

鑫元安鑫宝货币市场基金 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：恒丰银行股份有限公司

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。

基金托管人恒丰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	鑫元安鑫宝	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	843,812,563.55 份	
基金合同存续期	不定期	
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	0.00 份	843,812,563.55 份

2.2 基金产品说明

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	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。
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，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。

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。

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	恒丰银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	吴琪君
	联系电话	021-20892000 转	95395
	电子邮箱	service@xyamc.com	wuqijun@hfbank.com.cn
客户服务电话		4006066188	95395
传真		021-20892111	021-38966338

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	http://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 6 月 26 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日		2014 年	
	鑫元安鑫宝 A	鑫元安鑫宝 B	鑫元安鑫宝 A	鑫元安鑫宝 B	鑫元安鑫宝 A	鑫元安鑫宝 B
本期已实现收益	-	13,623,032.11	-	4,254,969.02	-	-
本期利润	-	13,623,032.11	-	4,254,969.02	-	-
本期净值收益率	-	2.6852%	-	1.6408%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末基金资产净值	-	843,812,563.55	-	341,858,500.98	-	-
期末基金份额净值	-	1	-	1	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
累计净值收益率	-	4.3700%	-	1.6408%	-	-

注：1、本基金利润分配按日结转份额。

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，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

鑫元安鑫宝 A

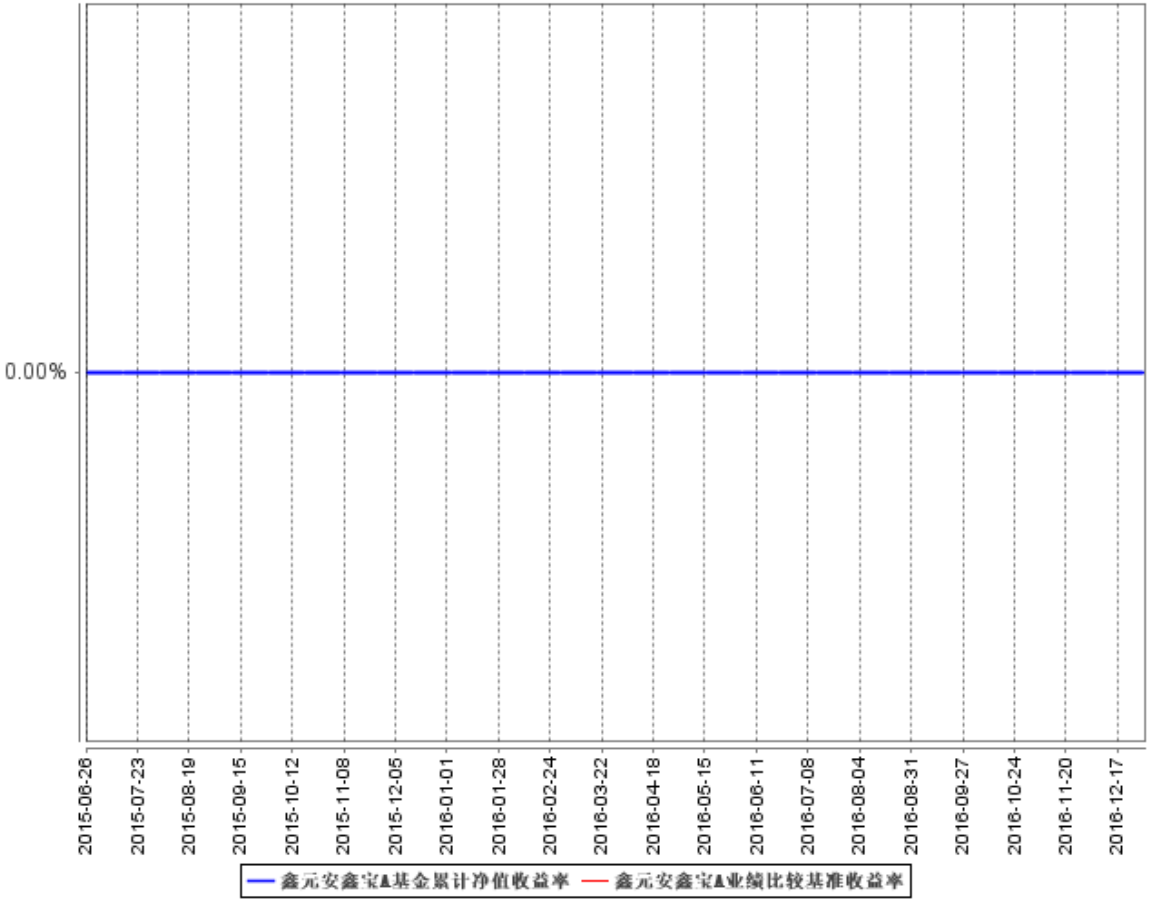
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%
过去六个月	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%
过去一年	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%
自基金合同 生效起至今	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%

鑫元安鑫宝 B

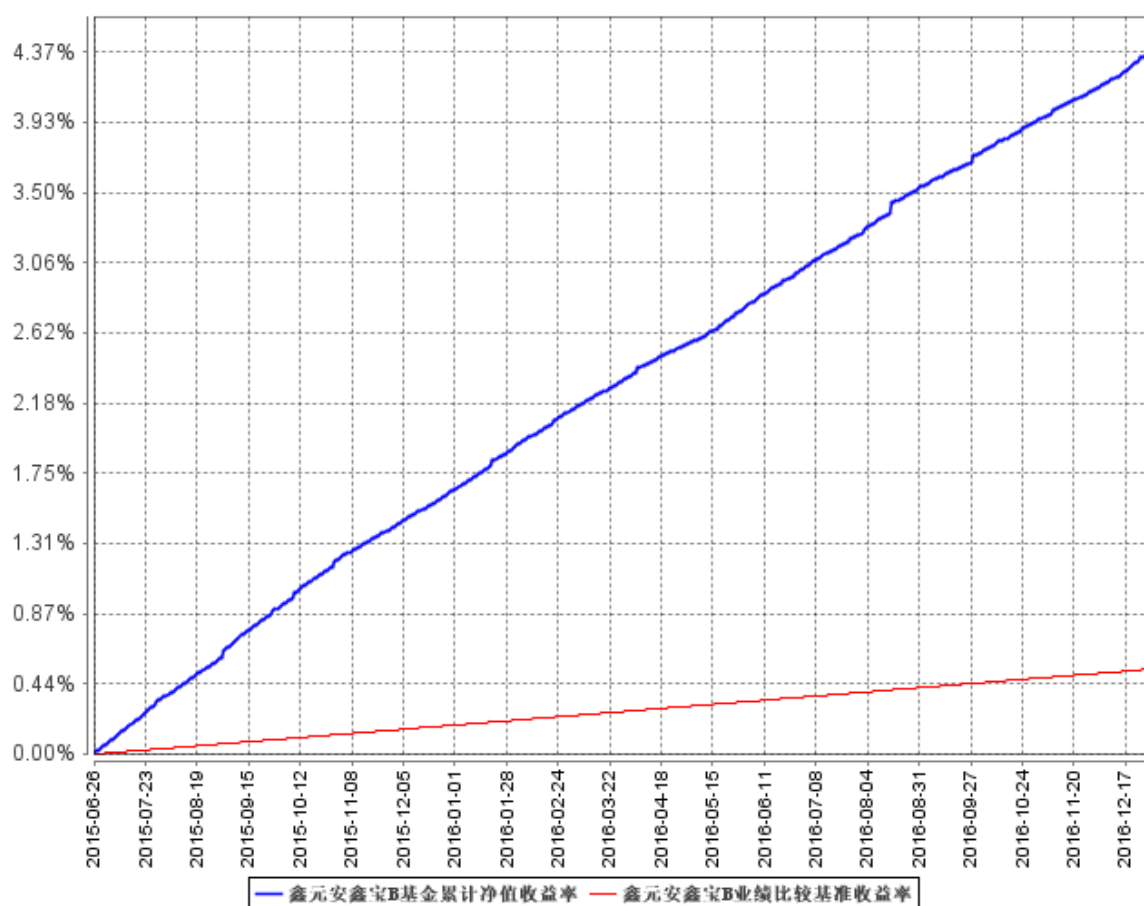
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6132%	0.0028%	0.0880%	0.0000%	0.5252%	0.0028%
过去六个月	1.3146%	0.0058%	0.1760%	0.0000%	1.1386%	0.0058%
过去一年	2.6852%	0.0048%	0.3500%	0.0000%	2.3352%	0.0048%
自基金合同 生效起至今	4.3700%	0.0045%	0.5312%	0.0000%	3.8388%	0.0045%

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

鑫元安鑫宝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



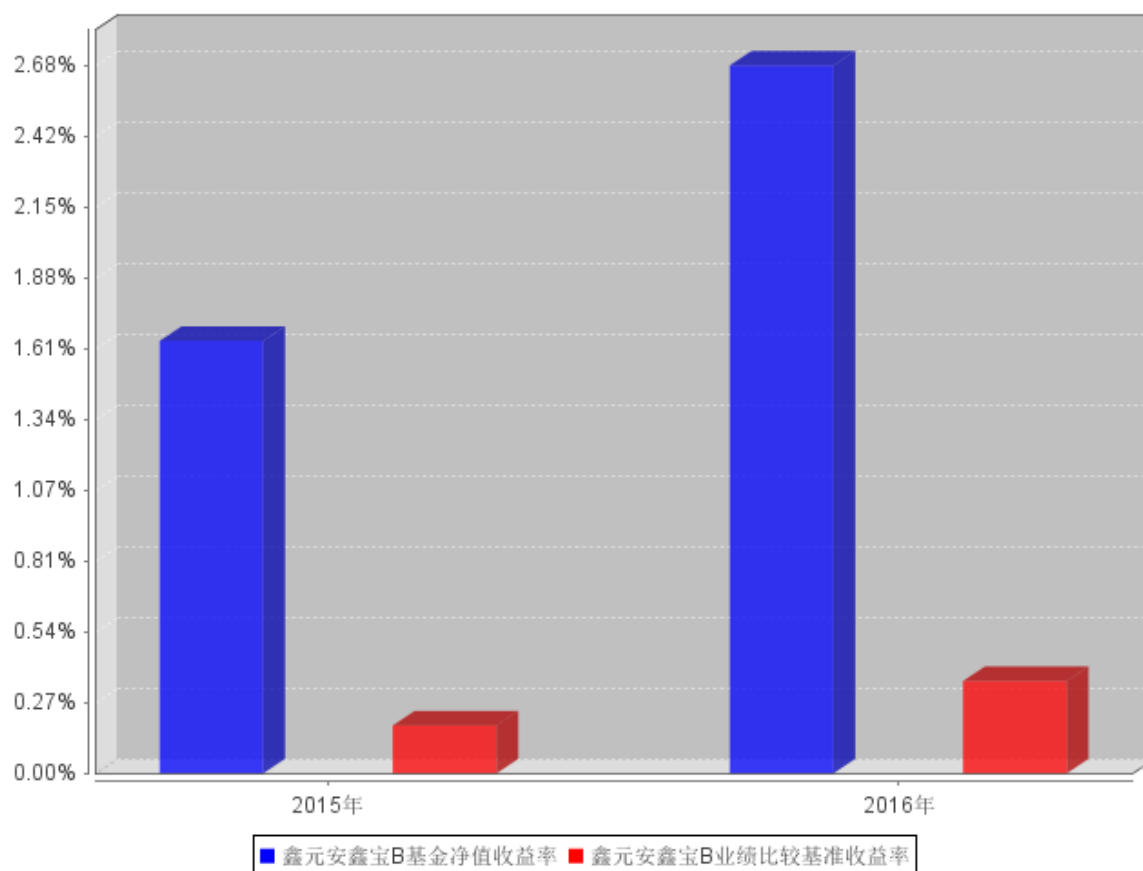
鑫元安鑫宝B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

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

鑫元安鑫宝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

鑫元安鑫宝 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
合计	0.00	-	-	-	
鑫元安鑫宝 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	13,623,032.11	-	-	13,623,032.11	
2015	4,254,969.02	-	-	4,254,969.02	
合计	17,878,001.13	-	-	17,878,001.13	

§ 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		
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、	2015 年 6 月 26 日	-	7 年	学历：国际审计专业，学士。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 8 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

	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；基金投资决策委员会委员				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，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。
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	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

	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；基金投资决策委员会委员				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

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

报告期内，本基金在短融和同业存单之间进行合理配置，并在资金面紧张的时机合理安排流动性，锁定回购收益，同时高度关注组合的流动性风险，采取相对谨慎的久期策略，灵活把握波段机会，并密切排查组合债券的信用风险。本基金将继续以流动性较好且可获得稳定收益的资产为主，合理安排流动性，将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于首位，为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元安鑫宝 B 的基金份额净值收益率为 2.6852%，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

从一月宏观数据来看，cpi 和 ppi 均高于市场预期，外贸开门红，海外整体需求改善，进口高增速体现内需强劲。同时一月信贷因为季节性原因投放量超过 2 亿，虽然弱于预期但主要是受到信贷调控的影响，社会融资规模创新高，除了季节性因素外，央行引导信贷合理增长，也可能是部分贷款需求转向表外。春节后食品价格迅速回落，使得 2 月 cpi 有望大幅回落，通胀压力在 2 月将有所缓解，但是原有对全年通胀中枢的抬升不可小觑 ppi 受大宗商品影响，2 月有望继续攀升。预 2 月计一季度信贷投放仍将保持较高规模，一月被压抑的信贷需求将被平滑至随后两月，房地长销量的减少对中长期贷款的影响预计在二季度才会有所体现，基建将成为稳增长的主要发

力点，企业贷款有望在全年保持较高增长。央行对金融市场的监管是否会强化都将取决于金融“去杠杆”的进度。短期看基本面稳定，信贷投放偏高，流动性管理是后期需要把握的主要方向，节后央行持续回笼节前投放的货币，叠加前期逆回购招标利率的上调，货币政策态度短期内依旧中性偏紧。

海外方面，美联储主席耶伦在参议院金融委员会发表半年度货币政策证词，主张适时加息，美元指数和美债收益率应声走高，也不乏对美国经济增速的担忧，特朗普政策执行的效果及美国经济增长或不及市场预期。

信用债方面，在经济平稳下整体基本面风险可控，但仍需关注地产等行业近期资金缺口变化；短期资金面面临到期压力，同时监管层对金融去杠杆态度坚决，若监管力度不减，债市仍将面临调整，短期组合仍以短久期策略为主。

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。

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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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 21145 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	鑫元安鑫宝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安鑫宝货币市场基金(以下简称“鑫元安鑫宝货币基金”)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	编制和公允列报财务报表是鑫元安鑫宝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: (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,上述鑫元安鑫宝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,公允反映了鑫元安鑫宝货币基金 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：鑫元安鑫宝货币市场基金

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		70,696,901.00	319,474.61
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		313,836,748.43	159,828,312.18
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		313,836,748.43	159,828,312.18
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		454,222,372.84	119,266,858.91
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,797,076.36	2,284,440.58
应收股利		-	-
应收申购款		28,504,110.31	65,440,514.79
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		870,057,208.94	347,139,601.07
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		25,649,761.52	4,999,877.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		203,242.99	8,286.22
应付托管费		49,271.04	22,096.59
应付销售服务费		153,971.95	13,810.36
应付交易费用		35,062.21	17,683.73

应交税费		-	-
应付利息		4,335.68	345.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		149,000.00	219,000.00
负债合计		26,244,645.39	5,281,100.09
所有者权益：			
实收基金		843,812,563.55	341,858,500.98
未分配利润		-	-
所有者权益合计		843,812,563.55	341,858,500.98
负债和所有者权益总计		870,057,208.94	347,139,601.07

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 843,812,563.55 份，全部为 B 类基金份额。

7.2 利润表

会计主体：鑫元安鑫宝货币市场基金

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		18,556,539.97	4,883,279.92
1.利息收入		17,605,841.00	4,410,012.21
其中：存款利息收入		4,065,138.97	1,738,881.41
债券利息收入		7,638,524.83	1,633,555.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,902,177.20	1,037,575.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		949,758.97	473,267.71
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		949,758.97	473,267.71
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）		940.00	-
减：二、费用		4,933,507.86	628,310.90
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,470,075.03	59,032.95
2. 托管费	7.4.8.2.2	419,026.92	109,088.27
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	1,207,271.70	80,263.41
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		1,499,734.21	154,326.27
其中：卖出回购金融资产支出		1,499,734.21	154,326.27
6. 其他费用		337,400.00	225,600.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,623,032.11	4,254,969.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,623,032.11	4,254,969.02

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元安鑫宝货币市场基金

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 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）	341,858,500.98	-	341,858,500.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	13,623,032.11	13,623,032.11
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）	501,954,062.57	-	501,954,062.57
其中：1. 基金申购款	16,842,155,462.41	-	16,842,155,462.41
2. 基金赎回款	-16,340,201,399.84	-	-16,340,201,399.84
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）	-	-13,623,032.11	-13,623,032.11

五、期末所有者权益（基金净值）	843,812,563.55	-	843,812,563.55
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)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）	200,363,082.18	-	200,363,082.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,254,969.02	4,254,969.02
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）	141,495,418.80	-	141,495,418.80
其中：1. 基金申购款	2,680,641,632.80	-	2,680,641,632.80
2. 基金赎回款	-2,539,146,214.00	-	-2,539,146,214.00
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）	-	-4,254,969.02	-4,254,969.02
五、期末所有者权益（基金净值）	341,858,500.98	-	341,858,500.98

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
基金管理人负责人

陈宇
主管会计工作负责人

包颖
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鑫元安鑫宝货币市场基金(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”)证监许可[2015]1246号《关于准予鑫元安鑫宝货币市场基金注册的批复》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《鑫元安鑫宝货币市场基金基金合同》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200,363,082.18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(2015)第835号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元安鑫宝货币市场基金基金合同》于2015年6月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,363,082.18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，基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《鑫元安鑫宝货币市场基金基金合同》和《鑫元安鑫宝货币市场基金招募说明书》的相关规定，本基金设 A 类基金份额和 B 类基金份额，其中 A 类份额尚未开放，B 类份额通过南京银行股份有限公司面向签约客户销售。在认购期内，鑫元安鑫宝货币基金仅发售 B 类基金份额。投资者可自行选择认申购的基金份额类别，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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，包括现金，通知存款，短期融资券(包括超级短期融资券)，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(包括证券公司短期公司债券)、资产支持证券、中期票据以及中国证监会、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》、《鑫元安鑫宝货币市场基金基金合同》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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间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
恒丰银行股份有限公司（“恒丰银行”）	基金托管人
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

注：无。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,470,075.03	59,032.95
其中：支付销售机构的客户维护费	368,169.55	14,756.16

注：1、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 × 0.33% / 当年天数。

2、根据《鑫元基金管理有限公司关于降低鑫元安鑫宝货币市场基金管理费及销售服务费的公告》的相关规定，本基金自 2015 年 7 月 8 日起调低本基金 B 类份额的基金管理费及销售服务费，并自 2016 年 1 月 9 日起逐步恢复收取本基金 B 类份额的基金管理费及销售服务费。自 2015 年 7 月 8 日至 2016 年 1 月 8 日，本基金 B 类份额的管理费按前一日基金资产净值的 0.03%年费率计提。自 2016 年 1 月 9 日起，本基金的管理费年费率逐月递增 0.05%直至恢复至原来的 0.33%，即自 2016 年 6 月 9 日起恢复为管理费按前一日基金资产净值 0.33%年费率计提。

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 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	419,026.92	109,088.27

注：支付基金托管人恒丰银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08%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 0.08% / 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 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		
	鑫元安鑫宝 A	鑫元安鑫宝 B	合计
鑫元基金	-	28,570.95	28,570.95
南京银行	-	1,176,762.81	1,176,762.81
合计	-	1,205,333.76	1,205,333.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元安鑫宝 A	鑫元安鑫宝 B	合计
南京银行	-	80,263.41	80,263.41
合计	-	80,263.41	80,263.41

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，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。其计算公式为：

日基金销售服务费=前一日基金资产净值 x 0.25% / 当年天数。

2、根据《鑫元基金管理有限公司关于降低鑫元安鑫宝货币市场基金管理费及销售服务费的公告》的相关规定，本基金自 2015 年 7 月 8 日起调低本基金 B 类份额的基金管理费及销售服务费，并自 2016 年 1 月 9 日起逐步恢复收取本基金 B 类份额的基金管理费及销售服务费。自 2015 年 7 月 8 日至 2016 年 1 月 8 日，本基金 B 类份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.05%年费率计提。自 2016 年 1 月 9 日起，本基金的销售服务费年费率逐月递增 0.05%直至恢复至原来的 0.25%，即自 2016 年 4 月 9 日起恢复为按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。

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

本期

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 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
恒丰银行	-	-	-	-	49,800,000.00	5,461.14
上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 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

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

鑫元安鑫宝 B
份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
南京银行	53,833.11	0.0064%	52,431.72	0.0200%

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)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
恒丰银行—活期	696,901.00	10,614.71	319,474.61	7,185.58
恒丰银行—定期	-	-	-	128,333.33

注：本基金的活期银行存款和表格中列示的定期存款由基金托管人恒丰银行保管，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

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：无。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 25,649,761.52 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
120307	12 进口 07	2017 年 1 月 3 日	100.16	200,000	20,032,000.00
160204	16 国开 04	2017 年 1 月 3 日	99.97	70,000	6,997,900.00
合计				270,000	27,029,900.00

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 313,836,748.43 元，无属于第一或第三层次的余额。（2015 年 12 月 31 日：第二层次 159,828,312.18 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	313,836,748.43	36.07
	其中：债券	313,836,748.43	36.07
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	454,222,372.84	52.21
	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	70,696,901.00	8.13
4	其他各项资产	31,301,186.67	3.60
5	合计	870,057,208.94	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	12.41

	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	25,649,761.52	3.04
	其中：买断式回购融资	-	-

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 6 月 24 日	21.07	巨额赎回	2016 年 6 月 27 日
2	2016 年 6 月 28 日	21.08	巨额赎回	2016 年 6 月 29 日
3	2016 年 7 月 12 日	23.20	巨额赎回	2016 年 7 月 13 日
4	2016 年 7 月 26 日	22.94	巨额赎回	2016 年 7 月 28 日
5	2016 年 7 月 27 日	21.65	巨额赎回	2016 年 7 月 28 日
6	2016 年 8 月 9 日	23.17	巨额赎回	2016 年 8 月 10 日
7	2016 年 8 月 16 日	25.30	巨额赎回	2016 年 8 月 17 日
8	2016 年 10 月 11 日	21.77	巨额赎回	2016 年 10 月 12 日
9	2016 年 11 月 15 日	20.04	巨额赎回	2016 年 11 月 16 日

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。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。

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	40
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

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净值比例（%）	各期限负债占基金资产净值比例（%）
----	--------	-------------------	-------------------

1	30 天以内	58.84	3.04
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	15.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	7.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	10.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	7.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.40	3.04

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	46,005,724.72	5.45
	其中：政策性金融债	46,005,724.72	5.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	29,997,582.07	3.56
6	中期票据	-	-
7	同业存单	237,833,441.64	28.19
8	其他	-	-
9	合计	313,836,748.43	37.19
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	011698139	16 陆家嘴 SCP001	300,000	29,997,582.07	3.56
2	120307	12 进出 07	200,000	20,006,818.27	2.37
3	111695137	16 哈尔滨银行 CD013	200,000	19,988,445.11	2.37
4	160204	16 国开 04	200,000	19,974,036.63	2.37
5	111699483	16 广东南粤银行 CD102	200,000	19,935,085.47	2.36
6	111680037	16 台州银行 CD022	200,000	19,920,926.03	2.36
7	111680488	16 九江银行 CD096	200,000	19,902,854.83	2.36
8	111697960	16 桂林银行 CD076	200,000	19,856,481.24	2.35
9	111681657	16 长安银行 CD066	200,000	19,850,785.71	2.35
10	111698253	16 赣州银行 CD019	200,000	19,822,738.13	2.35

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	1
报告期内偏离度的最高值	0.1905%
报告期内偏离度的最低值	-0.2693%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0933%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
-	2016 年 12 月 20 日	-0.2693%	市场波动收益率大幅上行	2016-12-21

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

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,797,076.36
4	应收申购款	28,504,110.31
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	31,301,186.67

§ 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 安鑫 宝 A	-	-	-	-	-	-
鑫元 安鑫 宝 B	69,331	12,170.78	362,389,435.11	42.95%	481,423,128.44	57.05%
合计	69,331	12,170.78	362,389,435.11	42.95%	481,423,128.44	57.05%

注：本基金 A 类份额暂未开放。

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	鑫元安鑫宝 A	-	-
	鑫元安鑫宝 B	791,583.55	0.0938%
	合计	791,583.55	0.0938%

注：本基金 A 类份额暂未开放。

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	鑫元安鑫宝 A	0
	鑫元安鑫宝 B	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	鑫元安鑫宝 A	0
	鑫元安鑫宝 B	10~50
	合计	10~50

注：本基金 A 类份额暂未开放。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	鑫元安鑫宝 A	鑫元安鑫宝 B
--	---------	---------

基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）基金份额总额	-	200,363,082.18
本报告期期初基金份额总额	-	341,858,500.98
本报告期基金总申购份额	-	16,842,155,462.41
减:本报告期基金总赎回份额	-	16,340,201,399.84
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	-	843,812,563.55

§ 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

本报告期内本基金投资策略无改变。

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 60,000.00 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 2 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	
中信证券	2	-	-	10,316.00	100.00%	-

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: 无。

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
中信证券	-	-	1,031,600,000.00	100.00%	-	-

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