鑫元安鑫宝货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:鑫元基金管理有限公司
基金托管人:恒丰银行股份有限公司
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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鑫元安鑫宝
交易代码	001526
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2015年6月26日
报告期末基金份额总额	723,361,214.48份
投资目标	本基金以基金资产安全性、流动性为先,并力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	整体资产配置策略 本基金采取积极的投资策略,自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析,形成对短期利率变化方向的预测;在此基础之上,确定组合久期和类别资产配置比例;在此框架之下,通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。 类属资产配置策略 类属资产配置是指基金组合在国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等投资品种之间的配置比例。通过对各类别金融工具政策倾向、税收政策、信用等级、收益率水平、资金供求、流动性等因素的研究判断,采用相对价值和信用利差策略,挖掘不同类别金融工具的差异化投资价值,合理配置并灵活调整不同类属债券在组合中的构成比例,形成合理组合以实现稳定的投资收益。
业绩比较基准	同期活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险产品。一般情况下,其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	鑫元基金管理有限公司
基金托管人	恒丰银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	鑫元安鑫宝A / 鑫元安鑫宝B
下属分级基金的交易代码	001526 / 001527
报告期末下属分级基金的份额总额	– / 723,361,214.48份

注:截止报告期末,本基金仅开放B类基金份额相关业务,A类基金份额尚未开放。故本报告中相关数据仅涉及B类基金份额。

§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(2017年1月1日 – 2017年3月31日)	
	鑫元安鑫宝A	鑫元安鑫宝B
1. 本期已实现收益	–	5,727,177.43
2. 本期利润	–	5,727,177.43
3. 期末基金资产净值	–	723,361,214.48

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鑫元安鑫宝A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%

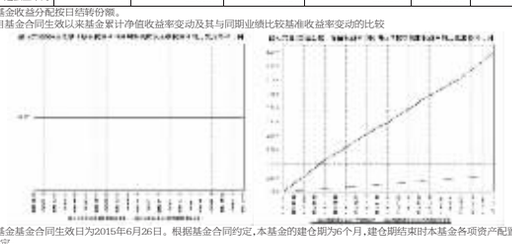
注:本基金收益分配按日结转份额。

鑫元安鑫宝B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8417%	0.0018%	0.0863%	0.0000%	0.7554%	0.0018%

注:本基金收益分配按日结转份额。

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



注:本基金基金合同生效日为2015年6月26日。根据基金合同约定,本基金的建仓期为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		
颜昕	鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元货币市场基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、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、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元合享利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的基金经理; 基金投资决策委员会委员	2015年6月26日	–	7年	学历:工商管理,硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2009年8月,任职于南京银行股份有限公司,担任交易员。2013年9月加入鑫元基金担任交易员,2014年2月至9月,担任鑫元基金交易室主管,2014年9月起担任鑫元货币市场基金的基金经理助理,2015年6月26日起担任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理,2015年7月15日起担任鑫元货币市场基金的基金经理,2016年1月13日起担任鑫元兴利债券型证券投资基金的基金经理,2016年3月2日起担任鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金(现鑫元合丰纯债债券型证券投资基金)的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016年6月3日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元招利债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元添利债券型证券投资基金的基金经理,2016年12月22日起担任鑫元招利债券型证券投资基金的基金经理,2017年3月13日起担任鑫元添利债券型证券投资基金的基金经理,2017年3月17日起担任鑫元添利债券型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。
张明凯	鑫元一年定期开放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、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、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、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元合享利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的基金经理;基金投资决策委员会委员	2015年6月26日	–	8年	学历:数量经济学专业,经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2008年7月至2013年8月,任职于南京银行股份有限公司,担任资深信用研究员,精通信用债的行情与风险研判,参与创立了南京银行内部债券信用风险控制体系,对债券市场行情具有较为精准的研判能力。2013年8月加入鑫元基金管理有限公司,任投资研究部信用研究员。2013年12月30日至2016年2月2日担任鑫元货币市场基金基金经理,2014年4月17日至今任鑫元一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年6月12日至今任鑫元稳利债券型证券投资基金基金经理,2014年6月26日至今任鑫元鸿利债券型证券投资基金的基金经理,2014年10月15日至今任鑫元合享分级债券型证券投资基金的基金经理、2014年12月2日至今任鑫元丰年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2014年12月16日起担任鑫元合丰纯债债券型证券投资基金(现鑫元合丰纯债债券型证券投资基金)的基金经理,2015年7月15日起至今任鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年4月21日起任鑫元双债增强债券型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。
王美芹	鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金的基金经理;基金投资决策委员会委员	2016年8月5日	–	10年	学历:工商管理、应用金融硕士研究生。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:1997年7月至2001年9月,任职于中国人寿保险公司河南省分公司,2002年3月至2005年12月,担任北京麦特诺亚咨询有限公司项目部项目主管,2007年2至2015月6月,先后担任泰信基金管理有限公司渠道部副经理、理财顾问部副总监,专户投资总监等职务,2015年6月加入鑫元基金担任专户投资经理,2016年8月5日起担任鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型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,本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《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异常交易监控管理办法》等公司制度,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5%的情况。

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		12.72
	其中:买断式回购融资		–
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资		–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2017年1月6日	20.10	巨额赎回	2017-01-09
2	2017年1月24日	26.96	巨额赎回	2017-01-26
3	2017年1月25日	20.58	巨额赎回	2017-01-26
4	2017年3月14日	20.00	巨额赎回	2017-03-15

注:相关债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情形及其后续调整符合中国证监会相关规定。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	45.84	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)-60天	11.00	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)-90天	2.77	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)-120天	0.83	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)-397天(含)	33.25	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		93.68	–

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	46,052,077.36	6.37
	其中:政策性金融债	46,052,077.36	6.37
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	30,004,463.37	4.15
6	中期票据	–	–
7	同业存单	314,918,720.97	43.54
8	其他	–	–
9	合计	390,975,261.70	54.05
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111792905	17宁波银行CD053	500,000	48,461,206.23	6.70
2	011698139	16陆家嘴SCP001	300,000	30,004,463.37	4.15
3	111792313	17宁波银行CD039	300,000	29,487,087.45	4.08
4	111698187	16广州农村商业银行CD130	300,000	29,266,526.80	4.05
5	111699221	16盛京银行CD151	300,000	29,175,788.00	4.03
6	120307	12进出07	200,000	20,002,711.18	2.77
7	111692207	16长沙银行CD039	200,000	19,985,274.99	2.76
8	111612170	16北京银行CD170	200,000	19,957,357.72	2.76
9	111698761	16杭州联合银行CD185	200,000	19,950,049.69	2.76
10	111791515	17温州银行CD021	200,000	19,901,011.75	2.75

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0279%
报告期内偏离度的最低值	-0.0184%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0133%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:无。

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期未未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.9.2 声明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。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

本报告期内基金投资的前十名证券的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、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	1,974,149.31
4	应收申购款	44,436,727.29
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	46,410,876.60

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	鑫元安鑫宝A	鑫元安鑫宝B
报告期期初基金份额总额	–	843,812,563.56
报告期期间基金总申购份额	–	6,477,410,332.30
报告期期间基金总赎回份额	–	6,597,861,681.37
报告期期末基金份额总额	–	723,361,214.48

§7 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,本基金管理人未持有本基金。

§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	20170101-20170103	300,164,085.65	150,249.36	300,314,335.01	0.00	0.00
产品特有风险							

本基金在报告期内曾出现单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的20%的情形,但截止报告期末已无该等情形。如本基金出现单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的20%的情形,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)基金合同提前终止的风险

根据《基金合同》的约定,《基金合同》生效后的存续期内,若连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的,基金合同将终止,并根据基金合同的约定进行基金财产清算。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。

§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宝货币市场基金设立的文件;
2、《鑫元安鑫宝货币市场基金基金合同》;
3、《鑫元安鑫宝货币市场基金托管协议》;
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
2017年4月21日

鑫元半年定期开放债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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规定,于2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鑫元半年定期开放
交易代码	000896
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2014年12月2日
报告期末基金份额总额	123,105,701.19份
投资目标	根据本基金定期开放的运作特征,在严格控制投资风险和有效保持资产流动性的前提下,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,自上而下决定资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。本基金的股票投资策略以精选个股为主,发挥基金管理人专业研究团队的研究能力,从定量和定性两个方面考察上市公司的增值潜力。
业绩比较基准	6个月定期存款利率(税后)
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,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	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
下属分级基金的基金简称	鑫元半年定期开放A / 鑫元半年定期开放C
下属分级基金的交易代码	000896 / 000897
报告期末下属分级基金的份额总额	107,146,564.10份 / 15,959,137.09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(2017年1月1日 – 2017年3月31日)	
	鑫元半年定期开放A	鑫元半年定期开放C
1. 本期已实现收益	529,200.04	67,521.42
2. 本期利润	231,168.73	45,798.28
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0022	0.0027
4. 期末基金资产净值	97,542,654.29	14,395,314.25
5. 期末基金份额净值	0.910	0.902

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

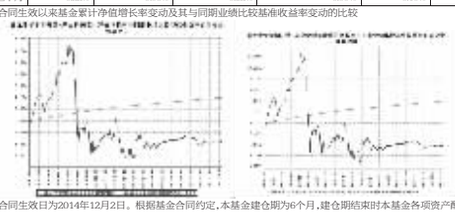
鑫元半年定期开放A

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	0.22%	0.07%	0.32%	0.00%	-0.10%	0.07%

鑫元半年定期开放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
过去三个月	0.22%	0.08%	0.32%	0.00%	-0.10%	0.08%

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



注:本基金的合同生效日为2014年12月2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基金合同约定。

§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		
张明凯	鑫元一年定期开放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、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、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、鑫元裕利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的基金经理;基金投资决策委员会委员	2014年12月2日	–	8年	学历:数量经济学专业,经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2008年7月至2013年8月,任职于南京银行股份有限公司,担任资深信用研究员,精通信用债的行情与风险研判,参与创立了南京银行内部债券信用风险控制体系,对债券市场行情具有较为精准的研判能力。2013年8月加入鑫元基金管理有限公司,任投资研究部信用研究员。2013年12月30日至2016年3月2日担任鑫元货币市场基金基金经理,2014年4月17日至今任鑫元一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年6月12日至今任鑫元稳利债券型证券投资基金基金经理,2014年10月15日至今任鑫元合享分级债券型证券投资基金的基金经理,2014年12月2日至今任鑫元丰年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2014年12月16日起担任鑫元合丰纯债债券型证券投资基金(现鑫元合丰纯债债券型证券投资基金)的基金经理,2015年7月15日起至今任鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年4月21日起任鑫元双债增强债券型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。
王美芹	鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金的基金经理;基金投资决策委员会委员	2016年8月5日	–	10年	学历:工商管理、应用金融硕士研究生。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:1997年7月至2001年9月,任职于中国人寿保险公司河南省分公司,2002年3月至2005年12月,担任北京麦特诺亚咨询有限公司项目部项目主管,2007年2至2015月6月,先后担任泰信基金管理有限公司渠道部副经理、理财顾问部副总监,专户投资总监等职务,2015年6月加入鑫元基金担任专户投资经理,2016年8月5日起担任鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型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 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《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异常交易监控管理制度》、《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5%的情况。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,438,910.00	5.08
	其中:股票	6,438,910.00	5.08
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	91,531,636.80	72.20
	其中:债券	91,531,636.80	72.20
	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	9,996,134.99	7.88
	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	17,134,939.64	13.52
8	其他资产	1,674,693.35	1.32
9	合计	126,776,314.78	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	726,600.00	0.65
C	制造业	3,586,060.00	3.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	322,000.00	0.29
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	73,900.00	0.07
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	296,000.00	0.26
J	金融业	1,046,750.00	0.94
K	房地产业	387,600.00	0.35
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	6,438,910.00	5.75

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

5.3 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	600881	亚泰集团	270,000	1,622,700.00	1.45
2	600612	老凤祥	16,000	630,080.00	0.56
3	600015	华夏银行	50,000	564,500.00	0.50
4	600622	嘉宝集团	20,000	387,600.00	0.35
5	000975	银泰资源	25,000	363,000.00	0.32
6	601988	中国银行	80,000	296,000.00	0.26
7	601628	中国人寿	10,000	253,000.00	0.23
8	603609	禾丰牧业	20,000	240,800.00	0.22
9	600028	中国石化	40,000	229,600.00	0.21
10	000001	平安银行	25,000	229,250.00	0.20

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	69,341,676.00	61.95
5	企业短期融资券	20,026,000.00	17.89
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	2,163,960.80	1.93
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	91,531,636.80	81.77

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	1080137	10可容基地债	100,000	10,117,000.00	9.04
2	011698252	16粤广告SCP002	100,000	10,018,000.00	8.95
3	041682001	16忠旺CP001	100,000	10,008,000.00	8.94
4	136643	16华宇02	100,000	9,734,000.00	8.70
5	136864	16绿城02	100,000	9,717,000.00	8.68

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 声明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。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

本报告期内基金投资的前十名证券的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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,696.07
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,654,997.28
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,674,693.35

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	2,084,960.80	1.86

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通