

# 鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金

## 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 2019 年 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.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>24</b>
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64

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 .....	64
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 .....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
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 .....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>73</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 .....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
13.1 备查文件目录 .....	75
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鑫元鑫新收益	
基金主代码	001601	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 15 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	99,020,225.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鑫元鑫新收益 A	鑫元鑫新收益 C
下属分级基金的交易代码:	001601	001602
报告期末下属分级基金的份额总额	98,996,697.29 份	23,528.35 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情况下，严格控制投资组合风险，并在追求资金的安全与长期稳定增长的基础上，通过积极主动的资产配置，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，评估股票、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×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		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		2017 年	
	鑫元鑫新收益 A	鑫元鑫新 收益 C	鑫元鑫新收益 A	鑫元鑫新 收益 C	鑫元鑫新收益 A	鑫元鑫新收益 C
本期 已实 现收 益	6,417,323.22	2,637.09	-15,011,697.61	-6,464.97	17,481,854.93	3,527,506.33
本期 利润	9,357,292.75	3,896.51	-7,560,601.76	-7,543.37	16,719,668.57	3,011,642.99
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.0944	0.1201	-0.0503	-0.0999	0.0353	0.0119
本 期 加 权 平 均 净 值 利 润 率	9.32%	12.06%	-5.06%	-10.10%	3.47%	1.19%
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	9.84%	9.06%	-6.73%	-7.44%	3.12%	3.10%
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	-1,487,190.55	-726.07	-7,908,674.75	-4,140.76	9,799,635.20

期末可供分配基金份额利润	-0.0150	-0.0309	-0.0798	-0.0875	0.0281	0.0248
期末基金资产净值	104,276,593.95	24,340.24	95,071,457.86	44,874.51	358,829,674.24	279,387.96
期末基金份额净值	1.0533	1.0345	0.9589	0.9486	1.0281	1.0248
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	7.41%	4.47%	-2.22%	-4.21%	4.84%	3.49%

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

鑫元鑫新收益 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	2.61%	0.23%	4.19%	0.37%	-1.58%	-0.14%
过去六个月	3.82%	0.32%	4.68%	0.43%	-0.86%	-0.11%
过去一年	9.84%	0.59%	20.21%	0.62%	-10.37%	-0.03%
过去三年	5.65%	0.48%	17.35%	0.56%	-11.70%	-0.08%
自基金合同	7.41%	0.40%	9.04%	0.69%	-1.63%	-0.29%



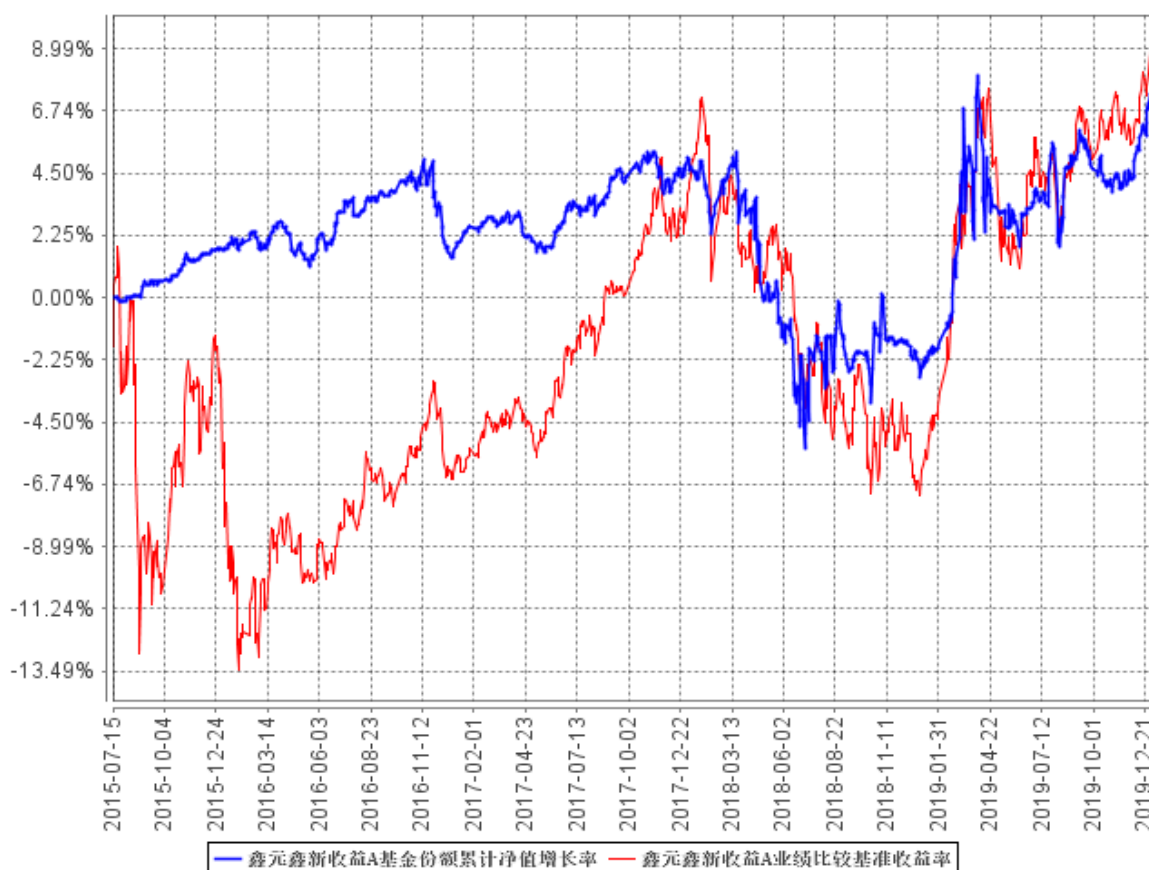
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

鑫元鑫新收益 C

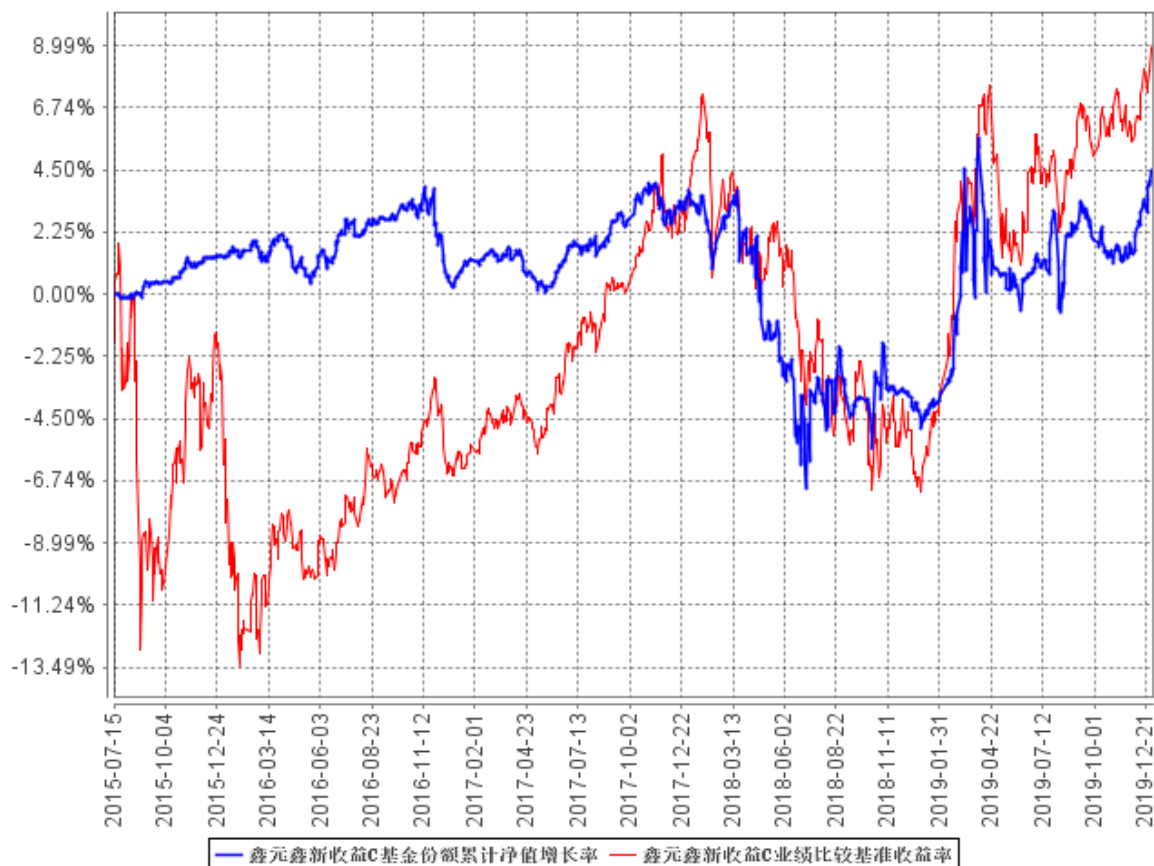
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.41%	0.23%	4.19%	0.37%	-1.78%	-0.14%
过去六个月	3.49%	0.32%	4.68%	0.43%	-1.19%	-0.11%
过去一年	9.06%	0.53%	20.21%	0.62%	-11.15%	-0.09%
过去三年	4.07%	0.46%	17.35%	0.56%	-13.28%	-0.10%
自基金合同生效起至今	4.47%	0.38%	9.04%	0.69%	-4.57%	-0.31%

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

鑫元鑫新收益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



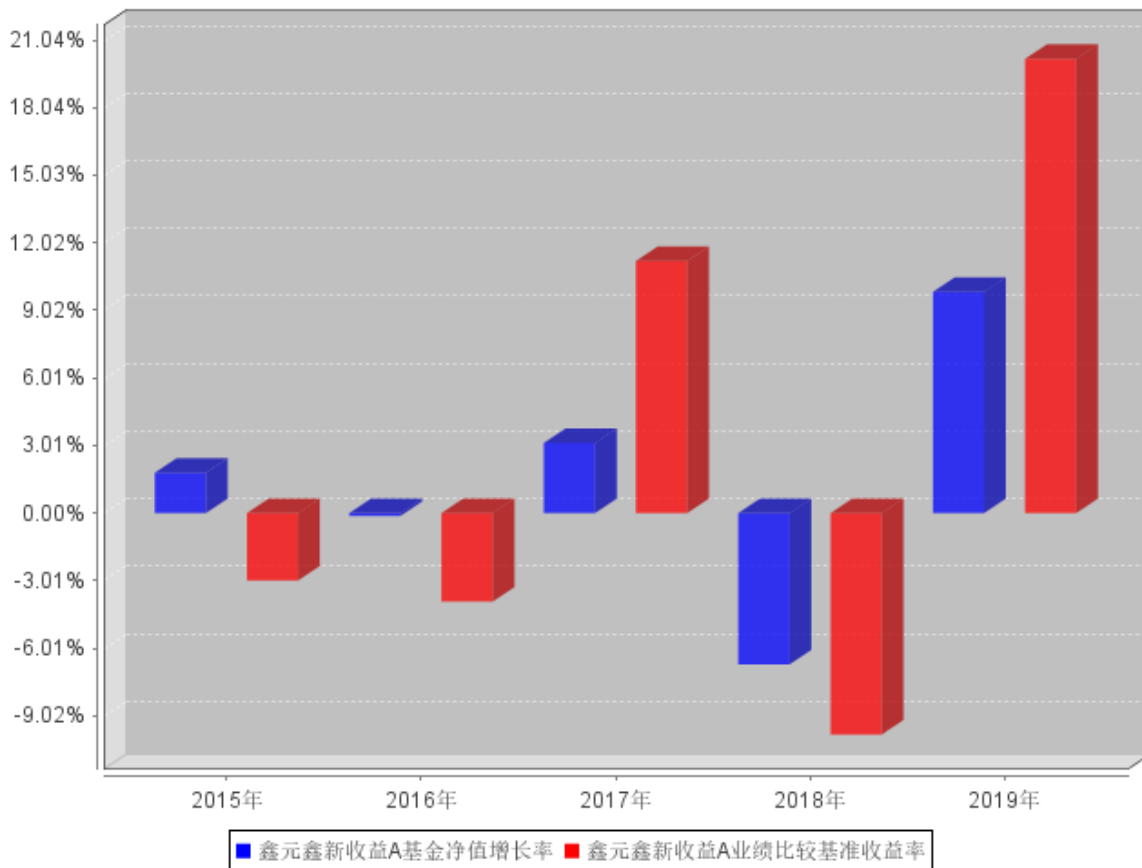
鑫元鑫新收益C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



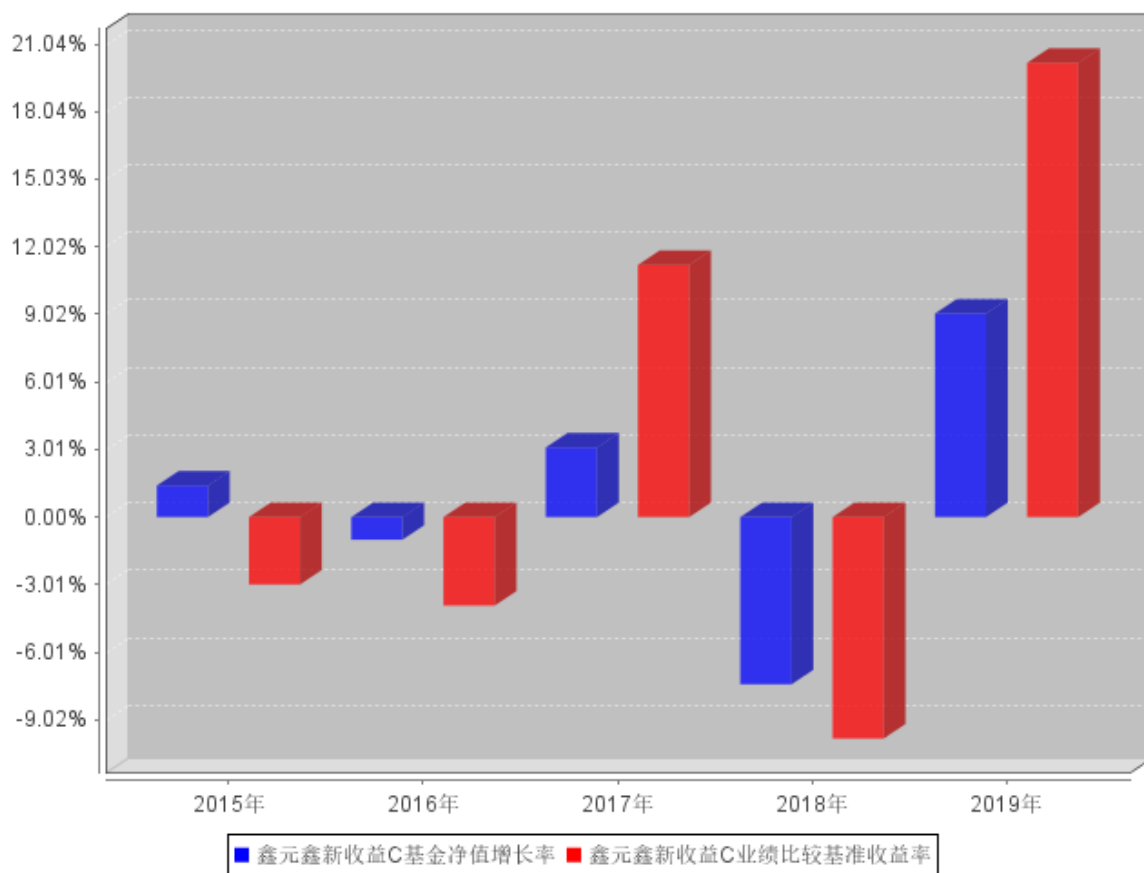
注：本基金的合同生效日为 2015 年 7 月 15 日。根据基金合同约定，本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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

鑫元鑫新收益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



鑫元鑫新收益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		
陈令朝	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018年1月9日	-	9年	学历：经济学硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年10月至2013年7月，任职于天相投资顾问有限公司，先后担任专题量化研究员、宏观策略研究员、策略主管，负责宏观研究及行业比较分析工作。2013年8月加入鑫元基金，担任宏观策略研究员，2014年9月至2018年1月担任专户投资经理。2018年1月9日至2019年11月25日担任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）的基金经理，2018年1月9日起担任鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年6月20日起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，2019年1月11日起担任鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
郑文旭	鑫元恒鑫收益增强债券型证券投资基金	2018年2月6日	-	11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：

	<p>金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、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、鑫元安睿三年定期开放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的基金经理</p>			<p>2008年6月至2010年6月任万得资讯债券产品经理。2010年6月至2013年7月任职于东海证券，先后担任债券研究员和研究主管。2013年8月加入鑫元基金担任信用研究员，2014年4月至2018年1月担任专户投资经理。2018年2月6日至2019年8月30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，2018年2月6日起担任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、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019年2月19日起担任鑫元臻利债券型证券投资基金的基金经理，2019年3月12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8月26日起担任鑫元安睿三年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2019年8月30日起担任鑫元恒利三个月定期开放债券型发起式证</p>
--	---	--	--	--

					券投资基金的基金经理，2019年9月11日起担任鑫元泽利债券型证券投资基金的基金经理，2019年11月13日起担任鑫元富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。
--	--	--	--	--	--

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 and 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

2019 年是资本市场比较重要的一年，科创板推出，退市公司创历史新高。十九届四中全会对制度改革进行顶层设计，资本市场的科技含量提升，并与产业转型的联动性更强，资本市场正在朝着承担经济转型升级的重要角色发展。产品在 2019 年表现不佳，我们判断对了趋势，却在正确的方向上下注不够重。

本年度产品采取自下而上的均衡配置策略，以净值稳定性为重要导向。运作期内权益资产配置比例相对较低，产品整体稳定性较强。在行业选择方面相对均衡，食品、医疗、机械、TMT、汽车等均有所配置。同时采取一定的回撤止损和止盈策略，该策略相对适应熊市环境，但对 2019 年的结构性行情，该策略有效性明显不足，对产品产生一定的负面冲击。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元鑫新收益 A 的基金份额净值增长率为 9.84%；鑫元鑫新收益 C 的基金份额净值增长率为 9.06%；同期业绩比较基准收益率为 20.21%。

#### 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 年对宏观经济有了新的认识，主要是因为中国参与全球化深度的提高，中美贸易摩擦问题加速了中国对知识产权保护和法治重要性的重视，进口博览会、全国各地自贸区的加速推进，贯彻发展新理念成为重要考核指标等等。特别是上海特斯拉项目落地的惊人速度，意味着一线城市在转型升级方面进入加快阶段。一直以来一线城市都在改革开放的最前沿担当重任，在关键时期是市场重要的风向标，我们认为当前正处于关键时点上。全球化深度提升以及政策上主动去适应这种变化，推动经济向知识经济转型，人才在这次转型中的重要性进入加速提升的拐点。政府再次回归服务型政府角色，一线城市正在加快向服务型政府的转变，正如浙江政府在 2020 年的政府工作报告中指出的“对民营企业真重视真关心真支持”、“坚持休养生息、放水养鱼”等等，本质是对经济转型过程中的趋势性力量的适应。这种适应转变越快，经济转型的节奏便越快，转型成功的概率就越高。因此跟踪宏观经济，应该更加重视实现宏观经济增长中的科技含量，单纯量上的增长并无太多的指示意义，这部分指标不仅仅包括研发强度、关键领域取得的突破，还包括专利、重要人才的引进力度与速度等等。

对于资本市场，由于政策和改革的加持，已经进入良性的循环阶段。投资策略方面，重点围绕两大方面展开：一是从产业转型角度，重点关注新兴产业，包括集成电路、新型显示、物联网、大数据、人工智能、新能源汽车、生命健康、大飞机、智能制造、前沿新材料等；二是头部配置策略。当前承担经济转型升级的区域基本成型，包括长三角一体化、粤港澳大湾区、深圳特色经济先行区、京津冀、成渝经济区等，这些区域经济占总量 70%以上，上述区域的新经济占比更加占优，资源将持续向头部区域集中。

#### 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鑫新收益灵活配置混合型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，鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的管理人——鑫元基金管理有限公司在鑫元鑫新收益灵活配置混合型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，鑫元鑫新收益灵活配置混合型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鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 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_B10 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	鑫元鑫新收益灵活配置混合型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鑫新收益灵活配置混合型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，后附的鑫元鑫新收益灵活配置混合型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，公允反映了鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 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，我们独立于鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金，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	鑫元鑫新收益灵活配置混合型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鑫新收益灵活配置混合型

	<p>证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鑫新收益灵活配置混合型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，就可能导致对鑫元鑫新收益灵活配置混合型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鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金不能持续经</p>

	营。  (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。  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。
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：鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金

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	29,700,964.64	28,337,903.85
结算备付金		3,378,536.34	1,827,845.17
存出保证金		63,203.89	163,923.37
交易性金融资产	7.4.7.2	29,786,660.00	28,139,888.00
其中：股票投资		23,626,060.00	22,113,488.00
基金投资		-	-
债券投资		6,160,600.00	6,026,400.00
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	40,000,400.00	38,000,380.00
应收证券清算款		1,539,550.18	-
应收利息	7.4.7.5	139,074.41	215,211.07
应收股利		-	-
应收申购款		729.25	10,147.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		104,609,118.71	96,695,299.28
<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		-	1,034,965.52
应付赎回款		1,083.77	49.24
应付管理人报酬		69,761.05	64,890.22
应付托管费		21,800.32	20,278.18
应付销售服务费		16.46	30.61
应付交易费用	7.4.7.7	76,521.03	159,753.09
应交税费		0.59	-
应付利息		-	-



应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	139,001.30	299,000.05
负债合计		308,184.52	1,578,966.91
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	99,020,225.64	99,193,333.88
未分配利润	7.4.7.10	5,280,708.55	-4,077,001.51
所有者权益合计		104,300,934.19	95,116,332.37
负债和所有者权益总计		104,609,118.71	96,695,299.28

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 99,020,225.64 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0533 元，份额总额 98,996,697.29 份，下属 C 类基金份额净值 1.0345 元，份额总额 23,528.35 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		11,945,495.91	-3,536,370.49
1.利息收入		1,523,097.79	5,192,792.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	248,875.37	141,067.63
债券利息收入		500,733.29	4,425,005.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		773,489.13	626,719.19
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,479,235.76	-16,180,932.26
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,620,350.77	-5,571,650.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-302,302.99	-10,768,599.83
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	161,187.98	159,318.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,941,228.95	7,450,017.45
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	1,933.41	1,751.84

列)			
<b>减：二、费用</b>		2,584,306.65	4,031,774.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	802,974.56	1,217,093.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	250,929.59	380,341.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	258.43	589.11
4. 交易费用	7.4.7.19	1,359,447.72	2,033,286.92
5. 利息支出		1,809.28	47,530.90
其中：卖出回购金融资产支出		1,809.28	47,530.90
6. 税金及附加		638.07	12,411.41
7. 其他费用	7.4.7.20	168,249.00	340,521.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		9,361,189.26	-7,568,145.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		9,361,189.26	-7,568,145.13

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金

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）	99,193,333.88	-4,077,001.51	95,116,332.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,361,189.26	9,361,189.26
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）	-173,108.24	-3,479.20	-176,587.44
其中：1. 基金申购款	351,612.25	4,014.38	355,626.63
2. 基金赎回款	-524,720.49	-7,493.58	-532,214.07
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	99,020,225.64	5,280,708.55	104,300,934.19



月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 201,451,366.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 33.43 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《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《鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，即 A 类基金份额和 C 类基金份额。其中在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，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、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元鑫新收益灵活配置混合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）、权证、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、证券公司短期债、可转换债券含分离交易可转债、可交换债、短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、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。本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 0-95%，权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%，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。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

#### 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) 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；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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和托管费及销售服务等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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益



分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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为两种：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 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。

#### 7.4.4.13 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股票投资和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：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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、资产支持证券和私募债

券除外)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券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。

#### 7.4.7 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	上年度末
	2019年12月31日	2018年12月31日
活期存款	29,700,964.64	28,337,903.85
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：	29,700,964.64	28,337,903.85

##### 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	21,069,931.86	23,626,060.00	2,556,128.14	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	6,159,400.00	6,160,600.00	1,200.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,159,400.00	6,160,600.00	1,200.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	27,229,331.86	29,786,660.00	2,557,328.14
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	22,497,388.81	22,113,488.00	-383,900.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,026,400.00	6,026,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	6,026,400.00	6,026,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	28,523,788.81	28,139,888.00	-383,900.81

#### 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	40,000,400.00	-
银行间市场	-	-
合计	40,000,400.00	-
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	38,000,380.00	-
银行间市场	-	-
合计	38,000,380.00	-

##### 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	8,162.98	5,484.48
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	1,520.40	822.60
应收债券利息	132,543.45	167,769.86
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-3,180.82	41,060.33
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	28.40	73.80
合计	139,074.41	215,211.07

#### 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	76,521.03	159,403.09
银行间市场应付交易费用	-	350.00
合计	76,521.03	159,753.09

#### 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	1.30	0.05
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	139,000.00	299,000.00
合计	139,001.30	299,000.05

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元鑫新收益 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	99,146,030.14	99,146,030.14
本期申购	334,150.12	334,150.12
本期赎回(以“-”号填列)	-483,482.97	-483,482.97
- 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	98,996,697.29	98,996,697.29

金额单位：人民币元

鑫元鑫新收益 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	47,303.74	47,303.74
本期申购	17,462.13	17,462.13
本期赎回(以“-”号填列)	-41,237.52	-41,237.52
- 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	23,528.35	23,528.35

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

鑫元鑫新收益 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,908,674.75	3,834,102.47	-4,074,572.28
本期利润	6,417,323.22	2,939,969.53	9,357,292.75
本期基金份额交易产生的变动数	4,160.98	-6,984.79	-2,823.81
其中：基金申购款	-10,567.98	14,697.83	4,129.85
基金赎回款	14,728.96	-21,682.62	-6,953.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,487,190.55	6,767,087.21	5,279,896.66

单位：人民币元

鑫元鑫新收益 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,140.76	1,711.53	-2,429.23
本期利润	2,637.09	1,259.42	3,896.51
本期基金份额交易产生的变动数	777.60	-1,432.99	-655.39
其中：基金申购款	-548.77	433.30	-115.47
基金赎回款	1,326.37	-1,866.29	-539.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-726.07	1,537.96	811.89

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	206,956.54	102,169.16
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	39,885.85	36,419.12
其他	2,032.98	2,479.35
合计	248,875.37	141,067.63

#### 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	497,101,891.38	746,666,382.28
减：卖出股票成本总额	489,481,540.61	752,238,033.11
买卖股票差价收入	7,620,350.77	-5,571,650.83

#### 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019	2018年1月1日至2018年



	年12月31日	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	-302,302.99	-10,768,599.83
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	-302,302.99	-10,768,599.83

#### 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1月1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	52,943,505.74	383,809,393.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	52,134,023.60	387,200,088.71
减：应收利息总额	1,111,785.13	7,377,904.33
买卖债券差价收入	-302,302.99	-10,768,599.83

#### 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1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	161,187.98	159,318.40
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	161,187.98	159,318.40

**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1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	2,941,228.95	7,450,017.45
——股票投资	2,940,028.95	-2,915,755.46
——债券投资	1,200.00	10,365,772.91
——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	2,941,228.95	7,450,017.45

**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1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	1,933.41	1,751.84
合计	1,933.41	1,751.84

注：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，基金管理人于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。详情请见基金管理人于指定媒介上披露的相关公告。

**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1月1日至2018年12 月31日
交易所市场交易费用	1,358,897.72	2,031,561.92
银行间市场交易费用	550.00	1,725.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,359,447.72	2,033,286.92

**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1月1日至2018年 12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	240,000.00
证券出借违约金	-	-
上清所证书查询费	1,200.00	1,200.00
债券账户维护费	36,000.00	45,000.00
银行汇划费用	1,049.00	1,321.60
律师费	-	3,000.00
合计	168,249.00	340,521.60

#### 7.4.7.21 分部报告

注：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
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”）	基金管理人的子公司

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	802,974.56	1,217,093.08
其中：支付销售机构的客户维护费	974.48	801.08

注：基金管理费逐日累计至每月月底，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

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

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	250,929.59	380,341.62

注：基金托管费逐日累计至每月月底，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		
	鑫元鑫新收益 A	鑫元鑫新收益 C	合计
南京银行	-	7.30	7.30
鑫元基金	-	58.21	58.21
合计	-	65.51	65.51

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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元鑫新收益 A	鑫元鑫新收益 C	合计
南京银行	-	8.64	8.64
鑫元基金	-	230.34	230.34
合计	-	238.98	238.98

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的 0.80% 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。销售服务费计提的计算方法如下：

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

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固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 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1月1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	29,700,964.64	206,956.54	28,337,903.85	102,169.16

#### 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

注：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
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	15,000	131,250.00	452,700.00	因配股而持有的流通受限股票

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
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	170	17,000.00	17,000.00	-
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	480	48,000.00	48,000.00	-
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	100	10,000.00	10,000.00	-

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	110	11,000.00	11,000.00	-
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	230	23,000.00	23,000.00	-
128085	鸿达 转债	2019年 12月18 日	2020 年1月 8日	新债未 上市	100.00	100.00	300	30,000.00	30,000.00	-
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	180	18,000.00	18,000.00	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 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

注：无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：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

本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。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	6,003,600.00	-
合计	6,003,600.00	-

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	17,000.00	-
AAA 以下	140,000.00	-
未评级	-	6,026,400.00
合计	157,000.00	6,026,400.00

注：未评级债券为政策性金融债。

**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约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期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	29,700,964.64	-	-	-	-	-	29,700,964.64
结算备付金	3,378,536.34	-	-	-	-	-	3,378,536.34
存出保证金	63,203.89	-	-	-	-	-	63,203.89
交易性金融资产	6,003,600.00	-	-	-	157,000.00	23,626,060.00	29,786,660.00
买入返售金融资产	40,000,400.00	-	-	-	-	-	40,000,400.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,539,550.18	1,539,550.18
应收利息	-	-	-	-	-	139,074.41	139,074.41
应收申购款	-	-	-	-	-	729.25	729.25
资产总计	79,146,704.87	-	-	-	157,000.00	25,305,413.84	104,609,118.71
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,083.77	1,083.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	69,761.05	69,761.05
应付托管费	-	-	-	-	-	21,800.32	21,800.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16.46	16.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	76,521.03	76,521.03
应付税费	-	-	-	-	-	0.59	0.59
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	139,001.30	139,001.30
负债总计	-	-	-	-	-	308,184.52	308,184.52
利率敏感度缺口	79,146,704.87	-	-	-	157,000.00	24,997,229.32	104,300,934.19
上年度末 2018年12月31	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

日							
资产							
银行存款	28,337,903.85	-	-	-	-	-	28,337,903.85
结算备付金	1,827,845.17	-	-	-	-	-	1,827,845.17
存出保证金	163,923.37	-	-	-	-	-	163,923.37
交易性金融资产	-	-6,026,400.00	-	-	-22,113,488.00	-	28,139,888.00
买入返售金融资产	38,000,380.00	-	-	-	-	-	38,000,380.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	215,211.07	215,211.07
应收申购款	-	-	-	-	-	10,147.82	10,147.82
资产总计	68,330,052.39	-6,026,400.00	-	-	-22,338,846.89	-	96,695,299.28
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,034,965.52	1,034,965.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	49.24	49.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,890.22	64,890.22
应付托管费	-	-	-	-	-	20,278.18	20,278.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30.61	30.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	159,753.09	159,753.09
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	299,000.05	299,000.05
负债总计	-	-	-	-	-	1,578,966.91	1,578,966.91
利率敏感度缺口	68,330,052.39	-6,026,400.00	-	-	-	-20,759,879.98	95,116,332.37

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	699.36	3,939.32
2. 市场利率上升 25 个基点	-699.20	-3,934.17

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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。本基金投资于股票资产占基金资产的 0%-95%，权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%，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	23,626,060.00	22.65	22,113,488.00	23.25
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	23,626,060.00	22.65	22,113,488.00	23.25

#### 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%	232,218.83	240,281.04
	沪深300指数下跌1%	-232,218.83	-240,281.04

#### 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的余额为人民币23,173,360.00元，属于第二层次的余额为人民币6,613,300.00元，无划分为第三层次的余额。（于2018年12月31日，属于第一层次的余额为人民币22,113,488.00元，属于第二层次的余额为人民币6,026,400.00元，无划分为第三层次的余额）。

##### 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	23,626,060.00	22.59
	其中：股票	23,626,060.00	22.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,160,600.00	5.89
	其中：债券	6,160,600.00	5.89
	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	40,000,400.00	38.24
	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	33,079,500.98	31.62
8	其他各项资产	1,742,557.73	1.67
9	合计	104,609,118.71	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,523,240.00	15.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,287,400.00	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,628,620.00	4.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,186,800.00	1.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,626,060.00	22.65

### 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	300750	宁德时代	54,000	5,745,600.00	5.51
2	002466	天齐锂业	65,000	1,961,700.00	1.88
3	002594	比亚迪	40,000	1,906,800.00	1.83
4	600570	恒生电子	24,000	1,865,520.00	1.79
5	603288	海天味业	17,000	1,827,670.00	1.75
6	600588	用友网络	60,000	1,704,000.00	1.63
7	300760	迈瑞医疗	9,000	1,637,100.00	1.57
8	002179	中航光电	40,000	1,562,400.00	1.50
9	300783	三只松鼠	20,000	1,287,400.00	1.23
10	300015	爱尔眼科	30,000	1,186,800.00	1.14
11	600276	恒瑞医药	10,000	875,200.00	0.84
12	600845	宝信软件	25,000	822,500.00	0.79
13	000513	丽珠集团	15,000	505,500.00	0.48
14	688008	澜起科技	7,000	501,270.00	0.48
15	002439	启明星辰	7,000	236,600.00	0.23

### 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	600588	用友网络	19,236,190.21	20.22
2	600271	航天信息	12,283,967.00	12.91

3	002475	立讯精密	11,618,306.79	12.21
4	300136	信维通信	9,939,910.67	10.45
5	300633	开立医疗	9,840,892.00	10.35
6	603083	剑桥科技	8,525,953.00	8.96
7	000063	中兴通讯	8,233,623.00	8.66
8	600570	恒生电子	8,196,939.60	8.62
9	600050	中国联通	7,729,352.03	8.13
10	002739	万达电影	7,190,024.50	7.56
11	600498	烽火通信	6,780,296.69	7.13
12	600118	中国卫星	6,734,794.00	7.08
13	603259	药明康德	6,632,800.00	6.97
14	300253	卫宁健康	6,379,808.00	6.71
15	002422	科伦药业	6,361,754.00	6.69
16	601933	永辉超市	6,284,192.38	6.61
17	600872	中炬高新	6,117,946.00	6.43
18	300353	东土科技	5,946,781.00	6.25
19	002152	广电运通	5,945,492.50	6.25
20	002179	中航光电	5,806,448.60	6.10
21	000516	国际医学	5,243,500.00	5.51
22	603960	克来机电	5,227,808.00	5.50
23	002373	千方科技	5,029,211.00	5.29
24	600346	恒力石化	5,005,355.00	5.26
25	601138	工业富联	4,899,300.00	5.15
26	300015	爱尔眼科	4,846,330.00	5.10
27	601066	中信建投	4,774,300.00	5.02
28	002281	光迅科技	4,714,728.00	4.96
29	002916	深南电路	4,653,174.00	4.89
30	002410	广联达	4,626,643.78	4.86
31	300760	迈瑞医疗	4,598,406.00	4.83
32	300308	中际旭创	4,522,490.00	4.75
33	600030	中信证券	4,429,500.00	4.66
34	603588	高能环境	4,118,377.00	4.33
35	002415	海康威视	4,110,662.00	4.32
36	000936	华西股份	4,092,200.00	4.30
37	002387	维信诺	4,051,623.00	4.26
38	600660	福耀玻璃	4,045,425.00	4.25

39	600259	广晟有色	4,045,330.00	4.25
40	300750	宁德时代	4,043,401.00	4.25
41	000034	神州数码	4,031,002.00	4.24
42	601360	三六零	4,005,146.00	4.21
43	600837	海通证券	3,992,280.85	4.20
44	600895	张江高科	3,964,753.00	4.17
45	300024	机器人	3,920,498.68	4.12
46	002405	四维图新	3,885,437.50	4.08
47	002065	东华软件	3,856,298.86	4.05
48	600900	长江电力	3,768,700.00	3.96
49	300070	碧水源	3,765,700.00	3.96
50	600705	中航资本	3,690,000.00	3.88
51	000066	中国长城	3,682,500.00	3.87
52	600867	通化东宝	3,626,628.00	3.81
53	601668	中国建筑	3,597,075.04	3.78
54	600216	浙江医药	3,549,875.56	3.73
55	002690	美亚光电	3,520,918.00	3.70
56	300357	我武生物	3,461,356.20	3.64
57	300003	乐普医疗	3,391,350.00	3.57
58	600276	恒瑞医药	3,345,818.84	3.52
59	002594	比亚迪	3,330,727.00	3.50
60	000963	华东医药	3,191,500.00	3.36
61	601117	中国化学	3,179,399.63	3.34
62	002439	启明星辰	3,165,442.00	3.33
63	601318	中国平安	3,137,560.00	3.30
64	002563	森马服饰	3,128,291.00	3.29
65	002841	视源股份	3,007,718.00	3.16
66	300456	耐威科技	2,999,502.70	3.15
67	000002	万科 A	2,809,143.00	2.95
68	600196	复星医药	2,785,585.00	2.93
69	002384	东山精密	2,762,500.00	2.90
70	300075	数字政通	2,711,053.00	2.85
71	600887	伊利股份	2,673,000.00	2.81
72	002466	天齐锂业	2,602,300.00	2.74
73	000826	启迪环境	2,587,812.75	2.72
74	002250	联化科技	2,532,600.00	2.66

75	600176	中国巨石	2,451,802.58	2.58
76	002024	苏宁易购	2,425,119.08	2.55
77	603866	桃李面包	2,416,760.00	2.54
78	000333	美的集团	2,366,279.00	2.49
79	300559	佳发教育	2,356,150.00	2.48
80	002463	沪电股份	2,243,800.00	2.36
81	000089	深圳机场	2,093,023.00	2.20
82	603882	金域医学	2,092,060.00	2.20
83	601966	玲珑轮胎	2,055,436.00	2.16
84	600309	万华化学	2,044,400.00	2.15
85	603288	海天味业	2,041,774.00	2.15
86	300020	银江股份	2,026,105.00	2.13
87	600315	上海家化	2,005,250.00	2.11
88	600602	云赛智联	1,978,622.00	2.08
89	600547	山东黄金	1,916,310.00	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 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	600588	用友网络	19,109,059.36	20.09
2	600271	航天信息	14,145,110.00	14.87
3	002475	立讯精密	11,919,094.10	12.53
4	300136	信维通信	10,354,631.00	10.89
5	300633	开立医疗	9,572,835.00	10.06
6	603083	剑桥科技	8,926,424.30	9.38
7	000063	中兴通讯	7,905,040.00	8.31
8	600050	中国联通	7,731,200.00	8.13
9	600118	中国卫星	7,206,839.00	7.58
10	002739	万达电影	7,048,846.50	7.41
11	600498	烽火通信	6,890,603.70	7.24
12	603259	药明康德	6,841,245.00	7.19
13	600570	恒生电子	6,684,407.20	7.03
14	002415	海康威视	6,588,579.51	6.93
15	002410	广联达	6,571,694.00	6.91
16	002422	科伦药业	6,544,050.00	6.88
17	600872	中炬高新	6,435,448.00	6.77

18	300253	卫宁健康	6,332,682.00	6.66
19	601933	永辉超市	6,313,450.00	6.64
20	300353	东土科技	6,192,176.00	6.51
21	000089	深圳机场	5,997,100.00	6.31
22	002152	广电运通	5,815,989.25	6.11
23	603960	克来机电	5,698,247.42	5.99
24	000516	国际医学	5,465,934.00	5.75
25	600346	恒力石化	5,239,200.00	5.51
26	300308	中际旭创	5,159,838.00	5.42
27	601066	中信建投	5,113,320.00	5.38
28	002373	千方科技	5,041,640.00	5.30
29	601138	工业富联	4,850,389.00	5.10
30	300456	耐威科技	4,457,790.10	4.69
31	002916	深南电路	4,442,330.20	4.67
32	600030	中信证券	4,427,900.00	4.66
33	600259	广晟有色	4,390,926.00	4.62
34	002179	中航光电	4,365,700.00	4.59
35	002281	光迅科技	4,325,967.00	4.55
36	002405	四维图新	4,265,674.00	4.48
37	000936	华西股份	4,148,414.00	4.36
38	600660	福耀玻璃	4,123,648.00	4.34
39	000066	中国长城	4,120,000.00	4.33
40	600837	海通证券	4,021,716.74	4.23
41	002387	维信诺	4,007,855.00	4.21
42	601360	三六零	3,934,168.00	4.14
43	300070	碧水源	3,929,895.00	4.13
44	000034	神州数码	3,918,606.00	4.12
45	600895	张江高科	3,852,200.00	4.05
46	002065	东华软件	3,833,716.86	4.03
47	600900	长江电力	3,799,500.00	3.99
48	002008	大族激光	3,788,506.00	3.98
49	600705	中航资本	3,780,000.00	3.97
50	603588	高能环境	3,732,710.00	3.92
51	300024	机器人	3,676,000.00	3.86
52	300015	爱尔眼科	3,629,444.00	3.82
53	002690	美亚光电	3,614,300.00	3.80
54	300357	我武生物	3,607,400.00	3.79
55	601668	中国建筑	3,487,000.00	3.67

56	600867	通化东宝	3,466,443.00	3.64
57	300003	乐普医疗	3,455,402.00	3.63
58	300760	迈瑞医疗	3,339,600.00	3.51
59	601318	中国平安	3,228,200.00	3.39
60	002563	森马服饰	3,216,468.00	3.38
61	600216	浙江医药	3,195,285.26	3.36
62	300559	佳发教育	3,147,700.00	3.31
63	601117	中国化学	3,140,000.00	3.30
64	002439	启明星辰	3,026,893.58	3.18
65	000002	万科 A	2,932,900.00	3.08
66	002841	视源股份	2,822,871.00	2.97
67	002384	东山精密	2,783,868.00	2.93
68	600196	复星医药	2,771,415.00	2.91
69	300075	数字政通	2,740,011.00	2.88
70	600887	伊利股份	2,738,000.00	2.88
71	300036	超图软件	2,593,500.00	2.73
72	002250	联化科技	2,587,789.00	2.72
73	000963	华东医药	2,565,606.00	2.70
74	603866	桃李面包	2,481,430.00	2.61
75	000333	美的集团	2,465,319.00	2.59
76	600276	恒瑞医药	2,458,395.00	2.58
77	600323	瀚蓝环境	2,400,305.00	2.52
78	600176	中国巨石	2,394,700.00	2.52
79	002024	苏宁易购	2,382,817.00	2.51
80	603882	金域医学	2,286,972.00	2.40
81	002463	沪电股份	2,282,163.77	2.40
82	000826	启迪环境	2,279,608.40	2.40
83	601966	玲珑轮胎	2,236,060.00	2.35
84	601021	春秋航空	2,158,947.00	2.27
85	300020	银江股份	2,016,101.00	2.12
86	600547	山东黄金	1,972,955.00	2.07
87	600315	上海家化	1,971,200.00	2.07
88	600309	万华化学	1,908,048.00	2.01

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	488,054,083.66
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	497,101,891.38
--------------	----------------

### 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	6,003,600.00	5.76
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）	157,000.00	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,160,600.00	5.91

### 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	019611	19 国债 01	60,000	6,003,600.00	5.76
2	113029	明阳转债	480	48,000.00	0.05
3	128085	鸿达转债	300	30,000.00	0.03
4	128084	木森转债	230	23,000.00	0.02
5	128086	国轩转债	180	18,000.00	0.02

### 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：本基金本报告期内未投资股指期货。

**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：本基金本报告期内未投资国债期货。

**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：本基金本报告期内未投资国债期货。

**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**

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未发生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	63,203.89
2	应收证券清算款	1,539,550.18
3	应收股利	-
4	应收利息	139,074.41
5	应收申购款	729.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,742,557.73

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本报告期末本基金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**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002466	天齐锂业	452,700.00	0.43	因配股而持有的流通受限股票

## § 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
鑫元鑫新收益 A	199	497,470.84	98,507,952.29	99.51%	488,745.00	0.49%
鑫元鑫新收益 C	98	240.09	0.00	0.00%	23,528.35	100.00%
合计	297	333,401.43	98,507,952.29	99.48%	512,273.35	0.52%

### 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	鑫元鑫新收益 A	57,194.63	0.0578%
	鑫元鑫新收益 C	4,230.83	17.9818%
	合计	61,425.46	0.0620%

### 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	鑫元鑫新收益 A	0~10
	鑫元鑫新收益 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元鑫新收益 A	0~10
	鑫元鑫新收益 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元鑫新收益 A	鑫元鑫新收益 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 15 日）基金份额总额	200,909,990.56	541,376.21
本报告期期初基金份额总额	99,146,030.14	47,303.74
本报告期基金总申购份额	334,150.12	17,462.13
减:本报告期基金总赎回份额	483,482.97	41,237.52
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	98,996,697.29	23,528.35

## § 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：本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

本报告期内本基金投资策略无改变。

### 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 50,000.00 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在本报告期内未受稽查或处罚。

### 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	461,835,513.26	46.89%	355,275.13	42.95%	-
华泰证券	2	266,423,770.16	27.05%	273,943.77	33.12%	-

广发证券	2	256,765,441.62	26.07%	197,915.20	23.93%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
方正证券	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。

### 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	31,057,294.46	58.16%	1,722,400,000.00	32.52%	-	-
华泰证券	20,285,893.53	37.99%	2,562,000,000.00	48.37%	-	-
广发证券	2,052,857.22	3.84%	1,012,100,000.00	19.11%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 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	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	公司网站、中国证券报	2019 年 1 月 22 日
3	鑫元基金管理有限公司关于	公司网站、上海证券报、	2019 年 1 月 31 日

	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	中国证券报、证券时报、 证券日报	
4	鑫元基金公告	公司网站	2019 年 2 月 21 日
5	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
6	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019 年第 1 号）	公司网站、中国证券报	2019 年 3 月 1 日
7	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2019 年第 1 号）	公司网站	2019 年 3 月 1 日
8	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告摘要	公司网站、中国证券报	2019 年 3 月 28 日
9	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告	公司网站	2019 年 3 月 28 日
10	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	公司网站、中国证券报	2019 年 4 月 18 日
11	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金销售机构、开通基金转换业务、定期定额投资业务的公告	公司网站、中国证券报、 上海证券报、证券日报、 证券时报	2019 年 4 月 26 日
12	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
13	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
14	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	公司网站、中国证券报	2019 年 7 月 19 日
15	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
16	鑫元基金管理有限公司关于	公司网站、中国证券报、	2019 年 7 月 23 日

	旗下部分基金新增北京百度百盈基金销售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	上海证券报、证券日报	
17	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要	公司网站、中国证券报	2019 年 8 月 24 日
18	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告	公司网站	2019 年 8 月 24 日
19	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2019 年第 2 号）	公司网站	2019 年 8 月 29 日
20	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019 年第 2 号）	公司网站、中国证券报	2019 年 8 月 29 日
21	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
22	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
23	鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	公司网站	2019 年 10 月 24 日
24	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
25	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



## § 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	20190101-20191231	98,507,952.29	0.00	0.00	98,507,952.29	99.48%
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，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 5000 万元情况的，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。

### 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鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元鑫新收益灵活配置混合型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