

鑫元鸿利债券型证券投资基金 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	鑫元鸿利
基金主代码	000694
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月26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	1,507,410,161.83份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保证适当流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争取得超越基金业绩比较基准的收益，为投资者创造稳定的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数
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。

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	郭明
	联系电话	021-20892000 转	010-66105799
	电子邮箱	service@xyamc.com	custody@icbc.com.cn
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	www.xyamc.com
基金年度报告备置地点	上海市静安区中山北路 909 号 12 层 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：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 6 月 26 日 (基金合同生效日)– 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	88,820,133.47	118,962,141.76	41,642,904.65
本期利润	54,636,038.73	156,198,306.52	55,186,659.91
加权平均基金份额本期利润	0.0324	0.0884	0.0466
本期基金份额净值增长率	2.64%	9.00%	4.40%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1556	0.0997	0.0327
期末基金资产净值	1,760,486,081.36	2,406,629,498.19	1,528,712,121.79
期末基金份额净值	1.168	1.138	1.044

注：1) 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。

2) 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。

3) 期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

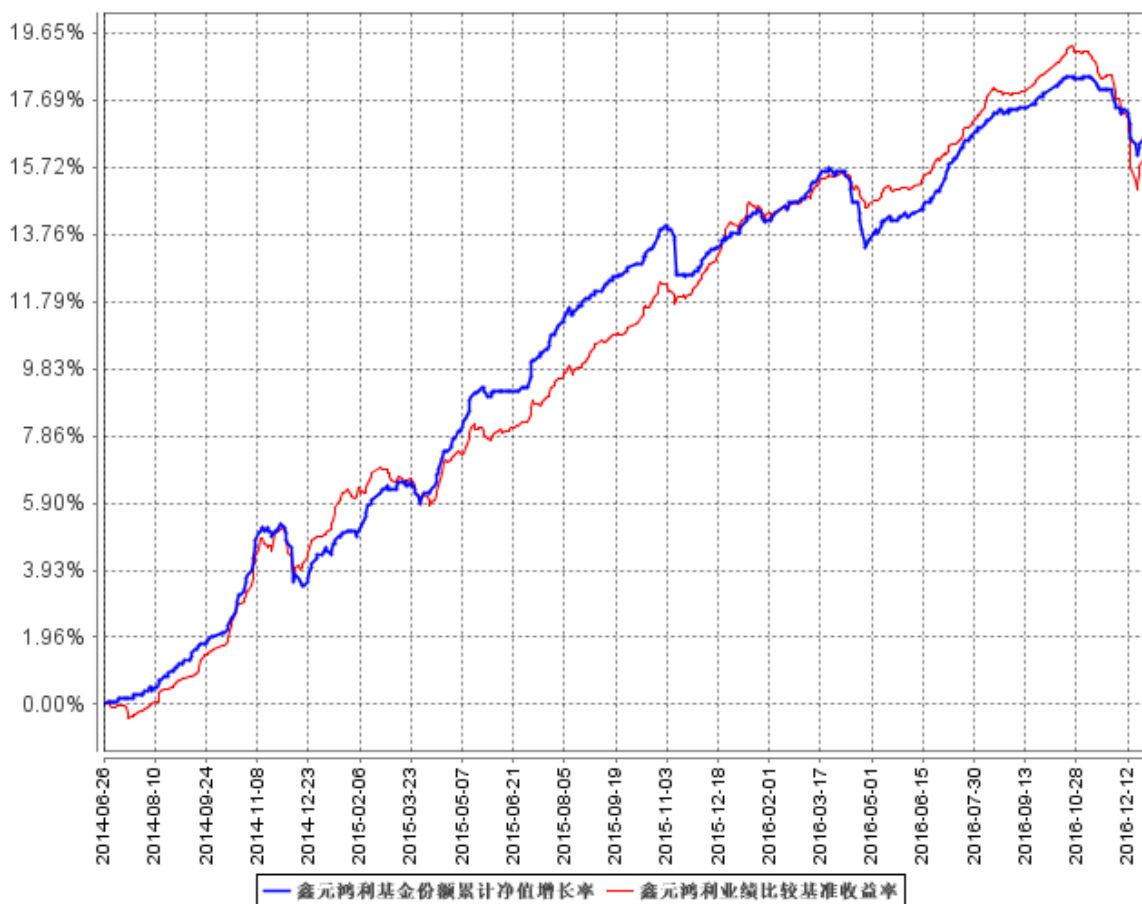
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.93%	0.09%	-1.79%	0.15%	0.86%	-0.06%
过去六个月	1.48%	0.08%	0.37%	0.11%	1.11%	-0.03%
过去一年	2.64%	0.08%	2.00%	0.09%	0.64%	-0.01%

自基金合同生效起至今	16.80%	0.09%	16.36%	0.09%	0.44%	0.00%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

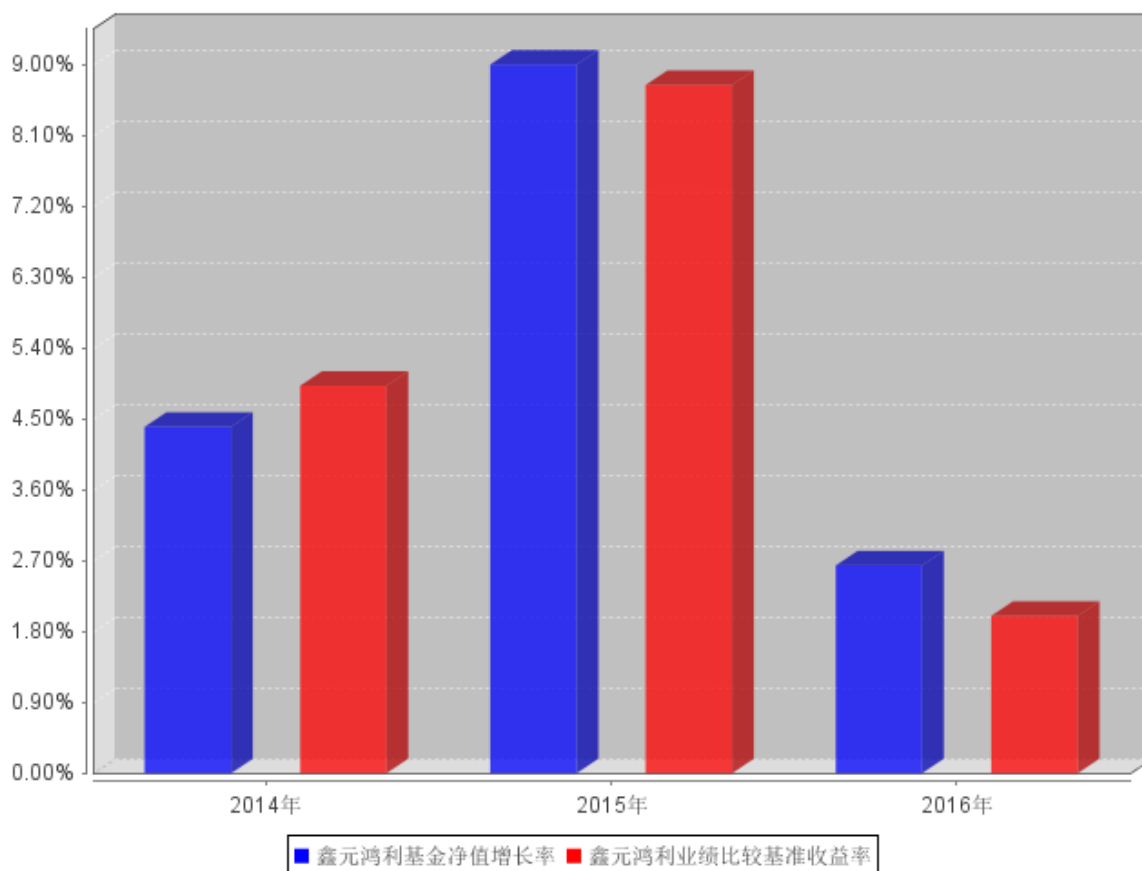
鑫元鸿利基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的合同生效日为 2014 年 6 月 26 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

鑫元鸿利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对比图



注：合同生效当年的本基金净值增长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

注：本基金过去三年未实施利润分配。

§ 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		
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	2014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

	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 会委员				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。
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	-	9 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。
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	2014年7月15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。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，

	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；基金投资决策委员会委员			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 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
进行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。

在投资操作方面，我们主要锚定绝对收益目标，不断根据债券市场变化灵活调整仓位并优化
持仓品种，基本实现了稳定收益目标：在年初银行委外等增量资金涌入的情况下采取均衡配置策
略，基本保持仓位稳定，以适当提高静态收益的方式获取组合稳定收益；二季度，在市场受到信
用违约事件影响大幅调整及组合遭遇大额赎回的情况上较好地应对流动性风险，并在之后的市场
回暖过程中保持了杠杆的稳定性，组合净值快速回升；三季度，受大宗商品价格暴涨、房地产销
售火爆以及理财监管预期趋严等因素的综合影响，利率债收益率虽然一波三折但信用债收益率则
受益于信用风险短期解除及资金配置力量加强，收益率逆市一路下行。组合进一步对持仓进行了
结构优化，着重对持有的浮盈较多的信用债部分品种进行了减持、降低了组合杠杆，从而较好地
避免了季末资金面紧张对组合的影响，积极参与了利率债的波段交易也对组合业绩有所增厚。四
季度，国内债券市场经受了内忧外困的多重影响陷入深幅调整，管理人通过密切跟踪影响国内经
济基本面的宏微观因素，并对货币政策边际收紧的变化进行了快速反应，通过一系列的减仓操作，
将组合杠杆和久期压制极低状态，使得组合保持了充裕的流动性，从而最大限度地规避了四季度
市场的流动性及信用危机并通过拆出资金获得稳定的资金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元鸿利的基金份额净值增长率为 2.64%，同期业绩比较基准收益率为 2.00%。

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，市场对之预期差异较大。

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。我们认为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。

在大类资产配置上，我们认为股票市场或将继续受益于上市公司盈利改善，而债券市场则有可能受到经济基本面及监管政策的多重冲击，而商品市场由于过去一年的透支虽然有方向上的机会但需要面临波动加剧的情形。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人在监察稽核工作中一方面将坚持投资者利益至上、坚持违法违规零容忍、严防触犯三条底线作为公司的最高经营宗旨和全体员工的根本行为准则，为全面风险管理、全程风险管理与全员风险管理相关内部控制管理规范的推行提供相对有利的内部控制环境；另一方面依据不断发展变化的外部经营环境、监管环境与业务实践对于公司内部控制与风险管理持续进行动态的调整与修正。监察稽核工作致力于保障本基金运作合法合规，切实维护基金份额持有人利益；致力于保障各项法律法规和内部管理制度贯彻执行，推动各项内部控制与风险管理机制的逐步优化与完善，促进公司各项业务合法合规运作。

本报告期内完成的监察稽核工作主要包括：一是密切关注法律法规与监管规范性文件的更新情况，及时进行内部传达以及组织员工学习理解；二是协调内部管理制度体系的修订和完善，推动公司各业务部门持续完善管理制度和业务流程建设，防范日常运作中发生违法违规行为与风险事件；三是从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；四是通过外部和内部培训、日常投资申报管理、员工行为规范管理等方式不断强化员工的合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突；五是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；六是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施。

4.7 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投资基金行业从业经验。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。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，按照中证指数有限公司所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。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。

4.9 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鸿利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他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，鑫元鸿利债券型证券投资基金的管理人——鑫元基金管理有限公司在鑫元鸿利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鑫元鸿利债券型证券投资基金未进行利润分配。

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鸿利债券型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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 21149 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	鑫元鸿利债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的鑫元鸿利债券型证券投资基金(以下简称“鑫元鸿利基金”)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	编制和公允列报财务报表是鑫元鸿利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： (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； (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。
注册会计师的责任段	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。 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。 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。
审计意见段	我们认为，上述鑫元鸿利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，公允反映了鑫元鸿利基金 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：鑫元鸿利债券型证券投资基金

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		383,447.80	20,105,117.29
结算备付金		855,659.18	22,707,526.18
存出保证金		25,598.14	19,080.13
交易性金融资产		1,481,180,126.30	2,656,859,326.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,481,180,126.30	2,656,859,326.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		235,621,238.43	-
应收证券清算款		-	1,786,461.28
应收利息		34,372,202.67	60,436,984.81

应收股利		-	-
应收申购款		29,982.01	31,345.99
递延所得税资产		-	-
其他资产		20,920,800.00	-
资产总计		1,773,389,054.53	2,761,945,841.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
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		11,499,885.00	352,796,734.50
应付证券清算款		1,980.56	47,923.91
应付赎回款		21,183.82	368,296.77
应付管理人报酬		895,864.61	1,214,035.67
应付托管费		298,621.56	404,678.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		25,176.30	164,654.17
应交税费		-	-
应付利息		260.35	6,190.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		160,000.97	313,829.87
负债合计		12,902,973.17	355,316,343.49
所有者权益:			
实收基金		1,507,410,161.83	2,114,784,445.00
未分配利润		253,075,919.53	291,845,053.19
所有者权益合计		1,760,486,081.36	2,406,629,498.19
负债和所有者权益总计		1,773,389,054.53	2,761,945,841.68

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.168 元，基金份额总额 1,507,410,161.83 份。

7.2 利润表

会计主体：鑫元鸿利债券型证券投资基金

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 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		77,117,231.89	183,748,610.11

1. 利息收入		125,207,064.96	138,266,107.70
其中：存款利息收入		448,424.08	1,843,771.57
债券利息收入		123,850,959.49	136,129,897.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		907,681.39	292,438.72
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,623,771.74	7,829,613.63
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-14,623,771.74	7,829,613.63
资产支持证券投资		-	-
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）		-34,184,094.74	37,236,164.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		718,033.41	416,724.02
减：二、费用		22,481,193.16	27,550,303.59
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	11,762,355.07	11,672,514.05
2. 托管费	7.4.8.2.2	3,920,785.03	3,890,838.07
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		34,499.29	23,776.00
5. 利息支出		6,385,143.04	11,581,477.15
其中：卖出回购金融资产支出		6,385,143.04	11,581,477.15
6. 其他费用		378,410.73	381,698.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		54,636,038.73	156,198,306.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54,636,038.73	156,198,306.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元鸿利债券型证券投资基金

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
	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）	2,114,784,445.00	291,845,053.19	2,406,629,498.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	54,636,038.73	54,636,038.73
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）	-607,374,283.17	-93,405,172.39	-700,779,455.56
其中：1. 基金申购款	289,755,840.08	43,474,822.39	333,230,662.47
2. 基金赎回款	-897,130,123.25	-136,879,994.78	-1,034,010,118.03
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,507,410,161.83	253,075,919.53	1,760,486,081.36
项目	上年度可比期间 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）	1,464,425,548.26	64,286,573.53	1,528,712,121.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	156,198,306.52	156,198,306.52
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）	650,358,896.74	71,360,173.14	721,719,069.88
其中：1. 基金申购款	1,142,545,882.30	135,109,695.91	1,277,655,578.21
2. 基金赎回款	-492,186,985.56	-63,749,522.77	-555,936,508.33
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,114,784,445.00	291,845,053.19	2,406,629,498.19

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：

<u>张乐赛</u>	<u>陈宇</u>	<u>包颖</u>
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

鑫元鸿利债券型证券投资基金(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”)证监许可[2014]585号《关于核准鑫元鸿利债券型证券投资基金募集的批复》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《鑫元鸿利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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710,446,746.12元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第315号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元鸿利债券型证券投资基金基金合同》于2014年6月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为710,446,757.66份基金份额,其中认购资金利息折合11.54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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、资产支持证券、债券回购、同业存款、通知存款、银行存款等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不参与买入股票和权证,投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数。

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》、《鑫元鸿利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,762,355.07	11,672,514.05
其中：支付销售机构的客户维护费	8,299.40	11,470.73

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 0.6% 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 × 0.6% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,920,785.03	3,890,838.07

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 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		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	383,447.80	129,328.52	105,117.29	79,832.87

注：本基金的活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

注：无。

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：本基金于 2016 年 12 月 31 日持有如附注 7.4.7.6 所述计入其他资产的“13 山水 MTN1”，因发行人违约而流通受限，合计账面价值为 20,920,800.00 元。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 11,499,885.00 元，于 2017 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 1,481,180,126.30 元，无属于第一层次以及第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 2,656,859,326.00 元，无属于第一层次以及第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对

于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,481,180,126.30	83.52
	其中：债券	1,481,180,126.30	83.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	235,621,238.43	13.29
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,239,106.98	0.07
7	其他各项资产	55,348,582.82	3.12
8	合计	1,773,389,054.53	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 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

注：本基金报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金报告期末未持有股票。

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	6,993,500.00	0.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,620,000.00	6.23
	其中：政策性金融债	109,620,000.00	6.23
4	企业债券	596,551,626.30	33.89
5	企业短期融资券	130,072,000.00	7.39
6	中期票据	637,943,000.00	36.24
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,481,180,126.30	84.13

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140407	14 农发 07	800,000	80,248,000.00	4.56
2	1382164	13 伊泰煤 MTN1	600,000	59,922,000.00	3.40
3	101455018	14 富兴 MTN002	500,000	53,600,000.00	3.04
4	101459031	14 镇江新区 MTN001	500,000	52,300,000.00	2.97
5	101455022	14 祁连山 MTN001	500,000	51,975,000.00	2.95

8.7 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：本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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：本基金报告期末未持有贵金属。

8.9 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：本基金报告期末未持有权证。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：根据基金投资范围，本基金不得参与国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：根据基金投资范围，本基金不得参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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**

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未发生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。

8.12.2 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

本基金未参与股票投资。

8.12.3 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	25,598.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,372,202.67
5	应收申购款	29,982.01
6	其他应收款	20,920,800.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,348,582.82

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末未持有股票。

§ 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

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
2,354	640,361.16	1,502,108,100.22	99.65%	5,302,061.61	0.35%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	56,957.63	0.0038%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2014 年 6 月 26 日) 基金份额总额	710,446,757.66
本报告期期初基金份额总额	2,114,784,445.00
本报告期基金总申购份额	289,755,840.08
减:本报告期基金总赎回份额	897,130,123.25
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,507,410,161.83

§ 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

报告期内组合未发生投资策略改变的情形。

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。目前的审计机构已提供审计服务的年限为 3 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	-	-	158,658.00	43.73%	-
方正证券	2	-	-	200,337.80	55.22%	-
兴业证券	2	-	-	3,790.71	1.04%	-

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	349,744,676.84	59.68%	15,518,070,000.00	43.43%	-	-
方正证券	217,228,488.37	37.07%	19,849,400,000.00	55.56%	-	-
兴业证券	19,015,091.61	3.24%	360,100,000.00	1.01%	-	-

鑫元基金管理有限公司
2017年3月31日