

# 鑫元安鑫回报混合型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|             |                                                                                                                                                                           |          |
|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| 基金简称        | 鑫元安鑫回报                                                                                                                                                                    |          |
| 基金主代码       | 009395                                                                                                                                                                    |          |
| 基金运作方式      | 契约型开放式                                                                                                                                                                    |          |
| 基金合同生效日     | 2020 年 9 月 28 日                                                                                                                                                           |          |
| 报告期末基金份额总额  | 245,966,105.31 份                                                                                                                                                          |          |
| 投资目标        | 本基金主要投资于固定收益资产，并在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘潜在投资机会，并积极运用金融衍生工具平滑组合波动，力争实现基金资产的长期稳健增值。                                                            |          |
| 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，跟踪宏观经济数据（GDP 增长率、PPI、CPI、工业增加值、进出口贸易数据等）、宏观政策导向、市场趋势和资金流向等多方面因素，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，并运用上述大类资产之间的相互关联性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      | 中证全债指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*25%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%                                                                                                                     |          |
| 风险收益特征      | 本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。                                                                                                                               |          |
| 基金管理人       | 鑫元基金管理有限公司                                                                                                                                                                |          |
| 基金托管人       | 交通银行股份有限公司                                                                                                                                                                |          |
| 下属分级基金的基金简称 | 鑫元安鑫回报 A                                                                                                                                                                  | 鑫元安鑫回报 C |

|                 |                  |             |
|-----------------|------------------|-------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 009395           | 016259      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 245,943,788.65 份 | 22,316.66 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） |           |
|-----------------|-------------------------------------|-----------|
|                 | 鑫元安鑫回报 A                            | 鑫元安鑫回报 C  |
| 1. 本期已实现收益      | 546,283.39                          | 34.76     |
| 2. 本期利润         | -1,678,739.88                       | -138.77   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0065                             | -0.0057   |
| 4. 期末基金资产净值     | 264,697,926.14                      | 23,957.84 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0763                              | 1.0735    |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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）鑫元安鑫回报 C 类基金份额实际存续从 2022 年 7 月 21 日开始。

#### 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

鑫元安鑫回报 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      | -0.66% | 0.22%     | -0.45%     | 0.21%         | -0.21% | 0.01% |
| 过去六个月      | -0.19% | 0.24%     | -0.35%     | 0.21%         | 0.16%  | 0.03% |
| 过去一年       | -1.38% | 0.25%     | 1.97%      | 0.24%         | -3.35% | 0.01% |
| 过去三年       | 7.69%  | 0.35%     | 5.35%      | 0.28%         | 2.34%  | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.63%  | 0.35%     | 5.40%      | 0.28%         | 2.23%  | 0.07% |

鑫元安鑫回报 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

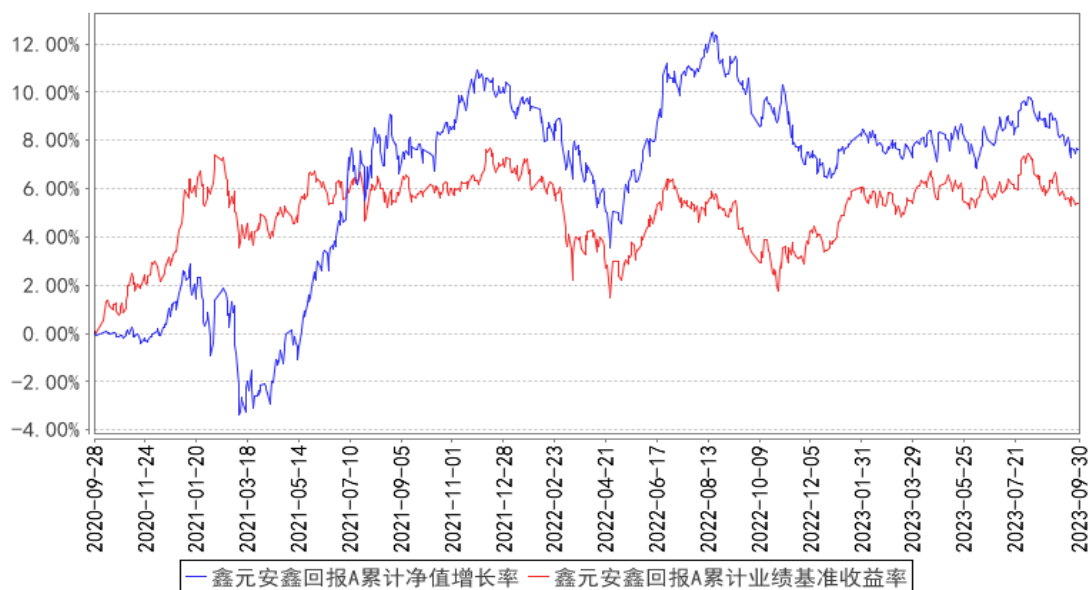
|                |        | 准差②   | 收益率③   | 收益率标准差<br>④ |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -0.72% | 0.22% | -0.45% | 0.21%       | -0.27% | 0.01% |
| 过去六个月          | -0.20% | 0.24% | -0.35% | 0.21%       | 0.15%  | 0.03% |
| 过去一年           | -1.56% | 0.25% | 1.97%  | 0.24%       | -3.53% | 0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -3.31% | 0.25% | -0.10% | 0.24%       | -3.21% | 0.01% |

注：（1）鑫元安鑫回报于 2022 年 7 月 18 日增设 C 类基金份额。

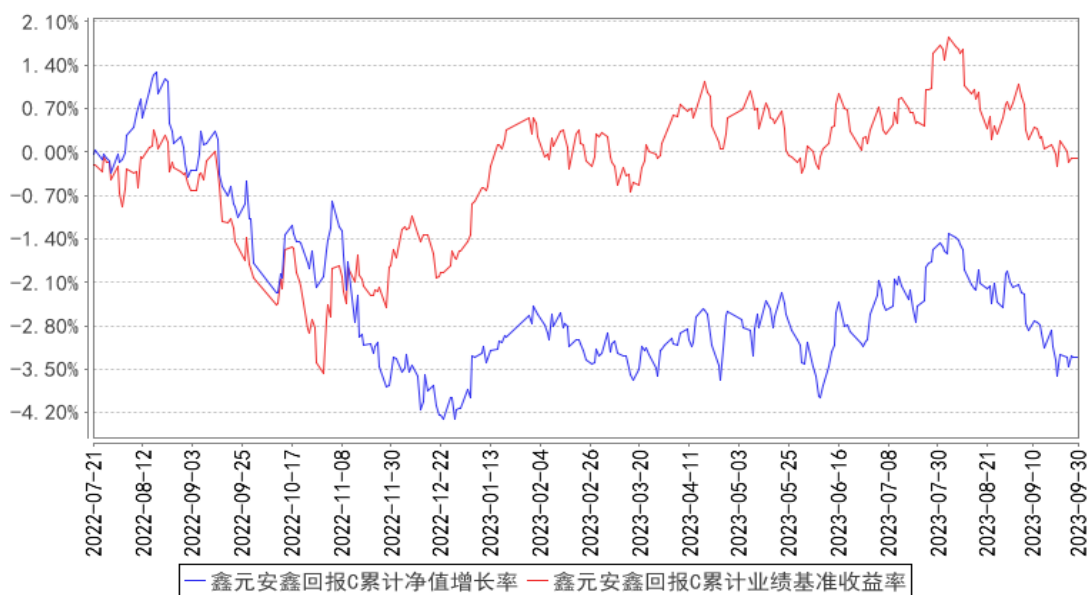
（2）鑫元安鑫回报 C 类基金份额实际存续从 2022 年 7 月 21 日开始。

### 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

鑫元安鑫回报A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鑫元安鑫回报C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：（1）本基金合同生效日为 2020 年 9 月 28 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合同约定。
- （2）鑫元安鑫回报于 2022 年 7 月 18 日增设 C 类基金份额。
- （3）鑫元安鑫回报 C 类基金份额实际存续于 2022 年 7 月 21 日开始。

## §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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 陈浩 | 本基金的基金经理 | 2022 年 6 月 28 日 | -    | 6 年    | 学历：经济学博士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任中国农业银行金融市场部债券高级交易员、平安银行资金运营中心债券投资经理。2021 年 6 月加入鑫元基金，历任固收投资经理，现任基金经理。 现任鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金、鑫元裕丰债券型证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元慧享纯债 3 个月定 |

|    |                                                     |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|----|-----------------------------------------------------|-----------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                     |                 |   |      | 期开放债券型证券投资基金的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 李彪 | 本基金的基金经理、权益投资部总经理助理、兼权益投资部股票投资部总经理、权益投资部 FOF 投资部总经理 | 2021 年 3 月 25 日 | - | 11 年 | 学历：理学硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任上海轶轲投资管理有限公司研究员、上海华策投资管理有限公司研究员、金瑞期货有限公司研究员、上海潼骁投资管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 5 月加入鑫元基金，历任研究员、基金经理助理，现任权益投资部总经理助理、兼权益投资部股票投资部总经理、权益投资部 FOF 投资部总经理。现任鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金、鑫元鑫动力混合型证券投资基金、鑫元长三角区域主题混合型证券投资基金、鑫元欣悦混合型证券投资基金、鑫元添鑫回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、鑫元科技创新主题混合型证券投资基金的基金经理。 |

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 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，未发现违反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》等法律法规以及投资管理权限相关、公平交易相关、异常交易监控相关的公司制度，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的 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金在今年三季度保持了一贯的均衡、稳健投资策略，多行业均衡，投资方向在食品饮料、医药、锂电、军工、高端仪器装备上，新增加了国内 AI 自主研发的龙头企业，同时三季度适当的往顺周期方向上有所倾斜，食品饮料通过一定的波段加厚了收益。军工在三季度的表现不尽如意，我们认为还是和大环境有关系，但是我们依然对今年军工企业三、四季度业绩充满信心。三季度锂电池拖累较为明显，主要还是受到全球博弈与海外罢工事件的影响。医药在三季度我们适当的增加了仓位，我们认为随着国内反腐结束，优质的医疗企业优势更加明显。创新药的创新周期在反腐背景下，只是很小的一个插曲。国产化的进程依然在进行，我们依然看好上有高端仪器的国产化中的具有研发优势的企业。我们认为 AI 前半程更多的在英伟达相关产业链光模块上，但是下半场国内大模型企业有望逐步赶上。

三季度债券市场整体先涨后跌，8 月中旬受央行意外降息的利好推动，收益率下行至年内低位，10Y 国债最低下行至 2.54%，10Y 国开债最低下行至 2.65%，30Y 国债最低下行至 2.87%附近。但 8 月下旬以来，随着地产调整政策放松力度加码、个税抵扣标准提高、股票交易印花税减半等政策陆续出台，债券收益率从低位逐步反弹。从期限利差来看，8 月政策利率下调后，长端下行幅度大于短端，收益率曲线走平。而 8 月底以来，受资金面紧张影响，短端上行幅度更大，期限利差继续缩窄，收益率曲线走平。信用债方面，7-8 月受“资产荒”以及“一揽子”化债政策的推动，城投债和银行次级债信用利差继续压缩，并从高等级品种向中低等级品种演绎，在 8 月底降息后信用债收益率触及年内低点，随后在 8 月底地产放松政策进一步加码的影响下开始回调。9 月上旬，理财预防性赎回基金导致信用债抛压加大，信用利差明显走扩，9 月中下旬随着央行降准且加大公开市场投放，资金面担忧有所缓解，信用债配置需求也有所恢复，债券市场整体呈现弱势整理状态。

报告期内，本产品主要关注票息类资产，严控信用风险、精选个券，根据市场情况灵活调整

组合久期和杠杆水平，较好的把握了利率波动的机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鑫元安鑫回报 A 基金份额净值为 1.0763 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.66%，同期业绩比较基准收益率为 -0.45%。截至本报告期末鑫元安鑫回报 C 基金份额净值为 1.0735 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.72%，同期业绩比较基准收益率为 -0.45%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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              | 54,991,165.71  | 17.45        |
|    | 其中：股票             | 54,991,165.71  | 17.45        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 254,164,826.73 | 80.65        |
|    | 其中：债券             | 254,164,826.73 | 80.65        |
|    | 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      | 5,968,673.21   | 1.89         |
| 8  | 其他资产              | 15,079.80      | 0.00         |
| 9  | 合计                | 315,139,745.45 | 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

| 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              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 51,951,565.71 | 19.62        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |



|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业     |               | -     |
| H | 住宿和餐饮业          |               | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,039,600.00  | 1.15  |
| J | 金融业             |               | -     |
| K | 房地产业            |               | -     |
| L | 租赁和商务服务业        |               | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      |               | -     |
| 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         |               | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       |               | -     |
| S | 综合              |               | -     |
|   | 合计              | 54,991,165.71 | 20.77 |

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 6,000   | 10,791,300.00 | 4.08         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 32,300  | 6,557,869.00  | 2.48         |
| 3  | 300896 | 爱美客  | 16,800  | 6,556,536.00  | 2.48         |
| 4  | 688789 | 宏华数科 | 63,275  | 6,075,032.75  | 2.29         |
| 5  | 603596 | 伯特利  | 69,000  | 5,071,500.00  | 1.92         |
| 6  | 688690 | 纳微科技 | 149,114 | 4,799,979.66  | 1.81         |
| 7  | 688600 | 皖仪科技 | 188,454 | 3,633,393.12  | 1.37         |
| 8  | 002158 | 汉钟精机 | 128,400 | 3,189,456.00  | 1.20         |
| 9  | 002230 | 科大讯飞 | 60,000  | 3,039,600.00  | 1.15         |
| 10 | 000738 | 航发控制 | 123,100 | 2,642,957.00  | 1.00         |

### 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      | 21,056,595.63  | 7.95         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 191,982,753.28 | 72.52        |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,348,065.57  | 7.69         |
| 4  | 企业债券      | 30,496,532.61  | 11.52        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 10,628,945.21  | 4.02         |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -     |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 254,164,826.73 | 96.01 |

#### 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  | 230009  | 23 附息国债 09      | 200,000 | 21,056,595.63 | 7.95         |
| 2  | 185484  | 22 华福 G1        | 200,000 | 20,473,610.96 | 7.73         |
| 3  | 185476  | 22 华鑫 01        | 200,000 | 20,471,780.82 | 7.73         |
| 4  | 2220028 | 22 泰隆银行二级<br>01 | 200,000 | 20,399,715.85 | 7.71         |
| 5  | 190208  | 19 国开 08        | 200,000 | 20,348,065.57 | 7.69         |

#### 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股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

##### 5.10.2 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。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括湖南银行股份有限公司。湖南银保监局于 2023 年 2 月 7 日对湖南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中的发行主体包括浙江泰隆商业银行股份有限公司。国家外汇管理局浙江省分局于 2023 年 8 月 23 日对浙江泰隆商业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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 13,385.65 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 1,694.15  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 15,079.80 |

### 5.11.4 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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 鑫元安鑫回报 A       | 鑫元安鑫回报 C  |
|---------------------------|----------------|-----------|
| 报告期期初基金份额总额               | 267,212,893.47 | 31,112.22 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,018,457.08   | 28,493.26 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 22,287,561.90  | 37,288.82 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | -              | -         |
| 报告期期末基金份额总额               | 245,943,788.65 | 22,316.66 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 18,510,846.65 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 18,510,846.65 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 7.5258        |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末，本基金管理人持有本基金 18,510,846.65 份。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 20230701-20230930       | 69,999,000.00 | -    | -    | 69,999,000.00 | 28.4588 |
| 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》生效后，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 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形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元安鑫回报混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元安鑫回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元安鑫回报混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日