

鑫元聚利债券型证券投资基金

[2016]第四季度报告

2016年12月31日

基金管理人:鑫元基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 基金概况

公司根据《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《鑫元基金管理有限公司投资管理权限及授权管理办法》、《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》、《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公司制度,对本基金的投资管理进行规范。

报告期内本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性负责。

基金管理人和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、准确性和完整性负责。

基金托管人、交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2017年1月18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项,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金经理承诺:本人声明已履行报告职责,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并保证所载数据真实准确。

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。

本报告期为2016年10月27日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鑑元聚利

交易代码 003900

基金运作方式 灵活配置混合型开放式基金

基金合同生效日 2016年10月27日

报告期末基金份额总额 1,990,530,751.56份

投资目标 在保持资产流动性与收益性的基础上,寻求超越业绩比较基准的稳定的投资回报。

本基金通过对宏观经济、金融政策、供需因素、估值因素、市场价格等因素的深入分析,对股票、固定收益类资产和货币市场工具等资产类别进行动态评估,择优配置于股票、固定收益类资产和货币市场工具等资产类别,在控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的稳定的投资回报。

投资策略 本基金将通过综合运用定性分析和定量分析的方法,对宏观经济、金融政策、供需因素、估值因素、市场价格等因素进行深入分析,对股票、固定收益类资产和货币市场工具等资产类别进行动态评估,择优配置于股票、固定收益类资产和货币市场工具等资产类别,在控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的稳定的投资回报。

业绩比较基准 中证二级债基指数

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,其预期风险与同期收益率高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 鑑元基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

§ 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(2016年10月27日-2016年12月31日) 变动金额 变动比例 (%)

1.本期已实现收益 4,461,417.15

2.期初可供分配利润 1,274,177.15

3.期末可供分配利润 0.00016

4.期末基金资产净值 2,001,334.91 391.01

5.期末基金份额净值 1.0000

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)和相关费用后的余额,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)上述基金利润不包括持有人认购或申购基金时产生的费用,计入费用后实际可得资金水平要低于所列数字。

3.2.1 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.2 本基金在不同时间以某项资产计价时净增加或减少及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.3 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.4 本基金在不同时间以某项资产计价时净增加或减少及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.5 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.6 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.7 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.8 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.9 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.10 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.11 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.12 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.13 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.14 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.15 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.16 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.17 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.18 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.19 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.20 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.21 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.22 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.23 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.24 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.25 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.26 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.27 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.28 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% -2.31% 0.16% 2.40% -0.10%

3.2.29 本期报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 阶段净值增长(%) 准备净值增长标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④