

鑫元双债增强债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

注：1. 基金的前任基金经理，在卸任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. 非前任基金经理，在卸任日期和任卸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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内，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，本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，本公司继续严格执行《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关于公平交易流程的各项制度规定，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人工干预等多种方式，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间进行监控分析，未发现存在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授权及投资管理协议》、《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投资授权及投资管理协议》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影响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
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，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 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末鑫元双债增强A基金份额净值为1.0165元，本报告期基金份额净值增长率为0.91%；截至本报告期末鑫元双债增强B基金份额净值为1.0165元，本报告期基金份额净值增长率为0.91%，同期业绩比较收益率为-0.90%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内不存在需要持有人人数或基金资产净值进行说明的情况。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
2	债券投资	—	—
3	固定收益投资	1,217,644,000.00	98.24
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	1,080,793.03	0.13
8	其他资产	20,188,979.00	1.63
9	合计	1,239,403,646.03	100.00

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股票投资。
5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资股票组合
注：本基金本报告期末未持有港股股票投资。

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	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,109,297.00	94.89
4	企业债券	5,109,297.00	94.89
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	5,109,297.00	94.89

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(条)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
2	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
3	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
4	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
5	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89

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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
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逆回购交易情况说明
5.9.1 本期国债逆回购交易情况说明
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债逆回购持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债逆回购。
5.9.3 本期国债逆回购投资评价
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1
本报告期内本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
本报告期内本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

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	699,375.00
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	699,375.00

5.11 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.11.1 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。
5.11.2 报告期末按行业分类的港股股票投资股票组合
注：本基金本报告期末未持有港股股票。

5.12 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。

5.13 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	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,109,297.00	94.89
4	企业债券	5,109,297.00	94.89
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	5,109,297.00	94.89

5.14 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(条)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
2	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
3	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
4	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
5	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89

5.15 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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.16 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。
5.17 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。

5.18 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明
5.18.1 本期国债逆回购交易情况说明
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.18.2 报告期末本基金投资的国债逆回购持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债逆回购。
5.18.3 本期国债逆回购投资评价
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.19 投资组合报告附注
5.19.1
本报告期内本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。
5.19.2
本报告期内本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。
5.19.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	699,375.00
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	699,375.00

5.20 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.20.1 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。
5.20.2 报告期末按行业分类的港股股票投资股票组合
注：本基金本报告期末未持有港股股票。

5.21 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。

5.22 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	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,109,297.00	94.89
4	企业债券	5,109,297.00	94.89
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	5,109,297.00	94.89

5.23 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(条)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
2	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
3	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
4	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
5	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89

5.24 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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.25 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。
5.26 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。

5.27 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明
5.27.1 本期国债逆回购交易情况说明
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.27.2 报告期末本基金投资的国债逆回购持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债逆回购。
5.27.3 本期国债逆回购投资评价
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.28 投资组合报告附注
5.28.1
本报告期内本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。
5.28.2
本报告期内本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。
5.28.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	699,375.00
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	699,375.00

5.29 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.29.1 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。
5.29.2 报告期末按行业分类的港股股票投资股票组合
注：本基金本报告期末未持有港股股票。

5.30 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。

5.31 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	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,109,297.00	94.89
4	企业债券	5,109,297.00	94.89
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	5,109,297.00	94.89

5.32 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(条)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
2	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
3	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
4	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
5	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89

5.33 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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.34 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。
5.35 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。

5.36 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明
5.36.1 本期国债逆回购交易情况说明
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.36.2 报告期末本基金投资的国债逆回购持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债逆回购。
5.36.3 本期国债逆回购投资评价
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.37 投资组合报告附注
5.37.1
本报告期内本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。
5.37.2
本报告期内本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。
5.37.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	699,375.00
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	699,375.00

5.38 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.38.1 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。
5.38.2 报告期末按行业分类的港股股票投资股票组合
注：本基金本报告期末未持有港股股票。

5.39 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。

5.40 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	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,109,297.00	94.89
4	企业债券	5,109,297.00	94.89
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	5,109,297.00	94.89

5.41 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(条)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
2	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
3	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
4	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
5	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89

5.42 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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.43 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。
5.44 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。

5.45 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明
5.45.1 本期国债逆回购交易情况说明
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.45.2 报告期末本基金投资的国债逆回购持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债逆回购。
5.45.3 本期国债逆回购投资评价
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.46 投资组合报告附注
5.46.1
本报告期内本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。
5.46.2
本报告期内本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。
5.46.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	699,375.00
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	699,375.00

5.47 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.47.1 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。
5.47.2 报告期末按行业分类的港股股票投资股票组合
注：本基金本报告期末未持有港股股票。

5.48 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。

5.49 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	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,109,297.00	94.89
4	企业债券	5,109,297.00	94.89
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	5,109,297.00	94.89

5.50 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(条)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
2	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
3	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
4	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89
5	010303	国开1303	88,560	5,109,297.00	94.89

5.51 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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.52 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。
5.53 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。

5.54 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明
5.54.1 本期国债逆回购交易情况说明
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.54.2 报告期末本基金投资的国债逆回购持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债逆回购。
5.54.3 本期国债逆回购投资评价
注：本基金本报告期末未投资国债逆回购。
5.55 投资组合报告附注
5.55.1
本报告期内本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