

## 鑫元一年定期开放债券型证券投资基金

## [2017] 第一季度报告

2017年3月31日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司  
基金托管人：中国光大银行股份有限公司  
报告送出日期：2017年4月21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约定，于2017年4月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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未来表现，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。

本报告所载的财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

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		
序号	行业类别	公允价值(元)
1	农林、牧、渔业	-
2	采矿业	-
3	制造业	6,943,712.00
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-
5	建筑业	-
6	批发和零售业	-
7	交通运输、仓储和邮政业	-
8	住宿和餐饮业	-
9	信息传输、软件和信息技术服务业	-
10	金融业	-
11	房地产业	-
12	租赁和商务服务业	-
13	科学研究、技术服务和地质勘查业	-
14	水利、环境和公共设施管理、业和居民、商业、服务业专用设备制造业	-
15	卫生、社会保障和社会福利和社会组织服务业	-
16	教育	-
17	文化、体育和娱乐业	-
18	中国证监会核准的其他行业	-
合计		9,167,112.00
	占基金资产净值比例(%)	5.08%

5.2.2 报告期按行业分类的沪港通股票投资组合

注：本基金报告期内未持有沪港通股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值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	300007	微证达	240,000	3,000,000.00	1.96%
2	600097	光大银行	2,000,000	2,600,000.00	1.70%
3	600061	新南洋	84,000	2,213,400.00	1.46%
4	002628	唐德影视	64,800	1,397,504.00	0.97%
5	011013	三棵树	4,800	146,200.00	0.10%
6					
7					
8					
9					
10					
合计				9,167,112.00	5.08%

5.3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	本报告期
1.本期利润	1,762,000.67	130,420.26
2.本期利润	477,406.04	32,200.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.00034	0.00027
4.期末基金资产净值	130,604,721.90	22,698,636.64
5.期末基金份额净值	0.994	0.994

注：(1)本期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，本报告期利润为本期实现收益加上本期利润。

(2)所有基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。

5.3.2 基金净值表现

注：本基金报告期内未持有沪港通股票投资。

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值大小排序的前十名股票投资组合

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	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	微证达	240,000	3,000,000.00	1.96%
2	企业债券	光大银行	2,000,000	2,600,000.00	1.70%
3	金融债券	新南洋	84,000	2,213,400.00	1.46%
4	企业债券	唐德影视	64,800	1,397,504.00	0.97%
5	企业短期融资券	三棵树	4,800	146,200.00	0.10%
6					
7					
8					
9					
10					
合计				9,167,112.00	5.08%

5.5.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	本报告期
1.本期利润	1,762,000.67	130,420.26
2.本期利润	477,406.04	32,200.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.00034	0.00027
4.期末基金资产净值	130,604,721.90	22,698,636.64
5.期末基金份额净值	0.994	0.994

注：(1)本期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，本报告期利润为本期实现收益加上本期利润。

(2)所有基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响实际收益水平要低于所列数字。

5.5.2 基金净值表现

注：本基金报告期内未持有沪港通股票投资。

5.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值大小排序的前十名股票投资组合

5.6.1 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债券投资组合

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	1000013	16微证达	300,000	27,660,000.00	18.00%
2	010107	21微证达	250,000	26,992,500.00	16.97%
3	1490000	14新南洋	100,000	10,531,000.00	6.89%
4	101164020	10万利EMTN002	100,000	10,376,000.00	6.78%
5	1200229	12三棵树	100,000	10,260,000.00	6.69%
6					
7					
8					
9					
10					
合计				9,167,112.00	5.08%

5.6.2 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债券投资组合

5.6.3 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组合

5.6.4 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贵金属组合

5.6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险组合

5.6.6 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期货组合

5.6.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及股权组合

5.6.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票期权组合

5.6.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他组合

5.7.1 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资产支持证券组合

5.7.2 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贵金属组合

5.7.3 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保险组合

5.7.4 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期货组合

5.7.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及股权组合

5.7.6 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股票期权组合

5.7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他组合

5.8.1 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资产支持证券组合

5.8.2 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贵金属组合

5.8.3 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保险组合

5.8.4 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期货组合

5.8.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及股权组合

5.8.6 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股票期权组合

5.8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他组合

5.9.1 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资产支持证券组合

5.9.2 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贵金属组合

5.9.3 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保险组合

5.9.4 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期货组合

5.9.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及股权组合

5.9.6 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股票期权组合