鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金 基金 2019 年半年度报告摘要

2019年6月30日

基金管理人: 鑫元基金管理有限公司

基金托管人: 中国光大银行股份有限公司

送出日期: 2019年8月24日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鑫元瑞利定期开放
基金主代码	004459
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2017年3月13日
基金管理人	鑫元基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2, 485, 014, 546. 70 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	中国光大银行股份有限公司
	姓名	李晓燕	石立平
信息披露负责人	联系电话	021-20892000 转	010-63639180
	电子邮箱	service@xyamc.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4006066188	95595
传真		021-20892111	010-63639132

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	50, 530, 476. 91
本期利润	61, 329, 964. 72
加权平均基金份额本期利润	0.0247
本期基金份额净值增长率	2. 39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0348
期末基金资产净值	2, 618, 819, 983. 78
期末基金份额净值	1.0538

- 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。

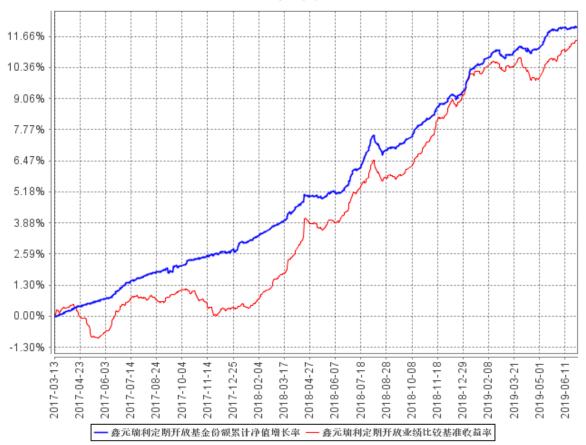
3.2 基金净值表现

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. 03%	0. 02%	0. 57%	0. 03%	-0. 54%	-0. 01%
过去三个月	0. 69%	0. 04%	0. 63%	0.06%	0.06%	-0. 02%
过去六个月	2. 39%	0. 04%	2. 07%	0.06%	0. 32%	-0. 02%
过去一年	6. 02%	0. 05%	6. 46%	0. 06%	-0. 44%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	12.01%	0. 04%	11. 47%	0. 07%	0. 54%	-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

鑫元瑞利定期开放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2017年3月13日。根据基金合同约定,本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2019 年 6 月 30 日,公司旗下管理 34 只证券投资基金——鑫元货币市场基金、鑫元恒鑫收益增强债券型证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元总量的债债券型证券投资基金、鑫元是多级。金元总量的债债券型证券投资基金、鑫元是金宝货币市场基金、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、鑫元和利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元福利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元清利债券型证券投资基金、鑫元清利债券型证券投资基金、鑫元清利定期开放债券型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型证券投资基金、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、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、鑫元产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、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元产利债券型发起式证券投资基金、鑫元产利债券型发起式证券投资基金、鑫元产利户月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元营利债券型证券投资基金、鑫元素利债券型证券投资基金、鑫元素利债券型证券投资基金、鑫元素利债券型证券投资基金、鑫元承利一个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元系利债券型证券投资基金、鑫元素利债券型证券投资基金、鑫元承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

抽友	班 夕	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从	7R BB
姓名	职务	任职日期	离任日期	业年限	说明
颜昕	鑫元安	2017年3月13	_	10年	学历:工商管理,硕士。
	鑫宝货	日			相关业务资格:证券投资

雨市场 基金、鑫 2009年8月、任职于南京 2009年8月、任职于南京 2009年8月、任职于南京 2009年8月、任职于南京 2009年8月、任职 7 年 2 月 年 2 月 年 3 月 2 回 1 加入 金、鑫元 6 年 9 月 1 加入 金、鑫元 6 年 9 月 2 四 1 加入 金、鑫元 6 年 9 月 2 四 1 加入 金、鑫元 2 2 1 4 年 2 月 5 年 8 月 月 1 5 日 起担 4 年 2 月 5 年 8 月 1 7 日 2 1 1 5 日 起担 4 年 9 月 1 5 日 起担 4 年 8 月 1 7 日 起担 4 年 8 月 1 7 日 起担 4 年 8 月 1 7 日 2 1 6 年 1 月 1 3 日 起担 4 年 8 月 2 日 年 8 元 元 2 1 正 9 投资 基金。 2 1 年 9 年 1 月 1 5 日 起担 4 年 8 日 2 1 日 9 年 1 月 1 5 日 起担 4 年 8 日 2 1 日 9 年 1 月 1 5 日 起担 4 年 8 日 2 1 日 9 年 1 月 1 日 2 日 全 2 2 2 1 9 年 9 年 1 月 1 日 2 日 全 2 2 2 1 9 年 9 年 1 月 1 日 2 日 全 2 2 2 1 9 年 9 年 1 月 1 日 2 日 全 2 2 2 1 9 年 9 日 2 1 日 2			
无货币 市场基 金、鑫元 合丰纯 (债债券 超证券 投资基 金、鑫元 表示基金担任交易员 2014年2月至8月担任鑫 元基金交易室主管,2014年9月担任鑫元货币市场 基金交易室主管,2014年9月担任鑫元货币市场 基金公易室主货币市场基金公园重加理, 2015年6月26日起担任 鑫元安全国协理,2015年6月26日起担任 鑫元安全国协理。2015年6月26日起担任 鑫元安全国发币市场基金 的基金经理,2016年7月15日起担任鑫元安和 发起式 证券投资基金、《元和债券型证券投资基金》的基金经理,2016年7月16券型证券投资基金、《元元汇 利债券型证券投资基金》的基金经理,2016年3月2日至2019年1月2日担任鑫元及对债券型证券投资基金》的基金经理,2016年3月2日至2019年21日担任鑫元及的基金经理,2016年3月2日至2019年21日担任金元交验债债券型证券投资基金》的基金经理,2016年3月2日至2019年2日日至2019年2日日至2019年2日日至2019年2日日至2019年2日日至2019年2日日至2019年2日日至2019年2日日至2019年2日日至2019年3月1日起担任金元次债债券型证券投资基金》的基金经理,2016年3月1日起担任金元定义债券型证券投资基金》目,2016年3月1日起担任金元定、债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任金元定、债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月12日起担任金元家和债券型证券投资基金。	币市场		基金从业资格。从业经历:
市场基金、鑫元 合丰纯 债债券 型证券 投资基 金、82013年9月加入 鑫元基金担任在秦元发 6债券 型证券 投资基 金、82015年6月26日起担任 82015年6月26日起担任 82015年6月15日起担任 82015年7月15日起担任 82015年7月15日起担任 82015年7月15日起担任 82015年7月15日起担任 82015年7月15日起担任 82015年7月15日起担任 82015年7月15日起担任 82015年7月15日起担任 82016年3月12日程 82015年3月12日程 82015年3月12日程 82015年3月12日程 82015年3月12日程 82015年3月12日程 82015年3月12日程 82015年3月12日程 82015年12月12日程 82015年12月12日程 82015年12月12日程 82015年12月12日担任 82015年12月12日起担任 82015年12月22日起担任 82015年12月22日起担任	基金、鑫		2009年8月,任职于南京
金、鑫元 合丰纯 (债债券 型证券 投资基 金、鑫元 以利定 期开放 (债债券 型证券 投资基 金、鑫元 兴利定 期开放 (债务型 发起式 证券 投资基金、 鑫元 发起式 证券投资基金、(原鑫元) 利债券型 发起式 证券投资基金、(原鑫元) 利债券型 发递基金、 鑫元 和债券 型证券 投资基金、 鑫元 和债券 型证券 投资基金、 多元 和债券 型证券 投资基金、 多元 和债券 型证券 投资基金、 《系元 和债券 型证券 投资基金、 《系元 和债券 型证券 投资基金、 《家元 和债券 型证券 投资基金、(原鑫元) 和债券型 证券投资基金)的基金经 理,2016年3月9日 上担任金元合。(原金元) 和债券型 证券投资基金((原金元) 有) 自担担任金元合。(原金元) 为(债务型 证券) 的基金经 理,2016年3月9日 证券投资基金、(原金元) 为(债务型 证券投资基金) 是金、金。(原金元) 有) 自是担任金元 (原金元) 有) 自是担任金元 (原金元) 有) 自是担任金元 (原金元) 有) 自是担任金元 (原金元) 有) 自是担任金元 (原金经理,2016年3月9日 证券投资基金) 金、金。 (原金经理,2016年7月17日 日起担任金元和 (债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月17日 日担任金元和(债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日 日担任金元、(国金经理、2016年10月27日 日产日)人生产日 定年公司 在第人债务型 证券 投资基金的基金经 理,2016年10月27日 日产日 定年公司 在第人债务型 证券 投资基金的基金经 理,2016年10月27日 日产至公司 在第人债务型 证券 投资基金的基金经 是一个公司 在第人债务型 证券 是一个公司 在第人债务型 是一个公司 在第人债务型 证券 是一个公司 在第人债务型 证券 是一个公司 在第人债务型 证券 是一个公司 在第人债务型 证券 是一个公司 在第人债务量 是	元货币		银行股份有限公司,担任
合丰纯 债债券型证券投资基金。鑫元 利利债券型证券投资基金。 多五元 型	市场基		交易员。2013年9月加入
使债券型证券投资基金、鑫元、利利定期开放	金、鑫元		鑫元基金担任交易员,
型证券 投资基。、鑫元 兴利定 期开放 债券型 发起式 证券投资基金、鑫元汇 利债券型型 发起式 证券投资基金、鑫元汇 利债券型型证券 投资基量。 鑫元汇 利债券型证券 投资基量。 多元元 双债增 强债券型证券 投资基金、多元 深利债券型证券 投资基金、多元 深利债券型证券 投资基金、多元 深入债债券型证券 投资基金。 多元 常型证券 投资基金。 多元 常型证券 投资基金。 多元 常型证券 投资基金。 多元 常型证券 投资基金。 多元 常型证券 投资基金。 多元 常型证券 投资基金。 多元 常型证券 发资基金。 多元 常型证券 发资基金。 多元 有力 传,型证券 投资基金。 多元 有力 传,型证券 投资基金。 《原鑫元合字绝债债券型 证券投资基金。 《原鑫元合字绝债债券型 证券投资基金。 《原鑫元合字绝债债券型 证券投资基金。 《原鑫元合字绝债债券型 证券投资基金。 《原鑫元合字绝债债券型 证券投资基金。 《原鑫元合字,的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元会 理,2016年3月9日起担任鑫元及 传增强债券型证券 投资基金。 多元 有月3日起担任鑫元及 传增强债券型证券 投资基金。 多元 有月3日起担任鑫元次 传增强债券型证券 投资基金。 多元 有月3日起担任鑫元次 有增强。 第一之间(年 7月13日起担任鑫元次 有增强。 发产型证券 投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年7月15日起担任金元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年7月17日起担任金元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元零利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起	合丰纯		2014年2月至8月担任鑫
提资基金、鑫元 兴利定期开放 的基金经理助理,2015年6月26日起担任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理,2015年7月15日起担任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理,2016年7月15日起担任鑫元广市场基金的基金经理,2016年1月13日起担任鑫元兴利度券型证券投资基金(原鑫元兴利债券型证券投资基金(原鑫元兴利债券型证券投资基金(原鑫元兴利债券型证券投资基金(原鑫元公享的基金经理,2016年3月2日起任鑫元合享地债债券型证券投资基金、鑫元 被利债券型证券 包含 的基金经理,2016年3月2日起担任鑫元合丰地债债券型证券投资基金(原鑫元合丰均债券型证券投资基金(原鑫元后丰分级债券型证券投资基金的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元公丰均债券型证券投资基金的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元元和债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元深入债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元和利债券型证券投资基金、鑫元粮利债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年7日起料任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起料任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起寿投资基金的基金经理,2016年10月27日起寿型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起寿型证券投资基金的基金经理,2016年12月22日起担任	债债券		元基金交易室主管,2014
金、鑫元 州开放 债券型 发起式 证券投 资基金、 鑫元汇 利债券 型证券 投资基 型证券 投资基 型证券 投资基 型证券 投资基 型证券 投资基 型证券 投资基 全、鑫元 不利债 参型证 券投资基 全、鑫元 不利债 参型证 券投资基 全、多元 不利债 参型证 券投资基 全、多元 不利债 参型证 券投资基 全、多元 不利债 参型证 券投资基 全、多元 不利债 参型证 券投资基 全、多元 不利债 参型证 券投资基 全、多元 不利债 参型证 券投资基 全、多元 不利债 参型证 券投资基。 、多元 不利债 参型证 券投资基。 、多元 不利债 参型证 券投资基。 、多元 不利债 参型证 券投资基。 、多元 不利债 参型证 多位 是、多。 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 多位 是、一个。 等人。 多位 是、一个。 等人。 多位 是、一个。 等人。 多位 是、一个。 等人。 多位 是、一个。 等人。 多。 是、一个。 每一、一个。 有) 另 日 起担任 多。 多。 的基。 全。 理,2016 年 3 月 9 日 起担 任。 多一、一个。 有) 3 日 起担任 多。 一个。 有) 3 日 起担任 多。 全。 全。 中 一, 月 13 日 起担任 多。 全。 全。 里 一、2016 年 8 月 17 日 起担任 是。全。 理 一、2016 年 10 月 27 日 起担任 多。全。 理 一、2016 年 10 月 27 日 起担任 多。 全。 理 一、2016 年 10 月 27 日 起担任 多。 是 全 理 一、2016 年 10 月 27 日 起担任 多。 是 全 理 一、2016 年 10 月 27 日 起担任 多。 是 全 理 工 条 为 设 是 全 理 、 2016 年 10 月 27 日 起担任 多。 是 全 是 理 、 多 数 是 全 里 。 2 数 。 2 数 。	型证券		年9月担任鑫元货币市场
無不安全	投资基		基金的基金经理助理,
期开放	金、鑫元		2015年6月26日起担任
(成券型	兴利定		鑫元安鑫宝货币市场基金
发起式 证券投资基金、鑫元 和债券型证券投资基金(原鑫元平 和债券型证券投资基金(原鑫元平 和债券型证券投资基金(原鑫元 双债增 显证券 投资基金(原鑫元 2016 年 3 月 2 日至 2019 年 1 月 21 日 担任鑫元合享纯债债券型证券 投资基金(原鑫元 2016 年 3 月 2 日起担任鑫元合享独债债券型证券 金)的基金经理,2016 年 3 月 2 日起担任鑫元合丰 2 6 6 6 6 7 8 7 9 9 7 8 9 7 8 9 8 9 8 9 8 9 8 9 8	期开放		的基金经理,2015年7月
证券投资基金、鑫元 和	债券型		15 日起担任鑫元货币市
發基金、鑫元汇 利债券型证券投资基金(原鑫元兴 利债券型证券投资基金)的基金经理,2016 年 3 月 2 日至 2019 年 1 月 21 日 担任鑫元合享纯债债券型证券投资基金(原鑫元合享分级债券型证券投资基金(原鑫元合享分级债券型证券投资基金)的基金经理,2016 年 3 月 2 日起担任鑫元合丰 统债债券型证券投资基金(原鑫元合丰 分级债券型证券投资基金(原鑫元合丰 外级债券型证券投资基金(原鑫元合丰 分级债券型证券投资基金(原鑫元合丰 分级债券型证券投资基金)的基金经理,2016 年 3 月 9 日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 6 月 3 日起担任鑫元双 债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 7 月 13 日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 8 月 17 日起担任鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元 招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 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 10 月 27 日起担任鑫元率,人债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 10 月 27 日起担任鑫元率,人债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 10 月 27 日起担任金金、鑫	发起式		场基金的基金经理,2016
2016 年 7 月 13 日起担任鑫元裕利 債券型证券投资基金 (原鑫元火利債券型证券投资基金、鑫元 双债增	证券投		年1月13日起担任鑫元兴
利债券型证券投资基金)的基金经理,2016年3月2日至2019年1月21日金、鑫元双债增强债券型证券投资基金(原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日起担任鑫元合丰金、鑫元裕利债券型证券投资基金)的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元合丰纯债债券型证券投资基金)的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元深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	资基金、		利定期开放债券型发起式
型证券 投资基 金、鑫元 双债增 强债券 型证券 投资基 金、6 的基金经理,2016 年 3 月 2 日起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 日起担任鑫元合丰 金、鑫元 裕利债 券型证 券投资基金的基金经理,2016 年 3 月 9 日起担 任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 6 月 3 日起担任鑫元双 债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 6 月 3 日起担任鑫元双 债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 7 月 13 日起担任鑫元裕利 债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 8 月 17 日起担任鑫元得利债券型 证券投资基金的基金经理,2016 年 8 月 17 日起担任鑫元得利债券型 金、鑫元 招利债 参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 10 月 27 日起 担任鑫元聚利债券型证券 发资基金的基金经理,2016 年 10 月 27 日起 担任鑫元聚利债券型证券 发资基金的基金经理,2016 年 10 月 27 日起 担任鑫元聚利债券型证券 发资基金的基金经理,2016 年 10 月 27 日起	鑫元汇		证券投资基金(原鑫元兴
投资基金、鑫元 双债增 证券投资基金(原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 日起担任鑫元合丰金、鑫元 裕利债 券型证券投资基金)的基金经理,2016 年 3 月 9 日起担任鑫元合丰金、鑫元 裕利债券型证券投资基金)的基金经理,2016 年 3 月 9 日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 3 月 9 日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 6 月 3 日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 7 月 13 日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 8 月 17 日起担任鑫元平利债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 8 月 17 日起担任鑫元聚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 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	利债券		利债券型证券投资基金)
金、鑫元 双债增 证券投资基金(原鑫元合享纯债债券型 证券投资基金(原鑫元合享外级债券型证券投资基金)的基金经理,2016 年 3 月 2 日起担任鑫元合丰 金、鑫元 裕利债 券型证券投资基金)的基金经 筹投资基金)的基金经 野投资基金、鑫 元得利 债券型 证券投资基金的基金经理,2016 年 6 月 3 日起担任鑫元双 债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 7 月 13 日起担任鑫元双 债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 7 月 13 日起担任鑫元裕利 债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 8 月 17 日起担任鑫元得利债券型 证券投资基金的基金经理,2016 年 10 月 27 日起 担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016 年 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, 发资基金的基金经理, 发资基金的基金经理, 是016 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, 是016 年 10 月 27 日起	型证券		的基金经理,2016年3月
双债增强债券型证券投资基金(原鑫元合享分级债券型证券投资基金)的基金经理,2016年3月2日起担任鑫元合丰金、鑫元裕利债券型证券投资基金)的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月3日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元和债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元和债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元将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	投资基		2日至2019年1月21日
望证券 投资基 金、鑫元 裕利债 券型证 券投资基金。 《原鑫元合丰分级债券型证券投资基金(原鑫元合丰分级债券型证券投资基金)的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016年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7月3日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年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10月27日起担任鑫元聚利债券型证券	金、鑫元		担任鑫元合享纯债债券型
型证券 投资基 金、鑫元 裕利债 券型证 券投资基金 (原鑫元合丰分级债券型 证券投资基金)的基金经 要,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 ⑥基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利 债券型证券 型证券 型证券 型证券 投资基金 金、鑫元 招利债 券型证券 投资基金 金系元 招利债 券型证券 投资基金的基金经理 证券投资基金的基金经理 证券投资基金的基金经理 证券投资基金的基金经理 证券投资基金的基金经理 证券投资基金的基金经理 证券投资基金的基金经理 证券投资基金的基金经理 证券投资基金的基金经理 担任鑫元聚利债券型证券 券投资 基金、鑫	双债增		证券投资基金(原鑫元合
投资基金、鑫元 裕利债	强债券		享分级债券型证券投资基
金、鑫元 裕利债 券型证 券投资 基金、鑫 券投资 基金、鑫 元得利 债券型 证券投资基金)的基金经 理,2016年3月9日起担 任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016年6月3日起担任鑫元双 债增强债券型证券投资基金。 多元聚 利债券 型证券 型证券 投资基金、鑫元 招利债 券型证券 投资基金、鑫元 招利债 券型证券 发资基金的基金经理,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8月17日起担任鑫元得利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起 担任鑫元聚利债券型证券 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 券投资基金的基金经理, 2016年12月22日起担任	型证券		金)的基金经理,2016年
裕利债 券型证 券投资 基金、鑫 元得利 债券型 证券投资基金的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016年6月3日起担任鑫元双 债券型证券投资基金的基金经理,2016年7 鑫元聚 利债券 型证券 投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利 债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元得利债券型 证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起 担任鑫元聚利债券型证券 投资基金的基金经理,2016年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10月27日起 担任鑫元聚利债券型证券 发数基金的基金经理,2016年12月22日起担任	投资基		3月2日起担任鑫元合丰
券型证券投资基金、鑫元 证券投资基金)的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年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	金、鑫元		纯债债券型证券投资基金
券投资理,2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金公理,2016年6月3日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年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	裕利债		(原鑫元合丰分级债券型
基金、鑫 元得利 债券型 证券投 资基金、 鑫元聚 利债券 型证券 型证券 型证券 投资基 金、鑫元 招利债 参型证 参型证 参及 多之 是 会 是 是 会 是 是 会 是 是 会 是 是 会 是 是 是 是 是	券型证		证券投资基金) 的基金经
元得利 债券型 证券投 资基金、 鑫元聚 利债券 型证券 投资基 金、鑫元 招利债 券型证 券投资基 金、鑫元 招利债 券型证 券投资基金的基金经 理,2016 年 8 月 17 日起担任鑫元得利债券型 证券投资基金的基金经 理,2016 年 10 月 27 日起 担任鑫元聚利债券型证券 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 10 月 27 日起	券投资		理,2016年3月9日起担
债券型 证券投 资基金、 鑫元聚 利债券 型证券 投资基 金、 金、 整元 和债券 型证券 投资基 金、 金元 和利债 参型证 参型证 参型证 参型证 参型证 参型证 参型证 参数证 参数证 参数证 参数证 参数证 参数证 参数证 参数证 参数资 基金、 金、 金	基金、鑫		任鑫元汇利债券型证券投
证券投资基金、	元得利		资基金的基金经理,2016
资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年12月22日起担任	债券型		年6月3日起担任鑫元双
鑫元聚 利债券 型证券 投资基 金经理,2016年8月17 日起担任鑫元得利债券型 金、鑫元 招利债 券型证 券投资 基金、鑫 基金、鑫 基金、鑫 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	证券投		债增强债券型证券投资基
利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17 投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金的基金经 招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 券型证券投资基金的基金经理, 提金、鑫	资基金、		金的基金经理,2016年7
型证券 投资基 金、鑫元 招利债 券型证 券投资 基金、鑫	鑫元聚		月 13 日起担任鑫元裕利
投资基 日起担任鑫元得利债券型 金、鑫元 证券投资基金的基金经 招利债 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, 基金、鑫 2016年12月22日起担任	利债券		债券型证券投资基金的基
金、鑫元 证券投资基金的基金经 招利债 理,2016年10月27日起 券型证 担任鑫元聚利债券型证券 券投资 投资基金的基金经理, 基金、鑫 2016年12月22日起担任	型证券		金经理,2016年8月17
招利债 券型证 券投资 基金、鑫 型,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	投资基		日起担任鑫元得利债券型
券型证 担任鑫元聚利债券型证券 券投资 投资基金的基金经理, 基金、鑫 2016 年 12 月 22 日起担任	金、鑫元		证券投资基金的基金经
券投资 投资基金的基金经理, 基金、鑫 2016年12月22日起担任	招利债		理,2016年10月27日起
基金、鑫 2016年12月22日起担任	券型证		担任鑫元聚利债券型证券
	券投资		投资基金的基金经理,
元瑞利 鑫元招利债券型证券投资			2016年12月22日起担任
	元瑞利		鑫元招利债券型证券投资

定期开		基金的基金经理,2017年
放债券		3月13日起担任鑫元瑞利
型发起		定期开放债券型发起式证
式证券		券投资基金(原鑫元瑞利
投资基		债券型证券投资基金)的
金、鑫元		基金经理,2017年3月17
添利债		日起担任鑫元添利债券型
券型证		证券投资基金的基金经
券投资		理,2017年12月13日起
基金、鑫		担任鑫元广利定期开放债
元广利		券型发起式证券投资基金
定期开		的基金经理,2018年3月
放债券		22 日起担任鑫元常利定
型发起		期开放债券型发起式证券
式证券		投资基金的基金经理,
投资基		2018年4月19日起担任
金、鑫元		鑫元合利定期开放债券型
常利定		发起式证券投资基金的基
期开放		金经理, 2018年5月25
债券型		日起担任鑫元增利定期开
发起式		放债券型发起式证券投资
证券投		基金的基金经理,2018年
资基金、		7月11日起担任鑫元淳利
鑫元合		定期开放债券型发起式证
利定期		券投资基金的基金经理,
开放债		2019年1月24日起担任
券型发		鑫元荣利三个月定期开放
起式证		债券型发起式证券投资基
券投资		金的基金经理, 2019年3
基金、鑫		月1日起担任鑫元承利三
元增利		个月定期开放债券型发起
定期开		式证券投资基金的基金经
放债券		理,2019年4月30日起
型发起		担任鑫元悦利定期开放债
式证券		券型发起式证券投资基金
投资基		的基金经理,2019年5月
金、鑫元		9 日起担任鑫元永利债券
淳利定		型证券投资基金的基金经
期开放		理。
债券型		
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				
	元承利				
	三个月				
	定期开				
	放债券				
	型发起				
	式证券				
	投资基				
	金、鑫元				
	悦利定				
	期开放				
	债券型				
	发起式				
	证券投				
	资基金、				
	鑫元永				
	利债券				
	型证券				
	投资基				
	金的基				
	金经理				
	鑫元货				学历:经济学专业,硕士。
	币市场				相关业务资格:证券投资
	基金、鑫				基金从业资格。从业经历:
	元兴利				2010年7月任职于北京汇
	定期开				致资本管理有限公司,担
	放债券				任交易员。2011年4月起
	型发起				在南京银行金融市场部资
	式证券	2017年3月13			产管理部和南京银行金融
赵慧	投资基	日	_	9年	市场部投资交易中心担任
	金、鑫元	•			债券交易员,有丰富的银
	汇利债				行间市场交易经验。2014
	券型证				年6月加入鑫元基金,担
	券投资				任基金经理助理。2016年
	基金、鑫				1月13日起担任鑫元兴利
	元双债				定期开放债券型发起式证
	增强债				券投资基金(原鑫元兴利
	券型证				债券型证券投资基金)的

券投资	₹ 2
基金、鑫日起担任鑫元货币市场	j基
元裕利 金的基金经理,2016年	₹3
债券型 月 9 日起担任鑫元汇和	刂债
证券投 券型证券投资基金的基	金
资基金、	起
鑫元得 担任鑫元双债增强债券	型
利债券 证券投资基金的基金组	Š
型证券 理,2016年7月13日	起
投资基 担任鑫元裕利债券型证	E券
金、鑫元 投资基金的基金经理,	
聚利债 2016 年 8 月 17 日起担	.任
券型证 <u>鑫元</u> 得利债券型证券投	と资
券投资 基金的基金经理,2016	5年
基金、鑫 10月27日起担任鑫元	聚
元招利	产的
债券型 基金经理,2016 年 12	月
证券投 22 日起担任鑫元招利任	责
资基金、	金
鑫元瑞 经理,2017年3月13	日
利定期 起担任鑫元瑞利定期开	F放
开放债 债券型发起式证券投资	基
参型发	业证
起式证	理,
券投资 2017 年 3 月 17 日起担	任
基金、鑫 鑫 鑫元添利债券型证券找	ł资
元添利 基金的基金经理,2017	7年
债券型 12 月 13 日起担任鑫元	广
证券投 利定期开放债券型发起	武
资基金、 证券投资基金的基金组	<u> </u>
鑫元广 理,2018年3月22日	起
利定期 担任鑫元常利定期开放	(债
开放债	金
券型发 的基金经理,2018年4	1月
起式证 19 日起担任鑫元合利	定
券投资 期开放债券型发起式证	E券
基金、鑫 投资基金的基金经理,	
元常利 2018 年 5 月 25 日起担	任
定期开 鑫元增利定期开放债券	き型
放债券 发起式证券投资基金的	J基
型发起 金经理,2018年7月	11
式证券	肝
投资基 放债券型发起式证券投	ł资
金、鑫元 基金的基金经理,2018	3年

合利定	11月13日起担任鑫元鑫
期开放 期开放	趋势灵活配置混合型证券
债券型	投资基金、鑫元价值精选
发起式	灵活配置混合型证券投资
证券投	基金和鑫元行业轮动灵活
资基金、	配置混合型发起式证券投
鑫元增	资基金的基金经理,2019
利定期	年1月24日起担任鑫元荣
开放债 二	利三个月定期开放债券型
券型发	发起式证券投资基金的基
起式证	金经理,2019年1月25
券投资	日起担任鑫元臻利债券型
基金、鑫	证券投资基金的基金经
元淳利	理,2019年3月1日起担
定期开	任鑫元承利三个月定期开
放债券	放债券型发起式证券投资
型发起	基金的基金经理,2019年
式证券	4月30日起担任鑫元悦利
投资基	定期开放债券型发起式证
金、鑫元	券投资基金的基金经理,
鑫趋势	2019年5月9日起担任鑫
灵活配	元永利债券型证券投资基
置混合	金的基金经理。
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	
发起式	
证券投	
资基金、	
鑫元荣	
利三个	
月定期	
开放债	

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			
基金的			
基金经			
理	 		

- 注: 1. 基金的首任基金经理,任职日期为基金合同生效日,离职日期为根据公司决议确定的解聘日期;
- 2. 非首任基金经理,任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;
- 3. 证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,受逆周期调控政策及权益市场异常火爆影响,债券市场走势分化,长端利率债收益率上行明显,而短端信用债收益率则继续大幅下行,债市投资者观望情绪浓厚,策略趋于保守。二季度,逆周期调控政策在一季度经济数据超预期好转之后有所调整,5月底市场流动性预期紧张后再度缓和。另一方面,经济增长数据在一季度超预期之后逐月走低,但由于地产投资的支撑仍在从而致使总量看韧性仍在;同时,通胀方面,以猪肉、鲜果为代表的食品不断攀升,此外具有基建、地产需求支撑的钢铁、水泥价格也表现强势,对通胀的担忧一度成为了市场关注的重点。另外,中美贸易摩擦对风险偏好的扰动也是一波三折,先是年初以来基于"百日谈判"的预期下风险偏好大幅回升,之后随着5月谈判破裂后风险偏好急速回落,再到6月下旬之后G20大阪峰会后的峰回路转,风险偏好有所修复。债券市场方面,收益率曲线也经历了先上后下再震荡的格局。

本产品一直采取相对保守的策略,一季度净值表现稳定。但进入二季度,由于市场波动加大, 组合重点投资的金融债品种有所调整。

展望后市,我们认为市场整体仍将呈现债强股弱的格局,我们将持续关注经济基本面和政策方面的信号,积极把握债券市场的机会,争取为投资者创造持续、稳定的回报。

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 2.39%, 业绩比较基准收益率为 2.07%。

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,从近期的经济和金融数据来看,经济下行压力有所增大。在全球经济复苏放缓的背景下,外需减弱与中美贸易谈判的不确定性加大,外贸形势严峻; 5 月底以来,中小银行的负债端压力凸显,流动性分层引发的信用分化难言结束,甚至不排除某个时点进一步加剧的可能性,引发新一轮的信用紧缩;后期的稳增长看点仍然在财政发力,但考虑到上半年财政收支情况有逐月下降的迹象,接下来不排除财政预算作出调整的可能,这也是近期债券市场走势纠结的原因之一。但从我们的分析框架来看,即使财政预算作出调整,在严控地方政府隐性债务和严肃财政纪律的大背景下,通过财政稳增长的最终目标在于托底而非强拉。综上,我们认为尽管有诸多逆周期调节政策及财政预算调整等预期的扰动,但纵观下半年,经济探底过程中企业融资回落以及信用周期末端的风险偏好回落才是债券市场的核心矛盾。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其 第 15 页 共 39 页 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

本报告期内,本基金未进行利润分配。截止报告期末,根据本基金基金合同和相关法律法规的规定,本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国光大银行股份有限公司在鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金(以下称"本基金")托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券 投资基金 2019 年半年度报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告 (注: 财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等 内容真实、准确。

§ 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:鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日: 2019年6月30日

单位: 人民币元

平位: 人民中			
))	 附注号	本期末	上年度末
Д /	MI 4T A	2019年6月30日	2018年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	745, 228, 293. 34	750, 691, 250. 78
结算备付金		16, 145, 192. 55	5, 550, 204. 57
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2, 574, 111, 000. 00	2, 746, 334, 000. 00
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2, 574, 111, 000. 00	2, 746, 334, 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		5, 997, 046. 29	-
应收利息	6.4.7.5	64, 865, 914. 71	56, 193, 438. 18
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		3, 406, 347, 446. 89	3, 558, 768, 893. 53
A 	17/4-5-4-E	本期末	上年度末
负债和所有者权益	附注号	2019年6月30日	2018年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		780, 153, 201. 22	998, 974, 514. 30
应付证券清算款		5, 806, 462. 24	449, 635. 26
应付赎回款			
应付管理人报酬		645, 670. 80	650, 178. 67
应付托管费		215, 223. 61	216, 726. 24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	126, 346. 67	79, 074. 51

应交税费		149, 877. 96	175, 950. 39
应付利息		315, 789. 19	453, 795. 10
应付利润		-	_
递延所得税负债		_	_
其他负债	6.4.7.8	114, 891. 42	279, 000. 00
负债合计		787, 527, 463. 11	1, 001, 278, 874. 47
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2, 485, 014, 546. 70	2, 485, 014, 546. 70
未分配利润	6.4.7.10	133, 805, 437. 08	72, 475, 472. 36
所有者权益合计		2, 618, 819, 983. 78	2, 557, 490, 019. 06
负债和所有者权益总计		3, 406, 347, 446. 89	3, 558, 768, 893. 53

注: 报告截止日 2019 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.0538 元,基金份额总额 2,485,014,546.70 份。

6.2 利润表

会计主体:鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期: 2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

		本期	上年度可比期间
项 目	附注号	2019年1月1日至	2018年1月1日至
		2019年6月30日	2018年6月30日
一、收入		83, 225, 283. 64	89, 393, 401. 49
1.利息收入		72, 499, 097. 75	72, 402, 231. 76
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	15, 123, 737. 42	88, 008. 07
债券利息收入		57, 375, 360. 33	69, 032, 431. 03
资产支持证券利息收入		-	273, 738. 57
买入返售金融资产收入		_	3, 008, 054. 09
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-73, 301. 92	1, 087, 272. 60
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	-73, 301. 92	1, 087, 272. 60
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"-"	6.4.7.17	10 700 407 91	15 002 907 12
号填列)		10, 799, 487. 81	15, 903, 897. 13
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	-	

减:二、费用		21, 895, 318. 92	12, 811, 785. 52
	6 4 10 2 1	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3, 865, 578. 91	4, 394, 989. 23
2. 托管费	6.4.10.2.2	1, 288, 526. 32	1, 315, 030. 29
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	_	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1, 072. 11	15, 720. 97
5. 利息支出		11, 580, 009. 76	6, 892, 622. 05
其中: 卖出回购金融资产支出		11, 580, 009. 76	6, 892, 622. 05
6. 税金及附加		117, 065. 83	46, 811. 86
7. 其他费用	6.4.7.20	5, 043, 065. 99	146, 611. 12
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		61, 329, 964. 72	76, 581, 615. 97
减: 所得税费用		_	_
四、净利润(净亏损以"-"号填 列)		61, 329, 964. 72	76, 581, 615. 97

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期: 2019年1月1日至2019年6月30日

单位: 人民币元

	2019年	本期 1月1日至 2019年6月 30日		
项目	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)	2, 485, 014, 546. 70	72, 475, 472. 36	2, 557, 490, 019. 06	
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	_	61, 329, 964. 72	61, 329, 964. 72	
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填 列)	_	_	-	
其中: 1.基金申购款		T	_	
2. 基金赎回款	Ţ	ſ	_	
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)	2, 485, 014, 546. 70	133, 805, 437. 08	2, 618, 819, 983. 78
	2018 年	上年度可比期间 1月1日至2018年6月	30 ⊟
项目	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)	2, 190, 476, 076. 08	10, 005, 198. 01	2, 200, 481, 274. 09
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	_	76, 581, 615. 97	76, 581, 615. 97
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)	-195, 032, 666. 51	-4, 592, 417. 22	-199, 625, 083. 73
其中: 1.基金申购款	804, 991, 189. 56	5, 007, 812. 14	809, 999, 001. 70
2. 基金赎回款	-1, 000, 023, 856. 07	-9, 600, 229. 36	-1, 009, 624, 085. 43
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)	_	-50, 024, 253. 49	-50, 024, 253. 49
五、期末所有者权益(基 金净值)	1, 995, 443, 409. 57	31, 970, 143. 27	2, 027, 413, 552. 84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

 张乐赛
 陈字
 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

鑫元瑞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]2147 号《关于核准鑫元瑞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《鑫元瑞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 200,036,084.43 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(2017)第 252 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元瑞利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,036,085.86 份基金份额,其中认购资金利息折合 1.43 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

2017 年 12 月 21 日鑫元瑞利债券型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,审议通过了《关于变更注册鑫元瑞利债券型证券投资基金的议案》,审议内容包括了鑫元瑞利债券型证券投资基金变更名称、基金类型、运作方式、投资策略、投资限制、管理费、赎回费、估值方法等,大会决定将"鑫元瑞利债券型证券投资基金"正式变更为"鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金",变更后的《鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》自 2018 年 1 月 20 日起正式生效。变更后的基金为契约型、定期开放式,存续期限不定。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、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、银行存款(包括但不限于协议存款、定期存款及其他银行存款等)、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,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%,但在每次开放期的前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作目的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内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%,封闭期内不受上述5%的限制,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《企业会计准则一基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指

导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鑫元基金管理有限公司("鑫元基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司("光大银行")	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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:无。

6.4.8.1.2 债券交易

注:无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:无。

6.4.8.1.4 权证交易

注:无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付	3, 865, 578. 91	4, 394, 989. 23

的管理费		
其中: 支付销售机构的客		
户维护费	_	_

注:自2018年1月1日至2018年1月19日支付基金管理人鑫元基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算方法如下:

H=E×0.60%÷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

2017年12月21日鑫元瑞利债券型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,审议通过了《关于变更注册鑫元瑞利债券型证券投资基金的议案》,审议内容包括了鑫元瑞利债券型证券投资基金变更名称、基金类型、运作方式、投资策略、投资限制、管理费、赎回费、估值方法等,大会决定将"鑫元瑞利债券型证券投资基金"正式变更为"鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金",变更后的《鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》自2018年1月20日起正式生效。自2018年1月20日起,支付基金管理人鑫元基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算方法如下:

H=E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
次 口	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付	1 200 526 22	1 215 020 20
的托管费	1, 288, 526. 32	1, 315, 030. 29

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

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3 销售服务费

注:无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

	本期末		上年度末	
	2019年6月30日	1	2018年12月31日	3
关联 方名 称	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 银行	9, 921, 619. 21	0. 3993%	9, 921, 619. 21	0. 3993%

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

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

₩	-	本期	上年度可比期间		
关联方	2019年1月1日	至 2019 年 6 月 30 日	2018年1月1日至2018年6月30日		
名称	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
光大银行	146, 867. 91	43, 699. 16	943, 461. 04	80, 999. 34	

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注:无。

6.4.9 期末 (2019 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 400,328,999.50 元,是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额	
码						
1822006	18 宝马汽	2019年7月	102. 53	1 120 000	115, 858, 900. 00	
1622000	车 01	1 日	102. 55	1, 130, 000	115, 656, 900. 00	
170200	17进出09	2019年7月	100 07	E00, 000	51, 135, 000. 00	
170309	17 进出 09	2 日	102. 27	500, 000	51, 155, 000. 00	
170407	17农发07	2019年7月	100. 92	1, 020, 000	102, 938, 400. 00	
170407	17.	2 日	100. 92	1, 020, 000	102, 930, 400. 00	
1000061	18 渤海银	2019年7月	101 10	1 500 000	151 770 000 00	
1820061	行 02	1 日	101. 18	1, 500, 000	151, 770, 000. 00	
合计				4, 150, 000	421, 702, 300. 00	

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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证券款余额为人民币 379,824,201.72 元,其中人民币 332,196,678.00 元于 2019 年 7 月 1 日 到期,人民币 47,627,523.72 元于 2019 年 7 月 4 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- 6.4.10.1 公允价值
- 6.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

- 6.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具
- 6.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 2,574,111,000.00 元,无划分为第一、三层次的余额。(于 2018 年 12 月 31 日,属于第二层次的余额为人民币 2,746,334,000.00 元,无划分为第一、三层次的余额。)

6.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

6.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月24日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	_	_
	其中: 股票	_	_
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	2, 574, 111, 000. 00	75. 57
	其中:债券	2, 574, 111, 000. 00	75. 57
	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	761, 373, 485. 89	22. 35
8	其他各项资产	70, 862, 961. 00	2. 08
9	合计	3, 406, 347, 446. 89	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注: 本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: 本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注: 本基金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	1, 036, 203, 000. 00	39. 57
	其中: 政策性金融债	233, 298, 000. 00	8. 91
4	企业债券	575, 365, 000. 00	21. 97
5	企业短期融资券	60, 432, 000. 00	2. 31
6	中期票据	902, 111, 000. 00	34. 45
7	可转债(可交换债)		
8	同业存单	_	_
9	其他	_	_
10	合计	2, 574, 111, 000. 00	98. 29

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
71, 2	灰 が10円	灰 一	双里(II)	ムル川區	比例 (%)

1	1822006	18 宝马汽车 01	1, 500, 000	153, 795, 000. 00	5. 87
2	101555001	15 甘国投 MTN001	1, 500, 000	151, 890, 000. 00	5. 80
3	1820061	18 渤海银行 02	1, 500, 000	151, 770, 000. 00	5. 80
4	1820062	18 盛京银行 02	1, 300, 000	130, 429, 000. 00	4. 98
5	112674	18 亚迪 01	1, 200, 000	123, 084, 000. 00	4. 70

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细注:本基金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中的发行主体包括渤海银行股份有限公司。中国银行保险 监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对渤海银行股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相 关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余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	_
2	应收证券清算款	5, 997, 046. 29
3	应收股利	_
4	应收利息	64, 865, 914. 71
5	应收申购款	_
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	70, 862, 961. 00

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 户均持			持有人结构					
		户均持有的基	机构投资者		个人投资者			
	(户)	金份额	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例		
ĺ	85	29, 235, 465. 26	2, 485, 006, 187. 36	100.00%	8, 359. 34	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99.9997%,个人投资者占总份额比例实际为0.0003%。

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	1, 398. 52	0. 0001%	
持有本基金	1, 390. 32	0.0001%	

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	_	I	_	_	_
基金管理人高级管理人员	_	-	_	_	-
基金经理等人员	_	-	-	_	-
基金管理人股东	9, 921, 619. 21	0.40	9, 921, 619. 21	0. 40	3年
其他	_		_	_	

合计	9, 921, 619. 21	0.40	9, 921, 619. 21	0.40	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日 (2017 年 3 月 13 日) 基金份额总额	200, 036, 085. 86
本报告期期初基金份额总额	2, 485, 014, 546. 70
本报告期期间基金总申购份额	_
减:本报告期期间基金总赎回份额	_
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2, 485, 014, 546. 70

§ 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、本报告期内,基金管理人副总经理李雁因个人原因,不能正常履职。基金管理人已于第 一时间指定专人负责其工作。
 - 2、本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

- 1、本报告期内,基金管理人副总经理李雁因个人原因,不能正常履职。基金管理人已于第一时间指定专人负责其工作。
 - 2、本报告期内,基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

111 - L - L - L - L - L - L - L - L - L		근 - I I > + 사	
券商名称		1 N/ 5 /T14/ FF DI U / HI / F	
夯冏名称	以示义勿	四叉门以分间门用壶	

	交易单元 数量	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	备注
中信证券	2	-	-	_	_	_
安信证券	2	_	_	112, 930. 88	70. 89%	_
方正证券	2	_	_	_	_	-
中金公司	2	_	_	_	_	-
银河证券	2	_	_	_	_	-
广发证券	2	_	_	46, 370. 77	29. 11%	_

- 注:(1)交易单元的主要选择标准:
- 1) 财务状况良好,经营行为规范;
- 2) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要;
- 3) 具备研究实力, 能及时提供高质量的研究服务;
- 4) 收取的交易佣金费率合理。
- (2) 交易单元的选择程序:
- 1) 投资研究部根据选择标准选取合作券商,发起签署研究服务协议;
- 2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议,办理交易单元的相关开通手续,调整相关系统参数,基金运营部及时通知托管人。
- (3) 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

	债券交易		债券回购交	权证交易		
券商名称	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
中信证券	_	_	_	_	_	_
安信证券	_	_	11, 293, 088, 000. 00	70. 90%	_	_
方正证券	_	_	_	_	_	_
中金公司	_	-	_		_	_
银河证券	_	_	_		_	_
广发证券	2, 003, 800. 00	100.00%	4, 635, 073, 000. 00	29. 10%	_	_

§ 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		报告期内持	报告期末持有基金情况				
一者 类 别	序号	持有基金份额比例 达到或者超过 20% 的时间区间	期初 份额	申购份额	赎回 份额	持有份额	份额占 比
机构	1	20190101-20190630	2, 475, 084, 568. 15	0.00	0.00	2, 475, 084, 568. 15	99. 60%
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》生效之日起3年后的对日,若基金资产净值低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。《基金合同》生效满3年后继续存续的,基金在存续期内连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于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,基金管理人应当终止《基金合同》,并按照《基金合同》的约定程序进行清算,不需要召开基金份额持有人大会。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。

鑫元基金管理有限公司 2019 年 8 月 24 日