鑫元双债增强债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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
报告送出日期:2019年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鑫元双债增强
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,001,698,035.26份
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%。在严格控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。
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	
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	1,001,619,369.33份	78,668.93份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	鑫元双债增强A	鑫元双债增强C
1. 本期已实现收益	9,392,530.88	658.44
2. 本期利润	5,650,372.87	363.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0056	0.0046
4. 期末基金资产净值	1,035,538,123.13	81,409.01
5. 期末基金份额净值	1.0339	1.0349

注:(1)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。

(2)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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

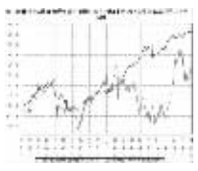
鑫元双债增强A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.55%	0.03%	-0.43%	0.29%	0.98%	-0.26%

鑫元双债增强C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.45%	0.03%	-0.43%	0.29%	0.88%	-0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:(1)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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵慧	鑫元货币市场基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、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、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元纯利债券型证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元聚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、鑫元添利债券型证券投资基金、鑫元添利债券型证券投资基金、鑫元添利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元添利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元添利定期开放债券型发起式