

# 鑫元合享分级债券型证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本半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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
<sup>3.1</sup> 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 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.....	40
7.9 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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40

7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 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.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元合享分级债券型证券投资基金	
基金简称	鑫元合享分级债券	
基金主代码	000813	
基金运作方式	契约型	
基金合同生效日	2014 年 10 月 15 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	591,604,162.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鑫元合享分级债券 A	鑫元合享分级债券 B
下属分级基金的交易代码:	000814	000815
报告期末下属分级基金的份额总额	411,590,762.82 份	180,013,400.00 份

### 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，通过合理配置债券等固定收益类金融工具并进行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	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。	
业绩比较基准	二年期银行定期存款收益率（税后）+1%	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金、但高于货币市场基金。	
	鑫元合享分级债券 A	鑫元合享分级债券 B
下属分级基金的风险收益特征	从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，合享 A 将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。	从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，合享 B 则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

### 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	张建春
	联系电话	021-20892000 转	010-63639180
	电子邮箱	service@xyamc.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		4006066188	95595
传真		021-20892111	010-63639132
注册地址		上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 31 楼	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		上海市静安区中山北路 909 号 12 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		束行农	唐双宁

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	上海市静安区中山北路 909 号 12 层 鑫元基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鑫元基金管理有限公司	上海市静安区中山北路 909 号 12 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,847,724.21
本期利润	8,740,127.09
加权平均基金份额本期利润	0.0161
本期加权平均净值利润率	1.55%
本期基金份额净值增长率	1.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	30,542,363.93
期末可供分配基金份额利润	0.0516
期末基金资产净值	613,192,467.38
期末基金份额净值	1.036

3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	6.23%

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。

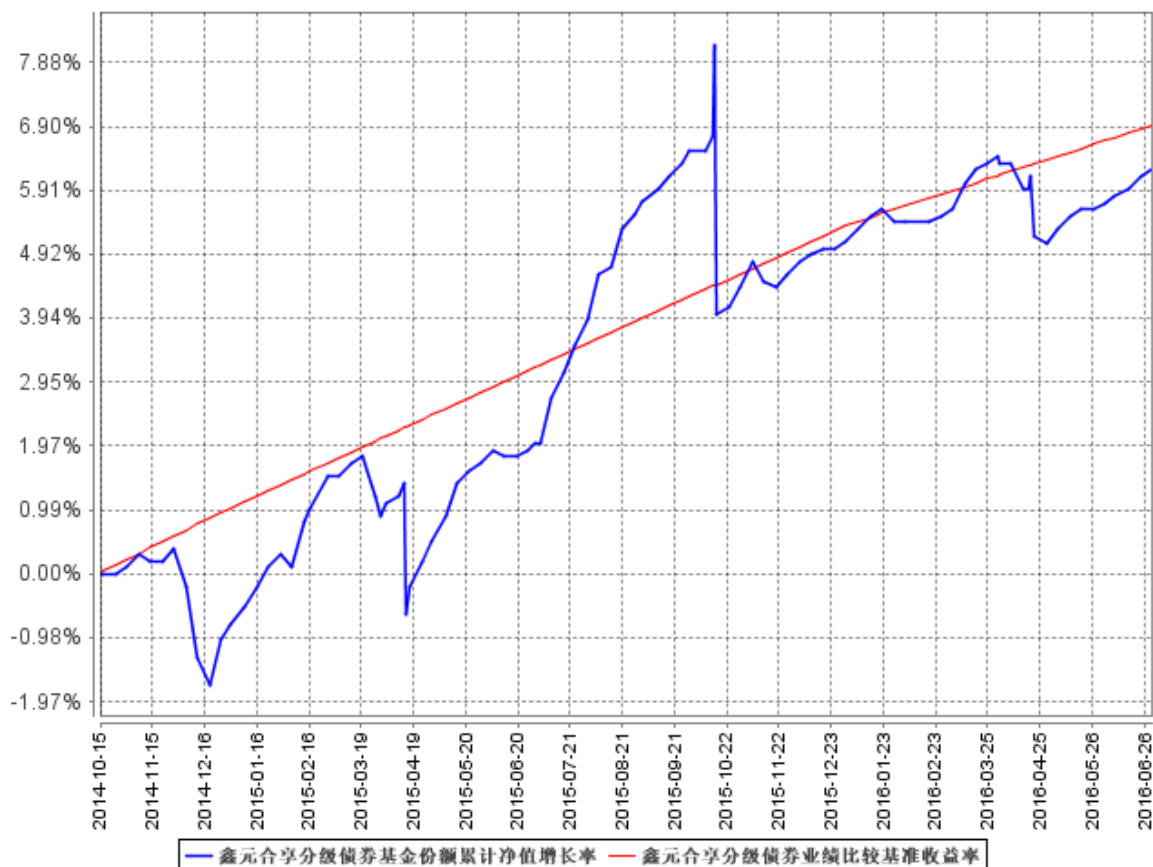
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去一个月	0.58%	0.04%	0.29%	0.01%	0.29%	0.03%
过去三个月	-0.19%	0.27%	0.77%	0.02%	-0.96%	0.25%
过去六个月	1.06%	0.23%	1.54%	0.02%	-0.48%	0.21%
过去一年	4.14%	0.60%	3.73%	0.02%	0.41%	0.58%
自基金合同生效起至今	6.23%	0.54%	6.91%	0.02%	-0.68%	0.52%

### 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

鑫元合享分级债券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 10 月 15 日。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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 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 6 月 30 日，公司旗下管理 12 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、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。

#### 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、鑫元合享债券型证券投资基金、鑫元合丰分级债券型证券投资基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理；基金投资决策委	2016年3月2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；同时兼任基金投资决策委员会委员。

	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、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	2014 年 10 月 15 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

	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	2014 年 10 月 20 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

	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、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					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；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。

#### 4.3.2 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

本基金一直秉持控制风险为首要地位的操作思路，一方面将久期锁定在一定区间内，另一方面降低杠杆水平。总体来看，在调整过程中，本基金的回撤度较小，运行较为平稳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鑫元合享分级债券的基金份额净值增长率为 1.06%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年一季度资金面的波动性较去年四季度明显加大，央行投放流动性的目的更多是对冲操作，一季度末资金压力凸显，除了惯常的季末效应外，首次 MPA 考核关注广义信贷增速，质押式逆回购被纳入考核从而抑制了银行的资金融出意愿，地产销售火爆信贷提速释放，加上央行谨慎操作，令资金面承压。高等级短融收益率一季度整体变化不大，仍在低位徘徊。

一季度末及二季度初经济回升力度和信贷投放明显超预期，直接导致二季度货币政策宽松边际减缓以及信贷投放的收缩，同时在猪周期和大宗商品价格大涨的带动下，部分投资者开始担忧通胀是否会抑制货币政策的宽松节奏，同时，监管层也加大金融杠杆的监管以及市场对人民币汇

率信心不足，另外，经济的结构性下行形成债市的结构性违约压力开始凸显，直接导致二季度债市出现较大幅度的调整。另一方面，五月以来，市场配置压力依然偏大，加上英国脱欧等多件黑天鹅事件影响，债券收益率趋势向下，结合我们对基本面，货币政策和供需关系的分析来看，我们认为今年债券收益率仍有下行空间。收益率曲线后续可能牛市变陡。

#### 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。成员包括首席营运官、首席投资官、督察长、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、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，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同相关约定，在分级运作存续期内，本基金（包括合享 A 与合享 B）不进行收益分配。

#### 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

2016 年上半年度，中国光大银行在鑫元合享分级债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵

守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对鑫元合享分级债券型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2016 年上半年度，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——鑫元基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际情况进行处理。

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

中国光大银行依法对基金管理人——鑫元基金管理有限公司编制的“鑫元合享分级债券型证券投资基金 2016 年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：鑫元合享分级债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	489,054.67	99,908.32
结算备付金		728,129.49	12,680,606.44
存出保证金		8,964.32	10,512.06
交易性金融资产	6.4.7.2	572,235,812.00	644,434,431.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		572,235,812.00	644,434,431.50

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	90,160,455.24	-
应收证券清算款		62,000,000.00	-
应收利息	6.4.7.5	11,973,869.99	13,416,657.76
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		737,596,285.71	670,642,116.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		124,036,108.98	130,498,695.00
应付证券清算款		-	26,101.83
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		200,322.53	183,085.16
应付托管费		50,080.63	45,771.26
应付销售服务费		33,946.14	28,978.76
应付交易费用	6.4.7.7	14,705.24	72,949.43
应交税费		-	-
应付利息		4,010.23	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	64,644.58	130,000.00
负债合计		124,403,818.33	130,985,581.44
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	560,268,952.87	500,426,944.83
未分配利润	6.4.7.10	52,923,514.51	39,229,589.81
所有者权益合计		613,192,467.38	539,656,534.64
负债和所有者权益总计		737,596,285.71	670,642,116.08

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金的份额净值 1.036 元，A 类基金份额净值 1.008 元，B 类基金份额净值 1.102 元；基金份额总额 591,604,162.82 份，其中，A 类基金份额总额 411,590,762.82 份；B 类基金份额总额 180,013,400.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鑫元合享分级债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日



单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		10,937,880.18	25,409,070.54
1.利息收入		15,002,026.30	18,404,709.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	81,005.08	106,062.76
债券利息收入		14,341,529.55	18,278,132.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		579,491.67	20,513.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,956,549.00	-3,397,875.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,956,549.00	-3,397,875.56
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,892,402.88	10,402,236.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		2,197,753.09	4,554,652.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,131,017.07	936,489.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	282,754.18	234,122.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	184,491.30	145,736.36
4. 交易费用	6.4.7.19	4,970.66	9,696.48
5. 利息支出		511,075.30	3,151,641.22
其中：卖出回购金融资产支出		511,075.30	3,151,641.22
6. 其他费用	6.4.7.20	83,444.58	76,966.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,740,127.09	20,854,418.39
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,740,127.09	20,854,418.39

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鑫元合享分级债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	500,426,944.83	39,229,589.81	539,656,534.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,740,127.09	8,740,127.09
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）	59,842,008.04	4,953,797.61	64,795,805.65
其中：1. 基金申购款	95,792,675.39	7,893,858.64	103,686,534.03
2. 基金赎回款	-35,950,667.35	-2,940,061.03	-38,890,728.38
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）	560,268,952.87	52,923,514.51	613,192,467.38
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	600,013,400.00	-5,022,091.99	594,991,308.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,854,418.39	20,854,418.39
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）	-312,930,693.00	-10,526,658.89	-323,457,351.89
其中：1. 基金申购款	63,021,414.00	-	63,021,414.00
2. 基金赎回款	-375,952,107.00	-10,526,658.89	-386,478,765.89

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）	287,082,707.00	5,305,667.51	292,388,374.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鑫元合享分级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]942号《关于核准鑫元合享分级债券型证券投资基金注册的批复》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《鑫元合享分级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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 599,999,000.00 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 598 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元合享分级债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 10 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 600,013,400.00 份,其中认购资金利息折合 14,400.00 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《鑫元合享分级债券型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金通过基金收益分配的安排,将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别,即合享 A 基金份额(基金份额简称“合享 A”)与合享 B 基金份额(基金份额简称“合享 B”)。其中,合享 A 根据基金合同的规定获取约定收益,扣除合享 A 的本金、应计约定收益后的全部剩余收益归合享 B 享有,亏损以合享 B 的资产净值为限由合享 B 承担。除基金合同终止时的基金清算财产分配外,每份合享 A 和每份合享 B 享有同等的权利和义务。合享 A 与合享 B 分别募集并按照基金合同约定的比例进行初始配比,所募集的两级基金的基金资产合并运作。

本基金在分级运作存续期内,以“2 年分级运作周期”滚动方式运作。分级运作周期为自分级运作周期起始日(首个分级运作周期起始日为基金合同生效日)起至 2 年后的对应日(该对应日及该对应日的前后一日应均为工作日,如该对应日不符合此条件,则顺延至符合该条件的首个工

作日，下同)止。自基金合同生效之日起，在任一分级运作周期内自分级运作周期起始日起每满 6 个月的对应日为合享 A 的申购开放日，前一日为合享 A 的赎回开放日。基金管理人仅在申购、赎回开放日接受合享 A 的申购、赎回申请。合享 B 在分级运作周期内封闭运作，且不上市交易。其中，在任一分级运作周期到期日当日(即自分级运作周期起始日起至 2 年后的对应日)及其前一日，基金管理人将不接受合享 A 的申购与赎回申请。自分级运作周期到期日后的第一个工作日起，进入本基金的过渡期，在过渡期的开放日内本基金接受合享 A 与合享 B 的申购与赎回申请。在接受过渡期的申购时，基金管理人有权根据基金份额上限和两级份额配比进行规模控制，其中过渡期内合享 A 与合享 B 的两级基金份额配比不超过 7:3。

在本基金任一分级运作周期内，合享 A 和合享 B 将根据基金合同的规定进行各级基金份额的折算。其中，合享 A 的前 3 个基金份额折算基准日为合享 A 的申购开放日(即在任一分级运作周期内分级运作周期起始日每满 6 个月的对应日)，第 4 个折算基准日为分级运作周期到期日；合享 B 的基金份额折算基准日为分级运作周期到期日。折算基准日日终，合享 A 和合享 B 的基金份额净值将调整为 1.000 元，折算后基金份额持有人所持有的合享 A 和合享 B 的份额数按照折算比例相应增减。

根据《鑫元合享分级债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，在过渡期内合享 B 最后一个申购开放日日终，若合享 B 的基金资产净值等于或小于 3,000 万元，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金无须召开基金份额持有人大会，将于合享 B 最后一个申购开放日后次个工作日直接转型为普通开放式债券型证券投资基金，即“鑫元合享纯债债券型证券投资基金”，份额分级运作终止，转型后基金的投资管理，包括投资范围、投资策略等均保持不变。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元合享分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，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、协议存款、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金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(在分级运作存续期内，在本基金分级运作周期内任一开放日、任一开放日前十个工作日和后十个工作日以及过渡期开始前十个工作日和结束后十个工作日，本基金可不受上述限制)。在每个分级运作周期内的每个开放日，现金或者到期日在一年内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金不参与买入股票和权证。本基金的业绩比较基准为：二年期银行定期存款收益率(税后)+1%。

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 2016 年 8 月 23 日批准报出。

## 6.4.2 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》、《鑫元合享分级债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半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 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年半年度经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括债券的差价收入,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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	489,054.67
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	489,054.67

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	188,688,818.95	191,909,612.00
	银行间市场	375,660,340.23	380,326,200.00
	合计	564,349,159.18	572,235,812.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	564,349,159.18	572,235,812.00	7,886,652.82

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

买入返售证券_银行间	90,160,455.24	-
合计	90,160,455.24	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	769.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	294.93
应收债券利息	11,845,341.71
应收买入返售证券利息	127,459.96
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.69
合计	11,973,869.99

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,325.05
银行间市场应付交易费用	9,380.19
合计	14,705.24

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

预提费用	64,644.58
合计	64,644.58

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元合享分级债券 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	338,493,282.33	320,413,544.83
本期申购	103,686,534.03	95,792,675.39
本期赎回(以“-”号填列)	-37,979,229.05	-35,950,667.35
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	7,390,175.51	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	411,590,762.82	380,255,552.87

金额单位：人民币元

鑫元合享分级债券 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	180,013,400.00	180,013,400.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	180,013,400.00	180,013,400.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,897,027.21	18,332,562.60	39,229,589.81
本期利润	6,847,724.21	1,892,402.88	8,740,127.09
本期基金份额交易产生的变动数	2,797,612.51	2,156,185.10	4,953,797.61
其中：基金申购款	4,414,282.84	3,479,575.80	7,893,858.64
基金赎回款	-1,616,670.33	-1,323,390.70	-2,940,061.03



本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,542,363.93	22,381,150.58	52,923,514.51

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
活期存款利息收入	27,304.67	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	53,614.30	
其他	86.11	
合计	81,005.08	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,956,549.00	
债券投资收益——赎回差价收入	-	
债券投资收益——申购差价收入	-	
合计	-5,956,549.00	

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	415,539,132.80	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	409,678,660.68	

减：应收利息总额	11,817,021.12
买卖债券差价收入	-5,956,549.00

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：无。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	1,892,402.88
——股票投资	-
——债券投资	1,892,402.88
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,892,402.88

#### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,495.66
银行间市场交易费用	3,475.00
合计	4,970.66

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	34,809.32
其他	800.00
债券账户维护费	18,000.00
合计	83,444.58

**6.4.7.21 分部报告**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

无。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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
中国光大银行股份有限公司(“光大银行”)	基金托管人

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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,131,017.07	936,489.16
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.4% 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 × 0.4% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	282,754.18	234,122.33

注：支付基金托管人光大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。

### 6.4.10.2.3 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6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元合享分级债券 A	鑫元合享分级债券 B	合计
鑫元基金	178,524.42	-	178,524.42
合计	178,524.42	-	178,524.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元合享分级债券 A	鑫元合享分级债券 B	合计
鑫元基金	145,736.36	-	145,736.36
合计	145,736.36	-	145,736.36

注：在任一分级运作周期内，合享 A 基金份额的销售服务费年费率为 0.1%，合享 B 基金份额不收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日合享 A 基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 A 类基金份额基金资产净值 x 0.1% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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。

#### 6.4.10.4.2 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。

### 6.4.10.5 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6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	489,054.67	27,304.67	1,095,217.75	16,117.08

注：本基金的活期存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无。

#### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2016 年 6 月 30 日，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 62,036,728.98 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
011599799	15 宁设备 SCP001	2016 年 7 月 1 日	100.61	400,000	40,244,000.00
101662017	16 新业国资 MTN001	2016 年 7 月 1 日	99.73	263,000	26,228,990.00
合计				663,000	66,472,990.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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 61,999,380.00 元，于 2016 年 7 月 1 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，投资于各类具有良好流动性的金融工具，属于证券投资基金中的较低风险品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是实现“在严格控制风险和保证适当流动性的前提下，通过合理配置债券等固定收益类金融工具并进行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”的投资目标。

本基金的基金管理人实行全员风险管理，风险管理是公司所有部门、全体员工的应尽职责。公司建立董事会、经营管理层、独立风险管理部门、业务部门四级风险管理组织架构，并分别明确风险管理职能与责任。董事会对公司的风险管理负有最终责任，董事会下设风险控制与合规审计委员会，负责研究、确定公司风险管理理念，指导公司风险管理体系的建设；经营管理层负责组织、部署风险管理工作，经营管理层设风险控制委员会，负责确定风险管理理念、原则、目标和方法，促进风险管理环境、文化的形成，组织风险管理体系建设，审议风险管理制度和流程，审议重大风险事件；监察稽核部作为独立风险管理部门负责协同相关业务部门落实投资风险、操作风险、合规风险、道德风险等各类风险的控制和管理，督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作；各业务部门负责根据职能分工贯彻落实风险管理程序，执行风险管理措施。根据风险管理工作要求，各业务部门健全完善规章制度和操作流程，严格遵守风险管理制度、流程和限额，严格执行从风险识别、风险测量、风险控制、风险评价到风险报告的风险管理程序，对本部门发生风险事件承担直接责任，及时、准确、全面、客观地将本部门及本部门发现的风险信息向风险管理部门报告。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.2.1 本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	20,312,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	180,650,000.00	230,905,000.00
合计	180,650,000.00	251,217,000.00

注：未评级债券为超级短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	20,402,000.00	20,278,000.00
AAA 以下	340,241,812.00	372,939,431.50
未评级	30,942,000.00	0.00
合计	391,585,812.00	393,217,431.50

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于赎回开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于申购及赎回开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基



金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 124,036,108.98 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	489,054.67	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	489,054.67
结算 备付	728,129.49	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	728,129.49

金							
存出保证金	8,964.32	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	8,964.32
交易性金融资产	90,484,000.00	33,284,700.00	76,339,000.00	258,473,200.00	113,654,912.00	0.00	572,235,812.00
买入返售金融资产	90,160,455.24	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	90,160,455.24
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	62,000,000.00	62,000,000.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	11,973,869.99	11,973,869.99
资产总计	181,870,603.72	33,284,700.00	76,339,000.00	258,473,200.00	113,654,912.00	73,973,869.99	737,596,285.71
负债							
卖出回购金融资产款	124,036,108.98	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	124,036,108.98
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	200,322.53	200,322.53
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	50,080.63	50,080.63
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	33,946.14	33,946.14
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	14,705.24	14,705.24

应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	4,010.23	4,010.23
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	64,644.58	64,644.58
负债总计	124,036,108.98	0.00	0.00	0.00	0.00	367,709.35	124,403,818.33
利率敏感度缺口	57,834,494.74	33,284,700.00	76,339,000.00	258,473,200.00	113,654,912.00	73,606,160.64	613,192,467.38
上年度末 2015年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	99,908.32	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	99,908.32
结算备付金	12,680,606.44	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	12,680,606.44
存出保证金	10,512.06	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10,512.06
交易性金融资产	0.00	141,000,000.00	113,434,800.00	275,876,103.50	114,123,528.00	0.00	644,434,431.50
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	13,416,657.76	13,416,657.76
资产总计	12,791,026.82	141,000,000.00	113,434,800.00	275,876,103.50	114,123,528.00	13,416,657.76	670,642,116.08
负债							

卖出回购金融资产款	130,498,695.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	130,498,695.00
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	26,101.83	26,101.83
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	183,085.16	183,085.16
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	45,771.26	45,771.26
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	28,978.76	28,978.76
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	72,949.43	72,949.43
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	130,000.00	130,000.00
负债总计	130,498,695.00	0.00	0.00	0.00	0.00	486,886.44	130,985,581.44
利率敏感度缺口	-117,707,668.18	141,000,000.00	113,434,800.00	275,876,103.50	114,123,528.00	12,929,771.32	539,656,534.64

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降25个基点	3,044,901.38	2,962,602.31

	市场利率上升 25 个基点	-3, 027, 736. 53	-2, 946, 431. 59
--	---------------	------------------	------------------

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，且本期期末未持有股票，因此无重大市场价格风险(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14 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 6 月 30 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 572, 235, 812. 00 元，无属于第一、三层次的余额。(2015 年 12 月 31 日：第二层次 644, 434, 431. 50 元，无第一、三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，本基金根据《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》，于 2015 年 3 月 26 日起改为采用中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 6 月 30 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	572,235,812.00	77.58
	其中：债券	572,235,812.00	77.58
	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	90,160,455.24	12.22
	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	1,217,184.16	0.17
7	其他各项资产	73,982,834.31	10.03
8	合计	737,596,285.71	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

#### 7.2.2 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股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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。

### 7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,942,000.00	5.05
	其中：政策性金融债	30,942,000.00	5.05
4	企业债券	258,656,812.00	42.18
5	企业短期融资券	180,650,000.00	29.46
6	中期票据	101,987,000.00	16.63
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	572,235,812.00	93.32

### 7.6 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	122464	15 世茂 01	500,000	50,395,000.00	8.22
2	011557002	15 中电 SCP002	500,000	50,240,000.00	8.19
3	011599799	15 宁设备 SCP001	400,000	40,244,000.00	6.56
4	011699558	16 清华 SCP002	400,000	40,028,000.00	6.53
5	150313	15 进出 13	300,000	30,942,000.00	5.05

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明**

无。

**7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明**

无。

### 7.12.3 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	8,964.32
2	应收证券清算款	62,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	11,973,869.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,982,834.31

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
鑫元合享分级债券A	1,946	211,506.04	388,000,000.00	94.27%	23,590,762.82	5.73%
鑫元合享分级债券B	1	180,013,400.00	180,013,400.00	100.00%	0.00	0.00%
合计	1,947	303,854.22	568,013,400.00	96.01%	23,590,762.82	3.99%

### 8.2 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	鑫元合享分级债券 A	51,141.40	0.0124%
	鑫元合享分级债券 B	-	-
	合计	51,141.40	0.0086%

### 8.3 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	鑫元合享分级债券 A	0~10
	鑫元合享分级债券 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元合享分级债券 A	0
	鑫元合享分级债券 B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元合享分级债券 A	鑫元合享分级债券 B
基金合同生效日(2014 年 10 月 15 日) 基金份额总额	420,000,000.00	180,013,400.00
本报告期期初基金份额总额	338,493,282.33	180,013,400.00
本报告期基金总申购份额	103,686,534.03	-
减:本报告期基金总赎回份额	37,979,229.05	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	7,390,175.51	-
本报告期末基金份额总额	411,590,762.82	180,013,400.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

## 10.2 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 9 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》，自 2016 年 4 月 8 日起王辉先生担任公司副总经理职务；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高级管理人员变更公告》，自 2016 年 4 月 15 日起李湧先生不再担任总经理职务，并由董事长束行农先生代理总经理职务；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》，自 2016 年 5 月 19 日起李雁女士担任公司副总经理职务。

### 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。

## 10.3 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。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

- 1、本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受稽查或处罚。
- 2、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
中金公司	2	-	-	19,199.51	37.75%	-
中信证券	2	-	-	3,150.27	6.19%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

广发证券	2	-	-	20,430.26	40.17%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	8,077.64	15.88%	-

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) 营运支持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，并及时通知托管人。

（3）报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：新增券商交易单元：安信证券。

### 10.7.2 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
中金公司	12,010,294.97	11.39%	1,908,080,000.00	38.31%	-	-
中信证券	22,027,804.56	20.89%	293,100,000.00	5.88%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	31,401,775.25	29.77%	2,012,000,000.00	40.39%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	40,023,749.37	37.95%	768,000,000.00	15.42%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鑫元基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断调整旗下部分基金开放时间的	公司网站	2016 年 1 月 4 日

	临时公告		
2	鑫元基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断调整旗下部分基金开放时间的临时公告	公司网站	2016 年 1 月 7 日
3	公募基金 2015 年第 4 季度报告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2016 年 1 月 22 日
4	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 1 日
5	鑫元基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 2 日
6	公募基金 2015 年年度报告及摘要	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2016 年 3 月 25 日
7	鑫元基金管理有限公司关于鑫元合享分级债券型证券投资基金 A 新增数米基金、天天基金和好买基金为销售机构的公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 8 日
8	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	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 9 日
9	鑫元合享分级债券型证券投资基金之合享 A 开放申购、赎回业务公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 11 日
10	鑫元合享分级债券型证券投资基金之合享 A 开放申购、赎回业务公告	公司网站、证券日报	2016 年 4 月 14 日
11	鑫元合享分级债券型证券投资基金之合享 A 基金份额折算方案的公告	公司网站、证券日报	2016 年 4 月 14 日
12	鑫元基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 16 日

13	公募基金 2016 年第 1 季度报告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2016 年 4 月 21 日
14	鑫元合享分级债券型证券投资基金之合享 A 基金份额折算和申购与赎回结果的公告	公司网站、证券日报	2016 年 4 月 21 日
15	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因停牌变更估值方法的提示性公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 6 日
16	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 9 日
17	鑫元基金管理有限公司关于调整旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠方案的公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 10 日
18	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	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 20 日
19	鑫元合享分级债券型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）	公司网站	2016 年 5 月 30 日
20	鑫元合享分级债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 1 号）	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 30 日
21	鑫元基金管理有限公司及鑫沅资产管理有限公司关于办公地址变更的公告	公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 6 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元合享分级债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元合享分级债券型证券投资基金基金合同》；

- 3、《鑫元合享分级债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

## 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司  
2016 年 8 月 25 日