

# 鑫元招利债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14        |
| 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.....             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 17        |
| 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..... | 17        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 17        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>18</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 18        |
| 6.2 利润表.....                                 | 19        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 20        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 21        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>45</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 45        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 45        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 45        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 45        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....    | 46        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 46        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 46        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....    | 46        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 47        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 47        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 48        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 48        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 48        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>49</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>50</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 50        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....      | 50        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 50        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 50        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 50        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 50        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 50        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 51        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>53</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....   | 53        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 53        |

|                         |           |
|-------------------------|-----------|
| <b>§12 备查文件目录</b> ..... | <b>54</b> |
| 12.1 备查文件目录.....        | 54        |
| 12.2 存放地点.....          | 54        |
| 12.3 查阅方式.....          | 54        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 鑫元招利债券型证券投资基金    |
| 基金简称       | 鑫元招利             |
| 基金主代码      | 004059           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2016 年 12 月 22 日 |
| 基金管理人      | 鑫元基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 893,855,012.81 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金将宏观分析和信用分析相结合，积极配置优质债券，并合理安排组合期限，在保证资产安全性的基础上力争获取稳定的超额收益。                  |
| 投资策略   | 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，属于证券投资基金中的较低风险品种，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。                  |

### 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            | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李晓燕                   | 张燕                     |
|         | 联系电话 | 021-20892000 转        | 0755-83199084          |
|         | 电子邮箱 | service@xyamc.com     | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4006066188            | 95555                  |
| 传真      |      | 021-20892111          | 0755-83195201          |
| 注册地址    |      | 上海市静安区中山北路 909 号 12 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 办公地址    |      | 上海市静安区中山北路 909 号 12 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 邮政编码    |      | 200070                | 518040                 |
| 法定代表人   |      | 洪伟                    | 缪建民                    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券日报》  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.xyamc.com">http://www.xyamc.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 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                  |
|--------|------------|-----------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 16,374,553.61               |
| 本期利润          | 14,930,965.75               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0167                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.55%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.56%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 76,160,300.81               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0852                      |
| 期末基金资产净值      | 970,015,313.62              |
| 期末基金份额净值      | 1.0852                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021年6月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | 18.88%                      |

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

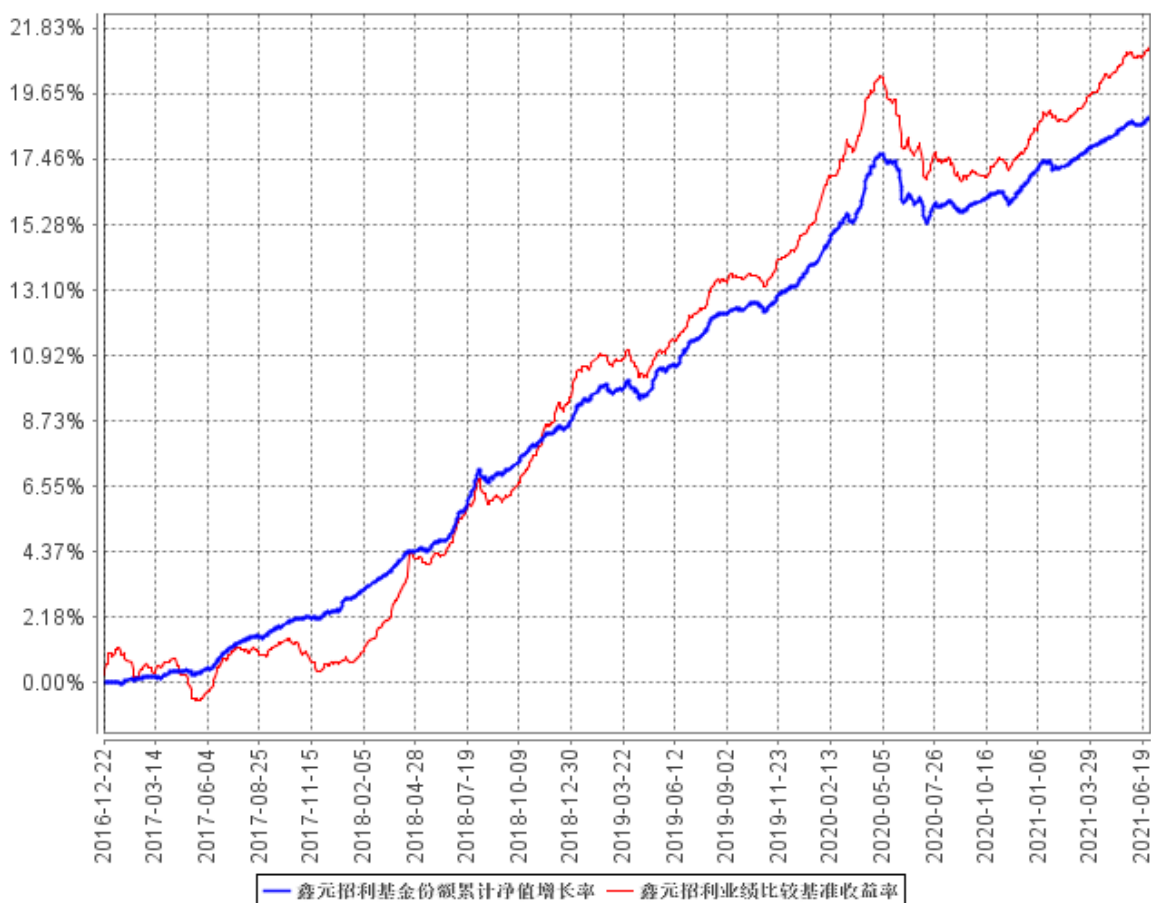
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.17%    | 0.02%       | 0.18%      | 0.04%         | -0.01% | -0.02% |
| 过去三个月      | 0.86%    | 0.02%       | 1.32%      | 0.04%         | -0.46% | -0.02% |
| 过去六个月      | 1.56%    | 0.02%       | 2.31%      | 0.04%         | -0.75% | -0.02% |
| 过去一年       | 2.42%    | 0.04%       | 2.84%      | 0.06%         | -0.42% | -0.02% |
| 过去三年       | 12.97%   | 0.05%       | 15.42%     | 0.07%         | -2.45% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.88%   | 0.04%       | 21.23%     | 0.07%         | -2.35% | -0.03% |



### 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

鑫元招利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 2016 年 12 月 22 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合同约定。

## § 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 2021 年 6 月 30 日，公司旗下管理 46 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发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元合享纯债债券型证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元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、鑫元添利三个月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、鑫元全利一年定期开放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、鑫元锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元一年定期开放中高等级债券型证券投资基金、鑫元中短债债券型证券投资基金、鑫元安硕两年定期开放债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金、鑫元乾利债券型证券投资基金。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|--|------------------|------|--------|--|
|    |  | 任职日期             | 离任日期 |        |  |
| 颜昕 | 基金经理。鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元合利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 | 2016 年 12 月 22 日 | -    | 8 年    | 学历：工商管理，硕士。<br>相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009 年 8 月起任南京银行股份有限公司金融市场部、金融同业部债券交易员。2013 年 9 月加入鑫元基金担任交易员，2014 年 2 月至 8 月担任鑫元基金交易室主管，2014 年 9 月起担任鑫元货币市场基金的基金经理助理，2015 年 6 月 26 日至 2020 年 11 月 25 日担任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理，2015 年 7 月 15 日至 2020 年 8 月 12 日担任鑫元货币市场基金的基金经理，2016 年 1 月 13 日起担任鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2016 年 3 月 2 日至 2019 年 1 月 21 日担任鑫元合享纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 3 月 2 日至 2019 年 8 月 30 日担任鑫元合丰纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 3 月 9 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金的基金经理，2016 年 8 月 17 日至 2019 年 10 月 15 日担 |

|  |                 |  |  |   |
|--|-----------------|--|--|---|
|  | 基金的<br>基金经<br>理 |  |  | <p>任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理，2016年10月27日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理，2016年12月22日起担任鑫元招利债券型证券投资基金的基金经理，2017年3月13日至2020年11月25日担任鑫元瑞利定期开放债券型发起式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，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</p> |
|--|-----------------|--|--|---|

|     |   |                |                 |       |   |
|-----|---|----------------|-----------------|-------|---|
|     |   |                |                 |       | 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 日至 2020 年 8 月 12 日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，2021 年 4 月 27 日起担任鑫元中债 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的基金经理。 |
| 高冬星 | 基金经理助理。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、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元招利 | 2021 年 3 月 1 日 | 2021 年 6 月 30 日 | 0.1 年 | 学历：金融学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 7 月至 2016 年 5 月任南京银行北京分行产品经理，2016 年 5 月至 2020 年 11 月任南京银行资金运营中心交易员。2020 年 12 月加入鑫元基金，2020/12/23 至 2021/6/30 担任基金经理助理。  |

|  |                                 |  |  |  |  |
|--|---------------------------------|--|--|--|--|
|  | 债券型<br>证券投资<br>基金<br>基金经<br>理助理 |  |  |  |  |
|--|---------------------------------|--|--|--|--|

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制订《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，通过系统和人工相结合的方式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

回顾上半年，债市的表现强于市场预期，整体呈现“慢牛”格局。年初海外经济体快速修复、出口增速维持强劲叠加地产投资维持韧性、消费持续恢复，市场对于基本面普遍较为乐观而对债券市场的预期较为谨慎。全球总需求的向好叠加供给缺口的影响大宗商品价格飙涨，我国 PPI 快速上行，PPI 与 CPI 的剪刀差达到历史极值，输入型通胀是否会导致国内货币政策边际收紧成为市场关注的热点，但央行始终坚持“稳字当头”，强调经济复苏结构不均衡、通胀上行难以持续、货币政策“以我为主”的立场，维持市场流动性合理充裕，2 月份以来资金利率波动率明显下降。另一方面，地方债供给节奏较往年明显偏慢，而信用风险的持续释放导致机构的风险偏好明显下降，二季度市场供需失衡的情况开始加剧，结构性资产荒的格局显现，债券市场收益率震荡下行。总体来看，上半年大类资产的沿着“股票—大宗—债券”的节奏轮动，对于宏观杠杆率、经济结构、资产价格等领域的调控是上半年政府经济工作的重要目标。

本基金在延续高等级信用债配置为主导的策略下，二季度加大了对利率债品种的波段操作，来增厚组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金份额净值增长率为 1.56%，同期业绩比较基准收益率为 2.31%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济的下行压力明显加大，出口在供应链修复加速和海外主动补库进程结束后面临一定的下行压力，各类调控政策对地产销售的负面影响将逐步传导到地产投资增速，城投融资管控从严继续压制基建投资增速，收入增速的放缓限制消费修复的空间，经济基本面来看仍旧对债券市场偏利好。与此同时，中小微企业生产经营仍然困难，结构性就业压力较大，货币政策预计维持稳定偏松态势。年内再次降准概率较大，降息也有一定概率。宽货币和紧信用的政策环境对债券市场较为友好。此外，机构欠配仍然存在，也对债券市场形成支撑。尽管 8、9 月份地方债供给放量可能对债市造成一定扰动，但是预计央行会进行流动性配合，因此供给冲击有限。总体来看，下半年债券市场有望继续走牛。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。成员包括公司总经理、基金运营部分管领导、

固定收益部、权益投资部和市场研究部分管领导、督察长、固定收益部负责人、权益投资部负责人、市场研究部负责人、风险管理部负责人、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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：鑫元招利债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 234,033.25                     | 348,123.39                       |
| 结算备付金           |            | 1,483,455.68                   | 1,516,223.72                     |
| 存出保证金           |            | 4,453.68                       | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,055,142,500.00               | 1,177,930,000.00                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 1,055,142,500.00               | 1,177,930,000.00                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 20,191,638.37                  | 20,217,252.95                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,077,056,080.98               | 1,200,011,600.06                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 106,499,147.25                 | 244,145,973.78                   |
| 应付证券清算款         |            | 9,328.63                       | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 238,806.64                     | 241,812.60                       |
| 应付托管费           |            | 79,602.24                      | 80,604.20                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 15,205.54                      | 16,784.75                        |
| 应交税费            |            | 77,226.41                      | 162,023.49                       |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息          |          | 13,271.70        | 70,021.27        |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 108,178.95       | 209,000.00       |
| 负债合计          |          | 107,040,767.36   | 244,926,220.09   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 893,855,012.81   | 893,855,970.88   |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 76,160,300.81    | 61,229,409.09    |
| 所有者权益合计       |          | 970,015,313.62   | 955,085,379.97   |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,077,056,080.98 | 1,200,011,600.06 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0852 元，基金份额总额 893,855,012.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鑫元招利债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 19,076,074.23                            | 25,950,399.30                                 |
| 1.利息收入                |            | 21,498,438.26                            | 25,402,712.84                                 |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 21,802.88                                | 16,743.53                                     |
| 债券利息收入                |            | 21,471,455.78                            | 25,365,309.60                                 |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 5,179.60                                 | 20,659.71                                     |
| 证券出借利息收入              |            | -  | -   |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -978,776.23                              | -217,453.15                                   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -  | -   |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -978,776.23                              | -217,453.15                                   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -1,443,587.86                            | 765,139.61                                    |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 0.06                                     | -   |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 4,145,108.48                             | 5,377,617.36                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 1,431,137.83                             | 1,409,810.63                                  |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 477,046.00                               | 469,936.87                                    |

|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -             | -             |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 2,923.42      | 725.00        |
| 5. 利息支出                    |            | 2,041,377.40  | 3,297,565.46  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 2,041,377.40  | 3,297,565.46  |
| 6. 税金及附加                   |            | 67,031.43     | 75,873.61     |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 125,592.40    | 123,705.79    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 14,930,965.75 | 20,572,781.94 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 14,930,965.75 | 20,572,781.94 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元招利债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |               |                |
|--|--|---------------|----------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 893,855,970.88                             | 61,229,409.09 | 955,085,379.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 14,930,965.75 | 14,930,965.75  |
| 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）      | -958.07                                    | -74.03        | -1,032.10      |
| 其中：1.基金申购款                             | 91.82                                      | 7.58          | 99.40          |
| 2.基金赎回款                                | -1,049.89                                  | -81.61        | -1,131.50      |
| 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）                        | 893,855,012.81                             | 76,160,300.81 | 970,015,313.62 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |               |                |

|  | 实收基金           | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 893,855,372.34 | 32,699,757.08 | 926,555,129.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -              | 20,572,781.94 | 20,572,781.94  |
| 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)      | 150.23         | 6.50          | 156.73         |
| 其中：1.基金申购款                             | 843.82         | 50.79         | 894.61         |
| 2.基金赎回款                                | -693.59        | -44.29        | -737.88        |
| 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)                        | 893,855,522.57 | 53,272,545.52 | 947,128,068.09 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
龙艺

\_\_\_\_\_  
陈宇

\_\_\_\_\_  
包颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鑫元招利债券型证券投资基金(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[2016]2605号《关于核准鑫元招利债券型证券投资基金募集的批复》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《鑫元招利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集200,027,649.37元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1671号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元招利债券型证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,031,649.44份基金份额,其中认购资金利息折合4,000.07份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为鑫元基金管理有限公司,基金托管人为招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，基金管理人就基金合同进行了修订，并对赎回费相关规则进行了调整。该修订自 2018 年 3 月 31 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元招利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、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、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、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)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》、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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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。

### 6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 234,033.25             |
| 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：            | 234,033.25             |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|



|               | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动       |
|---------------|------------------|------------------|--------------|
| 股票            | -                | -                | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -                | -            |
| 债券            | 交易所市场            | 130,453,352.05   | -496,352.05  |
|               | 银行间市场            | 923,985,366.09   | 1,200,133.91 |
|               | 合计               | 1,054,438,718.14 | 703,781.86   |
| 资产支持证券        | -                | -                | -            |
| 基金            | -                | -                | -            |
| 其他            | -                | -                | -            |
| 合计            | 1,054,438,718.14 | 1,055,142,500.00 | 703,781.86   |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,042.22          |
| 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  | 667.60            |
| 应收债券利息     | 20,189,926.55     |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 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         | 2.00              |
| 合计         | 20,191,638.37     |

**6.4.7.6 其他资产**

注：无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 9,414.00          |
| 银行间市场应付交易费用 | 5,791.54          |
| 合计          | 15,205.54         |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 预提费用        | 108,178.95        |
| 合计          | 108,178.95        |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 893,855,970.88             | 893,855,970.88 |
| 本期申购          | 91.82                      | 91.82          |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,049.89                  | -1,049.89      |
| - 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           | 893,855,012.81             | 893,855,012.81 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 66,090,454.99 | -4,861,045.90 | 61,229,409.09 |
| 本期利润           | 16,374,553.61 | -1,443,587.86 | 14,930,965.75 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -80.45        | 6.42          | -74.03        |
| 其中：基金申购款       | 8.17          | -0.59         | 7.58          |
| 基金赎回款          | -88.62        | 7.01          | -81.61        |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 82,464,928.15 | -6,304,627.34 | 76,160,300.81 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 10,148.57                  |
| 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 | 11,627.17                  |
| 其他        | 27.14                      |
| 合计        | 21,802.88                  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                  | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债 | -978,776.23                |

|                |             |
|----------------|-------------|
| 券到期兑付) 差价收入    |             |
| 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             | -978,776.23 |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 355,985,524.39             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 342,211,321.44             |
| 减：应收利息总额                | 14,752,979.18              |
| 买卖债券差价收入                | -978,776.23                |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

注：无。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期                              |
|----------------------------|---------------------------------|
|                            | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产                 | -1,443,587.86                   |
| ——股票投资                     | -                               |
| ——债券投资                     | -1,443,587.86                   |
| ——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<br>增值税 | -                               |
| 合计                         | -1,443,587.86                   |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 0.06                            |
| 合计      | 0.06                            |

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|           | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 773.42                          |
| 银行间市场交易费用 | 2,150.00                        |
| 交易基金产生的费用 | -                               |
| 其中：申购费    | -                               |
| 赎回费       | -                               |
| 合计        | 2,923.42                        |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期                              |
|----------|---------------------------------|
|          | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 审计费用     | 39,671.58                       |
| 信息披露费    | 59,507.37                       |
| 证券出借违约金  | -                               |
| 银行汇划费用   | 7,813.45                        |
| 债券账户服务费  | 18,000.00                       |
| 上清所证书查询费 | 600.00                          |
| 合计       | 125,592.40                      |

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称              | 与本基金的关系             |
|--------------------|---------------------|
| 鑫元基金管理有限公司（“鑫元基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 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      |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,431,137.83                   | 1,409,810.63                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                              | -                               |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 477,046.00           | 469,936.87           |

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

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期                   |        |      |       |      |               |           |
|----------------------|--------|------|-------|------|---------------|-----------|
| 2021年1月1日至2021年6月30日 |        |      |       |      |               |           |
| 银行间市场交易的各关联方名称       | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购         |           |
|                      | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出      |
| -                    | -      | -    | -     | -    | -             | -         |
| 上年度可比期间              |        |      |       |      |               |           |
| 2020年1月1日至2020年6月30日 |        |      |       |      |               |           |
| 银行间市场交易的各关联方名称       | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购         |           |
|                      | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出      |
| 招商银行                 | -      | -    | -     | -    | 48,500,000.00 | 33,757.68 |



**6.4.10.4 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****6.4.10.4.1 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。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：无。

**6.4.10.5.2 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**

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2021年6月30日 |                  | 上年度末<br>2020年12月31日 |                  |
|-------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额           | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 南京银行  | 893,831,562.22    | 99.9974%         | 893,831,562.22      | 99.9973%         |

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

**6.4.10.6 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 招商银行  | 234,033.25                 | 10,148.57 | 591,757.67                      | 16,051.81 |

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

注：无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：无。

**6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 48,499,727.25 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称   | 回购到期日     | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|--------|--------|-----------|--------|---------|---------------|
| 190403 | 19农发03 | 2021年7月5日 | 100.45 | 300,000 | 30,135,000.00 |
| 180212 | 18国开12 | 2021年7月5日 | 100.33 | 200,000 | 20,066,000.00 |
| 合计     |        |           |        | 500,000 | 50,201,000.00 |

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 57,999,420.00 元，于 2021 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，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。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；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。

### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.2.1 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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 30,144,000.00     | 19,996,000.00       |
| 合计     | 30,144,000.00     | 19,996,000.00       |

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 0.00              | 0.00                |

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 0.00              | 0.00                |

#### 6.4.13.2.4 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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
|--------|-------------------|---------------------|

|        |                  |                  |
|--------|------------------|------------------|
| AAA    | 974,797,500.00   | 1,127,787,000.00 |
| AAA 以下 | 0.00             | 0.00             |
| 未评级    | 50,201,000.00    | 30,147,000.00    |
| 合计     | 1,024,998,500.00 | 1,157,934,000.00 |

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 0.00              | 0.00                |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 0.00              | 0.00                |

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 0.00              | 0.00                |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 0.00              | 0.00                |

注：无。

#### 6.4.13.3 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 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 106,499,147.25 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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。

##### 6.4.13.3.1 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

《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、流通受限制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(2021 年 6 月 30 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。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021<br>年6<br>月30<br>日 | 1个月以内         | 1-3个月          | 3个月-1年         | 1-5年           | 5年<br>以上 | 不计息           | 合计               |
|-------------------------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----------|---------------|------------------|
| 资产                            |               |                |                |                |          |               |                  |
| 银行存款                          | 234,033.25    | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00     | 0.00          | 234,033.25       |
| 结算备付金                         | 1,483,455.68  | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00     | 0.00          | 1,483,455.68     |
| 存出保证金                         | 4,453.68      | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00     | 0.00          | 4,453.68         |
| 交易性金融资产                       | 80,594,000.00 | 125,911,500.00 | 434,040,000.00 | 414,597,000.00 | 0.00     | 0.00          | 1,055,142,500.00 |
| 衍生金融资产                        | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00     | 0.00          | 0.00             |
| 买入返售金融资产                      | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00     | 0.00          | 0.00             |
| 应收证券清算款                       | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00     | 0.00          | 0.00             |
| 应收利息                          | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00     | 20,191,638.37 | 20,191,638.37    |
| 应收                            | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00     | 0.00          | 0.00             |

|                           |                |                |                |                |      |               |                  |
|---------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------|---------------|------------------|
| 股利                        |                |                |                |                |      |               |                  |
| 应收<br>申购款                 | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 其他<br>资产                  | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 资产<br>总计                  | 82,315,942.61  | 125,911,500.00 | 434,040,000.00 | 414,597,000.00 | 0.00 | 20,191,638.37 | 1,077,056,080.98 |
| 负债                        |                |                |                |                |      |               |                  |
| 卖出<br>回购<br>金融<br>资产<br>款 | 106,499,147.25 | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 106,499,147.25   |
| 应付<br>证券<br>清算<br>款       | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 9,328.63      | 9,328.63         |
| 应付<br>赎回<br>款             | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 应付<br>管理<br>人报<br>酬       | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 238,806.64    | 238,806.64       |
| 应付<br>托管<br>费             | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 79,602.24     | 79,602.24        |
| 应付<br>销售<br>服务<br>费       | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 应付<br>交易<br>费用            | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 15,205.54     | 15,205.54        |
| 应付<br>税费                  | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 77,226.41     | 77,226.41        |
| 应付<br>利息                  | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 13,271.70     | 13,271.70        |
| 应付<br>利润                  | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 其他<br>负债                  | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 108,178.95    | 108,178.95       |
| 短期                        | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |



|                       |                |                |                |                |       |               |                  |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-------|---------------|------------------|
| 借款                    |                |                |                |                |       |               |                  |
| 交易性金融负债               | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 0.00          | 0.00             |
| 衍生金融负债                | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 0.00          | 0.00             |
| 负债总计                  | 106,499,147.25 | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 541,620.11    | 107,040,767.36   |
| 利率敏感度缺口               | -24,183,204.64 | 125,911,500.00 | 434,040,000.00 | 414,597,000.00 | 0.00  | 19,650,018.26 | 970,015,313.62   |
| 上年度末 2020 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                  | 348,123.39     | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 0.00          | 348,123.39       |
| 结算备付金                 | 1,516,223.72   | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 0.00          | 1,516,223.72     |
| 存出保证金                 | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 0.00          | 0.00             |
| 交易性金融资产               | 101,004,000.00 | 20,258,000.00  | 661,307,000.00 | 395,361,000.00 | 0.00  | 0.00          | 1,177,930,000.00 |
| 衍生金融资产                | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 0.00          | 0.00             |
| 买入返售金融资产              | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 0.00          | 0.00             |
| 应收证券清算款               | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00  | 0.00          | 0.00             |

|           |                |               |                |                |      |               |                  |
|-----------|----------------|---------------|----------------|----------------|------|---------------|------------------|
| 应收利息      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 20,217,252.95 | 20,217,252.95    |
| 应收股利      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 应收申购款     | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 其他资产      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 资产总计      | 102,868,347.11 | 20,258,000.00 | 661,307,000.00 | 395,361,000.00 | 0.00 | 20,217,252.95 | 1,200,011,600.06 |
| 负债        |                |               |                |                |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 244,145,973.78 | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 244,145,973.78   |
| 应付证券清算款   | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 应付赎回款     | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 应付管理人报酬   | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 241,812.60    | 241,812.60       |
| 应付托管费     | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 80,604.20     | 80,604.20        |
| 应付销售服务费   | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |
| 应付交易费用    | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 16,784.75     | 16,784.75        |
| 应付税费      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 162,023.49    | 162,023.49       |
| 应付利息      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 70,021.27     | 70,021.27        |
| 应付利润      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00             |

|                     |                 |               |                |                |      |               |                |
|---------------------|-----------------|---------------|----------------|----------------|------|---------------|----------------|
| 其他<br>负债            | 0.00            | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 209,000.00    | 209,000.00     |
| 短期<br>借款            | 0.00            | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00           |
| 交易<br>性金<br>融负<br>债 | 0.00            | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00           |
| 衍生<br>金融<br>负债      | 0.00            | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00          | 0.00           |
| 负债<br>总计            | 244,145,973.78  | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 780,246.31    | 244,926,220.09 |
| 利率<br>敏感<br>度缺<br>口 | -141,277,626.67 | 20,258,000.00 | 661,307,000.00 | 395,361,000.00 | 0.00 | 19,437,006.64 | 955,085,379.97 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                   |
|                  |                    | 本期末（2021年6月30日）                 | 上年度末（2020年12月31日） |
|                  | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 2,909,674.64                    | 3,121,320.95      |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | -2,888,194.16      | -3,099,376.93                   |                   |

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，投资范围内不包含股票资产，因此无重大市场价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

###### 6.4.14.1.1 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。

###### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 1,055,142,500.00 元，无划分为第一、三层次的余额。（于 2020 年 12 月 31 日，属于第二层次的余额为人民币 1,177,930,000.00 元，无划分为第一、三层次的余额。）

###### 6.4.14.1.2.2 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。

###### 6.4.14.1.2.3 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。

##### 6.4.14.2 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。

##### 6.4.14.3 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。

##### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,055,142,500.00 | 97.97         |
|    | 其中：债券             | 1,055,142,500.00 | 97.97         |
|    | 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      | 1,717,488.93     | 0.16          |
| 8  | 其他各项资产            | 20,196,092.05    | 1.88          |
| 9  | 合计                | 1,077,056,080.98 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金报告期末未持有境内股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金报告期末未持有股票。

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

注：本基金报告期末未持有股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金报告期末未持有股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -             |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 157,611,500.00   | 16.25         |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,201,000.00    | 5.18          |
| 4  | 企业债券      | 150,191,000.00   | 15.48         |
| 5  | 企业短期融资券   | 30,144,000.00    | 3.11          |
| 6  | 中期票据      | 717,196,000.00   | 73.94         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | -                | -             |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 1,055,142,500.00 | 108.78        |

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 1722024   | 17 国开金融债       | 800,000 | 82,168,000.00 | 8.47          |
| 2  | 101469029 | 14 北国资 MTN001  | 700,000 | 71,351,000.00 | 7.36          |
| 3  | 101801498 | 18 海淀国资 MTN002 | 700,000 | 70,140,000.00 | 7.23          |
| 4  | 131900006 | 19 南京地铁 GN001  | 500,000 | 51,155,000.00 | 5.27          |
| 5  | 101651059 | 16 南京安居 MTN001 | 500,000 | 50,515,000.00 | 5.21          |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

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

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

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 4,453.68      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 20,191,638.37 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 20,196,092.05 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末未持有股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例 | 持有份额      | 占总份<br>额比例 |
| 200          | 4,469,275.06  | 893,831,562.22 | 100.00%    | 23,450.59 | 0.00%      |

注：目前系统仅能保留四位小数。期末机构投资者占总份额比例实际为 99.9974%，个人投资者占总份额比例实际为 0.0026%。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 11,960.26 | 0.0013%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 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 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10              |



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                   |                |
|-----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（ 2016 年 12 月 22 日 ）基金份额总额 | 200,031,649.44 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 893,855,970.88 |
| 本报告期基金总申购份额                       | 91.82          |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 1,049.89       |
| 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                      | 893,855,012.81 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：本报告期内，基金管理人于 2021 年 4 月 29 日发布了《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。自 2021 年 4 月 28 日起，龙艺女士担任公司总经理，同时张乐赛先生不再担任上述职务。

2、基金托管人：本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

2、本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 方正证券 | 2      | -    | -            | 19,127.92 | 100.00%    | -  |

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) 市场研究部根据选择标准选取合作券商, 发起签署研究服务协议;
- 2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议, 办理交易单元的相关开通手续, 调整相关系统参数, 基金运营部及时通知托管人。

(3) 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况: 无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 方正证券 | 70,453,352.05 | 100.00%      | 1,842,600,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                 | 法定披露方式                     | 法定披露日期          |
|----|--------------------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1  | 鑫元招利债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告         | 公司网站                       | 2021 年 1 月 22 日 |
| 2  | 鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 4 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 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 3  | 鑫元基金管理有限公司关于公司住所变更的公告                | 公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2021 年 2 月 6 日  |
| 4  | 鑫元招利债券型证券投资基金 2020 年年度报告             | 公司网站                       | 2021 年 3 月 31 日 |
| 5  | 鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告     | 公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 6  | 鑫元招利债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告         | 公司网站                       | 2021 年 4 月 22 日 |
| 7  | 鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 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 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 8  | 鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告          | 公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2021 年 4 月 29 日 |
| 9  | 鑫元基金管理有限公司关于修订                       | 公司网站、中国证券                  | 2021 年 5 月 26 日 |

|    |                                   |                   |                 |
|----|-----------------------------------|-------------------|-----------------|
|    | 旗下 10 只公募基金基金合同等相关法律文件的公告         | 报、上海证券报、证券时报、证券日报 |                 |
| 10 | 鑫元招利债券型证券投资基金基金合同                 | 公司网站              | 2021 年 5 月 26 日 |
| 11 | 鑫元招利债券型证券投资基金托管协议                 | 公司网站              | 2021 年 5 月 26 日 |
| 12 | 鑫元招利债券型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号） | 公司网站              | 2021 年 5 月 31 日 |
| 13 | 鑫元招利债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）         | 公司网站              | 2021 年 5 月 31 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |         |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|---------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额           | 份额占比    |
| 机构    | 1              | 20210101-20210630       | 893,831,562.22 | 0.00 | 0.00 | 893,831,562.22 | 100.00% |
| 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。

注：目前系统仅能保留四位小数。报告期末机构投资者 1 持有基金份额占总份额比例实际为 99.9974%。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 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

2021 年 8 月 31 日