

# 鑫元货币市场基金 2016 年年度报告 摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                     |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| 基金简称            | 鑫元货币                |                     |
| 基金主代码           | 000483              |                     |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                     |
| 基金合同生效日         | 2013 年 12 月 30 日    |                     |
| 基金管理人           | 鑫元基金管理有限公司          |                     |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司        |                     |
| 报告期末基金份额总额      | 11,014,643,420.75 份 |                     |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                     |
| 下属分级基金的基金简称:    | 鑫元货币 A              | 鑫元货币 B              |
| 下属分级基金的交易代码:    | 000483              | 000484              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 467,579,311.83 份    | 10,547,064,108.92 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金将在保持基金资产安全性和高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定回报。  |
| 投资策略 | <p>1、整体资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>类属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。</p> <p>3、个券选择策略</p> <p>在确定债券平均组合久期、期限结构配置和类属配置的基础上，对影响个别债券定价的主要因素，包括信用风险、流动性、市场供求、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析，有限选择央票、短期国债等高等级债券品种以规避违约风险，在此基础上通过拟合收益率曲线寻找定价低估、收益率偏高的券种进行重点关注。</p> <p>4、回购策略</p> <p>该策略是利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式是利用买入债券进行正回购，在利用回购融入资金购买收益率较高债券品种，如此循环至回购期结束</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>卖出债券偿还所融入资金。在进行回购放大操作时，基金管理人将严格遵守相关法律法规关于债券正回购的有关规定。基金管理人也将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。</p> <p>5、收益率曲线策略</p> <p>根据债券市场收益率曲线的动态变化以及隐含的即期利率和远期利率提供的价值判断基础，结合对当期和远期资金面的分析，寻求在一段时期内获取因收益率曲线变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。本基金将比较分析子弹策略、哑铃策略和梯形策略等在不同市场环境下的表现，构建优化组合，获取合理收益。</p> |
| 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。   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人        | 基金托管人             |
|---------|--------------|-------------------|
| 名称      | 鑫元基金管理有限公司   | 中国工商银行股份有限公司      |
| 信息披露负责人 | 姓名           | 李晓燕               |
|         | 联系电话         | 021-20892000 转    |
|         | 电子邮箱         | service@xyamc.com |
| 客户服务电话  | 4006066188   | 95588             |
| 传真      | 021-20892111 | 010-66105798      |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.xyamc.com">http://www.xyamc.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市静安区中山北路 909 号 12 层<br>鑫元基金管理有限公司                     |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

|          |  |  |  |
|----------|--|--|--|
| 金额单位：人民币 |  |  |  |
|----------|--|--|--|

| 币元<br>3.1.1<br>期间<br>数据和<br>指标 |                |                   |                |                  |                |                  |
|--------------------------------|----------------|-------------------|----------------|------------------|----------------|------------------|
|                                | 鑫元货币 A         | 鑫元货币 B            | 鑫元货币 A         | 鑫元货币 B           | 鑫元货币 A         | 鑫元货币 B           |
| 本期<br>已实<br>现收<br>益            | 13,026,978.07  | 118,885,814.71    | 20,424,849.15  | 102,499,958.80   | 13,581,282.41  | 127,064,234.24   |
| 本期<br>利润                       | 13,026,978.07  | 118,885,814.71    | 20,424,849.15  | 102,499,958.80   | 13,581,282.41  | 127,064,234.24   |
| 本期<br>净值<br>收益<br>率            | 2.5639%        | 2.8105%           | 3.6014%        | 3.8502%          | 4.7615%        | 5.0259%          |
| 3.1.2<br>期末<br>数据<br>和指<br>标   | 2016 年末        |                   | 2015 年末        |                  | 2014 年末        |                  |
| 期末<br>基金<br>资产<br>净值           | 467,579,311.83 | 10,547,064,108.92 | 511,646,067.43 | 1,640,705,606.16 | 367,895,349.44 | 4,583,739,208.33 |
| 期末<br>基金<br>份额<br>净值           | 1              | 1                 | 1              | 1                | 1              | 1                |
| 3.1.3<br>累计<br>期末<br>指标        | 2016 年末        |                   | 2015 年末        |                  | 2014 年末        |                  |
| 累计<br>净值<br>收益<br>率            | 11.3672%       | 12.1861%          | 8.5832%        | 9.1193%          | 4.8086%        | 5.0738%          |

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 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

鑫元货币 A

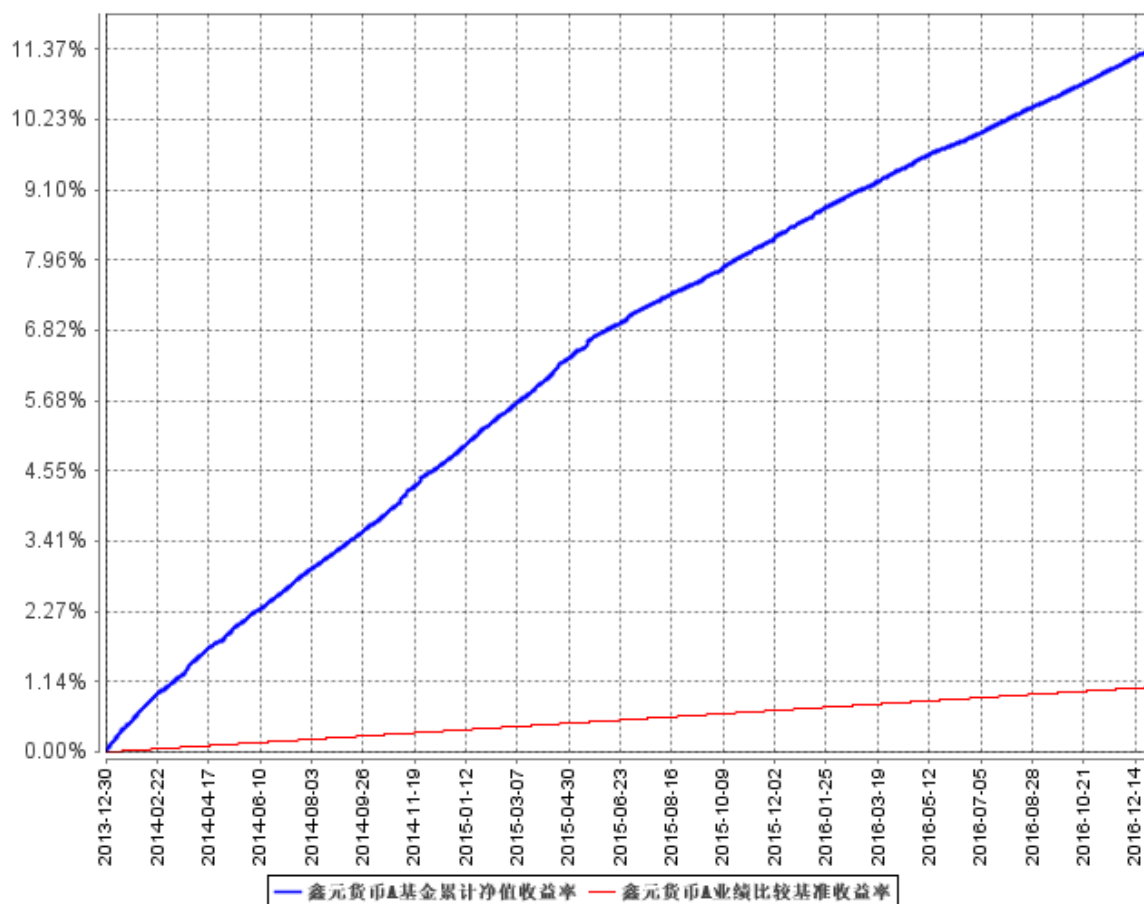
| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.6430%      | 0.0011%             | 0.0880%            | 0.0000%               | 0.5550%  | 0.0011% |
| 过去六个月          | 1.2635%      | 0.0018%             | 0.1760%            | 0.0000%               | 1.0875%  | 0.0018% |
| 过去一年           | 2.5639%      | 0.0026%             | 0.3500%            | 0.0000%               | 2.2139%  | 0.0026% |
| 过去三年           | 11.3172%     | 0.0052%             | 1.0500%            | 0.0000%               | 10.2672% | 0.0052% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 11.3672%     | 0.0052%             | 1.0519%            | 0.0000%               | 10.3153% | 0.0052% |

鑫元货币 B

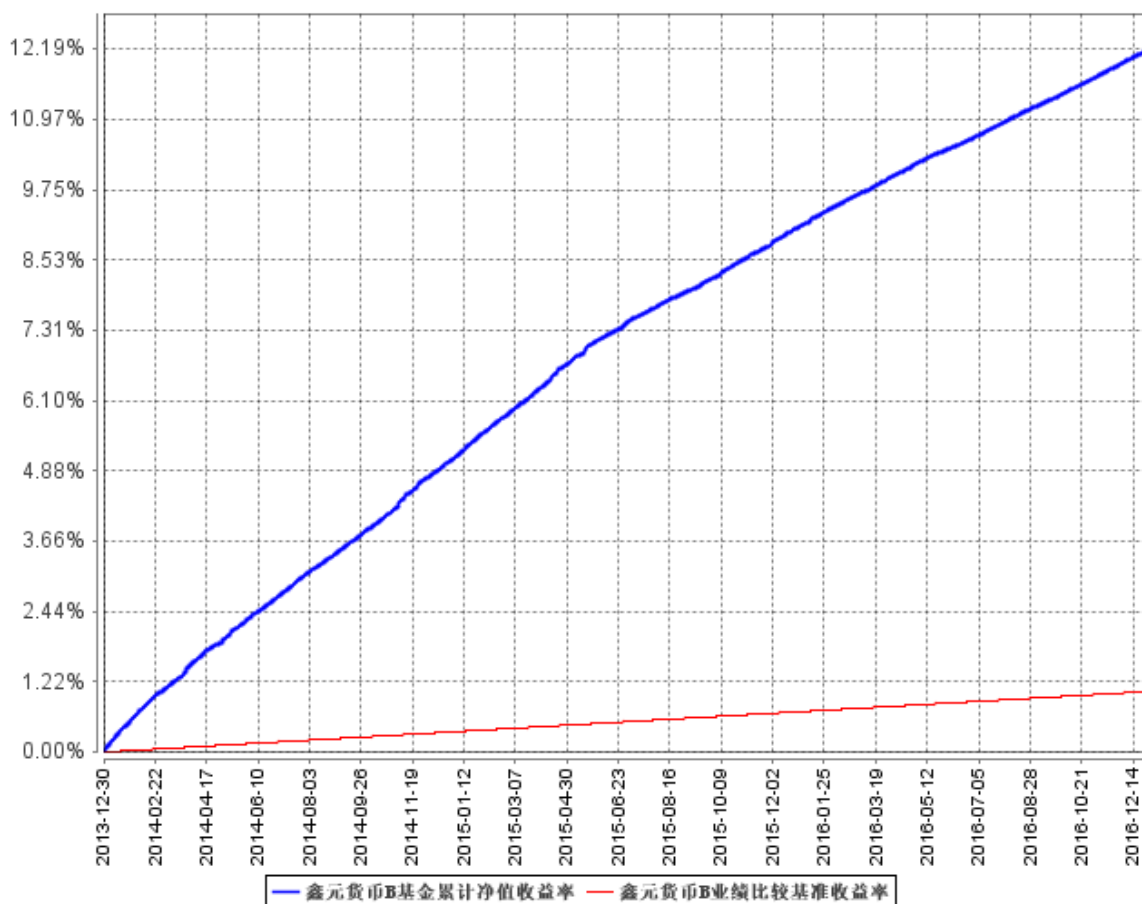
| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.7037%      | 0.0011%             | 0.0880%            | 0.0000%               | 0.6157%  | 0.0011% |
| 过去六个月          | 1.3858%      | 0.0018%             | 0.1760%            | 0.0000%               | 1.2098%  | 0.0018% |
| 过去一年           | 2.8105%      | 0.0026%             | 0.3500%            | 0.0000%               | 2.4605%  | 0.0026% |
| 过去三年           | 12.1350%     | 0.0052%             | 1.0500%            | 0.0000%               | 11.0850% | 0.0052% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 12.1861%     | 0.0052%             | 1.0519%            | 0.0000%               | 11.1342% | 0.0052% |

### 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

鑫元货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鑫元货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

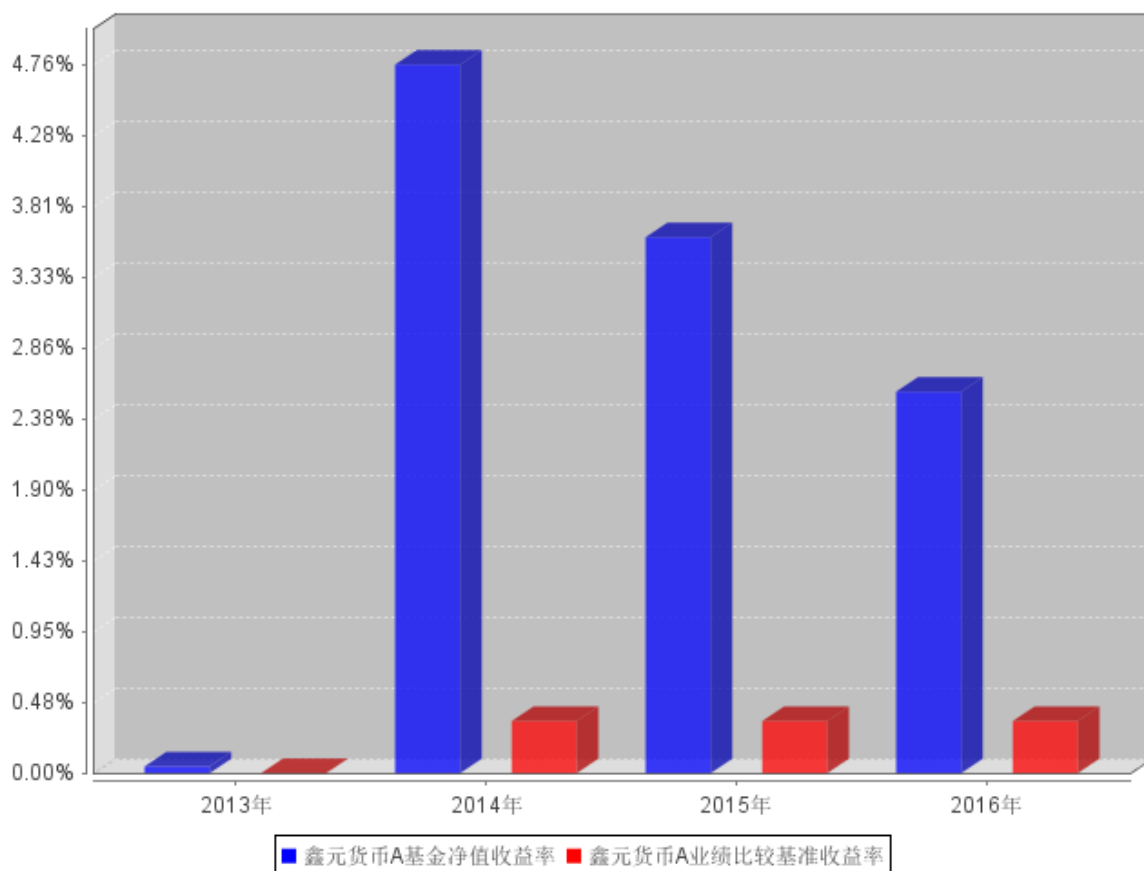


注：本基金合同生效日为 2013 年 12 月 30 日。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

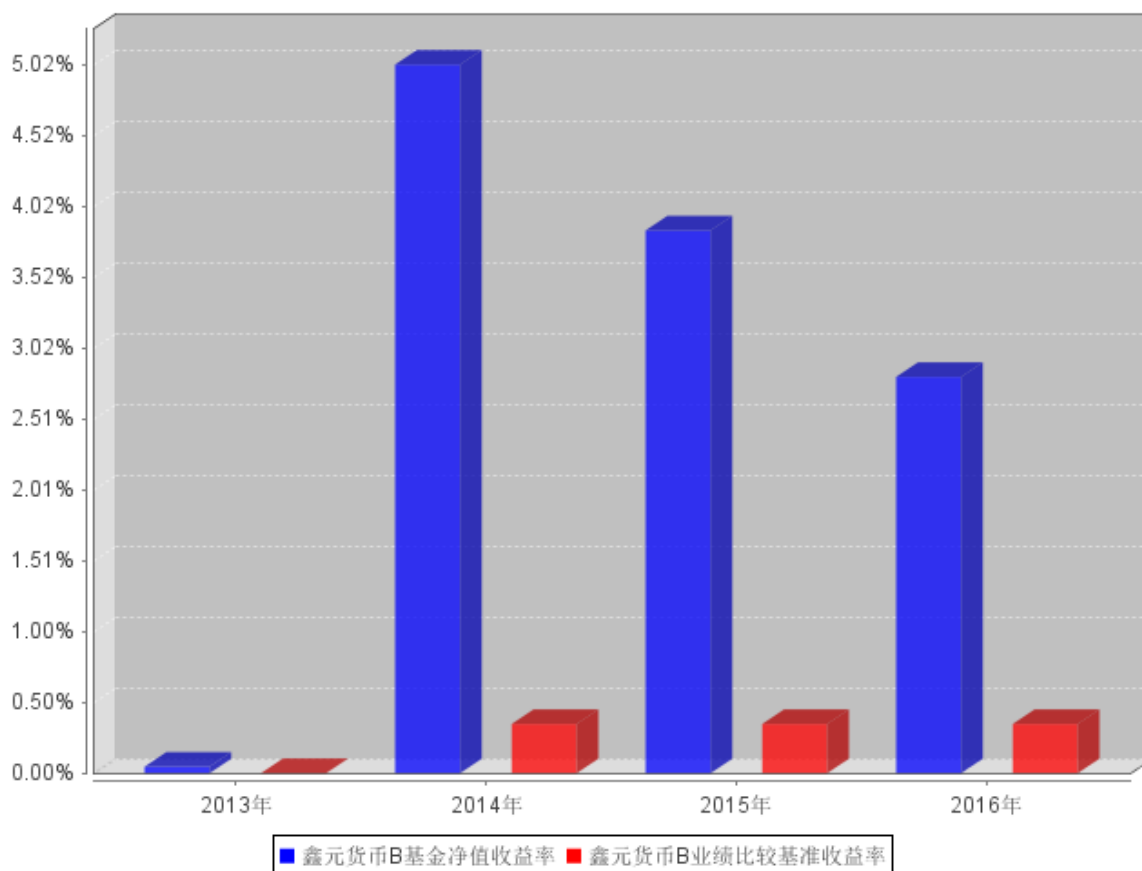
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 鑫元货币A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 鑫元货币B自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年的本基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 鑫元货币 A |                  |                   |                |                |    |
|--------|------------------|-------------------|----------------|----------------|----|
| 年度     | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动   | 年度利润<br>分配合计   | 备注 |
| 2016   | 13,026,978.07    | -                 | -              | 13,026,978.07  |    |
| 2015   | 21,953,398.08    | 7,451.35          | -1,536,000.28  | 20,424,849.15  |    |
| 2014   | 11,747,569.12    | 4,150,764.32      | -2,317,051.03  | 13,581,282.41  |    |
| 合计     | 46,727,945.27    | 4,158,215.67      | -3,853,051.31  | 47,033,109.63  |    |
| 鑫元货币 B |                  |                   |                |                |    |
| 年度     | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动   | 年度利润<br>分配合计   | 备注 |
| 2016   | 118,885,814.71   | -                 | -              | 118,885,814.71 |    |
| 2015   | 113,800,745.90   | -                 | -11,300,787.10 | 102,499,958.80 |    |
| 2014   | 104,800,790.94   | 8,223,380.53      | 14,040,062.77  | 127,064,234.24 |    |
| 合计     | 337,487,351.55   | 8,223,380.53      | 2,739,275.67   | 348,450,007.75 |    |

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为鑫元基金管理有限公司，本公司经中国证监会证监许可[2013]1115 号文批准于 2013 年 8 月成立，由南京银行股份有限公司发起，与南京高科股份有限公司联合组建；注册资本金 2 亿元人民币，总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理（包括特定对象投资咨询）和中国证监会许可的其他业务。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理 16 只证券投资基金——鑫元货币市场基金、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、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元合丰分级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）、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、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、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---|-----------------|------|--------|--|
|    |   | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 赵慧 | 鑫元货币市场基金、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 | 2016 年 3 月 2 日  | -    | 6 年    | 学历：经济学专业，硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。<br>从业经历：2010 年 7 月任职于北京汇致资本管理有限公司，担任交易员。2011 年 4 月起在南京银行金融市场部资产管理部和南京银行金融市场部投资交易中心担任债券交易员，有丰富的银行间市场交易经验。2014 年 6 月加入鑫元基金，担任基金经理助理。2014 年 7 月 15 日起担 |

|  |  |  |   |
|--|--|--|---|
| <p>券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金的基金经理；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、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；基金投资决</p> |  |  | <p>任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的基金经理助理，2014年10月20日起担任鑫元合享分级债券型证券投资基金的基金经理助理，2014年12月2日起担任鑫元半年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，2014年12月16日起担任鑫元合丰分级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）的基金经理助理，2015年7月15日起担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助理，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日起担任鑫元货币市场基金的基金经理，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日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理，2016年10月27日起担任鑫元聚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</p> |
|--|--|--|---|

|    |   |                    |   |     |   |
|----|---|--------------------|---|-----|---|
|    | 策委员会<br>委员  |                    |   |     | 投资基金的基金经理；<br>同时兼任基金投资决策<br>委员会委员。  |
| 颜昕 | 鑫元安鑫<br>宝货币市<br>场基金、<br>鑫元货币<br>市场基金、<br>鑫元合享<br>分级债券<br>型证券投<br>资基金、<br>鑫元合丰<br>纯债债券<br>型证券投<br>资基金、<br>鑫元兴利<br>债券型证<br>券投资基<br>金、鑫元<br>汇利债券<br>型证券投<br>资基金、<br>鑫元双债<br>增强债券<br>型证券投<br>资基金、<br>鑫元裕利<br>债券型证<br>券投资基<br>金、鑫元<br>得利债券<br>型证券投<br>资基金、<br>鑫元聚利<br>债券型证<br>券投资基<br>金、鑫元<br>招利债券<br>型证券投<br>资基金的<br>基金经理；<br>基金投<br>资决策委<br>员会委员 | 2015 年 7 月<br>15 日 | - | 7 年 | 学历：国际审计专业，<br>学士。相关业务资格：<br>证券投资基金从业资格。<br>从业经历：2009 年 8 月，<br>任职于南京银行股份有<br>限公司，担任交易员。<br>2013 年 9 月加入鑫元基<br>金担任交易员，<br>2014 年 2 月至 8 月，担<br>任鑫元基金交易室主管，<br>2014 年 9 月起担任鑫元<br>货币市场基金的基金经<br>理助理，2015 年 6 月<br>26 日起担任鑫元安鑫宝<br>货币市场基金的基金经<br>理，2015 年 7 月 15 日<br>起担任鑫元货币市场基<br>金的基金经理，<br>2016 年 1 月 13 日起担<br>任鑫元兴利债券型证券<br>投资基金的基金经理，<br>2016 年 3 月 2 日起担任<br>鑫元合享分级债券型证<br>券投资基金、鑫元合丰<br>分级债券型证券投资基<br>金（现鑫元合丰纯债债<br>券型证券投资基金）的<br>基金经理，2016 年<br>3 月 9 日起担任鑫元汇<br>利债券型证券投资基金<br>的基金经理，2016 年<br>6 月 3 日起担任鑫元双<br>债增强债券型证券投资<br>基金的基金经理，<br>2016 年 7 月 13 日起担<br>任鑫元裕利债券型证券<br>投资基金的基金经理，<br>2016 年 8 月 17 日起担<br>任鑫元得利债券型证券<br>投资基金的基金经理，<br>2016 年 10 月 27 日起担<br>任鑫元聚利债券型证券 |

|     |   |                  |                |     |  |
|-----|---|------------------|----------------|-----|--|
|     |   |                  |                |     | 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；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、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理；基金投资决策委员 | 2013 年 12 月 30 日 | 2016 年 3 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 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 日至今任鑫元半年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 12 月 16 日至今任鑫元合丰分级债券型证券投资基金（现鑫元合丰纯债债券 |

|  |     |  |  |   |
|--|-----|--|--|---|
|  | 会委员 |  |  | 型证券投资基金)的基金经理, 2015年6月26日至今任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理, 2015年7月15日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。 |
|--|-----|--|--|---|

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求专门制订《鑫元基金管理有限公司公平交易管理制度》, 结合《鑫元基金管理有限公司投资管理制度》、《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》等公司相关制度, 规范公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动, 同时涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节, 以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

在研究工作层面, 公司已建立客观的研究方法, 严禁利用内幕信息作为投资依据, 各投资组合享有公平的投资决策机会。在投资决策层面, 公司执行自上而下的分级投资权限管理体系, 依次为投资决策委员会、投资分管领导、投资组合经理, 明确各投资决策主体的职责和权限划分,

合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和投资分管领导等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行不合理干预。投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易执行层面，公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。不同投资组合下达同一证券的同向交易指令时，按照“价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡”的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易部询价机制，严格防范交易对手风险并审查价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。在事后分析层面，公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

### 4.3.2 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管理的各项制度规范，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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司制订《鑫元基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，通过系统和人工相结合的方式对基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。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。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年，受国内经济基本面改善、货币政策转向及监管层防金融风险去杠杆等监管预期的影响，加之年底美国大选、联储加息引发海外债市收益率上行，叠加债券市场交易对手弱市违约引发信用危机等综合影响，全年债券市场呈现巨幅波动，十年期国债收益率年内创近五年新低，也于年底大幅反弹 70 多 BP，回吐了全年涨幅。信用债在银行委外等配置盘的作用下也一度将期



限利差、信用利差压至历史低位，然而在年终调整时也一度哀鸿遍野。货币政策由年初的稳健宽松在 8 月份之后悄然转向中性稳健，年底的中央经济会议再次明确了 2017 年金融去杠杆、防局部泡沫的主基调，资金面在前三季度大部分时间较为宽松，但在四季度由于银行超储率处于低位，市场过多依赖央行的货币政策工具来提供流动性，加上银行理财纳入 MPA 考核等多重影响导致整个四季度资金面紧张情绪延续。

报告期内，鑫元货币基金在投资品种选择上相对保守，严防信用风险，根据资金面和负债端灵活安排杠杆和久期，并合理安排流动性，确保组合流动性安全的同时也能在资金面紧张的时候配置高收益资产，将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于首位，从结果来看各项指标在运作期间表现健康，全年收益基本能够运行在市场较高水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元货币 A 的基金份额净值收益率为 2.5639%，鑫元货币 B 的基金份额净值收益率为 2.8105%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，随着特朗普宣布就职后一系列保守主义改革措施的推出，在一定程度上助推了市场对于美国经济复苏预期的强度。考虑到欧洲多个国家也将于今年进行政选，逆全球化有愈发严重的倾向。此外，开年以来，美联储通过各种场合宣传尽早加息及于之后缩表的必要性，美债及欧洲收益率波动加大，似乎在为全年全球无风险利率上行埋下伏笔。

国内方面，受益于过去一年在煤炭行业推进的供给侧结构化改革初见成效，今年钢铁、水泥及玻璃等行业也将接棒供给侧改革任务。根据过去一年在煤炭行业行政手段为主、市场化手段为辅的改革经验，钢铁行业在去年年底就从中频炉下手，并将整治“地条钢”与政府官员考核结合，从而增强了市场对于钢铁去产能的信心。在这种情况下，除非需求侧出现超预期的下滑，供给侧改革的持续推进将有助于工业企业利润的进一步恢复，工业企业的固定资产投资或将随之有所回暖。此外，虽然房地产行业景气度在新一轮调控下有所抑制，但基建领域 PPP 项目的加速推进将继续托底经济，全年的投资增速或继续保持平稳。外贸增速虽然有可能受益于全球发达经济体复苏，但由于特朗普及欧洲右翼政党的逆全球化思潮涌动，贸易保护主义或有所抬头，全年贸易形势仍具有较大不确定性，市场对其预期差异较大。

通胀方面，国内供给侧改革的推进、美国财政刺激政策的推出以及全球地缘政治的微妙变化都有可能对工业品价格以及能源价格造成影响，从而对国内核心 CPI 造成压力。好在目前农产品价格仍在低位，故尚不会对 CPI 形成明显抬升，但需要密切关注 PPI 的持续超预期对 CPI 的影

响。

货币政策方面，自去年八月份货币政策悄然转向之后，年底的中央经济会议再次明确了 2017 年金融去杠杆、防局部泡沫的主基调。开年以来，央行分别上调了 MLF 利率及公开市场逆回购利率，对于金融市场的预期产生了明显影响。我们可以看到央行上调银行间政策利率是对经济基本面复苏、PPI 大幅超预期后实际利率过低的修正，同时表明央行希望通过价格机制进一步调节金融系统杠杆，以加强流动性的逆周期调节效果。由于仅仅调整的是银行间利率，故短期不会对实体经济的复苏造成明显影响，但对于杠杆率较高的金融机构以及债券市场还是有一定影响。接下来，我们将密切关注央行及其他监管机构在金融去杠杆方面的措施推进节奏，同时关注金融机构负债端的稳定性。我们预计，在金融机构杠杆率特别是同业杠杆没有明显下降前，除非经济基本面出现超预期下滑，货币政策收紧的方向仍比较确定。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。成员包括运营分管领导、投资分管领导、督察长、监察稽核部负责人、研究部门负责人、交易部负责人、基金运营部负责人等，对公司依法受托管理资产的投资品种估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。本公司的基金估值和会计核算由基金运营部负责实施，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金运营部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，定期集中支付收益。本基金管理人已根据本基金基金合同和相关法律法规的规定对应分配利润进行了分配。截止报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对鑫元货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，鑫元货币市场基金的管理人——鑫元基金管理有限公司在鑫元货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鑫元基金管理有限公司编制和披露的鑫元货币市场基金 2016 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2017)第 21150 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告   |     |
|--------------|--|-----|
| 审计报告收件人      | 鑫元货币市场基金全体基金份额持有人：   |     |
| 引言段          | 我们审计了后附的鑫元货币市场基金(以下简称“鑫元货币基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。  |     |
| 管理层对财务报表的责任段 | <p>编制和公允列报财务报表是鑫元货币基金的基金管理人鑫元基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>  |     |
| 注册会计师的责任段    | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |     |
| 审计意见段        | 我们认为，上述鑫元货币基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了鑫元货币基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。  |     |
| 注册会计师的姓名     | 薛竞   | 傅琛慧 |
| 会计师事务所的名称    | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)   |     |
| 会计师事务所的地址    | 上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼   |     |
| 审计报告日期       | 2017 年 3 月 30 日  |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：鑫元货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            |            | 3,479,860,884.76                | 1,477,449.56                     |
| 结算备付金           |            | -                               | -                                |
| 存出保证金           |            | 12,699.02                       | -                                |
| 交易性金融资产         |            | 2,475,398,068.29                | 1,538,417,883.98                 |
| 其中：股票投资         |            | -                               | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 2,438,797,068.29                | 1,538,417,883.98                 |
| 资产支持证券投资        |            | 36,601,000.00                   | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          |            | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        |            | 5,005,401,771.97                | 559,032,118.55                   |
| 应收证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收利息            |            | 44,167,862.33                   | 21,161,585.31                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 13,966,336.15                   | 33,773,612.87                    |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            |            | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 11,018,807,622.52               | 2,153,862,650.27                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          |            | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 2,734,282.89                    | 761,135.81                       |
| 应付托管费           |            | 828,570.59                      | 230,647.22                       |
| 应付销售服务费         |            | 183,824.65                      | 131,874.75                       |
| 应付交易费用          |            | 248,523.64                      | 68,318.90                        |

|               |  |                   |                  |
|---------------|--|-------------------|------------------|
| 应交税费          |  | -                 | -                |
| 应付利息          |  | -                 | -                |
| 应付利润          |  | -                 | -                |
| 递延所得税负债       |  | -                 | -                |
| 其他负债          |  | 169,000.00        | 319,000.00       |
| 负债合计          |  | 4,164,201.77      | 1,510,976.68     |
| <b>所有者权益：</b> |  |                   |                  |
| 实收基金          |  | 11,014,643,420.75 | 2,152,351,673.59 |
| 未分配利润         |  | -                 | -                |
| 所有者权益合计       |  | 11,014,643,420.75 | 2,152,351,673.59 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 11,018,807,622.52 | 2,153,862,650.27 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

11,014,643,420.75 份，其中 A 类基金份额总额 467,579,311.83 份，B 类基金份额总额

10,547,064,108.92 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鑫元货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|-----|---|--|
| <b>一、收入</b>           |     | 166,349,925.45                            | 144,662,190.35                                 |
| 1.利息收入                |     | 165,407,732.62                            | 124,565,654.56                                 |
| 其中：存款利息收入             |     | 33,152,505.02                             | 42,792,779.76                                  |
| 债券利息收入                |     | 58,851,004.55                             | 53,361,164.71                                  |
| 资产支持证券利息收入            |     | 264,300.65                                | -  |
| 买入返售金融资产收入            |     | 73,139,922.40                             | 28,411,710.09                                  |
| 其他利息收入                |     | -   | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |     | 942,192.83                                | 20,096,535.79                                  |
| 其中：股票投资收益             |     | -   | -  |
| 基金投资收益                |     | -   | -  |
| 债券投资收益                |     | 942,192.83                                | 20,096,535.79                                  |
| 资产支持证券投资收益            |     | -   | -  |
| 贵金属投资收益               |     | -   | -  |
| 衍生工具收益                |     | -   | -  |
| 股利收益                  |     | -   | -  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |     | -   | -  |

|                            |           |                |                |
|----------------------------|-----------|----------------|----------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |           | -              | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          |           | -              | -              |
| <b>减：二、费用</b>              |           | 34,437,132.67  | 21,737,382.40  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.8.2.1 | 15,940,086.98  | 11,387,350.41  |
| 2. 托管费                     | 7.4.8.2.2 | 4,830,329.39   | 3,450,712.29   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.8.2.3 | 1,718,956.23   | 1,734,531.60   |
| 4. 交易费用                    |           | -              | -              |
| 5. 利息支出                    |           | 11,527,819.46  | 4,759,696.47   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | 11,527,819.46  | 4,759,696.47   |
| 6. 其他费用                    |           | 419,940.61     | 405,091.63     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | 131,912,792.78 | 122,924,807.95 |
| 减：所得税费用                    |           | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | 131,912,792.78 | 122,924,807.95 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                 |                    |
|-----------------------------------|-----------------------------|-----------------|--------------------|
|                                   | 实收基金                        | 未分配利润           | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 2,152,351,673.59            | -               | 2,152,351,673.59   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）         | -                           | 131,912,792.78  | 131,912,792.78     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 8,862,291,747.16            | -               | 8,862,291,747.16   |
| 其中：1. 基金申购款                       | 40,086,590,561.67           | -               | 40,086,590,561.67  |
| 2. 基金赎回款                          | -31,224,298,814.51          | -               | -31,224,298,814.51 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净            | -                           | -131,912,792.78 | -131,912,792.78    |

|  |                                  |                 |                    |
|--|----------------------------------|-----------------|--------------------|
| 值变动（净值减少以“-”号填列）                       |                                  |                 |                    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 11,014,643,420.75                | -               | 11,014,643,420.75  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                 |                    |
|  | 实收基金                             | 未分配利润           | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 4,951,634,557.77                 | -               | 4,951,634,557.77   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                | 122,924,807.95  | 122,924,807.95     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -2,799,282,884.18                | -               | -2,799,282,884.18  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 36,155,078,262.47                | -               | 36,155,078,262.47  |
| 2. 基金赎回款                               | -38,954,361,146.65               | -               | -38,954,361,146.65 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                | -122,924,807.95 | -122,924,807.95    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,152,351,673.59                 | -               | 2,152,351,673.59   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张乐赛

陈宇

包颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鑫元货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2013年12月10日《关于核准鑫元货币市场基金募集的批复》(证监许可[2013]1562号)核准,由鑫元基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元货币市场基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,454,625,299.41元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验



字(2013)第 891 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元货币市场基金基金合同》于 2013 年 12 月 30 日正式生效,首次设立募集规模为 2,454,702,544.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 77,245.04 份基金份额。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《鑫元货币市场基金基金合同》和《鑫元货币市场基金招募说明书》的相关规定,本基金根据基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量的不同,对其持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,并形成 A 类和 B 类两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额类别,并将根据其持有的基金份额数额成为某一类别的基金份额持有人,不同基金份额类别之间不得互相转换,但因认购、申购、赎回、基金转换等交易及收益结转份额而发生基金份额自动升级或者降级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据以及中国证监会及/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金的投资目标是在保持基金资产安全性和高流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定回报。本基金的业绩比较基准为同期活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人鑫元基金管理有限公司于 2017 年 3 月 30 日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鑫元货币市场基金基金合同》和如财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年度的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 鑫元基金管理有限公司(“鑫元基金”)     | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构        |
| 南京银行股份有限公司(“南京银行”)     | 基金管理人股东、基金销售机构      |
| 南京高科股份有限公司             | 基金管理人股东             |

|                    |          |
|--------------------|----------|
| 鑫沅资产管理有限公司（“鑫沅资产”） | 基金管理人子公司 |
|--------------------|----------|

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

注：无。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年1月1日至2016年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月<br>31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 15,940,086.98                   | 11,387,350.41                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,367,315.33                    | 587,147.91                           |

注：支付基金管理人鑫元基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016年1月1日至2016年 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月 |
|----|-----------------------|-------------------------------|
|----|-----------------------|-------------------------------|

|                | 12 月 31 日    | 31 日         |
|----------------|--------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,830,329.39 | 3,450,712.29 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日      |            |              |
|----------------|---|------------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |            |              |
|                | 鑫元货币 A                                      | 鑫元货币 B     | 合计           |
| 南京银行           | 1,053,654.72                                | 60,395.11  | 1,114,049.83 |
| 鑫元基金           | 37,392.64                                   | 325,655.16 | 363,047.80   |
| 中国工商银行         | 137,683.93                                  | 203.46     | 137,887.39   |
| 合计             | 1,228,731.29                                | 386,253.73 | 1,614,985.02 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |            |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |            |              |
|                | 鑫元货币 A                                      | 鑫元货币 B     | 合计           |
| 南京银行           | 1,190,580.78                                | 822.67     | 1,191,403.45 |
| 鑫元基金           | 34,405.44                                   | 262,892.04 | 297,297.48   |
| 中国工商银行         | 145,790.01                                  | 656.42     | 146,446.43   |
| 合计             | 1,370,776.23                                | 264,371.13 | 1,635,147.36 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给鑫元基金，再由鑫元基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                |       |      |       |      |
|----------------|--|----------------|-------|------|-------|------|
|                | 债券交易金额                                 |                | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                | 基金买入                                   | 基金卖出           | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国工商银行         | -                                      | 101,085,810.38 | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间        |  |                |       |      |       |      |

| 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |        |                |       |      |       |      |
|----------------------------------|--------|----------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称               | 债券交易金额 |                | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出           | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国工商银行                           | -      | 102,042,382.28 | -     | -    | -     | -    |

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

###### 鑫元货币 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                          |
|-------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 南京银行  | 0.00                    | 0.0000%                  | 0.00                     | 0.0000%                  |

###### 鑫元货币 B

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                          |
|-------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 南京银行  | 2,218,919,588.84        | 20.1452%                 | 0.00                     | 0.0000%                  |

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |           |
|-----------|--|------------|---|-----------|
|           | 期末余额                                   | 当期利息收入     | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 中国工商银行    | 1,860,884.76                           | 109,492.34 | 1,477,449.56                                | 75,217.99 |

注：本基金的活期银行存款以及部分定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日      |           |               |          |           |               |
|---|-----------|---------------|----------|-----------|---------------|
| 关联方名称                                       | 证券代码      | 证券名称          | 发行方式     | 基金在承销期内买入 |               |
|   |           |               |          | 数量（单位：份）  | 总金额           |
| 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |           |               |          |           |               |
| 关联方名称                                       | 证券代码      | 证券名称          | 发行方式     | 基金在承销期内买入 |               |
|   |           |               |          | 数量（单位：份）  | 总金额           |
| 中国工商银行                                      | 011599320 | 15 穗地铁 SCP002 | 簿记建档集中配售 | 400,000   | 39,976,830.00 |

注：本基金于 15 穗地铁 SCP002 的联席承销商平安银行股份有限公司处投标认购该证券，按照市场公平合理价格执行。中国工商银行是 15 穗地铁 SCP002 的分销商。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 2,475,398,068.29 元，无属于第一或第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 1,538,417,883.98 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 2,475,398,068.29  | 22.47         |
|    | 其中：债券             | 2,438,797,068.29  | 22.13         |
|    | 资产支持证券            | 36,601,000.00     | 0.33          |
| 2  | 买入返售金融资产          | 5,005,401,771.97  | 45.43         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -             |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,479,860,884.76  | 31.58         |
| 4  | 其他各项资产            | 58,146,897.50     | 0.53          |
| 5  | 合计                | 11,018,807,622.52 | 100.00        |

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 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 | 10.51          |                |
|    | 其中:买断式回购融资   | -              |                |
| 序号 | 项目           | 金额             | 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的比例为报告期内每个交易日融资余额占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  | 2016 年 8 月 25 日 | 22.59             | 巨额赎回 | 2016 年 8 月 26 日 |

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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    | 59 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 95 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 50 |

### 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。

### 8.3.2 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 | 各期限负债占基金资 |
|----|--------|------------|-----------|
|----|--------|------------|-----------|



|   |                        | 净值的比例 (%) | 产净值的比例 (%) |
|---|------------------------|-----------|------------|
| 1 | 30 天以内                 | 41.87     | -          |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -         | -          |
| 2 | 30 天(含)—60 天           | 19.44     | -          |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -         | -          |
| 3 | 60 天(含)—90 天           | 19.81     | -          |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -         | -          |
| 4 | 90 天(含)—120 天          | 5.70      | -          |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -         | -          |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含)      | 12.69     | -          |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -         | -          |
|   | 合计                     | 99.51     | -          |

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超出 240 天情形。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | -                | -             |
| 2  | 央行票据                 | -                | -             |
| 3  | 金融债券                 | 561,153,705.88   | 5.09          |
|    | 其中：政策性金融债            | 561,153,705.88   | 5.09          |
| 4  | 企业债券                 | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券              | 409,868,008.04   | 3.72          |
| 6  | 中期票据                 | -                | -             |
| 7  | 同业存单                 | 1,467,775,354.37 | 13.33         |
| 8  | 其他                   | -                | -             |
| 9  | 合计                   | 2,438,797,068.29 | 22.14         |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -             |

## 8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 债券数量(张)   | 摊余成本           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|-------------------|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 111681681 | 16 嘉兴银行 CD063     | 2,000,000 | 199,777,432.95 | 1.81          |
| 2  | 160209    | 16 国开 09          | 1,900,000 | 189,998,762.54 | 1.72          |
| 3  | 140208    | 14 国开 08          | 1,300,000 | 130,948,766.48 | 1.19          |
| 4  | 160204    | 16 国开 04          | 1,000,000 | 99,997,053.70  | 0.91          |
| 5  | 011698257 | 16 鲁高速集 SCP006    | 1,000,000 | 99,973,420.30  | 0.91          |
| 6  | 111681692 | 16 嘉兴银行 CD064     | 1,000,000 | 99,888,716.48  | 0.91          |
| 7  | 111681696 | 16 金华银行 CD087     | 1,000,000 | 99,873,709.90  | 0.91          |
| 8  | 111607123 | 16 招行 CD123       | 1,000,000 | 99,839,467.16  | 0.91          |
| 9  | 111699618 | 16 东莞农村商业银行 CD086 | 1,000,000 | 98,533,630.38  | 0.89          |
| 10 | 111699056 | 16 唐山银行 CD013     | 1,000,000 | 97,390,807.11  | 0.88          |

## 8.7 “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 | 7        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.2813%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.1605% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0881%  |

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%情形。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%情形。

## 8.8 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码    | 证券名称         | 数量（份）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 1689246 | 16 上和<br>1A1 | 400,000 | 20,136,000.00 | 0.18         |
| 2  | 1689226 | 16 金诚<br>2A1 | 300,000 | 16,335,000.00 | 0.15         |

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.000 元。

### 8.9.2 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

基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内未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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 12,699.02     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 44,167,862.33 |
| 4  | 应收申购款   | 13,966,336.15 |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 58,146,897.50 |

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别   | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额      | 持有人结构             |        |                |        |
|--------|----------|----------------|-------------------|--------|----------------|--------|
|        |          |                | 机构投资者             |        | 个人投资者          |        |
|        |          |                | 持有份额              | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 鑫元货币 A | 39,220   | 11,921.96      | 19,904,950.68     | 4.26%  | 447,674,361.15 | 95.74% |
| 鑫元货币 B | 34       | 310,207,767.91 | 10,536,522,234.22 | 99.90% | 10,541,874.70  | 0.10%  |
| 合计     | 39,254   | 280,599.26     | 10,556,427,184.90 | 95.84% | 458,216,235.85 | 4.16%  |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别   | 持有份额总数(份)    | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 鑫元货币 A | 1,923,266.10 | 0.4114%  |
|                  | 鑫元货币 B | 0.00         | 0.0000%  |
|                  | 合计     | 1,923,266.10 | 0.0175%  |

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别   | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|--------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 鑫元货币 A | 50~100            |
|                                | 鑫元货币 B | 0                 |
|                                | 合计     | 50~100            |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 鑫元货币 A | 10~50             |
|                                | 鑫元货币 B | 0                 |

|  |    |       |
|--|----|-------|
|  | 合计 | 10~50 |
|--|----|-------|

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 | 鑫元货币 A           | 鑫元货币 B            |
|---------------------------------|------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2013 年 12 月 30 日）基金份额总额 | 804,848,555.21   | 1,649,853,989.24  |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 511,646,067.43   | 1,640,705,606.16  |
| 本报告期基金总申购份额                     | 5,055,776,814.73 | 35,030,813,746.94 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                   | 5,099,843,570.33 | 26,124,455,244.18 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）        | -                | -                 |
| 本报告期末基金份额总额                     | 467,579,311.83   | 10,547,064,108.92 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人：

本报告期内，基金管理人于 2016 年 4 月 16 日发布了《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。2016 年 4 月 15 日起，原总经理李湧先生因个人原因辞去公司总经理职务，并由董事长束行农先生代为履行其总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2016 年 5 月 20 日发布了《鑫元基金管理有限公司关于聘任基金行业高级管理人员的公告》。2016 年 5 月 19 日起，聘任李雁女士担任公司副总经理一职。

本报告期内，基金管理人于 2016 年 7 月 8 日发布了《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。2016 年 7 月 7 日起，原常务副总经理张乐赛先生转任公司总经理一职，董事长束行农先生不再代为履行公司总经理职务。

#### 2、基金托管人：本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 80,000.00 元，本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。目前的审计机构已为本基金提供审计服务的年限为 4 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。本报告期内，基金管理人收到中国证监会上海监管局对公司进行常规全面现场检查后出具的责令改正的行政监管措施决定书，以及对公司时任总经理的警示函。基金管理人高度重视相关整改意见，及时有针对性地制订并执行相应改进措施，进一步提升公司内部控制成效，已完成相关整改工作并通过现场检查验收。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 华泰证券 | 2      | -    | -            | 162,083.40 | 78.54%     | -  |

|      |   |   |   |           |        |   |
|------|---|---|---|-----------|--------|---|
| 兴业证券 | 2 | - | - | 44,298.65 | 21.46% | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | -         | -      | - |

注：（1）交易单元的主要选择标准：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范；
- 2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；
- 3) 具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；
- 4) 收取的交易佣金费率合理。

（2）交易单元的选择程序：

- 1) 投资研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；
- 2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。

（3）报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：兴业证券。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华泰证券 | -    | -            | 16,208,340,000.00 | 48.51%         | -    | -            |
| 兴业证券 | -    | -            | 17,205,974,500.00 | 51.49%         | -    | -            |
| 方正证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

鑫元基金管理有限公司  
2017年3月31日