

鑫元稳利债券型证券投资基金

2018年第三季度报告



鑫元稳利基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金的实际业绩于2014年6月12日,根据基金合同约定,本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

注:1.基金的首任基金经理,任职日期为基金合同生效日,离任日期为根据合同约定确定的解聘日期;

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《证券投资基金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、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 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,进一步完善境内

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异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及《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督核查。

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量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在7月中下旬理财新规落地,去杠杆杆稳人心,通常会回调转向信用,债市前期一路走

市的逻辑有所破坏,三季度整体走出震荡上行行情,报告期内,本产品继续保持长久期杠

杆策略,未拉长久期,下沉信用,因此净值保持相对稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0952元,本报告期基金份额净值增长率为0.98%,

业绩比较基准收益率为1.35%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

注:本基金本报告期末未持有境内股票。

4.7 报告期内基金投资资产净值预警说明

注:本基金本报告期末未持有境内股票。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 类别, 金额(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 columns: 行业名称, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业名称, 金额(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十名股票投资明细

Table with 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(%)

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.1 报告期末按品种分类的国债投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.2 报告期末按品种分类的金融债投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.3 报告期末按品种分类的央行票据投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.4 报告期末按品种分类的短期融资券投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.5 报告期末按品种分类的资产支持证券投资明细

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.6 报告期末按品种分类的债券回购投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.7 报告期末按品种分类的买断式回购投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 投资组合报告附注

5.5.1 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。

5.5.2 报告期内基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.3 报告期内基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.4 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.5 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.6 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.7 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.8 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.9 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.10 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.11 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.12 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.13 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.14 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.15 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.16 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.17 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.18 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.19 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.20 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.21 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.22 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.23 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.24 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.25 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.26 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.27 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.28 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.29 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.30 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.31 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.32 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.33 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.34 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.35 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.36 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.37 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.38 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.39 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.40 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.41 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.42 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.43 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.44 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.45 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.46 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.47 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.48 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.49 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.50 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.51 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.52 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.53 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.54 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.55 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.56 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.57 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.58 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.59 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.60 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.61 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.62 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.63 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.64 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

鑫元双债增强债券型证券投资基金

2018年第三季度报告



鑫元双债增强基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金的实际业绩于2016年4月21日,根据基金合同约定,本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

注:1.基金的首任基金经理,任职日期为基金合同生效日,离任日期为根据合同约定确定的解聘日期;

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《证券投资基金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、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 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异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及《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督核查。

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量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

李俊,中美贸易摩擦升级,美联储如期于9月再度加息,新兴市场波动加剧,国内方面,一

系列稳增长、稳投资的宏观政策陆续推出,加之地方政府加大发行带来的供给压力,债

券市场弱势震荡,利率债小幅调整但期间波动较大,信用债除低等级外表现好于利率债。

股市方面,上证指数整体呈现波动上行走势并创出2644点新高,市场观望情绪依旧,直至季末在系列利好的刺激下大盘股有所表现,指

数收涨有所收获。

报告期内,本基金降低了组合仓位和久期,适当加大了信用债配置,组合净值表现稳定。接

下来,管理人将继续加强对经济基本面及货币政策的跟踪,持续优化组合持仓,为投资人争取更好的回报。

4.5 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

注:本基金本报告期末未持有境内股票。

4.6 报告期内基金投资资产净值预警说明

注:本基金本报告期末未持有境内股票。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 类别, 金额(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 columns: 行业名称, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业名称, 金额(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十名股票投资明细

Table with 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(%)

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.1 报告期末按品种分类的国债投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.2 报告期末按品种分类的金融债投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.3 报告期末按品种分类的央行票据投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.4 报告期末按品种分类的短期融资券投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.5 报告期末按品种分类的资产支持证券投资明细

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.6 报告期末按品种分类的债券回购投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4.7 报告期末按品种分类的买断式回购投资组合

Table with columns: 品种, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 投资组合报告附注

5.5.1 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。

5.5.2 报告期内基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.3 报告期内基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.4 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.5 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.6 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.7 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.8 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.9 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.10 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.11 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.12 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.13 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.14 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.15 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.16 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.17 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.18 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.19 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.20 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.21 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.22 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.5.23 报告期内基金投资的前十名资产支持证券投资中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库的情况。