

鑫元得利债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

决议确定的聘任日期；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离任日期；

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 管理人自报告期内本基金运作遵守《证券投资基金法》及其他有关法律、法规和基金合同的约定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

4.3 公平交易专项说明4.3.1 公平交易制度的执行情况报告期内，本公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易流程的各项制度规范，进一步完善指上股票、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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明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，未发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超过该证券当日成交5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析在债券市场方面，一季度的行情多体现超预期流动性的宽松，而不是基本面经济数据所反映出来的平稳增长。从货币政策操作来看，降准本身所透露出的边际政策变化图是我们需要密切关注的，结合内部金融体系持续超预期见成的现实与通胀反弹较强的外部环境，总量货币政策存在边际宽松空间，为二季度市场下行创造了条件。

本基金在报告期内持续配置高等级信用债、存单，密切审查持仓债券的信用风险，并在资金面紧张的时机合理安排排布投资，高度重视持仓债券的流动性，本基金将继续以流动性较好且可获得稳定收益的资产为主，合理安排流动性，将基金资产安全及基金收益稳定的重要性置于首位，为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

截至本报告期末本基金资产净值为1,065,333元；本报告期基金份额净增长率为1.44%，业绩比较基准收益率为2.16%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。出现该情形的时间范围为2018年4月1日至2018年6月20日。截至报告期末，上述情形已消失。

5 投资组合报告5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with 4 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 4 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.10.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.7 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.9 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.10 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.12 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.13 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.15 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.16 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.18 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.19 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.21 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.22 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.24 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.25 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.27 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.28 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.30 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.31 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.33 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.34 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.10.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.7 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.9 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.10 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.12 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.13 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.15 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.16 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.18 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.19 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.21 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.22 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.24 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.25 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.27 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.28 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.30 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.31 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.33 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.34 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.36 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.37 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.39 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.40 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.10.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.7 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.9 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.10 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.12 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.13 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.15 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.16 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.18 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.19 报告期末前十名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)