

鑫元合丰分级债券型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人：鑫元基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期：2016年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员保证本基金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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，对本报告的内容予以复核，担保基金持有人对本基金合同规定的基金托管人复核无异议。

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。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月01日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鑫元合丰分级债券
交易代码	000916
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月16日
报告期末基金份额总额	215,030,578.00份
投资目标	本基金严格控制风险，追求绝对收益，在充分考虑流动性、风险性和收益性的前提下，通过合理配置债券等固定收益类资产，并进行积极的投资管理，力争取得超越基金业平均水平的稳定回报。
投资策略	本基金在中长期利率趋势分析的基础上，密切关注宏观经济、政策方向以及微观经济运行情况，深入分析和把握被低估的品种，审时度势的择机投资组合管理，以求获取稳定的组合收益。
业绩比较基准	二年期定期存款收益率(税后)+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种。相对于股市基金，本基金的风险较低，预期收益也相对较低。
基金管理人	鑫元基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	鑫元合丰分级债券A
下属分级基金的交易代码	000910
报告期末下属分级基金的份额总额	146,021,776.00份
下属分级基金的风险收益特征	从投资者持有的基金的基金类型来看，本基金A类风险低于B类，风险收益的预期要低于B类，其风险收益和预期风险要高于D类的债券基金风险特征。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期初见收益 2,800,103.18

2.本期利润 1,906,337.03

3.本期每份基金利润 0.00984

4.期末基金净值 228,262,693.27

5.期末基金份额净值 1.062

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) 所述基金业绩报酬不包括持有人认购或申购基金的各费用项，计入费用后实际收益水平将低于所示数字。

3.2 基金净值表现以来基金累计净增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

过去三个月 1.23% 0.23% 1.10% 0.03% 0.13% 0.02%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

序号 代码 基金名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 101650033 MTN001 200,000 21,102,000.00 9.24

2 112240 15中期票 200,000 20,994,000.00 9.20

3 122464 10中期票 200,000 20,162,000.00 8.83

4 016500796 15创债集 200,000 19,980,000.00 8.75

5 122126 11中期A02 144,330 14,907,846.70 6.63

5.6 报告期末未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 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期末未持有固有资金。

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 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。

5.10 声明基金投资的前十名股票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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

注：报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体本期没有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。

5.10.2 声明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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号 代码 名称 金额(元)

1 000915 0.0000 8,090.15

2 040707 0.0000 45,461.36

3 000910 0.0000

4 000911 0.0000

5 000912 0.0000

6 000913 0.0000

7 000914 0.0000

8 000915 0.0000

9 合计 0.0000 8,522,126.40

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目 鑫元合丰分级债券A 鑑元合丰分级债券B

报告期期初基金份额总额 160,024,979.47 70,000,000.00

报告期期间基金总申购份额 648,664,000.00

减：报告期期间基金总赎回份额 20,357,582.41

报告期期末基金份额总额 3,906,717.54

报告期期末基金份额净值 146,021,778.00 70,000,000.00

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日期和离任日期；

3. 证券从业的含义从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定：

4. 基金经理对基金的投资决策有重大影响的人员，其对基金的决策有重大影响，不存在损害基金份额持有人利益的行为；

5. 基金经理对基金的投资决策有重大影响的人员，其对基金的决策有重大影响，不存在损害基金份额持有人利益的行为；

6. 基金经理对基金的投资决策有重大影响的人员，其对基金的决策有重大影响，不存在损害基金份额持有人利益的行为；

7. 基金经理对基金的投资决策有重大影响的人员，其对基金的决策有重大影响，不存在损害基金份额持有人利益的行为；

8. 留存方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.5 报告期内基金的利润分配情况

4.6 报告期末基金资产净值

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

4.8 报告期内基金因投资策略或运作特点产生的风险揭示

4.9 报告期内基金的费用情况

4.10 报告期内基金的税收情况

4.11 报告期内基金的费用调整情况

4.12 报告期内基金的利润分配情况

4.13 报告期内进行的基金份额持有人大会决议

4.14 报告期内基金的停牌与未停牌情况

4.15 报告期内基金的融资融券交易情况

4.16 报告期内基金的其他重要信息

4.17 报告期内基金的清算情况

4.18 报告期内基金的会计政策变更情况

4.19 报告期内基金的估值政策和方法

4.20 报告期内基金的收益分配情况

4.21 报告期内基金的费用调整情况

4.22 报告期内基金的利润分配情况

4.23 报告期内进行的基金份额持有人大会决议

4.24 报告期内基金的停牌与未停牌情况

4.25 报告期内基金的融资融券交易情况

4.26 报告期内基金的其他重要信息

4.27 报告期内基金的清算情况

4.28 报告期内基金的会计政策变更情况

4.29 报告期内基金的估值政策和方法

4.30 报告期内基金的收益分配情况

4.31 报告期内基金的费用调整情况

4.32 报告期内基金的利润分配情况

4.33 报告期内进行的基金份额持有人大会决议

4.34 报告期内基金的停牌与未停牌情况

4.35 报告期内基金的融资融券交易情况

4.36 报告期内基金的其他重要信息

4.37 报告期内基金的清算情况

4.38 报告期内基金的会计政策变更情况

4.39 报告期内基金的估值政策和方法

4.40 报告期内基金的收益分配情况

4.41 报告期内基金的费用调整情况

4.42 报告期内基金的利润分配情况

4.43 报告期内进行的基金份额持有人大会决议

4.44 报告期内基金的停牌与未停牌情况

4.45 报告期内基金的融资融券交易情况

4.46 报告期内基金的其他重要信息

4.47 报告期内基金的清算情况

4.48 报告期内基金的会计政策变更情况

4.49 报告期内基金的估值政策和方法

4.50 报告期内基金的收益分配情况

4.51 报告期内基金的费用调整情况

4.52 报告期内基金的利润分配情况

4.53 报告期内进行的基金份额持有人大会决议

4.54 报告期内基金的停牌与未停牌情况

4.55 报告期内基金的融资融券交易情况

4.56 报告期内基金的其他重要信息

4.57 报告期内基金的清算情况

4.58 报告期内基金的会计政策变更情况

4.59 报告期内基金的估值政策和方法

4.60 报告期内基金的收益分配情况

4.61 报告期内基金的费用调整情况</