

鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

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多种方式,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各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不同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投资管理权限及授权管理办法》、《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检查。

报告期内未发现本基金存在可能導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多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
本基金专注于债券产品投资,追求稳定回报。配置策略主要集中在中短久期品种,主要是规避利率风险,同时在较为宽松的流动性环境下积极加大杠杆,获取超额回报。

4.5 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末本基金的份额净值为1.0452元;本报告期基金份额净值增长率为2.25%,业绩比较基准收益率为2.91%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
截至本报告期末本基金持有人数或基金资产净值未达到预警说明的情况。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	603,882,000.00	97.92
5	其中:债券	595,886,000.00	96.30
6	资产支持证券	9,996,000.00	1.62
7	衍生金融资产	-	-
8	应收利息	127,474,000.00	20.00
9	其他资产	-	-
10	合计	731,356,000.00	117.92

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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。

5.2.2 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。

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
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	396,886,000.00	72.59
4	企业债券/企业资产支持证券	39,000,000.00	7.30
5	公司债	127,474,000.00	24.13
6	地方政府债	90,386,000.00	16.96
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	-	-
9	其他债券	19,210,000.00	3.60
10	合计	663,686,000.00	113.42

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

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(%)
1	011801289	01国债28	500,000	50,346,000.00	9.46
2	127275	17国债08	450,000	46,485,000.00	8.72
3	127761	17国债08	450,000	46,500,000.00	8.61
4	127761	18国债08	450,000	46,500,000.00	8.61
5	1830308	01国债08	400,000	41,116,000.00	7.77

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1481016	贵州债01	100,000	9,996,000.00	1.88

5.7 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.7 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.10.8 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。

5.10.9 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.10.10 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
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.12 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。

5.10.13 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。

5.10.14 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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.7 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.10.8 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。

5.10.9 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.10.10 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
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.12 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。

5.10.13 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。

5.10.14 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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.7 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.10.8 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。

5.10.9 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.10.10 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
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.12 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。

5.10.13 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。

5.10.14 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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.7 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.10.8 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。

5.10.9 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.10.10 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
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.12 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。

5.10.13 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。

5.10.14 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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.7 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.10.8 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。

5.10.9 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.10.10 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
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.12 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。

5.10.13 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。

5.10.14 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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.7 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.10.8 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。

5.10.9 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.10.10 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
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.12 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。

5.10.13 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。

5.10.14 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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.7 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.10.8 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。

5.10.9 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.10.10 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
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.12 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。

5.10.13 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。

5.10.14 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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.7 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.10.8 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。

5.10.9 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.10.10 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
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.12 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。

5.10.13 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。

5.10.14 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中的发行主体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约定的备选股票库的情况。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,566,511.28
5	其他资产	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	16,566,511.28

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。