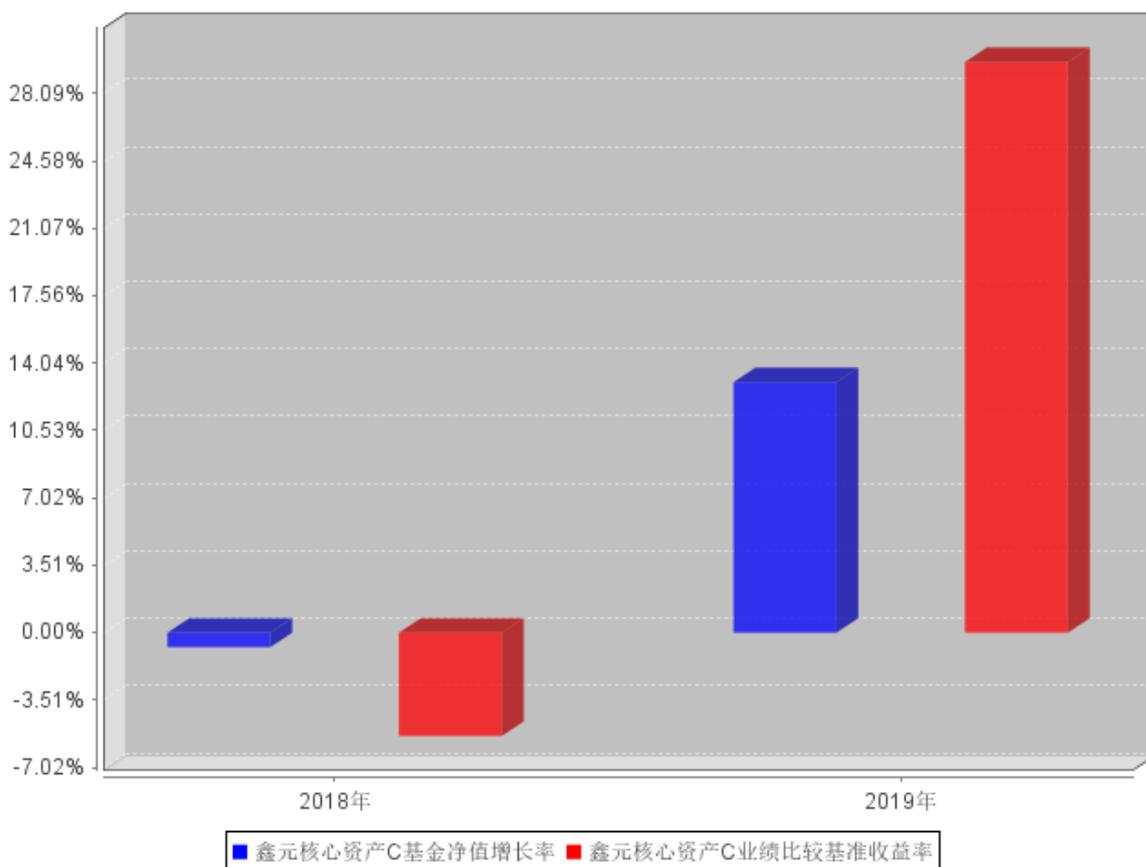
注：本基金的合同生效日为 2018 年 11 月 14 日，根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鑫元核心资产A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



鑫元核心资产C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施利润分配。

## § 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 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 12 月 31 日，公司旗下管理 40 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（原鑫元一年定期开放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（原鑫元合享分级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（原鑫元半年定期开放债券型证券投资基金）、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）、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（原鑫元兴利债券型证券投资基金）、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）、鑫元添利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（原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、鑫元恒利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元安睿三年定期开放债券型证券投资基金、鑫元泽利债券型证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金。

#### 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	证券从业年限	说明
----	----	----------------	--------	----

		限			
		任职日期	离任日期		
丁玥	鑫元鑫趋势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、鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的基金经理；兼任权益投研部总监、首席权益投资官、基金投资决策委员会委员	2018年11月14日	-	10年	学历：金融工程硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009年7月至2015年7月，任职于中国国际金融有限公司，担任研究部副总经理，2015年7月加入鑫元基金担任信用研究主管，2016年7月担任研究部总监，2018年6月担任权益投研部总监兼首席权益投资官。2016年7月26日至2019年8月30日担任鑫元聚鑫收益增强债券型证券投资基金（原鑫元半年定期开放债券型证券投资基金）的基金经理，2017年9月4日起担任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年12月14日至2019年8月30日担任鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年1月23日起担任鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年5月31日至2019年6月11日担任鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，2018年11月

					14 日起担任鑫元核心资产股票型发起式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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求专门制订《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，结合《鑫元基金管理有限公司投资管理制度》、《鑫元基金管理有限公司投资管理权限及授权管理办法》、《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司相关制度，规范公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

在研究工作层面，公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。在投资决策层面，公司执行自上而下的分级投资权限管理体系，依次为投资决策委员会、投资分管领导、投资组合经理，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和投资分管领导等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行不合理干预。投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易执行层面，公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。不同投资组合下达同一证券的同向交易指令时，按照“价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡”的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易部询价机制，严格防范交易对手风险并审查价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行

公平分配。在事后分析层面，公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

#### 4.3.2 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，未发现违反公平交易要求的情况。

#### 4.3.3 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对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

回顾 2019 年，权益资产表现优异。年初市场还在担忧经济的下行风险和中美贸易摩擦的冲击，但回过头来看，在低风险区域承担一些波动才是获得长期超额回报的来源。经历了 2018 年市场的大幅下跌，估值处于低位，风险溢价处于历史极值位置，这是市场上涨的一个重要基础。另一个重要因素是全球流动性重新走向降息扩表的老路，市场流动性宽松，越来越多的显现出资金增量市场的特征。增量的资金一方面来自于国内居民财富再配置的效应，另一方面外资的配置需求也源源不断地通过陆股通流入 A 股市场。

组合操作方面，本产品在前 5 月处于建仓期，较低的仓位导致业绩表现在市场的快速上涨中相对落后，非常遗憾。建仓期结束后，我们提高仓位集中持有消费蓝筹和低估值的金融股等核心资产，同时以较小的仓位持有科技板块的优质标的。我们相信以一个较长期的视角来看，这类深度价值的标的下行风险较小，估值修复的概率较高，风险收益比具有吸引力。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元核心资产 A 的基金份额净值增长率为 13.27%；鑫元核心资产 C 的基金份额净值增长率为 13.05%；同期业绩比较基准收益率为 29.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，我们认为居民资产再配置提高权益资产占比的趋势将得到验证，同时理财资金、险资社保资金、公募基金等也受益于增量资金的流入，外资配置中国流入 A 股大趋势仍将继续，这是我们中长期看好 A 股表现的重要因素。年初突如其来的新型冠状病毒肺炎打乱了经济运行的节奏，市场从去年底的经济阶段性复苏逻辑迅速切换至快速衰退逻辑。在这一次超快速的衰退中，尽管经济基本面受到一定负面影响，但是货币和财政的政策环境将双双宽松，有利于资产价格。中长期来看，快速衰退将加速市场出清，有利于龙头企业进一步提升市场份额。在经济结构上，也将催化一系列在线经济产业链的需求。而这一催化剂恰好发生在 5G 科技创新大周期启动和中国自主可控提升科技产业国产率的大背景下，强化了科技产业的投资价值。

在选股方面，我们坚持挖掘行业景气、能够实现较快增长，且治理结构优秀的公司，与之共同成长。对于科技创新板块，国内企业将在 5G、半导体、5G 应用端诞生出一批能与世界优秀企业媲美的优秀公司，自主创新之路刚刚开启。并将伴随科技周期的步伐，在科技产业链的硬件、软件、内容、应用场景等领域逐渐传导和扩散，相关行业先后轮动。对于新能源板块，我们将利用对行业的长期扎实研究与紧密跟踪，精选出享受行业高速增长同时在产业链具有核心优势的优秀企业，这些公司或即将在全球舞台中脱颖而出。另外，大消费包括医药企业始终是内需的重要组成，是资金长期配置的方向。我们注意到一些龙头企业已经站上了世界舞台，成为在全球具有明显优势的核心资产。

风险方面，疫情的进展和中美关系的反复会对市场造成波动，但作为投资人很难提前预判，更重要的在于应对。政策的边际变化是值得我们紧密跟踪保持敏感的。另外，上涨过快本身也是风险的积累，将削弱未来的收益率预期。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人在监察稽核工作中一方面将坚持投资者利益至上、坚持违法违规零容忍、严防触犯三条底线作为公司的最高经营宗旨和全体员工的根本行为准则，为全面风险管理、全程风险管理与全员风险管理相关内部控制管理规范的推行提供相对有利的内部控制环境；另一方面依据不断发展变化的外部经营环境、监管环境与业务实践对于公司内部控制与风险管理持续进行动态的调整与修正。监察稽核工作致力于保障本基金运作合法合规，切实维护基金份额持有人利益；致力于保障各项法律法规和内部管理制度贯彻执行，推动各项内部控制与风险管理机制的逐步优化与完善，促进公司各项业务合法合规运作。

本报告期内完成的监察稽核工作主要包括：一是密切关注法律法规与监管规范性文件的更新情况，及时进行内部传达以及组织员工学习理解；二是协调内部管理制度体系的修订和完善，推

动公司各业务部门持续完善管理制度和业务流程建设，防范日常运作中发生违法违规行为与风险事件；三是从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；四是通过外部和内部培训、日常投资申报管理、员工行为规范管理等方式不断强化员工的合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突；五是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；六是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施。

#### **4.7 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投资基金行业从业经验。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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内，本基金未进行利润分配。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。

#### **4.9 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，本基金托管人在对鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的管理人—鑫元基金管理有限公司在鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鑫元基金管理有限公司编制和披露的鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2020）审字第 61444343_B31 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估鑫元核心资产股票型发起式证

	<p>券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金不能持续经营。</p>

	<p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈露	蔺育化
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2020 年 3 月 31 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,223,944.37	7,133,382.53
结算备付金		538,095.24	62,452.89
存出保证金		30,745.61	10,428.92
交易性金融资产	7.4.7.2	121,897,249.42	2,395,359.55
其中：股票投资		114,625,339.82	2,395,359.55
基金投资		-	-
债券投资		7,271,909.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	5,500,055.00
应收证券清算款		12,001,972.60	-
应收利息	7.4.7.5	114,599.97	9,565.41
应收股利		-	-
应收申购款		15,383.70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		135,821,990.91	15,111,244.30
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	170,718.42
应付赎回款		3,603.69	-
应付管理人报酬		167,084.22	19,015.30
应付托管费		27,847.38	3,169.22
应付销售服务费		232.93	783.70
应付交易费用	7.4.7.7	15,060.24	5,260.66
应交税费		2.69	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	30,000.09	20,000.00
负债合计		243,831.24	218,947.30
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	120,492,087.74	14,992,002.75
未分配利润	7.4.7.10	15,086,071.93	-99,705.75
所有者权益合计		135,578,159.67	14,892,297.00
负债和所有者权益总计		135,821,990.91	15,111,244.30

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 120,492,087.74 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1252 元，份额总额 120,209,676.18 份；下属 C 类基金份额净值 1.1219 元，份额总额 282,411.56 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 14 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		10,254,789.34	-37,000.18
1.利息收入		139,878.09	29,991.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	33,925.78	9,322.72
债券利息收入		51,382.76	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		54,569.55	20,668.66
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,204,660.02	-74,144.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,957,928.72	-74,144.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	50,284.50	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	196,446.80	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	6,825,716.55	7,152.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	84,534.68	-
<b>减：二、费用</b>		1,160,351.68	62,705.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	661,243.75	28,863.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	110,207.41	4,810.58
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,069.17	1,189.80
4. 交易费用	7.4.7.19	338,453.03	7,830.70
5. 利息支出		920.82	-
其中：卖出回购金融资产支出		920.82	-
6. 税金及附加		0.50	-
7. 其他费用	7.4.7.20	44,457.00	20,011.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		9,094,437.66	-99,705.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		9,094,437.66	-99,705.75

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31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）	14,992,002.75	-99,705.75	14,892,297.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,094,437.66	9,094,437.66
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）	105,500,084.99	6,091,340.02	111,591,425.01
其中：1. 基金申购款	128,718,509.52	7,643,588.22	136,362,097.74
2. 基金赎回款	-23,218,424.53	-1,552,248.20	-24,770,672.73
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）	120,492,087.74	15,086,071.93	135,578,159.67
项目	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生效日)至2018年12月31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）	14,992,002.75	-	14,992,002.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-99,705.75	-99,705.75
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	14,992,002.75	-99,705.75	14,892,297.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张乐赛</u>	<u>陈宇</u>	<u>包颖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2018]991 号文《关于准予鑫元核心资产股票型发起式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《鑫元核心资产股票型发起式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人民币 14,990,163.45 元,已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61444343\_B02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 11

月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 14,992,002.75 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,839.30 份基金份额。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金合同》和《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金根据认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购、申购时收取认购、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算和公告基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元核心资产股票型发起式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股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、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、证券公司短期公司债、可转换债券含分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、权证、股指期货、国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括但不限于协议存款、定期存款及其他银行存款等）、货币市场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）。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：本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%（投资于港股通标的股票比例不得超过股票资产的 50%），其中投资于核心资产主题相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

#### 7.4.2 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（以下合称“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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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 2 号《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〈年度报告和中期报告〉》、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。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 7.4.6.2 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，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	1,223,944.37	7,133,382.53
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	-	-
合计:	1,223,944.37	7,133,382.53

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	107,807,195.27	114,625,339.82	6,818,144.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,257,185.00	7,271,909.60
	银行间市场	-	-
	合计	7,257,185.00	7,271,909.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	115,064,380.27	121,897,249.42	6,832,869.15
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,388,206.95	2,395,359.55	7,152.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,388,206.95	2,395,359.55	7,152.60

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	5,500,055.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,500,055.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	653.98	1,663.95
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	242.10	33.05
应收债券利息	114,616.39	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-926.30	7,868.21
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	13.80	0.20
合计	114,599.97	9,565.41

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	15,060.24	5,260.66

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,060.24	5,260.66

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.09	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	30,000.00	20,000.00
合计	30,000.09	20,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元核心资产 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,832,707.77	13,832,707.77
本期申购	127,734,898.01	127,734,898.01
本期赎回（以“-”号填列）	-21,357,929.60	-21,357,929.60
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	120,209,676.18	120,209,676.18

金额单位：人民币元

鑫元核心资产 C		
项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,159,294.98	1,159,294.98
本期申购	983,611.51	983,611.51
本期赎回（以“-”号填列）	-1,860,494.93	-1,860,494.93
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	282,411.56	282,411.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鑫元核心资产 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-97,502.45	6,600.95	-90,901.50
本期利润	2,250,940.66	6,759,141.74	9,010,082.40
本期基金份额交易产生的变动数	974,224.80	5,158,252.70	6,132,477.50
其中：基金申购款	1,330,055.16	6,308,047.32	7,638,102.48
基金赎回款	-355,830.36	-1,149,794.62	-1,505,624.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,127,663.01	11,923,995.39	15,051,658.40

单位：人民币元

鑫元核心资产 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,355.90	551.65	-8,804.25
本期利润	17,780.45	66,574.81	84,355.26
本期基金份额交易产生的变动数	-1,998.04	-39,139.44	-41,137.48
其中：基金申购款	-10,060.68	15,546.42	5,485.74
基金赎回款	8,062.64	-54,685.86	-46,623.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,426.51	27,987.02	34,413.53

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生效 日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	29,210.72	9,232.11
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,075.81	90.07
其他	639.25	0.54
合计	33,925.78	9,322.72

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金 合同生效日)至2018年12月 31日
卖出股票成交总额	88,075,605.05	1,998,845.71
减：卖出股票成本总额	85,117,676.33	2,072,989.87
买卖股票差价收入	2,957,928.72	-74,144.16

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金 合同生效日)至2018年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	50,284.50	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	50,284.50	-

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金 合同生效日)至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,572,728.50	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,498,240.00	-
减：应收利息总额	24,204.00	-
买卖债券差价收入	50,284.50	-

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：无。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生效 日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	196,446.80	-
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	196,446.80	-

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同 生效日)至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	6,825,716.55	7,152.60
——股票投资	6,810,991.95	7,152.60
——债券投资	14,724.60	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	6,825,716.55	7,152.60

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	84,530.15	-
转换费收入 006193	4.53	-
合计	84,534.68	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	338,453.03	7,830.70
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-

合计	338,453.03	7,830.70
----	------------	----------

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同 生效日)至2018年12月31日
审计费用	30,000.00	-
信息披露费	-	20,000.00
证券出借违约金	-	-
债券账户维护费	13,500.00	-
银行汇划费用	557.00	11.00
开户费	400.00	-
合计	44,457.00	20,011.00

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京银行股份有限公司（“南京银行”）	基金管理人股东、基金销售机构
南京高科股份有限公司	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。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

**7.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无。

**7.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	661,243.75	28,863.49
其中：支付销售机构的客户维护费	73,178.03	4,669.76

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 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生效日)至2018年12月31日
----	-----------------------------	---

	月 31 日	日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	110,207.41	4,810.58

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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C	合计
鑫元基金	-	1,137.49	1,137.49
工商银行	-	2,720.32	2,720.32
合计	-	3,857.81	3,857.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 11 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C	合计
鑫元基金	-	148.16	148.16
工商银行	-	865.58	865.58
合计	-	1,013.74	1,013.74

注：基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.80% 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。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

注：无。

##### 7.4.10.4.2 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

注：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C
基金合同生效日（2018年11月14日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.2993%	-

项目	上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C
基金合同生效日（2018年11月14日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	66.7022%	-

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金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。

#### 7.4.10.5.2 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

注：无。

#### 7.4.10.6 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年11月14日(基金合同生效日) 至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,223,944.37	29,210.72	7,133,382.53	9,232.11

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股未上市	43.98	43.98	1,734	76,261.32	76,261.32	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	新股未上市	28.21	28.21	2,575	72,640.75	72,640.75	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

002466	天齐 锂业	2019年 12月26 日	2020 年1月 3日	配股流 通受限	8.75	30.18	1,620	14,175.00	48,891.60	-
--------	----------	---------------------	-------------------	------------	------	-------	-------	-----------	-----------	---

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
123036	先导 转债	2019年 12月16 日	2020 年1月 10日	新债未 上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
110065	淮矿 转债	2019年 12月25 日	2020 年1月 13日	新债未 上市	100.00	100.00	220	22,000.00	22,000.00	-
113029	明阳 转债	2019年 12月18 日	2020 年1月 7日	新债未 上市	100.00	100.00	570	57,000.00	57,000.00	-
113030	东风 转债	2019年 12月26 日	2020 年1月 20日	新债未 上市	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.00	-
113554	仙鹤 转债	2019年 12月18 日	2020 年1月 10日	新债未 上市	100.00	100.00	130	13,000.00	13,000.00	-
128084	木森 转债	2019年 12月18 日	2020 年1月 10日	新债未 上市	100.00	100.00	290	29,000.00	29,000.00	-
128085	鸿达 转债	2019年 12月19 日	2020 年1月 8日	新债未 上市	100.00	100.00	380	38,000.00	38,000.00	-
128086	国轩 转债	2019年 12月19 日	2020 年1月 10日	新债未 上市	100.00	100.00	220	22,000.00	22,000.00	-

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票名 称	停牌日 期	停牌 原因	期末 估值单价	复牌日 期	复牌 开盘单价	数量(股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
----------	----------	----------	----------	------------	----------	------------	-------	------------	------------	----

603799	华友钴业	2019年12月31日	重大资产重组	39.39	2020年1月2日	40.43	5,200	144,124.00	204,828.00	-
--------	------	-------------	--------	-------	-----------	-------	-------	------------	------------	---

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平较高的投资品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现基金合同中约定的投资目标。

本基金的基金管理人实行全员风险管理，风险管理是公司所有部门、全体员工的应尽职责。公司建立董事会、经营管理层、独立风险管理部门、业务部门四级风险管理组织架构，并分别明确风险管理职能与责任。董事会对公司的风险管理负有最终责任，董事会下设风险控制与合规审计委员会，负责研究、确定公司风险管理理念，指导公司风险管理体系的建设；经营管理层负责组织、部署风险管理工作，经营管理层设风险控制委员会，负责确定风险管理理念、原则、目标和方法，促进风险管理环境、文化的形成，组织风险管理体系建设，审议风险管理制度和流程，审议重大风险事件；监察稽核部作为独立风险管理部门负责协同相关业务部门落实投资风险、操作风险、合规风险、道德风险等各类风险的控制和管理，督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作；各业务部门负责根据职能分工贯彻落实风险管理程序，执行风险管理措施。根据风险管理工作要求，各业务部门健全完善规章制度和操作流程，严格遵守风险管理制度、流程和限额，严格执行从风险识别、风险测量、风险控制、风险评价到风险报告的风险管理程序，对本

部门发生风险事件承担直接责任，及时、准确、全面、客观地将本部门及本部门发现的风险信息向风险管理部门报告。

#### 7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金根据存款存放银行的资质，评估并控制银行存款的信用风险。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。

##### 7.4.13.2.1 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	6,507,800.00	-
合计	6,507,800.00	-

注：未评级债券为国债。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 7.4.13.2.4 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	188,869.60	-
AAA 以下	174,000.00	-

未评级	401,240.00	-
合计	764,109.60	-

注：未评级债券为国债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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在基金运作周期内的每个开放日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。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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本基金的组合资产持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标，对本基金的流动性风险进行持续的监测和分析。同时，本基金的基金管理人在基金运作周期内的每个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，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制相关的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末(2019 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证

券”。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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。

本基金投资于银行存款、交易所及银行间市场交易的固定收益品种等其他计息品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,223,944.37	-	-	-	-	-	1,223,944.37
结算备付金	538,095.24	-	-	-	-	-	538,095.24
存出保证金	30,745.61	-	-	-	-	-	30,745.61

交易性金融资产	-	-	-6,909,040.00	166,869.60	196,000.00	114,625,339.82	121,897,249.42
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,001,972.60	12,001,972.60
应收利息	-	-	-	-	-	114,599.97	114,599.97
应收申购款	-	-	-	-	-	15,383.70	15,383.70
资产总计	1,792,785.22	-	-6,909,040.00	166,869.60	196,000.00	126,757,296.09	135,821,990.91
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,603.69	3,603.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	167,084.22	167,084.22
应付托管费	-	-	-	-	-	27,847.38	27,847.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	232.93	232.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,060.24	15,060.24
应付税费	-	-	-	-	-	2.69	2.69
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	30,000.09	30,000.09
负债总计	-	-	-	-	-	243,831.24	243,831.24
利率敏感度缺口	1,792,785.22	-	-6,909,040.00	166,869.60	196,000.00	126,513,464.85	135,578,159.67
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,133,382.53	-	-	-	-	-	7,133,382.53
结算备付金	62,452.89	-	-	-	-	-	62,452.89
存出保证金	10,428.92	-	-	-	-	-	10,428.92
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,395,359.55	2,395,359.55
买入返售金融资产	5,500,055.00	-	-	-	-	-	5,500,055.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	9,565.41	9,565.41
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	12,706,319.34	-	-	-	-	2,404,924.96	15,111,244.30
负债							
卖出回购金融资产款							
应付证券清算款						170,718.42	170,718.42
应付赎回款							
应付管理人报酬						19,015.30	19,015.30
应付托管费						3,169.22	3,169.22
应付销售服务费						783.70	783.70
应付交易费用						5,260.66	5,260.66
应付税费							
应付利息							
应付利润							
其他负债						20,000.00	20,000.00
负债总计						218,947.30	218,947.30
利率敏感度缺口	12,706,319.34					2,185,977.66	14,892,297.00

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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		
分析	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（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	6,660.27	-
2. 市场利率上升 25 个基点	-6,647.44	-	

#### 7.4.13.4.2 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。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。本基金期末未持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此无重大外汇风险。

## 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2019 年 12 月 31 日			
	美元 折合人 民币	港币 折合人民 币	其他币种 折合人 民币	合计
以 外 币 计 价 的 资 产				
资 产 合 计	-	-	-	-
以 外 币 计 价 的 负 债				
负 债 合 计	-	-	-	-
资 产 负 债 表 外 汇 风 险 敞 口 净 额	-	-	-	-
项目	上年度末			
	2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民 币	合计

	币		币	
以 外 币 计 价 的 资 产				
交 易 性 金 融 资 产	-	442,393.38	-	442,393.38
资 产 合 计	-	442,393.38	-	442,393.38
以 外 币 计 价 的 负 债				
负 债 合 计	-	-	-	-
资 产 负 债 表 外 汇 风 险 敞 口 净 额	-	442,393.38	-	442,393.38

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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( 2019 年 12 月 31 日 )	上年度末 ( 2018 年 12 月 31 日 )
所有港币均相对人民币升值 5%	-	22, 119. 67
所有港币均相对人民币贬值 5%	-	-22, 119. 67

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估符合基金合同约定范围的大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	114, 625, 339. 82	84. 55	2, 395, 359. 55	16. 08
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	114,625,339.82	84.55	2,395,359.55	16.08

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	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（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	沪深300指数上涨1%	1,158,976.17	22,380.44
	沪深300指数下跌1%	-1,158,976.17	-22,380.44

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 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。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31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一层次余额为人民币114,268,929.31元，属于第二层次余额为人民币7,628,320.11元，无划分为第三层次的余额。（于2018年12月31日，属于第一层次余额为人民币2,395,359.55元，无划分为第二、三层次的余额。）

##### 7.4.14.1.2.2 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。

##### 7.4.14.1.2.3 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。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 3 月 31 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	114,625,339.82	84.39
	其中：股票	114,625,339.82	84.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,271,909.60	5.35
	其中：债券	7,271,909.60	5.35
	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	1,762,039.61	1.30
8	其他各项资产	12,162,701.88	8.95
9	合计	135,821,990.91	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,967,675.00	1.45
B	采矿业	3,472,601.00	2.56
C	制造业	48,425,089.40	35.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,476,130.00	1.83
E	建筑业	3,123,860.00	2.30
F	批发和零售业	1,258,977.00	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	3,145,113.00	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,341,047.00	2.46
J	金融业	39,237,724.78	28.94
K	房地产业	5,139,535.00	3.79
L	租赁和商务服务业	1,542,190.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	119,756.00	0.09

N	水利、环境和公共设施管理业	125,138.04	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	719,136.00	0.53
R	文化、体育和娱乐业	531,367.60	0.39
S	综合	-	-
	合计	114,625,339.82	84.55

### 8.2.2 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。

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	94,993	8,118,101.78	5.99
2	600519	贵州茅台	4,300	5,086,900.00	3.75
3	600036	招商银行	91,700	3,446,086.00	2.54
4	000651	格力电器	41,800	2,741,244.00	2.02
5	000333	美的集团	44,600	2,597,950.00	1.92
6	000858	五粮液	17,800	2,367,578.00	1.75
7	600276	恒瑞医药	26,300	2,301,776.00	1.70
8	601288	农业银行	554,800	2,047,212.00	1.51
9	000001	平安银行	122,500	2,015,125.00	1.49
10	600000	浦发银行	155,500	1,923,535.00	1.42
11	600030	中信证券	69,000	1,745,700.00	1.29
12	600887	伊利股份	54,400	1,683,136.00	1.24
13	601166	兴业银行	83,000	1,643,400.00	1.21
14	000002	万科 A	43,500	1,399,830.00	1.03
15	601328	交通银行	240,000	1,351,200.00	1.00
16	600016	民生银行	213,100	1,344,661.00	0.99
17	300498	温氏股份	36,100	1,212,960.00	0.89
18	601601	中国太保	29,500	1,116,280.00	0.82
19	601668	中国建筑	186,000	1,045,320.00	0.77
20	600900	长江电力	56,200	1,032,956.00	0.76
21	600837	海通证券	65,600	1,014,176.00	0.75
22	002415	海康威视	30,300	992,022.00	0.73
23	600585	海螺水泥	17,600	964,480.00	0.71
24	600048	保利地产	58,900	953,002.00	0.70

25	002475	立讯精密	26,000	949,000.00	0.70
26	000725	京东方 A	200,300	909,362.00	0.67
27	600031	三一重工	49,100	837,155.00	0.62
28	603288	海天味业	7,300	784,823.00	0.58
29	600309	万华化学	13,800	775,146.00	0.57
30	601888	中国国旅	8,700	773,865.00	0.57
31	600104	上汽集团	31,800	758,430.00	0.56
32	002714	牧原股份	8,500	754,715.00	0.56
33	601169	北京银行	129,500	735,560.00	0.54
34	300059	东方财富	46,200	728,574.00	0.54
35	600009	上海机场	9,100	716,625.00	0.53
36	601211	国泰君安	38,300	708,167.00	0.52
37	601988	中国银行	183,300	676,377.00	0.50
38	002142	宁波银行	24,000	675,600.00	0.50
39	000338	潍柴动力	42,400	673,312.00	0.50
40	600690	海尔智家	33,400	651,300.00	0.48
41	601688	华泰证券	31,900	647,889.00	0.48
42	000063	中兴通讯	17,800	629,942.00	0.46
43	000568	泸州老窖	7,200	624,096.00	0.46
44	600028	中国石化	117,900	602,469.00	0.44
45	601818	光大银行	135,400	597,114.00	0.44
46	002304	洋河股份	5,400	596,700.00	0.44
47	601766	中国中车	83,200	594,048.00	0.44
48	002027	分众传媒	94,600	592,196.00	0.44
49	601229	上海银行	61,000	578,890.00	0.43
50	601012	隆基股份	22,600	561,158.00	0.41
51	601088	中国神华	28,900	527,425.00	0.39
52	601628	中国人寿	15,100	526,537.00	0.39
53	601899	紫金矿业	111,900	513,621.00	0.38
54	600050	中国联通	78,200	460,598.00	0.34
55	600340	华夏幸福	16,000	459,200.00	0.34
56	600570	恒生电子	5,800	450,834.00	0.33
57	002230	科大讯飞	13,000	448,240.00	0.33
58	000661	长春高新	1,000	447,000.00	0.33
59	601989	中国重工	84,800	444,352.00	0.33
60	600919	江苏银行	60,600	438,744.00	0.32
61	600999	招商证券	23,900	437,131.00	0.32
62	600019	宝钢股份	76,100	436,814.00	0.32
63	601006	大秦铁路	53,200	436,772.00	0.32

64	001979	招商蛇口	21,800	433,166.00	0.32
65	601939	建设银行	58,500	422,955.00	0.31
66	000166	申万宏源	81,300	416,256.00	0.31
67	300015	爱尔眼科	10,500	415,380.00	0.31
68	601857	中国石油	70,300	409,849.00	0.30
69	600015	华夏银行	53,100	407,277.00	0.30
70	000876	新希望	20,300	404,985.00	0.30
71	601186	中国铁建	39,900	404,586.00	0.30
72	000538	云南白药	4,500	402,435.00	0.30
73	601390	中国中铁	66,200	393,228.00	0.29
74	600741	华域汽车	14,700	382,053.00	0.28
75	000776	广发证券	24,900	377,733.00	0.28
76	002594	比亚迪	7,900	376,593.00	0.28
77	000100	TCL 集团	80,600	360,282.00	0.27
78	601336	新华保险	7,300	358,795.00	0.26
79	300142	沃森生物	10,700	347,108.00	0.26
80	002024	苏宁易购	33,300	336,663.00	0.25
81	600958	东方证券	30,300	326,028.00	0.24
82	601225	陕西煤业	35,700	320,943.00	0.24
83	600588	用友网络	11,200	318,080.00	0.23
84	300003	乐普医疗	9,600	317,568.00	0.23
85	600352	浙江龙盛	21,800	315,446.00	0.23
86	600547	山东黄金	9,600	313,152.00	0.23
87	002044	美年健康	20,400	303,756.00	0.22
88	600660	福耀玻璃	12,600	302,274.00	0.22
89	002202	金风科技	25,200	301,140.00	0.22
90	601155	新城控股	7,600	294,272.00	0.22
91	601669	中国电建	67,600	293,384.00	0.22
92	000157	中联重科	43,900	293,252.00	0.22
93	600406	国电南瑞	13,800	292,284.00	0.22
94	002236	大华股份	14,700	292,236.00	0.22
95	601901	方正证券	33,400	289,578.00	0.21
96	600886	国投电力	31,500	289,170.00	0.21
97	002736	国信证券	22,900	287,395.00	0.21
98	600436	片仔癀	2,600	285,662.00	0.21
99	600383	金地集团	19,700	285,650.00	0.21
100	002001	新和成	12,100	281,446.00	0.21
101	601933	永辉超市	36,700	276,718.00	0.20
102	601377	兴业证券	39,000	276,120.00	0.20

103	000069	华侨城 A	35,400	275,766.00	0.20
104	600703	三安光电	15,000	275,400.00	0.20
105	603993	洛阳钼业	62,600	272,936.00	0.20
106	002311	海大集团	7,500	270,000.00	0.20
107	300136	信维通信	5,900	267,742.00	0.20
108	300124	汇川技术	8,400	257,376.00	0.19
109	002241	歌尔股份	12,800	254,976.00	0.19
110	002007	华兰生物	7,200	253,080.00	0.19
111	002008	大族激光	6,300	252,000.00	0.19
112	600196	复星医药	9,400	250,040.00	0.18
113	600438	通威股份	18,900	248,157.00	0.18
114	600795	国电电力	104,100	243,594.00	0.18
115	601111	中国国航	25,000	242,250.00	0.18
116	000783	长江证券	33,600	239,904.00	0.18
117	000895	双汇发展	8,200	238,046.00	0.18
118	601108	财通证券	20,800	235,872.00	0.17
119	600705	中航资本	48,100	233,285.00	0.17
120	600011	华能国际	41,700	232,686.00	0.17
121	600061	国投资本	15,300	231,642.00	0.17
122	600271	航天信息	9,900	229,383.00	0.17
123	603986	兆易创新	1,100	225,379.00	0.17
124	300122	智飞生物	4,500	223,470.00	0.16
125	000425	徐工机械	40,700	222,629.00	0.16
126	600089	特变电工	33,300	221,445.00	0.16
127	600606	绿地控股	31,400	218,230.00	0.16
128	002460	赣锋锂业	6,200	215,946.00	0.16
129	600010	宝钢股份	162,400	214,368.00	0.16
130	002555	三七互娱	7,900	212,747.00	0.16
131	600177	雅戈尔	30,500	212,585.00	0.16
132	600029	南方航空	29,600	212,528.00	0.16
133	002352	顺丰控股	5,700	211,983.00	0.16
134	002466	天齐锂业	7,020	211,863.60	0.16
135	600111	北方稀土	19,500	211,380.00	0.16
136	000768	中航飞机	12,700	208,026.00	0.15
137	601788	光大证券	15,800	206,980.00	0.15
138	600809	山西汾酒	2,300	206,310.00	0.15
139	601600	中国铝业	58,100	205,674.00	0.15
140	600176	中国巨石	18,800	204,920.00	0.15
141	603799	华友钴业	5,200	204,828.00	0.15

142	601555	东吴证券	20,400	203,796.00	0.15
143	601985	中国核电	40,700	203,500.00	0.15
144	000786	北新建材	7,900	201,055.00	0.15
145	002271	东方雨虹	7,600	199,956.00	0.15
146	002624	完美世界	4,500	198,630.00	0.15
147	601877	正泰电器	7,400	198,320.00	0.15
148	300408	三环集团	8,900	198,292.00	0.15
149	300144	宋城演艺	6,400	197,824.00	0.15
150	000963	华东医药	8,100	197,478.00	0.15
151	002456	欧菲光	12,500	195,000.00	0.14
152	002410	广联达	5,700	193,686.00	0.14
153	600109	国金证券	20,700	192,510.00	0.14
154	600115	东方航空	32,800	190,568.00	0.14
155	603019	中科曙光	5,500	190,190.00	0.14
156	002050	三花智控	10,900	188,897.00	0.14
157	002179	中航光电	4,800	187,488.00	0.14
158	600893	航发动力	8,600	186,448.00	0.14
159	601800	中国交建	20,300	185,948.00	0.14
160	002422	科伦药业	7,900	185,571.00	0.14
161	300033	同花顺	1,700	185,487.00	0.14
162	600332	白云山	5,200	185,172.00	0.14
163	601607	上海医药	10,000	183,700.00	0.14
164	000625	长安汽车	18,100	181,543.00	0.13
165	601138	工业富联	9,900	180,873.00	0.13
166	600100	同方股份	20,400	178,908.00	0.13
167	601919	中远海控	33,400	176,018.00	0.13
168	600221	海航控股	101,600	175,768.00	0.13
169	600487	亨通光电	10,700	173,982.00	0.13
170	002602	世纪华通	15,200	173,736.00	0.13
171	600522	中天科技	20,900	173,470.00	0.13
172	601618	中国中冶	61,300	171,640.00	0.13
173	600637	东方明珠	18,300	171,288.00	0.13
174	601998	中信银行	27,100	167,207.00	0.12
175	600066	宇通客车	11,600	165,300.00	0.12
176	600068	葛洲坝	24,200	161,656.00	0.12
177	601997	贵阳银行	16,900	161,564.00	0.12
178	000728	国元证券	17,400	161,298.00	0.12
179	600018	上港集团	27,700	159,829.00	0.12
180	601727	上海电气	32,000	159,360.00	0.12

181	600926	杭州银行	17,300	158,468.00	0.12
182	000961	中南建设	15,000	158,250.00	0.12
183	600498	烽火通信	5,700	156,465.00	0.12
184	300017	网宿科技	16,400	156,292.00	0.12
185	600362	江西铜业	9,100	154,063.00	0.11
186	002673	西部证券	15,600	152,880.00	0.11
187	601198	东兴证券	11,600	152,424.00	0.11
188	000656	金科股份	19,800	152,064.00	0.11
189	600674	川投能源	15,300	150,705.00	0.11
190	000596	古井贡酒	1,100	149,512.00	0.11
191	000423	东阿阿胶	4,200	148,554.00	0.11
192	600219	南山铝业	66,200	148,288.00	0.11
193	600170	上海建工	41,800	147,972.00	0.11
194	601838	成都银行	16,300	147,841.00	0.11
195	603160	汇顶科技	700	144,410.00	0.11
196	600038	中直股份	3,000	143,130.00	0.11
197	600023	浙能电力	36,000	142,560.00	0.11
198	002146	荣盛发展	14,400	141,552.00	0.10
199	601021	春秋航空	3,200	140,448.00	0.10
200	600516	方大炭素	11,500	139,840.00	0.10
201	002493	荣盛石化	11,200	138,768.00	0.10
202	600208	新湖中宝	36,700	138,726.00	0.10
203	600346	恒力石化	8,600	138,288.00	0.10
204	002081	金螳螂	15,500	136,710.00	0.10
205	600004	白云机场	7,800	136,110.00	0.10
206	600085	同仁堂	4,800	135,264.00	0.10
207	300024	机器人	9,500	133,000.00	0.10
208	002508	老板电器	3,900	131,859.00	0.10
209	600535	天士力	8,500	131,070.00	0.10
210	002739	万达电影	7,200	130,680.00	0.10
211	600482	中国动力	6,500	130,000.00	0.10
212	600583	海油工程	17,600	129,888.00	0.10
213	600489	中金黄金	15,300	129,744.00	0.10
214	601018	宁波港	33,900	128,820.00	0.10
215	603833	欧派家居	1,100	128,700.00	0.09
216	600867	通化东宝	10,100	127,765.00	0.09
217	000630	铜陵有色	54,800	127,684.00	0.09
218	600760	中航沈飞	4,000	126,400.00	0.09
219	000671	阳光城	14,800	125,800.00	0.09

220	601881	中国银河	10,600	123,066.00	0.09
221	600369	西南证券	23,700	123,003.00	0.09
222	600398	海澜之家	16,000	122,880.00	0.09
223	000703	恒逸石化	8,800	122,496.00	0.09
224	601878	浙商证券	11,000	122,430.00	0.09
225	000627	天茂集团	17,100	120,384.00	0.09
226	603259	药明康德	1,300	119,756.00	0.09
227	300070	碧水源	15,600	118,560.00	0.09
228	000629	攀钢钒钛	39,800	116,216.00	0.09
229	002032	苏泊尔	1,500	115,170.00	0.08
230	600118	中国卫星	5,200	111,124.00	0.08
231	603156	养元饮品	3,800	110,314.00	0.08
232	601117	中国化学	17,100	110,124.00	0.08
233	600153	建发股份	12,200	109,678.00	0.08
234	601992	金隅集团	29,000	108,170.00	0.08
235	600027	华电国际	29,300	107,531.00	0.08
236	300413	芒果超媒	3,060	106,977.60	0.08
237	603858	步长制药	5,100	105,162.00	0.08
238	600663	陆家嘴	7,700	104,027.00	0.08
239	000709	河钢股份	38,700	99,846.00	0.07
240	601808	中海油服	5,200	99,840.00	0.07
241	002252	上海莱士	13,400	99,428.00	0.07
242	601633	长城汽车	11,000	97,350.00	0.07
243	601066	中信建投	3,200	97,280.00	0.07
244	002120	韵达股份	2,900	96,570.00	0.07
245	600977	中国电影	6,300	95,886.00	0.07
246	601238	广汽集团	8,000	93,520.00	0.07
247	002773	康弘药业	2,500	92,425.00	0.07
248	002558	巨人网络	5,000	90,300.00	0.07
249	002153	石基信息	2,300	89,700.00	0.07
250	600297	广汇汽车	27,500	89,650.00	0.07
251	601216	君正集团	27,900	87,327.00	0.06
252	002938	鹏鼎控股	1,800	80,820.00	0.06
253	002601	龙鳞佰利	5,200	80,028.00	0.06
254	002294	信立泰	4,000	79,760.00	0.06
255	600816	安信信托	17,800	79,032.00	0.06
256	000938	紫光股份	2,500	79,000.00	0.06
257	601898	中煤能源	15,700	78,814.00	0.06
258	688181	八亿时空	1,734	76,261.32	0.06

259	002010	传化智联	10,900	76,082.00	0.06
260	600188	兖州煤业	7,000	73,920.00	0.05
261	600025	华能水电	17,400	73,428.00	0.05
262	002310	东方园林	14,600	73,292.00	0.05
263	601360	三六零	3,100	72,881.00	0.05
264	688081	兴图新科	2,575	72,640.75	0.05
265	600372	中航电子	5,100	72,624.00	0.05
266	600566	济川药业	3,000	72,540.00	0.05
267	000898	鞍钢股份	20,900	70,015.00	0.05
268	300433	蓝思科技	4,800	66,336.00	0.05
269	601319	中国人保	8,600	65,274.00	0.05
270	600998	九州通	4,600	65,090.00	0.05
271	002411	延安必康	3,900	60,957.00	0.04
272	002468	申通快递	2,900	56,550.00	0.04
273	000415	渤海租赁	14,700	55,860.00	0.04
274	601828	美凯龙	3,900	44,187.00	0.03
275	600390	五矿资本	4,700	38,822.00	0.03
276	002939	长城证券	2,700	37,422.00	0.03
277	002945	华林证券	2,500	37,350.00	0.03
278	600233	圆通速递	2,800	35,420.00	0.03
279	601162	天风证券	4,800	35,328.00	0.03
280	601577	长沙银行	3,800	34,466.00	0.03
281	603260	合盛硅业	1,100	32,417.00	0.02
282	601298	青岛港	4,200	28,854.00	0.02
283	601212	白银有色	7,600	27,968.00	0.02
284	600299	安迪苏	2,000	22,120.00	0.02
285	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.02
286	600733	北汽蓝谷	3,200	18,688.00	0.01
287	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
288	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	8,406,161.76	56.45
2	600519	贵州茅台	5,755,691.00	38.65

3	601668	中国建筑	4,471,030.00	30.02
4	000651	格力电器	3,704,881.00	24.88
5	600036	招商银行	3,215,575.00	21.59
6	601288	农业银行	3,006,476.00	20.19
7	600900	长江电力	2,812,800.00	18.89
8	600030	中信证券	2,678,221.00	17.98
9	300498	温氏股份	2,612,179.00	17.54
10	000858	五粮液	2,396,640.00	16.09
11	600547	山东黄金	2,288,585.00	15.37
12	000333	美的集团	2,278,162.00	15.30
13	601328	交通银行	2,245,400.00	15.08
14	600276	恒瑞医药	2,182,790.00	14.66
15	002796	世嘉科技	2,092,005.00	14.05
16	000001	平安银行	1,941,625.00	13.04
17	002415	海康威视	1,859,889.00	12.49
18	600000	浦发银行	1,833,742.07	12.31
19	002716	ST 金贵	1,723,976.00	11.58
20	601688	华泰证券	1,706,865.00	11.46
21	002475	立讯精密	1,666,056.00	11.19
22	600887	伊利股份	1,657,236.00	11.13
23	601390	中国中铁	1,638,954.00	11.01
24	000063	中兴通讯	1,609,234.00	10.81
25	601899	紫金矿业	1,570,241.00	10.54
26	600588	用友网络	1,504,299.00	10.10
27	000661	长春高新	1,490,865.00	10.01
28	002422	科伦药业	1,437,921.00	9.66
29	601166	兴业银行	1,430,660.00	9.61
30	601006	大秦铁路	1,311,238.00	8.80
31	002405	四维图新	1,304,078.00	8.76
32	002384	东山精密	1,299,347.00	8.72
33	600016	民生银行	1,283,527.20	8.62
34	600104	上汽集团	1,270,272.00	8.53
35	600570	恒生电子	1,253,246.00	8.42
36	600872	中炬高新	1,209,308.00	8.12
37	000426	兴业矿业	1,201,499.00	8.07
38	000002	万科 A	1,142,310.00	7.67

39	300033	同花顺	1,139,983.00	7.65
40	601888	中国国旅	1,126,553.00	7.56
41	002230	科大讯飞	1,122,650.00	7.54
42	601601	中国太保	1,122,045.00	7.53
43	600875	东方电气	1,094,047.00	7.35
44	00700	腾讯控股	1,082,534.90	7.27
45	300059	东方财富	1,050,962.00	7.06
46	600489	中金黄金	1,025,348.00	6.89
47	000603	盛达资源	1,021,621.00	6.86
48	600837	海通证券	988,353.00	6.64
49	600958	东方证券	976,421.00	6.56
50	601012	隆基股份	953,002.00	6.40
51	601021	春秋航空	946,824.00	6.36
52	600176	中国巨石	925,374.00	6.21
53	002237	恒邦股份	914,740.00	6.14
54	601766	中国中车	893,785.00	6.00
55	600703	三安光电	862,350.00	5.79
56	601186	中国铁建	861,492.00	5.78
57	600340	华夏幸福	855,892.00	5.75
58	600048	保利地产	838,528.48	5.63
59	603288	海天味业	811,383.00	5.45
60	001979	招商蛇口	805,904.00	5.41
61	601628	中国人寿	803,379.00	5.39
62	002250	联化科技	775,760.00	5.21
63	000977	浪潮信息	769,843.00	5.17
64	601225	陕西煤业	768,443.00	5.16
65	300255	常山药业	757,225.00	5.08
66	601377	兴业证券	756,927.00	5.08
67	603259	药明康德	746,625.00	5.01
68	000725	京东方 A	745,116.00	5.00
69	600009	上海机场	741,941.00	4.98
70	600585	海螺水泥	728,829.00	4.89
71	300559	佳发教育	725,277.00	4.87
72	002024	苏宁易购	714,962.00	4.80
73	600093	易见股份	708,494.00	4.76
74	300296	利亚德	702,178.00	4.72

75	002594	比亚迪	697,705.00	4.69
76	600031	三一重工	697,220.00	4.68
77	601169	北京银行	691,530.00	4.64
78	601211	国泰君安	691,284.00	4.64
79	688111	金山办公	672,261.74	4.51
80	002507	涪陵榨菜	660,100.00	4.43
81	601988	中国银行	659,880.00	4.43
82	600131	岷江水电	659,354.00	4.43
83	600038	中直股份	657,990.00	4.42
84	002714	牧原股份	647,658.00	4.35
85	603501	韦尔股份	644,776.00	4.33
86	603083	剑桥科技	635,368.00	4.27
87	000568	泸州老窖	621,590.00	4.17
88	600438	通威股份	619,739.00	4.16
89	00570	中国中药	616,461.55	4.14
90	600309	万华化学	608,320.00	4.08
91	002142	宁波银行	604,800.00	4.06
92	600028	中国石化	593,037.00	3.98
93	600398	海澜之家	591,640.00	3.97
94	600745	闻泰科技	590,750.00	3.97
95	601933	永辉超市	590,537.00	3.97
96	002304	洋河股份	567,000.00	3.81
97	601229	上海银行	561,357.82	3.77
98	601088	中国神华	554,504.00	3.72
99	002001	新和成	552,801.00	3.71
100	000975	银泰黄金	534,487.00	3.59
101	601818	光大银行	528,060.00	3.55
102	000963	华东医药	510,318.00	3.43
103	600690	海尔智家	506,974.02	3.40
104	002027	分众传媒	504,218.00	3.39
105	600867	通化东宝	498,571.00	3.35
106	601989	中国重工	493,536.00	3.31
107	300119	瑞普生物	489,500.00	3.29
108	600050	中国联通	486,349.00	3.27
109	000338	潍柴动力	479,968.00	3.22
110	601965	中国汽研	475,200.00	3.19

111	600019	宝钢股份	458,122.00	3.08
112	601800	中国交建	457,792.00	3.07
113	300365	恒华科技	436,140.00	2.93
114	600446	金证股份	435,095.00	2.92
115	601857	中国石油	433,751.00	2.91
116	600377	宁沪高速	428,108.08	2.87
117	300750	宁德时代	428,000.00	2.87
118	600498	烽火通信	421,503.00	2.83
119	600563	法拉电子	419,686.00	2.82
120	002839	张家港行	416,560.00	2.80
121	601939	建设银行	413,010.00	2.77
122	002241	歌尔股份	411,567.00	2.76
123	600999	招商证券	411,440.00	2.76
124	600919	江苏银行	410,868.00	2.76
125	002179	中航光电	409,344.00	2.75
126	600015	华夏银行	398,781.00	2.68
127	000166	申万宏源	397,557.00	2.67
128	300502	新易盛	396,635.00	2.66
129	002081	金螳螂	395,180.00	2.65
130	000625	长安汽车	394,510.00	2.65
131	600195	中牧股份	394,100.00	2.65
132	300253	卫宁健康	393,444.00	2.64
133	002025	航天电器	391,650.00	2.63
134	600216	浙江医药	388,836.00	2.61
135	002311	海大集团	381,350.00	2.56
136	603019	中科曙光	374,680.00	2.52
137	600604	市北高新	374,050.00	2.51
138	002127	南极电商	367,100.00	2.47
139	601336	新华保险	366,314.00	2.46
140	002410	广联达	352,586.00	2.37
141	600741	华域汽车	352,529.05	2.37
142	000538	云南白药	349,273.00	2.35
143	000776	广发证券	348,600.00	2.34
144	002675	东诚药业	339,202.00	2.28
145	000895	双汇发展	334,668.00	2.25
146	002202	金风科技	328,356.00	2.20

147	000876	新希望	326,830.00	2.19
148	600004	白云机场	325,888.00	2.19
149	300015	爱尔眼科	323,550.00	2.17
150	300666	江丰电子	322,750.00	2.17
151	002367	康力电梯	321,116.00	2.16
152	600352	浙江龙盛	319,152.00	2.14
153	601669	中国电建	317,044.00	2.13
154	002709	天赐材料	310,650.00	2.09
155	300144	宋城演艺	307,918.00	2.07
156	002271	东方雨虹	306,098.00	2.06
157	600323	瀚蓝环境	304,400.00	2.04
158	300017	网宿科技	300,756.00	2.02
159	600201	生物股份	300,400.00	2.02
160	600886	国投电力	299,802.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601668	中国建筑	3,334,500.00	22.39
2	002796	世嘉科技	2,414,779.00	16.21
3	600547	山东黄金	2,299,214.55	15.44
4	600900	长江电力	2,037,250.00	13.68
5	688111	金山办公	1,967,647.00	13.21
6	002716	ST 金贵	1,739,108.00	11.68
7	000651	格力电器	1,423,730.00	9.56
8	002384	东山精密	1,334,094.00	8.96
9	002405	四维图新	1,327,830.00	8.92
10	600872	中炬高新	1,323,605.00	8.89
11	002422	科伦药业	1,313,739.00	8.82
12	300498	温氏股份	1,300,913.00	8.74
13	000426	兴业矿业	1,277,573.04	8.58
14	600588	用友网络	1,230,054.40	8.26
15	600875	东方电气	1,210,647.00	8.13
16	601390	中国中铁	1,196,586.00	8.03
17	601899	紫金矿业	1,167,429.00	7.84
18	601688	华泰证券	1,162,694.60	7.81

19	000661	长春高新	1,143,230.00	7.68
20	600030	中信证券	1,116,082.74	7.49
21	002237	恒邦股份	1,110,080.00	7.45
22	601288	农业银行	1,078,471.00	7.24
23	00700	腾讯控股	1,045,180.66	7.02
24	002475	立讯精密	998,464.00	6.70
25	000063	中兴通讯	980,846.00	6.59
26	601006	大秦铁路	977,070.00	6.56
27	000603	盛达资源	943,946.64	6.34
28	600489	中金黄金	937,640.00	6.30
29	601021	春秋航空	926,744.00	6.22
30	601186	中国铁建	925,829.28	6.22
31	300033	同花顺	912,070.00	6.12
32	002415	海康威视	910,385.00	6.11
33	600519	贵州茅台	889,638.00	5.97
34	601328	交通银行	864,100.00	5.80
35	600570	恒生电子	831,072.00	5.58
36	300559	佳发教育	805,029.00	5.41
37	002250	联化科技	801,675.00	5.38
38	000977	浪潮信息	783,547.00	5.26
39	600176	中国巨石	745,730.00	5.01
40	300255	常山药业	725,140.00	4.87
41	600703	三安光电	707,000.00	4.75
42	603259	药明康德	696,540.00	4.68
43	00570	中国中药	693,807.39	4.66
44	300296	利亚德	682,760.07	4.58
45	002230	科大讯飞	666,529.00	4.48
46	600958	东方证券	655,319.00	4.40
47	002507	涪陵榨菜	639,510.00	4.29
48	603501	韦尔股份	630,702.00	4.24
49	600093	易见股份	613,194.00	4.12
50	600131	岷江水电	587,808.00	3.95
51	603083	剑桥科技	572,964.00	3.85
52	600038	中直股份	569,610.00	3.82
53	601377	兴业证券	564,224.00	3.79
54	600745	闻泰科技	530,640.00	3.56
55	601965	中国汽研	525,790.00	3.53
56	600604	市北高新	507,686.00	3.41

57	000975	银泰黄金	497,370.00	3.34
58	600104	上汽集团	490,750.00	3.30
59	02357	中航科工	461,980.64	3.10
60	600446	金证股份	456,280.00	3.06
61	300253	卫宁健康	452,440.00	3.04
62	601225	陕西煤业	443,000.00	2.97
63	600438	通威股份	430,054.08	2.89
64	600398	海澜之家	429,100.00	2.88
65	300365	恒华科技	423,445.00	2.84
66	600377	宁沪高速	416,606.19	2.80
67	002839	张家港行	416,284.00	2.80
68	300750	宁德时代	413,250.00	2.77
69	601888	中国国旅	412,500.00	2.77
70	00386	中国石油化工股份	411,806.21	2.77
71	600340	华夏幸福	408,000.00	2.74
72	002025	航天电器	404,050.00	2.71
73	600563	法拉电子	389,900.00	2.62
74	001979	招商蛇口	382,400.00	2.57
75	600004	白云机场	377,820.00	2.54
76	601628	中国人寿	362,388.00	2.43
77	600216	浙江医药	362,187.00	2.43
78	002024	苏宁易购	358,825.00	2.41
79	603127	昭衍新药	354,000.00	2.38
80	600867	通化东宝	352,800.00	2.37
81	300119	瑞普生物	351,900.00	2.36
82	601012	隆基股份	346,000.00	2.32
83	300502	新易盛	345,850.00	2.32
84	600195	中牧股份	341,090.00	2.29
85	002127	南极电商	340,665.00	2.29
86	300059	东方财富	339,224.00	2.28
87	002675	东诚药业	338,183.00	2.27
88	002367	康力电梯	334,936.00	2.25
89	300666	江丰电子	327,175.00	2.20
90	002019	亿帆医药	318,500.00	2.14
91	600323	瀚蓝环境	311,800.00	2.09
92	600201	生物股份	310,654.00	2.09
93	300628	亿联网络	308,900.00	2.07

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	190,536,664.65
卖出股票收入（成交）总额	88,075,605.05

**8.5 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	6,909,040.00	5.10
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	-	-
7	可转债（可交换债）	362,869.60	0.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,271,909.60	5.36

**8.6 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	019615	19 国债 05	65,000	6,507,800.00	4.80
2	019308	13 国债 08	4,000	401,240.00	0.30
3	132021	19 中电 EB	1,380	166,869.60	0.12
4	113029	明阳转债	570	57,000.00	0.04
5	128085	鸿达转债	380	38,000.00	0.03

**8.7 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**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.11.2 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。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 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**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

**8.12.2 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。

**8.12.3 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	30,745.61
2	应收证券清算款	12,001,972.60
3	应收股利	-
4	应收利息	114,599.97
5	应收申购款	15,383.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	12,162,701.88
---	----	---------------

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
鑫元核心资产 A	251	478,923.01	77,722,347.13	64.66%	42,487,329.05	35.34%
鑫元核心资产 C	162	1,743.28	-	0.00%	282,411.56	100.00%
合计	413	291,748.40	77,722,347.13	64.50%	42,769,740.61	35.50%

### 9.2 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	鑫元核心资产 A	993,305.39	0.8263%
	鑫元核心资产 C	134,071.64	47.4738%
	合计	1,127,377.03	0.9356%

### 9.3 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	鑫元核心资产 A	50~100
	鑫元核心资产 C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元核心资产 A	10~50
	鑫元核心资产 C	0
	合计	10~50

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有	10,000,000.00	8.30	10,000,000.00	8.30	3年

资金					
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	8.30	10,000,000.00	8.30	3年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元核心资产 A	鑫元核心资产 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 14 日）基金份额总额	13,832,707.77	1,159,294.98
本报告期期初基金份额总额	13,832,707.77	1,159,294.98
本报告期基金总申购份额	127,734,898.01	983,611.51
减:本报告期基金总赎回份额	21,357,929.60	1,860,494.93
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	120,209,676.18	282,411.56

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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、基金管理人：本报告期内，基金管理人原副总经理李雁因个人原因，不能正常履职。基金管理人已发布有关公告，自 2019 年 8 月 28 日起，李雁不再担任公司副总经理一职。

2、基金托管人：本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为本基金进行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），未发生改聘。本报告期内应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 30,000.00 元。目前的会计师事务所为本基金提供审计服务的年限为 2 年。

### 11.6 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，基金管理人原副总经理李雁因个人原因，不能正常履职。基金管理人已发布有关公告，自 2019 年 8 月 28 日起，李雁不再担任公司副总经理一职。

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
兴业证券	2	181,817,154.28	65.94%	134,332.24	62.76%	-
广发证券	2	51,417,131.35	18.65%	37,658.46	17.59%	-
华泰证券	2	42,499,440.14	15.41%	42,048.33	19.65%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

### 11.7.2 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
兴业证券	5,598,891.30	61.01%	102,500,000.00	28.83%	-	-
广发证券	2,114,270.00	23.04%	-	-	-	-
华泰证券	1,464,396.86	15.96%	253,000,000.00	71.17%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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。

### 11.8 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	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019 年 1 月 2 日
2	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2019 年 1 月 11 日
3	鑫元基金管理有限公司关于	公司网站、中国证券报	2019 年 1 月 11 日

	旗下部分基金参与交通银行网上银行渠道基金定期定额投资费率优惠活动的公告		
4	鑫元基金管理有限公司关于鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	公司网站、中国证券报	2019年1月11日
5	鑫元基金管理有限公司关于鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金 A 类份额参与部分销售机构申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2019年1月11日
6	鑫元基金管理有限公司关于鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金 A 类份额实行网上交易系统申购、定期定额投资业务费率优惠的公告	公司网站、中国证券报	2019年1月11日
7	鑫元基金管理有限公司关于鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金参与部分销售机构转换费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2019年1月11日
8	鑫元基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019年1月31日
9	鑫元基金公告	公司网站	2019年2月21日
10	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泉州银行股份有限公司申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2019年2月27日
11	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报	2019年3月29日
12	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	公司网站、证券时报	2019年4月18日
13	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏天鼎证券投资咨询有限公司为基	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报	2019年4月26日

	金销售机构、开通基金转换业务、定期定额投资业务的公告		
14	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海联泰基金销售有限公司开通基金定期定额投资业务、参与定期定额投资业务费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报	2019年5月27日
15	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金更新招募说明书（2019年第1号）	公司网站	2019年6月28日
16	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第1号）	公司网站、证券时报	2019年6月28日
17	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金2019年6月28日资产净值的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报	2019年6月29日
18	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金2019年第二季度报告	公司网站、证券时报	2019年7月19日
19	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2019年7月20日
20	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为基金销售机构、开通基金转换业务、定期定额投资业务、参与费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报	2019年7月22日
21	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金新增安信证券股份有限公司为基金销售机构、开通基金转换业务、定期定额投资业务、参与费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年8月23日
22	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金2019年半年度报告摘要	公司网站、证券时报	2019年8月24日
23	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金2019年半年度报告	公司网站	2019年8月24日
24	鑫元基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2019年8月30日

25	鑫元基金管理有限公司关于 董事会成员换届变更的公告	公司网站、中国证券报、上海 证券报、证券时报、证券 日报	2019 年 8 月 30 日
26	鑫元核心资产股票型发起式 证券投资基金 2019 年第 3 季 度报告	公司网站	2019 年 10 月 24 日
27	鑫元基金管理有限公司旗下 全部基金 2019 年第 3 季度报 告提示性公告	公司网站、中国证券报、上 海证券报、证券时报、证券 日报	2019 年 10 月 24 日
28	鑫元基金管理有限公司关于 根据《公开募集证券投资基金 信息披露管理办法》修订旗下 39 只公募基金基金合同等相 关法律文件的公告	公司网站、中国证券报、上 海证券报、证券日报、证券 时报	2019 年 11 月 29 日
29	鑫元基金管理有限公司关于 旗下部分基金参与交通银行 手机银行渠道基金申购、定期 定额投资费率优惠活动的公 告	公司网站、中国证券报、上 海证券报、证券时报、证券 日报	2019 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20190101-20190923	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	8.30%
	2	20190925-20191231	0.00	29,766,584.77	0.00	29,766,584.77	24.70%
个人	1	20190924-20190924	0.00	18,933,068.26	0.00	18,933,068.26	15.71%
	2	20190924-20190924	0.00	18,933,068.26	18,933,068.26	0.00	0.00%
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 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》生效满 3 年后继续存续的，基金在存续期内连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于人民币 5000 万元的，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，本基金合同将终止并根据基金合同约定的程序进行清算，且无须召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应向中国证监会报告并履行相关信息披露程序。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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 根据中国证券监督管理委员会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，以及本基金基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报监管机构备案，基金管理人对本基金的基金合同、托管协议中的信息披露有关条款进行了修改。同时，基金管理人在本基金更新的招募说明书及摘要中，对涉及上述修改的内容进行相应更新。详情请见基金管理人发布的相关公告。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司

2020年3月31日