鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2019年8月24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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	鑫元核心资产	
基金主代码	006193	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年11月14日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,477,564.26份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	鑫元核心资产A	鑫元核心资产C
下属分级基金的交易代码：	006193	006194
报告期末下属分级基金的份额总额	12,801,848.59份	675,715.67份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金在秉承价值投资理念的前提下，把握市场发展趋势并严格控制投资组合风险，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估中国A股、港股、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	郭明
	联系电话	021-20892000转	(010)66105799
	电子邮箱	service@xyamc.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006066188	95588
传真		021-20892111	(010)66105798

2.4信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	鑫元核心资产A	鑫元核心资产C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 － 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 － 2019年6月30日)
本期已实现收益	-490,392.60	-21,404.73
本期利润	240,015.74	32,752.70
加权平均基金份额本期利润	0.0182	0.0425
本期基金份额净值增长率	1.45%	1.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0473	-0.0472
期末基金资产净值	12,902,334.44	681,078.61
期末基金份额净值	1.0078	1.0079

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、本基金合同于2018年11月14日生效，截止2019年6月30日不满一年。

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

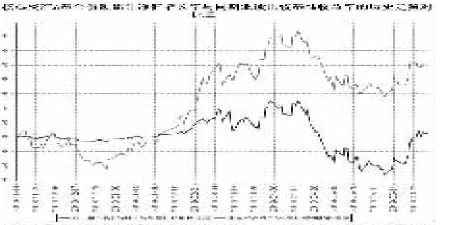
鑫元核心资产A

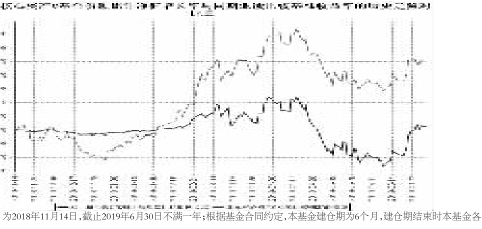
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.41%	1.09%	4.40%	0.93%	3.01%	0.16%
过去三个月	-3.13%	1.39%	-0.82%	1.23%	-2.31%	0.16%
过去六个月	1.45%	1.12%	22.06%	1.24%	-20.61%	-0.12%
自基金合同生效起至今	0.78%	0.99%	15.17%	1.18%	-14.39%	-0.19%

鑫元核心资产C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	7.36%	1.08%	4.40%	0.93%	2.96%	0.15%
过去三个月	-2.83%	1.39%	-0.82%	1.23%	-2.01%	0.16%
过去六个月	1.56%	1.12%	22.06%	1.24%	-20.50%	-0.12%
自基金合同生效起至今	0.79%	0.99%	15.17%	1.18%	-14.38%	-0.19%

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2018年11月14日，截止2019年6月30日不满一年；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2019年6月30日，公司旗下管理34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、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、鑫元聚鑫收益增强债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债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、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、鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金、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、鑫元广利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、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金、鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元臻利债券型证券投资基金、鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元永利债券型证券投资基金。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁玥	鑫元聚鑫收益增强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、鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的基金经理；兼任权益投研部总监、首席权益投资官、基金投资决策委员会委员	2018年11月14日	–	10年	学历：金融工程硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009年7月至2015年7月，任职于中国国际金融有限公司，担任研究部副总经理，2015年7月加入鑫元基金担任信用研究主管，2016年7月担任研究部总监，2018年6月担任权益投研部总监兼首席权益投资官。2016年7月26日起担任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）的基金经理，2017年9月4日起担任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年12月14日起担任鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年1月23日起担任鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年5月31日至2019年6月11日担任鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，2018年11月14日起担任鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的基金经理；同时兼任基金投资决策委员会委员。

注：1. 基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离职日期为根据公司决议确定的解聘日期；

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《证券业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、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管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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部关于公平交易管理的各项制度规范，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

公司制订《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，通过系统和人工相结合的方式进行基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。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，未出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管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

上半年在经济预期增长目标下调、货币及财政政策由需求管理向供给侧发力愈发明显及中美贸易摩擦持续反复的背景下，产品投资策略逐步向科技、消费医药及等受益于供给侧改革及补短板的行业聚焦，也阶段性参与了金融券商以及贵金属的交易性行情。1-4月份产品处于建仓期，仓位偏低，是落后于基准指数的主要原因，建仓期结束后仓位维持在较高水平。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元核心资产A的基金份额净值增长率为1.45%；鑫元核心资产C的基金份额净值增长率为1.56%；同期业绩比较基准收益率为22.06%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济仍处于下行趋势中，叠加了全球经济放缓，盈利底部尚需等待。政策也进入由需求端管理向供给侧发力的大周期，因而不能轻易期待需求端的强刺激，更应该关注产业结构升级和产业转型相关的具体政策可能带来的结构性机会。金融供给侧改革以及科创板的成立都将对产业转型升级以及资本市场本身带来长期深远的影响。成长前景广阔的新领域将广泛获得直接融资的灌溉，获得更加有质量的成长。无风险高收益类资产的正本清源也将大大提升风险类资产应有的价值。尽管这些都是长期的慢变量，但都令我们对资本市场的长期前景保持乐观。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。成员包括公司总经理、基金运营部分管领导、固定收益部和权益投研部分管领导、督察长、固定收益部负责人、权益投研部负责人、监察稽核部负责人、交易部负责人、基金运营部负责人等，对公司依法受托管理资产的投资品种估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。本公司的基金估值和会计核算由基金运营部负责实施，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金运营部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间债券市场及证券交易所上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。截止报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的管理人——鑫元基金管理有限公司在鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鑫元基金管理有限公司编制和披露的鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,256,905.15	7,133,382.53
结算备付金		113,125.26	62,452.89
存出保证金		12,648.21	10,428.92
交易性金融资产	6.4.7.2	10,991,897.00	2,395,359.55
其中：股票投资		10,991,897.00	2,395,359.55
基金投资		–	–
债券投资		–	–
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产	6.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	6.4.7.4	–	5,500,055.00
应收证券清算款		302,237.30	–
应收利息	6.4.7.5	399.42	9,565.41
应收股利		–	–
应收申购款		1,155.98	–
递延所得税资产		–	–
其他资产	6.4.7.6	–	–
资产总计		13,678,368.32	15,111,244.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债：			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债	6.4.7.3	–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	170,718.42
应付赎回款		12,470.43	–
应付管理人报酬		15,923.22	19,015.30
应付托管费		2,653.86	3,169.22
应付销售服务费		405.36	783.70
应付交易费用	6.4.7.7	48,625.34	5,260.66
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	6.4.7.8	14,877.06	20,000.00
负债合计		94,955.27	218,947.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	13,477,564.26	14,992,002.75
未分配利润	6.4.7.10	105,848.79	-99,705.75
所有者权益合计		13,583,413.05	14,892,297.00
负债和所有者权益总计		13,678,368.32	15,111,244.30

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额13,477,564.26份。其中下属A类基金份额净值1.0078元，基金份额总额12,801,848.59份，下属C类基金份额净值1.0079元，基金份额总额675,715.67份。

6.2利润表

会计主体：鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		563,419.02	–
1.利息收入		42,497.13	–
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,737.23	–
债券利息收入		–	–
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		25,759.90	–
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）		-270,504.57	–
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-332,812.87	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益	6.4.7.13	–	–
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	–	–
贵金属投资收益	6.4.7.14	–	–
衍生工具收益	6.4.7.15	–	–
股利收益	6.4.7.16	62,308.30	–
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	784,565.77	–
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,860.69	–
减：二、费用		290,650.58	–
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	104,550.38	–
2.托管费	6.4.10.2.2	17,425.09	–
3.销售服务费	6.4.10.2.3	3,088.90	–
4.交易费用	6.4.7.19	146,072.82	–
5.利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6.税金及附加		–	–
7.其他费用	6.4.7.20	19,513.39	–
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		272,768.44	–
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		272,768.44	–

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,992,002.75	-99,705.75	14,892,297.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	272,768.44	272,768.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,514,438.49	-67,213.90	-1,581,652.39
其中：1.基金申购款	888,964.91	-3,743.66	885,221.25
2.基金赎回款	-2,403,403.40	-63,470.24	-2,466,873.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	13,477,564.26	105,848.79	13,583,413.05

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	–	–	–
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	–	–
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
其中：1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	–	–	–

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张乐赛　　　陈宇　　　包颖
基金管理人负责人　　　主管会计工作负责人　　　会计机构负责人

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]991号文《关于准予鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由鑫元基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币14,990,163.45元，已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2018）验字第61444343_B02号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金合同》于2018年11月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为14,992,002.75份基金份额，其中认购资金利息折合1,839.30份基金份额。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、权证、股指期货、国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括但不限于协议存款、定期存款及其他银行存款等）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为80%-95%（投资于港股通标的股票比例不得超过股票资产的50%），其中投资于核心资产主题相关证券比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

6.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日起至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2019年1月1日起至2019年6月30日止。

6.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资等；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9)权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鑫元基金管理有限公司(“鑫元基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
南京银行股份有限公司(“南京银行”)	基金管理人股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

注：无。

6.4.8.1.2债券交易

注：无。

6.4.8.1.3债券回购交易

注：无。

6.4.8.1.4权证交易

注：无。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	104,550.38	–
其中：支付销售机构的客户维护费	12,658.85	–

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,425.09	–

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元核心资产A	鑫元核心资产C	合计
鑫元基金	–	574.61	574.61
工商银行	–	1,934.97	1,934.97
合计	–	2,509.58	2,509.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元核心资产A	鑫元核心资产C	合计

注：基金的销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。计算方法如下：

H=E×0.80%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	鑫元核心资产A	鑫元核心资产C
基金合同生效日（2018年11月14日）持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	10,000,000.00	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	10,000,000.00	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	74.1974%	–

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	鑫元核心资产A	鑫元核心资产C
基金合同生效日（2018年11月14日）持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

6.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	2,256,905.15	15,186.70	–	–

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

无。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1公允价值

6.4.10.1.1不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.10.1.2以公允价值计量的金融工具

6.4.10.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次余额为人民币10,991,897.00元，无划分为第二、三层次的余额。（于2018年12月31日，属于第一层次余额为人民币2,395,359.55元，无划分为第二、三层次的余额。）

6.4.10.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.10.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期末发生变动。

6.4.10.2承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.10.3其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.10.4财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月24日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,991,897.00	80.36
	其中：股票	10,991,897.00	80.36
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	2,370,030.41	17.33
8	其他各项资产	316,440.91	2.31
9	合计	13,678,368.32	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	2,280,995.00	16.79
C	制造业	3,917,556.00	28.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	358,000.00	2.64
E	建筑业	244,512.00	1.80
F	批发和零售业	255,250.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	450,000.00	3.31
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	763,100.00	5.62
J	金融业	1,460,560.00	10.75
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	443,250.00	3.26
M	科学研究和技术服务业	416,064.00	3.06
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	402,610.00	2.96
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	10,991,897.00	80.92

7.2.2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。

7.3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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600547	山东黄金	23,500	967,495.00	7.12
2	600036	招商银行	20,000	719,600.00	5.30
3	000651	格力电器	12,500	687,500.00	5.06
4	600872	中炬高新	13,800	591,054.00	4.35
5	002507	涪陵榨菜	15,000	457,500.00	3.37
6	601021	春秋航空	10,000	450,000.00	3.31
7	601888	中国国旅	5,000	443,250.00	3.26
8	603259	药明康德	4,800	416,064.00	3.06
9	000063	中兴通讯	12,400	403,372.00	2.97
10	300015	爱尔眼科	13,000	402,610.00	2.96

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600547	山东黄金	1,951,817.00	13.11
2	000426	兴业矿业	1,201,499.00	8.07
3	002796	世嘉科技	1,187,797.00	7.98
4	600030	中信证券	1,159,372.00	7.79
5	000651	格力电器	1,127,685.00	7.57
6	601390	中国中铁	1,107,210.00	7.43
7	600900	长江电力	1,104,840.00	7.42
8	002415	海康威视	1,045,422.00	7.02
9	600570	恒生电子	1,044,736.00	7.02
10	002716	金贵银业	1,043,853.00	7.01
11	002405	四维图新	1,037,670.00	6.97
12	000063	中兴通讯	1,018,274.00	6.84
13	601899	紫金矿业	1,018,233.00	6.84
14	600519	贵州茅台	988,596.00	6.64
15	002422	科伦药业	949,847.00	6.38
16	601288	农业银行	917,970.00	6.16
17	601688	华泰证券	908,262.00	6.10
18	600489	中金黄金	887,954.00	5.96
19	600588	用友网络	800,227.00	5.37
20	600872	中炬高新	775,550.00	5.21
21	000977	浪潮信息	769,843.00	5.17
22	600176	中国巨石	759,774.00	5.10
23	300255	常山药业	757,225.00	5.08
24	002384	东山精密	753,697.00	5.06
25	601021	春秋航空	727,624.00	4.89
26	300559	佳发教育	725,277.00	4.87
27	600093	易见股份	708,494.00	4.76
28	002230	科大讯飞	696,250.00	4.68
29	000661	长春高新	693,865.00	4.66
30	300498	温氏股份	672,508.00	4.52
31	600036	招商银行	659,140.00	4.43
32	600958	东方证券	657,357.00	4.41
33	603501	韦尔股份	644,776.00	4.33
34	00570	中国中药	616,461.55	4.14
35	600875	东方电气	609,447.00	4.09
36	300033	同花顺	604,205.00	4.06
37	300296	利亚德	598,176.00	4.02
38	002475	立讯精密	596,356.00	4.00
39	600745	闻泰科技	590,750.00	3.97
40	00700	腾讯控股	554,389.27	3.72
41	000975	银泰资源	534,487.00	3.59
42	600104	上汽集团	506,450.00	3.40
43	601377	兴业证券	502,257.00	3.37
44	300119	瑞普生物	489,500.00	3.29
45	603083	剑桥科技	487,518.00	3.27
46	002237	恒邦股份	480,200.00	3.22
47	601186	中国铁建	474,861.00	3.19
48	600398	海澜之家	461,400.00	3.10
49	601225	陕西煤业	447,500.00	3.00
50	002250	联化科技	443,360.00	2.98
51	600446	金证股份	435,095.00	2.92
52	601328	交通银行	433,400.00	2.91
53	002507	涪陵榨菜	431,000.00	2.89
54	300750	宁德时代	428,000.00	2.87
55	601006	大秦铁路	417,000.00	2.80
56	002839	张家港行	416,560.00	2.80
57	603259	药明康德	406,276.00	2.73
58	600216	浙江医药	388,836.00	2.61
59	601628	中国人寿	374,690.00	2.52
60	600604	市北高新	374,050.00	2.51
61	600438	通威股份	369,692.00	2.48
62	002127	南极电商	367,100.00	2.47
63	002024	苏宁易购	366,977.00	2.46
64	000603	盛达矿业	358,243.00	2.41
65	300059	东方财富	353,342.00	2.37
66	600131	岷江水电	339,854.00	2.28
67	002675	东诚药业	339,202.00	2.28
68	601012	隆基股份	331,700.00	2.23
69	300015	爱尔眼科	323,550.00	2.17
70	300666	江丰电子	322,750.00	2.17
71	002367	康力电梯	321,116.00	2.16
72	002594	比亚迪	311,000.00	2.09
73	002709	天赐材料	310,650.00	2.09
74	600323	瀚蓝环境	304,400.00	2.04
75	601888	中国国旅	300,550.00	2.02
76	600201	生物股份	300,400.00	2.02
77	000963	华东医药	299,880.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002796	世嘉科技	1,524,605.00	10.24
2	600547	山东黄金	1,337,217.55	8.98
3	000426	兴业矿业	1,277,573.04	8.58
4	002716	金贵银业	1,096,847.00	7.37
5	601390	中国中铁	1,069,586.00	7.18
6	002422	科伦药业	1,034,039.00	6.94
7	601688	华泰证券	1,031,658.60	6.93
8	600900	长江电力	1,026,700.00	6.89
9	601186	中国铁建	925,829.28	6.22
10	002415	海康威视	910,385.00	6.11
11	600519	贵州茅台	889,638.00	5.97
12	300559	佳发教育	805,029.00	5.41
13	600030	中信证券	790,394.74	5.31
14	000977	浪潮信息	783,547.00	5.26
15	600588	用友网络	770,679.40	5.18
16	002384	东山精密	767,894.00	5.16
17	000661	长春高新	749,230.00	5.03
18	600489	中金黄金	741,840.00	4.98
19	600570	恒生电子	740,952.00	4.98
20	300255	常山药业	725,140.00	4.87
21	00570	中国中药	693,807.39	4.66
22	002230	科大讯飞	666,529.00	4.48
23	002405	四维图新	655,520.00	4.40
24	600958	东方证券	655,319.00	4.40
25	601899	紫金矿业	637,929.00	4.28
26	000063	中兴通讯	633,646.00	4.25
27	600093	易见股份	613,194.00	4.12
28	300498	温氏股份	611,100.00	4.10
29	300296	利亚德	591,125.07	3.97
30	002475	立讯精密	570,840.00	3.83
31	300033	同花顺	565,930.00	3.80
32	601377	兴业证券	564,224.00	3.79
33	601288	农业银行	562,271.00	3.78
34	00700	腾讯控股	560,855.27	3.77
35	000651	格力电器	543,680.00	3.65
36	600745	闻泰科技	530,640.00	3.56
37	601006	大秦铁路	510,270.00	3.43
38	600604	市北高新	507,686.00	3.41
39	603501	韦尔股份	498,702.00	3.35
40	600176	中国巨石	496,994.00	3.34
41	600104	上汽集团	490,750.00	3.30
42	002237	恒邦股份	467,200.00	3.14
43	02357	中航科工	461,980.64	3.10
44	600446	金证股份	456,280.00	3.06
45	600875	东方电气	448,410.00	3.01
46	601225	陕西煤业	443,000.00	2.97
47	601328	交通银行	430,500.00	2.89
48	600438	通威股份	430,054.08	2.89
49	600398	海澜之家	429,100.00	2.88
50	002839	张家港行	416,284.00	2.80
51	300750	宁德时代	413,250.00	2.77
52	00386	中国石油化工股份	411,806.21	2.77
53	002250	联化科技	406,025.00	2.73
54	601021	春秋航空	400,600.00	2.69
55	600004	白云机场	377,820.00	2.54
56	601628	中国人寿	362,388.00	2.43
57	600216	浙江医药	362,187.00	2.43
58	002024	苏宁易购	358,825.00	2.41
59	300119	瑞普生物	351,900.00	2.36
60	601012	隆基股份	346,000.00	2.32
61	002127	南极电商	340,665.00	2.29
62	300059	东方财富	339,224.00	2.28
63	002675	东诚药业	338,183.00	2.27
64	002367	康力电梯	334,936.00	2.25
65	300666	江丰电子	327,175.00	2.20
66	600323	瀚蓝环境	311,800.00	2.09
67	600201	生物股份	310,654.00	2.09

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	57,783,636.35
卖出股票收入（成交）总额	49,638,851.80

7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6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。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9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。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1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。

7.11.2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。

7.11.3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。

7.12投资组合报告附注

7.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括招商银行股份有限公司。深圳保监局于2018年7月5日对招商银行股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余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。

7.12.2基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内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。

7.12.3期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,648.21
2	应收证券清算款	302,237.30
3	应收股利	–
4	应收利息	399.42
5	应收申购款	1,155.98
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	316,440.91

7.12.4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。

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
鑫元核心资产A	300	42,672.83	10,000,000.00	78.11%	2,801,848.59	21.89%
鑫元核心资产C	213	3,172.37	–	–	675,715.67	100.00%
合计	513	26,272.06	10,000,000.00	74.20%	3,477,564.26	25.80%

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	鑫元核心资产A	1,422,395.54	11.1109%
	鑫元核心资产C	142,945.50	21.1547%
	合计	1,565,341.04	11.6144%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鑫元核心资产A	50~100
	鑫元核心资产C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元核心资产A	10~50
	鑫元核心资产C	0
	合计	10~50

8.4发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	74.20	10,000,000.00	74.20	3年
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	–	–	–	–	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	10,000,000.00	74.20	10,000,000.00	74.20	3年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元核心资产A	鑫元核心资产C
基金合同生效日(2018年11月14日)基金份额总额	13,832,707.77	1,159,294.98
本报告期期初基金份额总额	13,832,707.77	1,159,294.98
本报告期期间基金总申购份额	208,204.24	680,760.67
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,239,063.42	1,164,339.98
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
本报告期期末基金份额总额	12,801,848.59	675,715.67

§10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，基金管理人副总经理李雁因个人原因，不能正常履职。基金管理人已于第一时间指定专人负责其工作。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

10.4基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，基金管理人副总经理李雁因个人原因，不能正常履职。基金管理人已于第一时间指定专人负责其工作。

2、本报告期内，基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	52,270,883.89	48.66%	39,087.49	45.78%	–
华泰证券	2	29,970,875.26	27.90%	27,874.95	32.65%	–
广发证券	2	25,180,729.00	23.44%	18,414.56	21.57%	–
中金公司	2	–	–	–	–	–
方正证券	2	–	–	–	–	–

注：（1）交易单元的主要选择标准：

1）财务状况良好，经营行为规范；

2）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；

3）具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；

4）收取的交易佣金费率合理。

（2）交易单元的选择程序：

1) 投资研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；

2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。

（3）报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	–	–	58,600,000.00	100.00%	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190630	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	74.20%
个人	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–

产品特有风险

本基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的20%，中小投资者在投资本基金时可能面临以下风险：

（一）赎回申请延期办理或暂停赎回的风险

单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，因此当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。

（二）基金净值大幅波动的风险

单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。

（三）基金投资目标偏离的风险

单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。

（四）基金合同提前终止或其它相关风险

《基金合同》生效满3年后继续存续的，基金在存续期内连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情况的，本基金合同将终止并根据基金合同约定的程序进行清算，且无须召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应向中国证监会报告并履行相关信息披露程序。因此，在极端情况下，当单一投资者大量赎回本基金后，可能造成基金资产净值大幅缩减，对本基金的继续存续产生决定性影响。

鑫元基金管理有限公司
2019年8月24日