

基金管理人：鑫元基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：2018年7月19日

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月17日复核了报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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该基金的招募说明书。

本报告期自2018年4月19日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金

交易代码 000649

基金运作方式 募集的定期开放式

基金合同生效日 2018年4月19日

报告期末基金份额总额 510,000,000.00份

报告期末基金净值 1.0000

报告期利润 611,967,922.72

总份额净值 1.0000

报告期净值增长率 0.00%

报告期净值增长率标准差 0.00%

报告期夏普比率 0.00%

报告期收益特征 全国债市指数收益率

风险收益特征 大类资产配置策略，即根据宏观经济形势、政策环境、市场环境、资金面等进行动态分析，对资产配置比例进行适时调整。

基金管理人 鑫元基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日—2018年6月30日)

1.本期已实现收益 3,362,294.32

2.本期利润 1,000,000.00

3.期末可供分配利润 611,967,922.72

4.期末基金资产净值 1.0000

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金报告期内基金净值增长率变化率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 收益率(%) 收益率标准差(%) ① - ③ - ④ -

过去一个月 0.03% 0.00% 0.00% 0.00% -0.03% -0.02%

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

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日—2018年6月30日)

1.本期已实现收益 -130,052.73

2.本期利润 -2,424,229.36

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0067

4.期末基金份额净值 79,006,402.01

5.期末可供分配基金份额净值 0.0001

6.期末基金资产净值 79,006,402.01

注：(1)本基金的合同生效日为2018年4月19日，截止2018年6月30日不满一年。根据基金合同约定，本基金建仓期为6个月，截至本报告期末，本基金尚未处于建仓期内，将在6个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理时间 任期起止日期 离任日期 说明

陈晓东 基金经理 2018年4月19日 -

注：(1)本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离任日期为根据公司决议确定的解聘日期；
(2)非本基金基金经理，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

在报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定，认真履行基金管理职责，没有发生损害基金持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同规定的各项规章制度，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续严格执行《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.2 价差交易专项说明

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.31 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.32 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.33 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.34 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.35 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.36 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.37 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.38 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.39 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元基金管理有限公司公平交易制度指导意见》等法律法规及《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》，《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度，对本基金的异常交易行为进行监控。

4.3.40 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司未进行任何可能导致不公平交易和利益输送的关联交易。

4.3.41 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规和《鑫元