

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
报告送出日期:2018年7月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对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:中国光大银行股份有限公司根据基金合同规定,于2018年7月17日复旦了本报告中的财务指标、净值表现、组合报告等内容,保证复旦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运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金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报告中的招募说明书。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:鑫元双债增强债券型证券投资基金

交易代码:000232

基金运作方式:契约型,开放式

基金合同生效日:2016年4月21日

报告期末基金份额总额:1,002,256,907.07份

投资目标:本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制信用风险和降低债券的久期的情况下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

投资策略:本基金主要通过投资于债券,在适度控制信用风险和降低债券的久期的情况下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

风险收益特征:本基金为债券基金,属于证券投资基金中的较低风险品种。

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

下属分级基金的基金简称:鑫元双债增强A 鑫元双债增强C

下属分级基金的交易代码:000232 000233

报告期末下属分级基金的份额总额:1,002,126,424.26份 129,664.92份

§ 3 主要财务指标及基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)

1.本期已实现收益 0.174,496.07 1,223.23

2.本期利润 12,442,105.62 1,714.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.0124 0.0136

4.期末基金资产净值 1,006,963,173.97 129,664.92

5.期末基金份额净值 1.0049 1.0006

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

(2)为了更好的服务于广大投资者,在维护现有基金份额持有人利益的前提下,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定及基金合同的约定,基金管理人经基金托管人和代销机构一致同意,自2017年8月1日起对本基金基金份额净值的0.1点数提高至0.3点数后3点提高至5点数后4点,并相应回修改基金合同和托管协议。具体见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

3.2 基金净值表现

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

鑫元双债增强A

阶段 净值增长(%) 收益率标准差(%) 收益率标准差(%)

过去三个月 1.25% 0.04% -1.18% 0.23% 2.40% -0.19%

鑫元双债增强C

阶段 净值增长(%) 收益率标准差(%) 收益率标准差(%)

过去三个月 1.27% 0.04% -1.18% 0.23% 2.40% -0.19%

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

注:1)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

2)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

3)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

4)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

5)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

6)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

7)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

8)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

9)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

10)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

11)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

12)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

13)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

14)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

15)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

16)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

17)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

18)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

19)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

20)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

21)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

22)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

23)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

24)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

25)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

26)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

27)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

28)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

29)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

30)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

31)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

32)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

33)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

34)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

35)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

36)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

37)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

38)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

39)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

40)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

41)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

42)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

43)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

44)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

45)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

46)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

47)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

48)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

49)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。

50)本基金的信用风险和利率风险主要通过投资于债券,在适度控制

信用风险和利率风险的前提下,通过主动管理的理财策略,实现基金资产的长期、稳定的增值。