鑫元双债增强债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年3月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核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和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的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基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鑫元双债增强	
基金主代码	002632	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,002,499,684.73份	
基金合同存续期	不定期	
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:	002632	002633
报告期末下属分级基金的份额总额	1,002,405,262.65份	94,422.08份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以信用债和可转债为主要投资对象,在适度承担信用风险并保证资产流动性的条件下,通过积极主动的投资管理,力争取得超越基金业绩比较基准的收益,实现基金资产长期,稳定的增长。
投资策略	本基金为债券型基金,对债券的投资比例不低于基金资产的80%。在严格把控投资风险的基础上,适度参与权益类资产的投资从而提高投资收益。本基金紧密跟踪债券市场与股票市场的运行情况和风险收益特征,结合对宏观经济环境、国家政策趋向及利率变化趋势等重点分析,判断债券市场和股票市场的相对投资价值,在债券资产与股票资产之间进行动态调整。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鑫元基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	石立平
	联系电话	021-20892000转	010-63639180
	电子邮箱	service@xyamc.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4006066188	95595
传真		021-20892111	010-63639132

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xyamc.com
基金年度报告备置地点	上海市静安区中山北路909号12层 鑫元基金管理有限公司

注:为保障基金份额持有人利益,基金管理人经与《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及《证券日报》协商一致,决定自2019年1月22日起,将本基金的信息披露报纸调整为《中国证券报》。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年4月21日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	鑫元双债增强A	鑫元双债增强C	鑫元双债增强A	鑫元双债增强C	鑫元双债增强A	鑫元双债增强C
本期实现收益	30,706,479.43	3,249.48	33,626,422.06	5,241.12	10,590,424.58	5,172.30
本期利润	40,458,018.94	4,619.70	14,218,965.36	335.05	2,361,576.26	1,526.69
加权平均基份额本期利润	0.0404	0.0413	0.0158	0.0021	0.0049	0.0060
本期基金份额净值增长率	4.05%	3.82%	0.90%	0.55%	0.60%	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0165	0.0195	0.0061	0.0015	0.0059	0.0040
期末基金资产净值	1,018,968,214.82	96,264.23	1,007,802,219.26	115,054.10	502,477,109.58	208,021.00
期末基份额净值	1.0165	1.0195	1.0061	1.0015	1.0060	1.0040

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、为更好地服务于广大投资者,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》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及基金合同的约定,基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自2017年8月1日起对本基金基金份额净值的小数点保留精度由小数点后3位提高至小数点后4位,并相应修改基金合同和托管协议。具体请见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。根据原基金合同的约定,2016年末“期末基金份额净值”的小数点保留精度为小数点后3位。目前系统强制保留4位小数,小数点后第4位强制补0。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

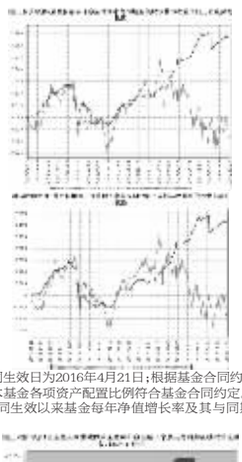
鑫元双债增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.91%	0.03%	-0.90%	0.32%	1.81%	-0.29%
过去六个月	1.16%	0.10%	-0.79%	0.29%	1.95%	-0.19%
过去一年	4.05%	0.08%	-1.23%	0.26%	5.28%	-0.18%
自基金合同生效起至今	5.63%	0.08%	-1.13%	0.21%	6.76%	-0.13%

鑫元双债增强C

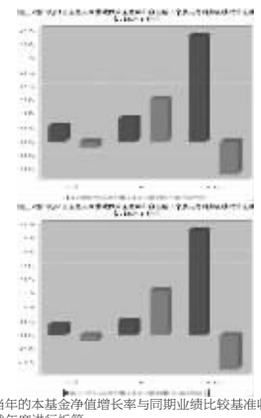
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.81%	0.03%	-0.90%	0.32%	1.71%	-0.29%
过去六个月	0.98%	0.10%	-0.79%	0.29%	1.77%	-0.19%
过去一年	3.82%	0.08%	-1.23%	0.26%	5.05%	-0.18%
自基金合同生效起至今	4.80%	0.08%	-1.13%	0.21%	5.93%	-0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:本基金的合同生效日为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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

鑫元双债增强A

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.3000	30,044,513.27	17,874.48	30,062,387.75	
2017	0.0900	9,013,155.87	251.53	9,013,407.40	
2016	-	-	-	-	
合计	0.3900	39,057,669.14	18,126.01	39,075,795.15	

单位:人民币元

鑫元双债增强C

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.2000	1,678.02	782.67	2,460.69	
2017	0.0800	722.94	211.02	933.96	
2016	-	-	-	-	
合计	0.2800	2,400.96	993.69	3,394.65	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为鑫元基金管理有限公司,本公司经中国证监会证监许可[2013]1115号文批准于2013年8月成立,由南京银行股份有限公司发起,与南京高科股份有限公司联合组建;注册资本金17亿元人民币,总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理(包括特定对象投资咨询)和中国证监会许可的其他业务。

截至2018年12月31日,公司旗下管理20只证券投资基金——鑫元货币市场基金、鑫元恒鑫收益增强债券型证券投资基金(原鑫元一年定期开放债券型证券投资基金)、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元合享纯债债券型证券投资基金(原鑫元合享分级债券型证券投资基金)、鑫元聚鑫收益增强债券型证券投资基金(原鑫元半年定期开放债券型证券投资基金)、鑫元丰纯债债券型证券投资基金(原鑫元合丰分级债券型证券投资基金)、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金(原鑫元兴利债券型证券投资基金)、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金(原鑫元瑞利债券型证券投资基金)、鑫元添利债券型证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元广汇定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元起兴定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元开元定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元丰利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元裕利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元裕利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元裕