鑫元永利债券型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告

2020年6月30日

基金管理人: 鑫元基金管理有限公司

基金托管人: 江苏银行股份有限公司

报告送出日期: 2020年7月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本 基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

| 基金简称 | 鑫元永利 |
|------------|---|
| 交易代码 | 005497 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019年5月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 450, 004, 453. 11 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下,积极配置 优质债券、合理安排组合期限,力争获取超越业绩比 较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金为债券型基金,对债券的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下,本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对债券资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货 币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 |
| 基金管理人 | 鑫元基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 江苏银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2020年4月1日 - 2020年6月30日) |
|-----------------|-----------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 4, 258, 262. 87 |
| 2. 本期利润 | -2, 752, 113. 72 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0051 |
| 4. 期末基金资产净值 | 456, 075, 308. 46 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0135 |

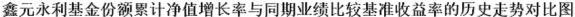
- 注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益) 扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- (2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

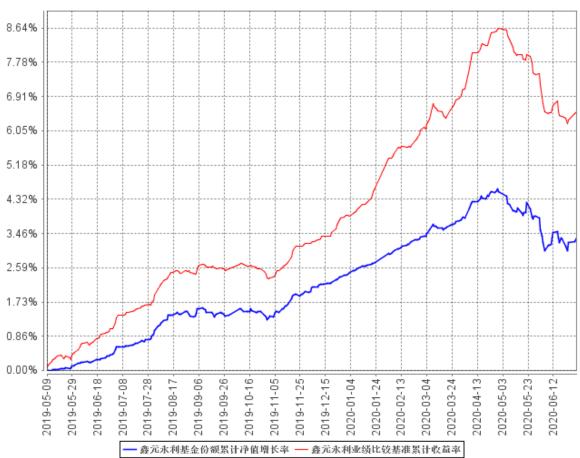
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -0.44% | 0.11% | -0.39% | 0.13% | -0.05% | -0.02% |
| 过去六个月 | 0.92% | 0.08% | 2.52% | 0.12% | -1.60% | -0.04% |
| 过去一年 | 2. 92% | 0.06% | 5. 42% | 0.09% | -2.50% | -0.03% |
| 自基金合同 生效起至今 | 3. 35% | 0.06% | 6. 52% | 0.08% | -3. 17% | -0.02% |

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





注:本基金的合同生效日为2019年5月9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合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-----------------------|-------------|-----------|-----------------|--------------------------------------|
| 姓石 | - 昭 第 | 任职日期 | 离任日期 | 证分 <u>从</u> 业平成 | 近·奶 |
| 赵慧 | 鑫元货币 市 场 基 金、鑫元 | 2019年5月9日 | 2020年6月1日 | 6年 | 学历:经济学专业, 硕士。相关业务资格: 证券投资基金从业资 |

| 汇利债券 | |
|------------------------|--|
| 型证券投 | |
| 资基金、 | |
| 鑫元双债 | |
| 增强债券 | |
| 型证券投 | |
| 至 显 分 及 | |
| 桑 金 玉 、 鑫 元 得 利 | |
| | |
| 债券型证 | |
| 券投资基 ^ 金二 | |
| 金、鑫元 | |
| 广利定期 | |
| 开放债券 | |
| 型发起式 | |
| 证券投资 | |
| 基金、鑫 | |
| 元常利定 | |
| 期开放债 | |
| 券型发起 | |
| 式证券投 | |
| 资基金、 | |
| 鑫元增利 | |
| 定期开放 | |
| 债券型发 | |
| 起式证券 | |
| 投资基 | |
| 金、鑫元 | |
| 享利定期 | |
| 开放债券 | |
| 型发起式 | |
| | |
| 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 | |
| 价值精选 | |
| 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 | |
| | |

格。从业经历: 2010 年 7 月起任北京汇致 资本管理有限公司交 易员, 2011年4月至 2012年2月任南京银 行金融市场部资产管 理部和金融市场部投 资交易中心债券交易 员, 2014年6月加入 鑫元基金,担任基金 经理助理, 2016 年 1 月 13 日至 2019 年 10 月15日担任鑫元兴利 定期开放债券型发起 式证券投资基金(原 鑫元兴利债券型证券 投资基金)的基金经 理,2016年3月2日 起担任鑫元货币市场 基金的基金经理, 2016年3月9日起担 任鑫元汇利债券型证 券投资基金的基金经 理,2016年6月3日 起担任鑫元双债增强 债券型证券投资基金 的基金经理,2016年 7月13日至2019年 10月22日担任鑫元裕 利债券型证券投资基 金的基金经理,2016 年8月17日起担任鑫 元得利债券型证券投 资基金的基金经理, 2016年10月27日至 2019年10月11日担 任鑫元聚利债券型证 券投资基金的基金经 理, 2016年12月22 日至 2019 年 10 月 22 日担任鑫元招利债券 型证券投资基金的基 金经理,2017年3月 13 日至 2019 年 10 月 15 日担任鑫元瑞利定

开放债券型发起式证

| 起式证券 | | 期开放债券型发起式 |
|------|--|--|
| 投资基 | | 证券投资基金(原鑫 |
| 金、鑫元 | | 元瑞利债券型证券投 |
| 悦利定期 | | 资基金)的基金经理, |
| 开放债券 | | 2017年3月17日至 |
| 型发起式 | | 2020年6月1日担任 |
| 证券投资 | | 鑫元添利三个月定期 |
| 基金、鑫 | | 开放债券型发起式证 |
| 元恒利三 | | 券投资基金(原鑫元 |
| 个月定期 | | 添利债券型证券投资 |
| 开放债券 | | 基金)的基金经理, |
| 型发起式 | | 2017年12月13日起 |
| 证券投资 | | 担任鑫元广利定期开 |
| 基金、鑫 | | 放债券型发起式证券 |
| 元富利三 | | 投资基金的基金经 |
| 个月定期 | | 理,2018年3月22日 |
| 开放债券 | | 起担任鑫元常利定期 |
| 型发起式 | | 开放债券型发起式证 |
| 证券投资 | | 券投资基金的基金经 |
| 基金、鑫 | | 理,2018年4月19日 |
| 元中短债 | | 至 2019 年 10 月 11 日 |
| 债券型证 | | 担任鑫元合利定期开 |
| 券投资基 | | 放债券型发起式证券 |
| 金的基金 | | 投资基金的基金经 |
| 经理 | | 理,2018年5月25日 |
| | | 起担任鑫元增利定期 |
| | | 开放债券型发起式证 |
| | | 券投资基金的基金经 |
| | | 理,2018年7月11日 |
| | | 起担任鑫元淳利定期 |
| | | 开放债券型发起式证 |
| | | 券投资基金的基金经 |
| | | 理,2018年11月13 |
| | | 日起担任鑫元鑫趋势 |
| | | 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 |
| | | 证券投资基金和鑫元 |
| | | 证分权员基金和鑫儿 行业轮动灵活配置混 |
| | | 行业北切火佔癿直底 合型发起式证券投资 |
| | | 基金的基金经理, |
| | | 2019 年 1 月 24 日至 |
| | | 2020年4月20日担任 |
| | | 鑫元荣利三个月定期 |
| | | 鐘儿不们———————————————————————————————————— |

| | | | | | 业 hn 次 ++ |
|------------|------|---------|---------|----|-------------------|
| | | | | | 券投资基金的基金经 |
| | | | | | 理,2019年1月25日 |
| | | | | | 至 2020 年 4 月 20 日 |
| | | | | | 担任鑫元臻利债券型 |
| | | | | | 证券投资基金的基金 |
| | | | | | 经理,2019年3月1日 |
| | | | | | 至 2020 年 4 月 20 日 |
| | | | | | 担任鑫元承利三个月 |
| | | | | | 定期开放债券型发起 |
| | | | | | 式证券投资基金的基 |
| | | | | | 金经理,2019年4月 |
| | | | | | 30 日起担任鑫元悦利 |
| | | | | | 定期开放债券型发起 |
| | | | | | 式证券投资基金的基 |
| | | | | | 金经理,2019年5月 |
| | | | | | 9 日至 2020 年 6 月 1 |
| | | | | | 日担任鑫元永利债券 |
| | | | | | 型证券投资基金的基 |
| | | | | | 金经理,2019年7月 |
| | | | | | 5 日起担任鑫元恒利 |
| | | | | | 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 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,2020年5月27日 |
| | | | | | 起担任鑫元中短债债 |
| | | | | | 券型证券投资基金的 |
| | | | | | 基金经理。 |
| | 鑫元安鑫 | | | | 学历:工商管理,硕 |
| | 宝货币市 | | | | 士。相关业务资格: |
| | 场基金、 | | | | 证券投资基金从业资 |
| | 鑫元货币 | | | | 格。从业经历: 2009 |
| | 市场基 | | | | 年 8 月起任南京银行 |
| | 金、鑫元 | | | | 股份有限公司金融市 |
| 颜 昕 | 兴利定期 | 2019年5月 | 2020年6月 | 6年 | 场部、金融同业部交 |
| | 开放债券 | 9 日 | 1 日 | | 易员。2013年9月加 |
| | 型发起式 | | | | 入鑫元基金担任交易 |
| | 证券投资 | | | | 员, 2014年2月至8 |
| | 基金、鑫 | | | | 月担任鑫元基金交易 |
| | 元裕利债 | | | | 室主管,2014年9月 |
| | 券型证券 | | | | 起担任鑫元货币市场 |
| | 投资基 | | | | 基金的基金经理助 |

| 金、鑫元 | | 理,2015年6月26日 |
|---------------------------------------|--|------------------------|
| 聚利债券 | | 起担任鑫元安鑫宝货 |
| 型证券投 | | 币市场基金的基金经 |
| 资基金、 | | 理,2015年7月15日 |
| 鑫元招利 | | 起担任鑫元货币市场 |
| 债券型证 | | 基金的基金经理, |
| 券投资基 | | 2016年1月13日起担 |
| 金、鑫元 | | 任鑫元兴利定期开放 |
| 瑞利定期 | | 债券型发起式证券投 |
| 开放债券 | | 资基金 (原鑫元兴利 |
| 型发起式 | | 债券型证券投资基 |
| 证券投资 | | 金)的基金经理,2016 |
| 基金、鑫 | | 年 3 月 2 日至 2019 年 |
| 元合利定 | | 1月21日担任鑫元合 |
| 期开放债 | | 享纯债债券型证券投 |
| | | 资基金(原鑫元合享 |
| 式证券投 | | 分级债券型证券投资 |
| 资基金、 | | 基金)的基金经理, |
| 五 | | 2016年3月2日至 |
| 三个月定 | | 2019年8月30日担任 |
| 期开放债 | | 鑫元合丰纯债债券型 |
| 券型发起 | | 证券投资基金(原鑫 |
| 式证券投 | | 元合丰分级债券型证 |
| 为 | | 为投资基金)的基金 类投资基金)的基金 |
| □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ | | 经理, 2016 年 3 月 9 |
| 至立红埕 | | 日至 2019 年 10 月 22 |
| | | 日担任鑫元汇利债券 |
| | | , |
| | | 型证券投资基金的基金经理,2016年6月 |
| | | 3 日至 2019 年 10 月 |
| | | 22 日担任鑫元双债增 |
| | | |
| | | 强债券型证券投资基金的基金经理,2016 |
| | | |
| | | 年7月13日起担任鑫 |
| | | 元裕利债券型证券投资基本的基本 |
| | | 资基金的基金经理, |
| | | 2016年8月17日至 |
| | | 2019年10月15日担 |
| | | 任鑫元得利债券型证 |
| | | 券投资基金的基金经 |
| | | 理, 2016年10月27 |
| | | 日起担任鑫元聚利债 |
| | | 券型证券投资基金的 |
| | | 基金经理,2016年12 |
| | | 月 22 日起担任鑫元招 |

| 利债券型企业,2017年3月3日期上债券型交担,2017年3月3月17日至13月3期开放债券型发起式正券到金、证券型型。2019年10月20月20日4日期产价,2017年10月12日日担期产价,2018年3月17日至11日担期产价,2018年3月2019年10月25日2019年10月13日至2019年10月15日担债债券型公司,2018年3月22日至2日至2019年10月1日担债债券型公司,2018年3月21日担债债券型公司,2018年3月2日担债债券型公司,2018年3月2日担债债券型公司,2019年10月2期开放债券基金经理,2019年10月2期开放债券基金经理。2019年10月2期开放债券型金百月11日担任债券型金百月11日1日担任债券型金百月11日1日担任债券型公司,2019年10月定期开放债券基金百月11日1日担任金2020年4月20日年2019年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1月2日至2020年4月20日年1日年1日日至2020年4月20日年1日日至2020年4月20日年1日日至2020年4月20日日至2020年4月20日日至2020年4月20日日至2020年4月20日日至2020年201日至2020年2020年2020年2020年2020年2020年2020年202 | | | |
|---|--|--|--------------------|
| 年3月13日起担任鑫元· 元 对定证 对投资 型 担担 在 | | | 利债券型证券投资基 |
| 元瑞利定证明并投资基金(原料投资基金(原料投资基金),2017年13月17日担任第开放债券型金经理。2017年10月29日担任期开放债券型发展。在经理,2018年2019年10月15日担债券基金(原务投资基金)的基金经理,2018年2019年10月15日担债券基金的基金等型。2018年2019年10月11日担债券基金的基金。经理。2018年2019年10月22日担债债券基金。19月22日担债债券基金。经理。2018年3月22日担抵债券基金。经理。2018年5月2岁日担抵债券基金。经理。2018年5月2岁日至2019年10月29月开放债券基金。经理。2018年5月2岁日担抵债券基金。经过,2018年5月29日担任企务股营,2018年5月29日担任企务股营,2018年5月29日担任企务股营,2018年5月29日担任企务企业,2019年10月11日担任金额工资,2019年10月11日担任金额工资,2019年10月11日担任金额工资,2019年10月11日担任金额工资,2019年1月20日担任金额工资,2019年1月20日担任金额工资,2019年4月20日担任金额公司,2019年4月20日担任金额公司,2019年3月11日至2020年4月20日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日,2019年3月1 | | | 金的基金经理,2017 |
| 元瑞利定证明并投资基金(原料投资基金(原料投资基金),2017年13月17日担任第开放债券型金经理。2017年10月29日担任期开放债券型发展。在经理,2018年2019年10月15日担债券基金(原务投资基金)的基金经理,2018年2019年10月15日担债券基金的基金等型。2018年2019年10月11日担债券基金的基金。经理。2018年2019年10月22日担债债券基金。19月22日担债债券基金。经理。2018年3月22日担抵债券基金。经理。2018年5月2岁日担抵债券基金。经理。2018年5月2岁日至2019年10月29月开放债券基金。经理。2018年5月2岁日担抵债券基金。经过,2018年5月29日担任企务股营,2018年5月29日担任企务股营,2018年5月29日担任企务股营,2018年5月29日担任企务企业,2019年10月11日担任金额工资,2019年10月11日担任金额工资,2019年10月11日担任金额工资,2019年10月11日担任金额工资,2019年1月20日担任金额工资,2019年1月20日担任金额工资,2019年4月20日担任金额公司,2019年4月20日担任金额公司,2019年3月11日至2020年4月20日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日日担任金额公司,2019年3月11日,2019年3月1 | | | 年3月13日起担任鑫 |
| 型发尾露云端杂虫 2017 年 10 月 29 日 40 月 17 日 42 期 45 单 3 月 17 日 42 期 45 单 42 经 5 年 3 月 17 日 42 日 42 年 3 月 17 日 42 日 42 年 3 日 42 年 4 日 4 日 4 日 4 日 4 日 4 日 4 日 4 日 4 日 4 | | | |
| 金(原教设 基金)的基金经理、2019年10月29日担任森亚族利 三个月定期开教投资基金。 1月17日至2019年10月29日担任森政债券基金会证, 2017年12月13日担任森沙设基金(原教设 2017年12月13日担任森沙发设 基金等理、2019年10月15日担任森沙发 数基金经理、2019年10月15日担任森沙发 数基金经期,2018年10月22日至任森外型处的基金会经理,2018年4月19日起和被债基金。 1月2日起在森沙发达基金经理,2018年4月22期开放债资基金。 1月1日担任森河产发 电通讯 2018年5月25日至 2019年10月29日担任森河产发起基金经理,2018年7月1日担任金元增发起基金经理,2018年7月1日担任金元增发起基金经理,2019年10月11日担任金元均发达基金的基。 2019年10月11日,1日至2019年10月11日,1日至2019年10月11日,1日至2019年1月24日,2019年1月24日,2019年1月24日,2019年1月24日,2019年3月1 | | | |
| 型证券投资基金)的基金经理、2017年3月17日至2019年10月29日担任鑫元添和一个人起度森放债券型证券投资基金)的基金经理,2017年12月13日至2019年10月15日担任鑫元广利定期证券投资基金的基金经理,2018年3月22日年2019年10月11日担任鑫元产发起或选经理,2018年3月22日年2019年10月2日起放债券型的基金经理,2018年3月25日至2019年10月29日担任鑫元党起志金经理,2018年3月25日至2019年10月11日在债券型发起或经理,2018年7月11日担任券型发起或经理,2018年7月11日担任债券型发起或经理,2018年7月11日在金元产资基金。2019年1月11日在债券型发起或经理,2019年1月11日在债券型发起或经理,2019年1月21日至2020年来到正则依债券基金的基金经理,2019年1月20日至2020年来到于2019年1月20日至2020年来到于2019年1月20日至2020年来到于2019年1月20日至2020年来到于2019年3月1日至2020年3月1日至2020年3月1日至2020年3月1日至2020年3月1日至2020年3月1 | | | |
| 基金经理, 2017 年 3 月 17 日至 2019 年 10 月 29 日担任鑫元添利 三个月定期开放债券型发起式ご券投资基金(原产资本金)的基金经理,2017 年 12 月 13 日担任金元公员等 型证券投资基金(则为 20 日年 10 月 15 日担任金元广利定期开放债券型金统基。金经理,2018 年 3 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日担任鑫元常利定期开放债券型发的基金经理,2018 年 3 月 12 日担任鑫元常利定期开放债券型发的基金经理,2018 年 5 月 25 日至 2019 年 10 月 11 日担债券型发的基金经理,2018 年 7 月 11 日至 2019 年 10 月 11 日至 2019 年 10 月 11 日至 2019 年 10 月 11 日至 2019 年 1 月 24 日至 2019 年 1 月 24 日至 2020 年 4 月 20 日担任鑫元效起或证券投资基金的基金经理,2019 年 1 月 24 日至 2020 年 4 月 20 日担任鑫元效发表。2019 年 1 月 24 日至 2020 年 4 月 20 日担任鑫元效券投资基金的基金经理,2019 年 3 月 1 | | | |
| 月17日至2019年10月29日担任鑫元添利三个月定期开放债券型发起或益证券投资基金(证券投资基金)的基金经理,2017年12月13日至2019年10月15日担任鑫元广和定期严投资基金,2018年3月22日至2019年10月11日担任鑫型发起或试证券投资基金的基金经理,2018年3月22日至2019年10月21日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元增入宣明年10月11日至2019年10月11日至2019年1月2日担任金元学及过工证券投资基金的基。经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任金元荣及时基本经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任金元荣发设资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日年1月24日至2020年4月20月26日,2019年3月1 | | | |
| 月 29 日担任鑫元添利三个月定期开放债券型发 基金(原鑫元课券投资基金)的基金经理,2017年12月13日至 2019年10月15日担任鑫元广利定期开放债券型 8 全型,2018年3月22日至 2019年10月11日担任鑫型发起或证券投资基金。经理,2018年4月19日起担任鑫元党规查。经理,2018年4月19日起担任鑫元党规志。经理,2018年6月25日至 2029年10月29日担任鑫元型发起或证券投资基金。经理 2019年10月29日担任鑫元型发制更有规则定,为投资基金。经理,2019年1月2期开放债券型的基。1日至2019年10月11日担任鑫元学发起或证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任金元荣利定式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任金元荣升型发动或证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 三个月定期开放债券型发起之。 | | | |
| 型发起或证券投资基金)的基金经理,2017年12月13日至2019年10月15日担任鑫元广利定期开放债券型金数型或证券投资基金的基金经理,2018年3月22日至2019年10月11日担任鑫元常发起或证券投资基金经理,2018年4月19日起担任鑫元党发起或证券投资基金经理,2018年4月19日起担任鑫元党型的第年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券基金经理,2018年7月1日至2019年10月11日至2019年10月11日至2019年10月11日至2019年10月11日至2019年10月11日至2019年1月24日至2019年1月24日至2019年1月24日至2019年1月24日至2020年4月20日担任金元荣投资基金的基金经理,2019年3月1定期开放债券型发起证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 金(原鑫元添利债券型证券投资基金)的基金经理,2017年12月13日至2019年10月15日担任鑫元广利定期开放债券型放基式证券投资基金的基金经理,2018年3月22日至2019年10月11日担任鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年4月19日起担任鑫元含利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起金处理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起或经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个日定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个日定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 型证券投资基金)的基金经理,2017年12月13日至2019年10月15日担任鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年3月22日至2019年10月11日开放债券型发起或证券投资基金的基金经理,2018年4月19日起担任鑫元常和定期开放债券型金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增和定期开放债券基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元增和定期开放债券型发起或证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年1月1日担任鑫元淳和定期开放债券型发起或证券投资基金的基金经理,2019年1月2日至2020年4月20日1日担任鑫元荣和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1日 | | | 型发起式证券投资基 |
| 基金经理,2017年12月13日至2019年10月15日担任鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年3月22日至2019年10月11日担任鑫元常利定期开放债券型金的基金经理,2018年4月19日起担任鑫元常型处起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元常利起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日担任鑫元常利起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日担任鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月1日担任鑫元常和定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20月度期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年4月20月度期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | 金(原鑫元添利债券 |
| 月13日至2019年10月15日担任鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年3月22日至2019年10月11日担任鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年4月19日起担任鑫元合为起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月1日至2019年10月11日担任鑫元淳利起,并放债券型起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | 型证券投资基金)的 |
| 月15日担任鑫元广利 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2018年3月 22日至2019年10月 11日担任鑫元常利定 期开放债券型发起式 证券投资基金的基金 经理,2018年6利定 期开放债券型发起式 证券投资基金的基金 经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期 开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日 至2019年10月11日 担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日 至2020年4月20日 担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日 至2020年4月20日 担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | 基金经理, 2017年12 |
| 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2018年3月 22日至2019年10月 11日担任鑫元常利定 期开放债券型发起式 证券投资基金的基金 经理,2018年4月19日起担任鑫元合利定 期开放债券型发起式 证券投资基金的基金 经理,2019年10月29日担任鑫元增利定期 开放债券基金的基金 经理,2018年7月11日至2019年10月11日 担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券 投资基金的基金 理,2019年1月11日 担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券 投资基金的基金 经理,2019年1月24日至2020年4月20日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | 月 13 日至 2019 年 10 |
| 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2018年3月 22日至2019年10月 11日担任鑫元常利定 期开放债券型发起式 证券投资基金的基金 经理,2018年4月19日起担任鑫元合利定 期开放债券型发起式 证券投资基金的基金 经理,2019年10月29日担任鑫元增利定期 开放债券基金的基金 经理,2018年7月11日至2019年10月11日 担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券 投资基金的基金 理,2019年1月11日 担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券 投资基金的基金 经理,2019年1月24日至2020年4月20日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | 月 15 日担任鑫元广利 |
| 式证券投资基金的基金经理,2018年3月22日至2019年10月11日担任鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年4月19日起担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金任理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元津利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 金经理,2018年3月 22日至2019年10月 11日担任鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金 经理,2018年4月19日起担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金 经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起或证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起或证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起或证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 22 日至 2019 年 10 月 11 日担任鑫元常利定 期开放债券型发起式 证券投资基金的基金 经理, 2018 年 4 月 19 日起担任鑫元合利定 期开放债券型发起式 证券投资基金的基金 经理, 2018 年 5 月 25 日至 2019 年 10 月 29 日担任鑫元增利定期 开放债券型发起式证 券投资基金的基金经 理, 2018 年 7 月 11 日 至 2019 年 10 月 11 日 担任鑫元淳利定期开 放债券型发起式证券 投资基金的基金经 理, 2019 年 1 月 24 日 至 2020 年 4 月 20 日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理, 2019 年 3 月 1 | | | |
| 11 日担任鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018 年 4 月 19 日起担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018 年 5 月 25 日至 2019 年 10 月 29 日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018 年 7 月 11 日至 2019 年 10 月 11 日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019 年 1 月 24 日至 2020 年 4 月 20 日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019 年 3 月 1 | | | |
| 期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年4月19日起担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 证券投资基金的基金经理,2018年4月19日起担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 经理,2018年4月19日起担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 日起担任鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 证券投资基金的基金 经理,2018年5月25 日至2019年10月29 日担任鑫元增利定期 开放债券型发起式证 券投资基金的基金经 理,2018年7月11日 至2019年10月11日 担任鑫元淳利定期开 放债券型发起式证券 投资基金的基金经 理,2019年1月24日 至2020年4月20日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | |
| 经理,2018年5月25日至2019年10月29日担任鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 日至 2019 年 10 月 29 日担任鑫元增利定期 开放债券型发起式证 券投资基金的基金经理,2018 年 7 月 11 日 至 2019 年 10 月 11 日 担任鑫元淳利定期开 放债券型发起式证券 投资基金的基金经理,2019 年 1 月 24 日 至 2020 年 4 月 20 日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019 年 3 月 1 | | | |
| 日担任鑫元增利定期 开放债券型发起式证 券投资基金的基金经 理,2018年7月11日 至2019年10月11日 担任鑫元淳利定期开 放债券型发起式证券 投资基金的基金经 理,2019年1月24日 至2020年4月20日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | |
| 开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 券投资基金的基金经理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | |
| 理,2018年7月11日至2019年10月11日担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | 开放债券型发起式证 |
| 至 2019 年 10 月 11 日 担任鑫元淳利定期开 放债券型发起式证券 投资基金的基金经 理,2019 年 1 月 24 日 至 2020 年 4 月 20 日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019 年 3 月 1 | | | 券投资基金的基金经 |
| 担任鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | 理,2018年7月11日 |
| 放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2019年3月1 | | | 至 2019 年 10 月 11 日 |
| 投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日 至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | 担任鑫元淳利定期开 |
| 投资基金的基金经理,2019年1月24日至2020年4月20日 至2020年4月20日担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | 放债券型发起式证券 |
| 理, 2019 年 1 月 24 日 至 2020 年 4 月 20 日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理, 2019 年 3 月 1 | | | |
| 至 2020 年 4 月 20 日 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理, 2019 年 3 月 1 | | | |
| 担任鑫元荣利三个月 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | |
| 定期开放债券型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | |
| 式证券投资基金的基 金经理,2019年3月1 | | | |
| 金经理,2019年3月1 | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | 日至 2020 年 4 月 20 |

| | T | T | T | T | T |
|-----|-----------------|---------|---|-----|------------------------|
| | | | | | 日担任鑫元承利三个 |
| | | | | | 月定期开放债券型发 |
| | | | | | 起式证券投资基金的 |
| | | | | | 基金经理,2019年4 |
| | | | | | 月 30 日至 2020 年 6 |
| | | | | | 月 1 日担任鑫元悦利 |
| | | | | | 定期开放债券型发起 |
| | | | | | 式证券投资基金的基 |
| | | | | | 金经理,2019年5月 |
| | | | | | 9 日至 2020 年 6 月 1 |
| | | | | | 日担任鑫元永利债券 |
| | | | | | 型证券投资基金的基 |
| | | | | | 金经理, 2019年7月 |
| | | | | | 5 日起担任鑫元恒利 |
| | | | | | 三个月定期开放债券 |
| | | | | | 型发起式证券投资基 |
| | | | | | 金的基金经理。 |
| | 鑫元聚鑫 | | | | 学历: 工商管理、应 |
| | 收益增强 | | | | 用金融硕士研究生。 |
| | 债券型发 | | | | 相关业务资格:证券 |
| | 起式证券 | | | | 投资基金从业资格。 |
| | 投资基 | | | | 从业经历: 1997 年 7 |
| | 金 、鑫 | | | | 月至 2001 年 9 月任中 |
| | 元鸿利债 | | | | 国人寿保险公司河南 |
| | 券型证券 | | | | 省分公司培训专员, |
| | 投资基 | | | | 2002年3月至2005年 |
| | 金、鑫元 | | | | 11 月任北京麦特诺亚 |
| | 欣享灵活 | | | | 咨询有限公司清华 |
| | 配置混合 | | | | CFP 项目主管, 2007 |
| | 型证券投 | | | | 年2月至2009年9月 |
| | 资基金、 | 2019年5月 | | | 任泰信基金管理有限 |
| 王美芹 | 鑫元全利 | 17日 | _ | 11年 | 公司渠道部副经理、 |
| | 债券型发 | 1. 7 | | | 理财顾问部副总监, |
| | 起式证券 | | | | 2011年2月至2015年 |
| | 投资基 | | | | 6 月任泰信基金管理 |
| | 金、鑫元 | | | | 有限公司专户投资总 |
| | 並、 | | | | 监兼投资经理,2015 |
| | 月定期开 | | | | 年 6 月加入鑫元基金 |
| | 放债券型 | | | | 担任专户投资经理, |
| | 发起式证 | | | | 2016年8月5日起担 |
| | 券投资基 | | | | 任鑫元聚鑫收益增强 |
| | 金、鑫元 | | | | 债券型发起式证券投 |
| | 业、 <i>鐘九</i> | | | | 资基金(原鑫元聚鑫 |
| | 型证券投 | | | | 收益增强债券型证券 收益增强债券型证券 |
| | ② 证分以 资基金、 | | | | 投资基金、鑫元半年 |
| | 以 至 立 、 | |] | | |

| - 2 | 全二户局 | | 分 |
|----------|-------------|---|------------------|
| | 鑫元安睿 | | 定期开放债券型证券 |
| | 三年定期 | | 投资基金)、鑫元鸿利 |
| | 开放债券 | | 债券型证券投资基金 |
| 型 | 型证券投 | | 的基金经理,2017年 |
| 3 | 资基金、 | | 12月14日起担任鑫元 |
| 经 | 鑫元一年 | | 欣享灵活配置混合型 |
| <u> </u> | 定期开放 | | 证券投资基金的基金 |
| | 中高等级 | | 经理, 2018 年 10 月 |
| 信 | 责券型证 | | 25 日起担任鑫元全利 |
| | 券投资基 | | 债券型发起式证券投 |
| | 金的基金 | | 资基金的基金经理, |
| 4 | 经理 | | 2019 年 1 月 25 日至 |
| | | | 2020年4月20日担任 |
| | | | 鑫元臻利债券型证券 |
| | | | 投资基金的基金经 |
| | | | 理,2019年2月12日 |
| | | | 起担任鑫元荣利三个 |
| | | | 月定期开放债券型发 |
| | | | 起式证券投资基金的 |
| | | | 基金经理, 2019 年 5 |
| | | | 月17日起担任鑫元永 |
| | | | 利债券型证券投资基 |
| | | | 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,2020年 |
| | | | 3月18日起担任鑫元 |
| | | | 一年定期开放中高等 |
| | | | 级债券型证券投资基 |
| | | | 金的基金经理。 |
| | L | L | |

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,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流程的各项制度规范,进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式,确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及《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公平交易管理制度》、《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度,对本基金的异常交易行为进行监督检查。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度的债券市场在惊心动魄的大幅调整中结束,但回头来看,虽然国内疫情拐点出现和经济基本面快速回升均支持市场利率有所修复,但4月3日央行的"双降"(定向降准+下调存款准备金利率)对市场利率的方向引导以及5月中旬之后的引导流动性收紧的反差之大是造成6月份债市"踩踏"的根本原因。展望三季度,在经济基本面回升力度的持续性和货币政策修复之后再定位或许不排除存在一定的预期差,但债市情绪的修复也许也会一波三折,给具体的投资操作带来困扰。

组合操作方面,二季度一度受到了流动性预期引导的困扰,但从操作上,基于过低的绝对收益水平,从谨慎的角度还是对信用债进行了部分减持,但长端利率方面仍保持了较为积极的头寸,故在前两个月一度较为受伤,但由于组合的整体策略还是觉有一定的防御性,故在六月份表现相对稳定。

展望后市,将继续密切跟踪经济基本面及货币政策的调整方向,并进一步优化组合结构以保持足够的灵活性,争取为投资者获取更为稳健的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1. 0135 元;本报告期基金份额净值增长率为-0. 44%,业绩比较基准收益率为-0. 39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|----------------|-------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | | ı |
| | 其中: 股票 | ı | ı |
| 2 | 基金投资 | | |
| 3 | 固定收益投资 | 608, 835, 848. 80 | 97. 71 |
| | 其中:债券 | 608, 835, 848. 80 | 97. 71 |
| | 资产支持证券 | 1 | - |
| 4 | 贵金属投资 | ı | _ |
| 5 | 金融衍生品投资 | ı | Í |
| 6 | 买入返售金融资产 | 1 | - |
| | 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 | 989, 870. 46 | 0.16 |
| 8 | 其他资产 | 13, 283, 678. 42 | 2. 13 |
| 9 | 合计 | 623, 109, 397. 68 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注: 本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注: 本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例(%) | |
|----|------------|-------------------|--------------|--|
| 1 | 国家债券 | 3, 042, 000. 00 | 0.67 | |
| 2 | 央行票据 | _ | - | |
| 3 | 金融债券 | 250, 997, 200. 00 | 55. 03 | |
| | 其中:政策性金融债 | 250, 997, 200. 00 | 55. 03 | |
| 4 | 企业债券 | 273, 895, 648. 80 | 60. 05 | |
| 5 | 企业短期融资券 | | _ | |
| 6 | 中期票据 | 80, 901, 000. 00 | 17.74 | |
| 7 | 可转债 (可交换债) | ı | _ | |
| 8 | 同业存单 | | _ | |
| 9 | 其他 | - | = | |
| 10 | 合计 | 608, 835, 848. 80 | 133. 49 | |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比 例(%) |
|----|---------|----------------|-----------|-------------------|------------------|
| 1 | 190210 | 19 国开 10 | 1,000,000 | 102, 190, 000. 00 | 22. 41 |
| 2 | 190406 | 19 农发 06 | 500,000 | 51, 300, 000. 00 | 11. 25 |
| 3 | 190215 | 19 国开 15 | 400,000 | 40, 552, 000. 00 | 8. 89 |
| 4 | 1624028 | 16 建湖棚 改项目债 | 500,000 | 34, 855, 000. 00 | 7. 64 |
| 5 | 180205 | 18 国开 05 | 300,000 | 33, 033, 000. 00 | 7. 24 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

- **5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**注:本基金本报告期末未持有贵金属。
- **5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本产品未参与国债期货投资。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本产品未参与国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

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

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

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 (元) |
|----|---------|------------------|
| 1 | 存出保证金 | 25, 317. 18 |
| 2 | 应收证券清算款 | _ |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 13, 258, 361. 24 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |

| 7 | 待摊费用 | - |
|---|------|------------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13, 283, 678. 42 |

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

| 报告期期初基金份额总额 | 550, 003, 642. 37 |
|------------------------|-------------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 0. 59 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 99, 999, 189. 85 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-" | |
| 填列) | |
| 报告期期末基金份额总额 | 450, 004, 453. 11 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资 者类 别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|---------------|----------------|---------------------------------|-------------------|------|------------|-------------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例 达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初 份额 | 申购份额 | 赎回 份额 | 持有份额 | 份额占 比 |
| 机构 | 1 | 20200623-20200630 | 99, 999, 000. 00 | 0.00 | 0.00 | 99, 999, 000. 00 | 22. 22% |
| | 2 | 20200401-20200630 | 199, 999, 000. 00 | 0.00 | 0.00 | 199, 999, 000. 00 | 44.44% |
| | 3 | 20200623-20200630 | 100,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 100, 000, 000. 00 | 22. 22% |
| 个人 | _ | _ | 1 | _ | _ | - | - |

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,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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元永利债券型证券投资基金设立的文件;
- 2、《鑫元永利债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《鑫元永利债券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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 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7月21日