

财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月17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2018年1月1日起至2018年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

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情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金	
基金简称	财通资管鑫逸混合	
基金主代码	004888	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年08月30日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	218,213,341.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通资管鑫逸混合A	财通资管鑫逸混合C
下属分级基金的交易代码	004888	004889
报告期末下属分级基金的份额总额	196,978,021.39份	21,235,320.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。另外，本基金可投资于股票、权证等权益类资产，基金管理人将选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资，强化基金的获利能力，提高预期收益水平，以期达到收益增强的效果。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	财通证券资产管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱慧
	联系电话	021-20568207
	电子邮箱	qianh@ctzg.com
客户服务电话	95336	95599
传真	021-68753502	010-68121816
注册地址	浙江省杭州市上城区白云路26号143室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸东座F9
邮政编码	200122	100031
法定代表人	马晓立	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通证券资产管理有限公司	浙江省杭州市上城区四宜路22号四宜大院B幢
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

§ 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(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	财通资管鑫逸混合A	财通资管鑫逸混合C
本期已实现收益	803,027.00	-123,298.05
本期利润	2,454,991.52	-42,103.75
加权平均基金份额本期利润	0.0073	-0.0015
本期加权平均净值利润率	0.72%	-0.15%
本期基金份额净值增长率	-2.67%	-2.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-5,129,926.85	-600,886.16
期末可供分配基金份额利润	-0.0260	-0.0283
期末基金资产净值	191,848,094.54	20,634,434.00
期末基金份额净值	0.9740	0.9717
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-2.60%	-2.83%

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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

财通资管鑫逸混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一 个月	-4.10%	0.80%	-1.28%	0.25%	-2.82%	0.55%
过去三 个月	-5.99%	0.72%	-1.22%	0.23%	-4.77%	0.49%
过去六 个月	-2.67%	0.72%	-0.92%	0.23%	-1.75%	0.49%
自基金 合同生 效起至 今	-2.60%	0.60%	-0.67%	0.20%	-1.93%	0.40%

财通资管鑫逸混合C

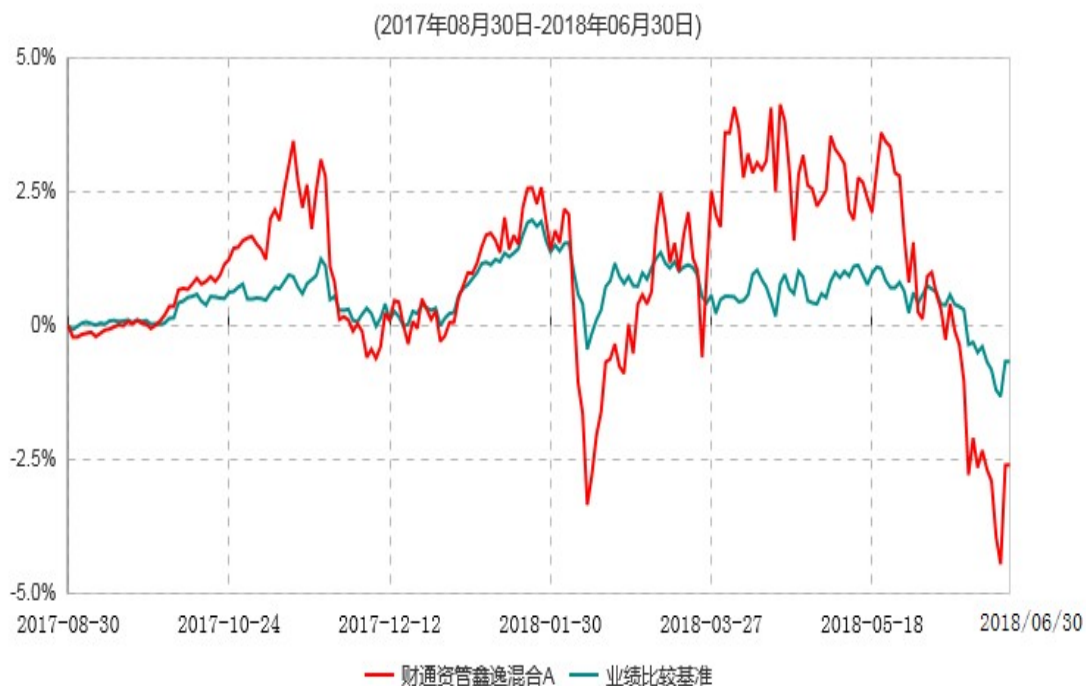
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一 个月	-4.12%	0.80%	-1.28%	0.25%	-2.84%	0.55%
过去三 个月	-6.05%	0.72%	-1.22%	0.23%	-4.83%	0.49%
过去六 个月	-2.82%	0.72%	-0.92%	0.23%	-1.90%	0.49%
自基金 合同生 效起至 今	-2.83%	0.60%	-0.67%	0.20%	-2.16%	0.40%

注：1、业绩比较基准：沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。

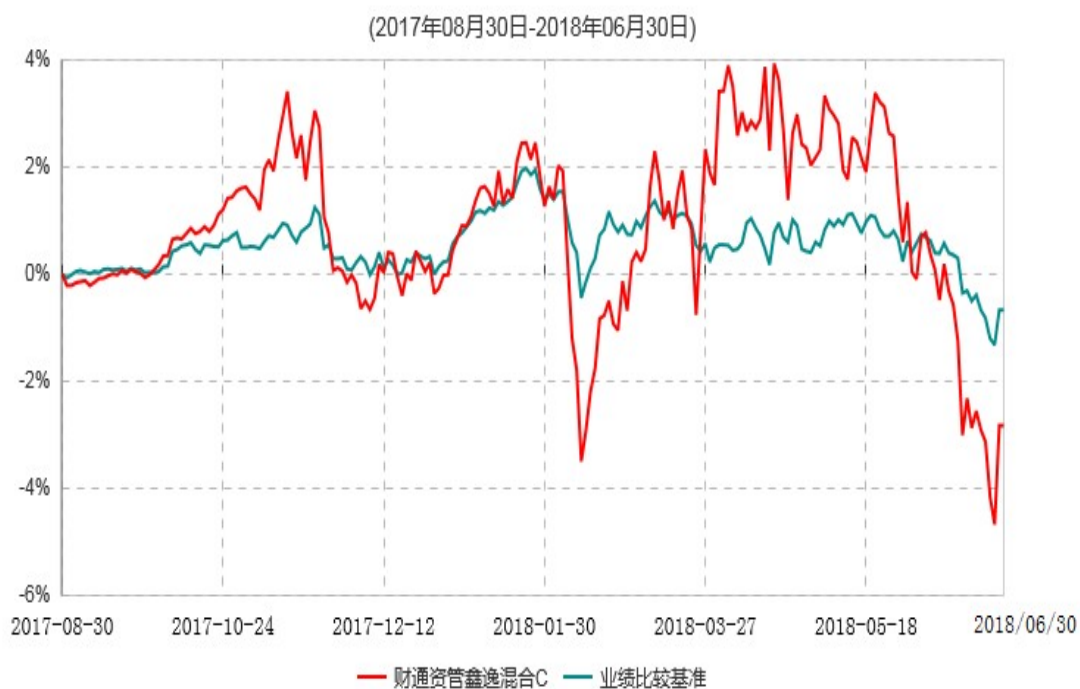
2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

财通资管鑫逸混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



财通资管鑫逸混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2017年8月30日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月，本基金已建仓完毕。截至建仓期结束，各项资产配置比例符合本基金基金合同约定。

3、自基金合同生效至报告期末，财通资管鑫逸混合A基金份额净值增长率为-2.60%，同期业绩比较

基准收益率为-0.67%；财通资管鑫逸混合C基金份额净值增长率为-2.83%，同期业绩比较基准收益率为-0.67%。

§ 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

财通证券资产管理有限公司系财通证券股份有限公司的全资子公司，注册资本2亿元人民币。2015年12月，公司获准开展公开募集证券投资基金管理业务。截至2018年6月30日，公司共管理9只基金，分别为财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金。

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		
宫志芳	本基金基金经理、 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金	2017-08-30	-	7	武汉大学数理金融硕士，中级经济师，2010年7月进入浙江泰隆银行资金运营部先后从事外汇交易和债券交易。2012年3月进入宁波通商银行金融市场部筹备债券业务，主要负责资金、债券投资交易，同时15年初筹备并开展贵金属自营业务；2016年3月加入财通证券资产管理有限公司。

	金和财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金经理				
杨坤	本基金基金经理、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金和财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金基金经理	2017-09-12	-	15	复旦大学工商管理硕士，基金从业10年。历任光大保德信基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理；中欧基金管理有限公司行业研究员、研究部副总监、专户事业部投资经理助理；海富通基金管理有限公司投资经理；富国基金管理有限公司投资经理。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，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，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

从基本面数据来看，上半年宏观经济并不乐观，尤其是需求数据持续弱势。生产数据在一季度之后迎来了短暂的恢复，6月份 PMI、发电量以及高炉开工等多项生产回暖，但需求数据回落并创出新低。生产和需求数据出现显著背离，6月上半月生产数据相继回落，经济增速承压明显。外部风险也在不断加剧，中美贸易摩擦不断升级，美元不断走强，人民币贬值压力陡增。而在6月下旬，央行在公开市场操作释放流动性的同时，进行力度较大的降准，通过货币形式来稳定市场情绪，刺激经济发展。同时，个税改革再次提上日程，进一步降低居民税负，进而提振消费、扩大内需；从政策面来看，去杠杆是今年上半年的政策主线，M2、社融等数据大幅走弱，与之伴随的是社会需求快速下降，信用违约频现，以及金融行业规模的收缩。短期来看，金融监管、市场对基本面和流动性预期仍是左右债市的主因，而债市在一系列利好因素支撑下，收益率震荡下行。中长期来看，在严监管、去杠杆背景下，社融持续回落，货币政策难收紧，而内外需不强影响消费，基建、地产和制造业投资增速在“紧信用”背景下或难超去年，叠加中美贸易摩擦不确定性较大影响进出口，下半年经济下行压力较大，债市慢牛格局仍在。

固收操作方面，上半年抓住市场机会卖出长久期债券置换部分短久期债券，适当控制整体杠杆及久期，同时辅以转债的波段操作，力保在保证安全性和流动性的前提下增厚整体收益。

权益策略：看好行业景气度得以维持、与经济周期弱相关的行业里管理能力优秀、风险转嫁能力强、治理机构良好的公司，具体包括与衣食住行用密切相关的泛消费领域，例如具有定价能力的大众消费品；科技行业（消费电子，计算机、传媒娱乐等）；此外，在医疗服务和健康领域的具有较高竞争壁垒的企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管鑫逸混合A基金份额净值为0.9740元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.67%，同期业绩比较基准收益率为-0.92%；截至报告期末财通资管鑫逸混合C基金份额净值为0.9717元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.82%，同期业绩比较基准收益率为-0.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政策层面，下半年去杠杆有望从缩减债务过渡到缩减债务与稳定经济增长混合搭配，货币政策有边际宽松的可能，后续可重点观察相关部门对于降准、社融、去杠杆路径的表述；基本面上下半年经济下行压力较大，债市慢牛格局仍在；权益方面，虽然股票价格短期会在一定程度上偏离公司的价值，但长期终将回归到基本面的投资逻辑，目前无论是从历史估值角度，还是上市公司盈利增速来判断，我们都认为现在是一个很好的投资时点。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议，由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内无利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—财通证券资产管理有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，财通证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，财通证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,193,248.32	6,421,771.74
结算备付金		776,740.74	6,370,158.44
存出保证金		230,528.70	254,895.84

交易性金融资产	6.4.7.2	239,824,954.48	622,645,807.65
其中：股票投资		83,634,396.28	200,905,175.35
基金投资		-	-
债券投资		156,190,558.20	421,740,632.30
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	-	84,736,867.11
应收证券清算款		7,306,474.36	-
应收利息	6.4.7.5	4,457,023.05	10,361,335.39
应收股利		-	-
应收申购款		10,904.84	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		253,799,874.49	730,790,836.17
负债和所有者权益	附注 号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
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		40,178,150.98	121,044,707.95
应付证券清算款		-	3,793,761.87
应付赎回款		294,803.95	1,082,597.77
应付管理人报酬		116,256.37	345,700.49
应付托管费		26,828.40	79,777.03
应付销售服务费		3,468.64	12,893.07
应付交易费用	6.4.7.7	454,845.48	916,668.81
应交税费		20,078.83	-
应付利息		62,505.68	10,937.87
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	160,407.62	177,045.12
负债合计		41,317,345.95	127,464,089.98
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	218,213,341.55	602,973,494.76
未分配利润	6.4.7.1 0	-5,730,813.01	353,251.43
所有者权益合计		212,482,528.54	603,326,746.19
负债和所有者权益总计		253,799,874.49	730,790,836.17

注：报告截止日2018年6月30日，A类基金份额净值0.9740元，C类基金份额净值0.9717元；基金份额总额218,213,341.55份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额196,978,021.39份，C类基金份额总额21,235,320.16份。

6.2 利润表

会计主体：财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		8,218,491.39
1. 利息收入		8,520,008.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,586.73
债券利息收入		8,267,261.77
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		184,160.24
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,307,061.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,580,963.12
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,408,095.85
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-

衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	681,997.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,733,158.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	272,385.16
减：二、费用		5,805,603.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,189,100.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	274,407.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	28,070.90
4. 交易费用	6.4.7.18	2,270,506.04
5. 利息支出		1,925,698.35
其中：卖出回购金融资产支出		1,925,698.35
6. 税金及附加		28,580.18
7. 其他费用	6.4.7.19	89,239.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,412,887.77
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,412,887.77

注：本基金合同于2017年8月30日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年06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）	602,973,494.76	353,251.43	603,326,746.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动	-	2,412,887.77	2,412,887.77

数(本期利润)			
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)	-384,760,153.21	-8,496,952.21	-393,257,105.42
其中:1.基金申购款	1,174,934.72	2,825.32	1,177,760.04
2.基金赎回款	-385,935,087.93	-8,499,777.53	-394,434,865.46
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)	218,213,341.55	-5,730,813.01	212,482,528.54

注:本基金合同生效日为2017年8月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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:

马晓立

刘博

刘博

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

财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金(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[2017]745号《关于准予财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金注册的批复》核准,由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管鑫逸回报混合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人民币752,401,753.52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(2017)第819号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》于2017年8月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为752,806,584.78份基金份额,其中认购资金利息折合404,831.26份基金份额

额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》和《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货等）、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为0%–40%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证、期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。

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》、《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 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

本基金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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018年06月30日
活期存款	1,193,248.32
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	1,193,248.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	82,658,725.39	83,634,396.28	975,670.89
贵金属投资-金	-	-	-

交易所黄金合约				
债券	交易所市场	28,135,043.24	27,934,205.20	-200,838.04
	银行间市场	127,667,911.61	128,256,353.00	588,441.39
	合计	155,802,954.85	156,190,558.20	387,603.35
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		238,461,680.24	239,824,954.48	1,363,274.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应收活期存款利息	448.06
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	314.64
应收债券利息	4,456,166.89
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.13

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	93.33
合计	4,457,023.05

注：其他指应收存出保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	449,541.42
银行间市场应付交易费用	5,304.06
合计	454,845.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	160,407.62
合计	160,407.62

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 财通资管鑫逸混合A

金额单位：人民币元

项目 (财通资管鑫逸混合A)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	542,570,846.35	542,570,846.35
本期申购	1,151,705.73	1,151,705.73
本期赎回（以“-”号填列）	-346,744,530.69	-346,744,530.69
本期末	196,978,021.39	196,978,021.39

6.4.7.9.2 财通资管鑫逸混合C

金额单位：人民币元

项目 (财通资管鑫逸混合C)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,402,648.41	60,402,648.41
本期申购	23,228.99	23,228.99
本期赎回（以“-”号填列）	-39,190,557.24	-39,190,557.24
本期末	21,235,320.16	21,235,320.16

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 财通资管鑫逸混合A

单位：人民币元

项目 (财通资管鑫逸混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,995.59	341,280.00	358,275.59
本期利润	803,027.00	1,651,964.52	2,454,991.52
本期基金份额交易产生的变动数	-2,618,623.45	-5,324,570.51	-7,943,193.96
其中：基金申购款	8,025.26	-4,864.93	3,160.33
基金赎回款	-2,626,648.71	-5,319,705.58	-7,946,354.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,798,600.86	-3,331,325.99	-5,129,926.85

6.4.7.10.2 财通资管鑫逸混合C

单位：人民币元

项目 (财通资管鑫逸混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-43,246.18	38,222.02	-5,024.16
本期利润	-123,298.05	81,194.30	-42,103.75
本期基金份额交易产生的变动数	-76,336.61	-477,421.64	-553,758.25
其中：基金申购款	-109.92	-225.09	-335.01
基金赎回款	-76,226.69	-477,196.55	-553,423.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-242,880.84	-358,005.32	-600,886.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	40,211.67
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	25,293.33
其他	3,081.73
合计	68,586.73

注：其他包括存出保证金利息收入、直销申购款利息收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	973,458,570.42
减：卖出股票成本总额	975,039,533.54
买卖股票差价收入	-1,580,963.12

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 2018年01月01日至2018年06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	-1,408,095.85
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	-1,408,095.85

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 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券(、债转股及债券 到期兑付)成交总额	543,936,253.77
减：卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额	528,517,823.66
减：应收利息总额	16,826,525.96
买卖债券差价收入	-1,408,095.85

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	681,997.64
基金投资产生的股利收益	-

合计	681,997.64
----	------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	1,733,158.82
——股票投资	-1,712,613.84
——债券投资	3,445,772.66
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,733,158.82

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	272,385.16
合计	272,385.16

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	2,263,079.04
银行间市场交易费用	7,427.00
合计	2,270,506.04

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	30,744.66
信息披露费	20,662.96
汇划手续费	19,231.76
帐户维护费	18,000.00
银行间查询服务费	600.00
合计	89,239.38

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

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
财通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
财通证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券股份有限公司	791,348,549.84	43.17%	—	—

注：本基金合同生效日为2017年8月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券股份有限公司	158,639,976.15	67.44%	—	—

注：本基金合同生效日为2017年8月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财通证券股份有限公司	575,794,000.00	62.83%	—	—

注：本基金合同生效日为2017年8月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
财通证券股份有限公司	357,004.15	31.75%	111,969.30	24.91%
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
财通证券股份有限公司	—	—	—	—

注：1. 本基金合同生效日为2017年8月30日，无上年度可比期间数据。

2. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

3. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2018年01月01日至2018年06月 30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,189,100.91	—
其中：支付销售机构的客户维护费	803,838.78	—

注：1. 本基金合同生效日为2017年8月30日，无上年度可比期间数据。

2. 本基金管理费按前一日基金资产净值的0.65%的年费率计提，具体计算公式如下：每日应计提的基金管理费=前一日该基金资产净值×0.65%÷当年天数。基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月3 0日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月3 0日
当期发生的基金应支付的托管费	274,407.86	—

注：1. 本基金合同生效日为2017年8月30日，无上年度可比期间数据。

2. 本基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提，具体计算公式如下：每日应计提的基金托管费=前一日该基金资产净值×0.15%÷当年天数。基金托管费每日计提，按月支付。

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 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管鑫逸混合A	财通资管鑫逸混合C	合计
财通证券资产管理有限公司	—	9,974.88	9,974.88

财通证券 股份有限 公司	-	7,083.87	7,083.87
中国农业 银行股份 有限公司	-	10,935.58	10,935.58
合计	-	27,994.33	27,994.33
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管鑫逸混合A	财通资管鑫逸混合C	合计
财通证券 资产管理 有限公司	-	-	-
财通证券 股份有限 公司	-	-	-
中国农业 银行股份 有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：1. 本基金合同生效日为2017年8月30日，无上年度可比期间数据。

2. 本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.20%的年费率计提。其销售服务费计提的计算公式为：每日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值*0.20%/当年天数。基金销售服务费每日累计，按月支付。

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本报告期管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期无各关联方投资本基金的情况。

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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	1,193,248.32	40,211.67	-	-

注：1. 本基金合同生效日为2017年8月30日，无上年度可比期间数据。

2. 本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2018年06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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大资产重组	16.60	2018-07-31	16.50	123,022	1,827,325.32	2,042,165.20	-
--------	------	------------	--------	-------	------------	-------	---------	--------------	--------------	---

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

截至本报告期末2018年6月30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32,678,150.98元，是以如下债券作为抵押：

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
1280336	12娄底债	2018-07-04	25.38	400,000	10,152,000.00
1680360	16威海临港小微债	2018-07-04	97.50	80,000	7,800,000.00
011800040	18镇国投SCP001	2018-07-05	100.65	50,000	5,032,500.00
101800024	18滨海新城MTN001	2018-07-05	99.33	100,000	9,933,000.00
合计				630,000	32,917,500.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，本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7,500,000.00元，于2018年7月12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

本基金是一只混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益水平的投资品种。本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、

超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货等）、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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，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建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本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%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	10,028,000.00	-

A-1以下	-	-
未评级	17,580,000.00	61,386,600.00
合计	27,608,000.00	61,386,600.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级部分为国债、政策性金融债和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用同业存单。

6.4.13.2.4 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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	14,451,413.80	81,105,944.80
AAA以下	114,131,144.40	279,248,087.50
未评级	-	-
合计	128,582,558.20	360,354,032.30

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用同业存单。

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随时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上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每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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不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的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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，其余均能以合理价格适时变现。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。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金等利率敏感性资产，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2018年06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	1,193,248.32	-	-	-	-	-	1,193,248.32
结算	776,740.74	-	-	-	-	-	776,740.74

备付金							
存出保证金	230,528.70	-	-	-	-	-	230,528.70
交易性金融资产	-	-	77,265,354.00	65,104,204.20	13,821,000.00	83,634,396.28	239,824,954.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,306,474.36	7,306,474.36
应收利息	-	-	-	-	-	4,457,023.05	4,457,023.05
应收申购款	-	-	-	-	-	10,904.84	10,904.84
资产总计	2,200,517.76	-	77,265,354.00	65,104,204.20	13,821,000.00	95,408,798.53	253,799,874.49
负债							
卖出回购金融资产款	40,178,150.98	-	-	-	-	-	40,178,150.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	294,803.95	294,803.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	116,256.37	116,256.37
应付托管费	-	-	-	-	-	26,828.40	26,828.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,468.64	3,468.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	454,845.48	454,845.48
应交	-	-	-	-	-	20,078.83	20,078.83

税费							
应付利息	-	-	-	-	-	62,505.68	62,505.68
其他负债	-	-	-	-	-	160,407.62	160,407.62
负债总计	40,178,150.98	-	-	-	-	1,139,194.97	41,317,345.95
利率敏感度缺口	-37,977,633.22	-	77,265,354.00	65,104,204.20	13,821,000.00	94,269,603.56	212,482,528.54
上年度末2017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	6,421,771.74	-	-	-	-	-	6,421,771.74
结算备付金	6,370,158.44	-	-	-	-	-	6,370,158.44
存出保证金	254,895.84	-	-	-	-	-	254,895.84
交易性金融资产	40,547,000.00	60,576,000.00	172,193,600.00	129,609,532.30	18,814,500.00	200,905,175.35	622,645,807.65
买入返售金融资产	84,736,867.11	-	-	-	-	-	84,736,867.11
应收利息	-	-	-	-	-	10,361,335.39	10,361,335.39
资产总计	138,330,693.13	60,576,000.00	172,193,600.00	129,609,532.30	18,814,500.00	211,266,510.74	730,790,836.17
负债							
卖出回购金融资产款	121,044,707.95	-	-	-	-	-	121,044,707.95
应付	-	-	-	-	-	3,793,761.8	3,793,761.8

证券清算款						7	7
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,082,597.77	1,082,597.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	345,700.49	345,700.49
应付托管费	-	-	-	-	-	79,777.03	79,777.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,893.07	12,893.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	916,668.81	916,668.81
应付利息	-	-	-	-	-	10,937.87	10,937.87
其他负债	-	-	-	-	-	177,045.12	177,045.12
负债总计	121,044,707.95	-	-	-	-	6,419,382.03	127,464,089.98
利率敏感度缺口	17,285,985.18	60,576,000.00	172,193,600.00	129,609,532.30	18,814,500.00	204,847,128.71	603,326,746.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	545,245.13	525,611.20
	2. 市场利率上升25个基点	-540,723.51	-521,666.49

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	83,634,396.28	39.36	200,905,175.35	33.30
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	83,634,396.28	39.36	200,905,175.35	33.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证综指、中小板指、创业板指”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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	“上证综指、中小板指、创业板指”指数上升5%	4,951,333.97	12,013,050.72
	“上证综指、中小板指、创业板指”指数下降5%	-4,951,333.97	-12,013,050.72

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（上证综指、中小板指、创业板指）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	83,634,396.28	32.95
	其中：股票	83,634,396.28	32.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	156,190,558.20	61.54
	其中：债券	156,190,558.20	61.54
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	1,969,989.06	0.78
8	其他各项资产	12,004,930.95	4.73
9	合计	253,799,874.49	100.00

7.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,723,913.88	24.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,120.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,452,814.00	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	2,102,692.00	0.99
H	住宿和餐饮业	1,491,151.20	0.70
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,162,385.20	6.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,908,810.00	0.90
L	租赁和商务服务业	2,222,145.00	1.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,355,965.00	2.05
R	文化、体育和娱乐业	1,205,400.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	83,634,396.28	39.36

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002859	洁美科技	116,194	4,525,756.30	2.13
2	002912	中新赛克	47,000	4,418,000.00	2.08
3	600763	通策医疗	89,500	4,355,965.00	2.05
4	600309	万华化学	69,900	3,174,858.00	1.49
5	600690	青岛海尔	163,300	3,145,158.00	1.48
6	600519	贵州茅台	4,200	3,072,132.00	1.45
7	603883	老百姓	27,900	2,320,164.00	1.09
8	600271	航天信息	91,100	2,302,097.00	1.08
9	600436	片仔癀	20,502	2,294,788.86	1.08
10	300170	汉得信息	139,800	2,270,352.00	1.07
11	300596	利安隆	92,350	2,262,575.00	1.06
12	300059	东方财富	171,100	2,255,098.00	1.06
13	600588	用友网络	91,520	2,243,155.20	1.06
14	000661	长春高新	9,800	2,231,460.00	1.05

15	601888	中国国旅	34,500	2,222,145.0 0	1.05
16	600872	中炬高新	79,332	2,221,296.0 0	1.05
17	000963	华东医药	44,200	2,132,650.0 0	1.00
18	603043	广州酒家	93,300	2,124,441.0 0	1.00
19	600196	复星医药	51,100	2,115,029.0 0	1.00
20	600009	上海机场	37,900	2,102,692.0 0	0.99
21	000651	格力电器	44,200	2,084,030.0 0	0.98
22	300146	汤臣倍健	123,022	2,042,165.2 0	0.96
23	603517	绝味食品	47,300	2,007,885.0 0	0.94
24	600585	海螺水泥	59,539	1,993,365.7 2	0.94
25	001979	招商蛇口	100,200	1,908,810.0 0	0.90
26	603833	欧派家居	14,400	1,836,432.0 0	0.86
27	002153	石基信息	62,800	1,821,200.0 0	0.86
28	002304	洋河股份	12,800	1,684,480.0 0	0.79
29	600754	锦江股份	40,345	1,491,151.2 0	0.70
30	000333	美的集团	28,400	1,483,048.0 0	0.70
31	600521	华海药业	54,020	1,441,793.8	0.68

				0	
32	002371	北方华创	27,700	1,375,859.00	0.65
33	000858	五粮液	17,900	1,360,400.00	0.64
34	002821	凯莱英	14,600	1,273,558.00	0.60
35	000636	风华高科	76,000	1,206,880.00	0.57
36	000681	视觉中国	42,000	1,205,400.00	0.57
37	300454	深信服	10,500	1,154,580.00	0.54
38	002376	新北洋	63,700	1,053,598.00	0.50
39	002563	森马服饰	70,200	1,003,860.00	0.47
40	300124	汇川技术	12,400	406,968.00	0.19
41	600025	华能水电	3,000	9,120.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	17,263,470.15	2.86
2	600036	招商银行	16,530,146.67	2.74
3	601939	建设银行	14,882,915.19	2.47
4	001979	招商蛇口	12,887,298.94	2.14
5	601318	中国平安	12,131,422.00	2.01
6	002027	分众传媒	11,713,225.00	1.94
7	000651	格力电器	11,012,860.08	1.83

8	600690	青岛海尔	10,614,674.64	1.76
9	002304	洋河股份	10,612,139.40	1.76
10	600703	三安光电	8,995,561.00	1.49
11	600763	通策医疗	8,692,907.00	1.44
12	000002	万科A	8,536,948.98	1.41
13	600519	贵州茅台	7,719,249.00	1.28
14	000338	潍柴动力	7,562,772.20	1.25
15	600570	恒生电子	7,543,083.00	1.25
16	600019	宝钢股份	7,538,742.26	1.25
17	000661	长春高新	7,161,181.00	1.19
18	300059	东方财富	7,120,900.24	1.18
19	300188	美亚柏科	7,098,474.00	1.18
20	603993	洛阳钼业	7,038,563.00	1.17

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	16,794,950.00	2.78
2	601939	建设银行	16,230,740.18	2.69
3	600036	招商银行	15,353,634.92	2.54
4	002304	洋河股份	11,372,907.68	1.89
5	002027	分众传媒	11,313,004.00	1.88
6	600703	三安光电	11,225,743.54	1.86
7	601318	中国平安	11,008,430.06	1.82
8	001979	招商蛇口	10,643,153.59	1.76
9	600570	恒生电子	10,396,678.98	1.72
10	300188	美亚柏科	9,931,525.45	1.65
11	601766	中国中车	9,447,380.00	1.57
12	002081	金螳螂	9,430,907.80	1.56

13	000651	格力电器	9,368,376.88	1.55
14	300347	泰格医药	8,992,759.00	1.49
15	000977	浪潮信息	8,980,726.68	1.49
16	600519	贵州茅台	8,673,415.00	1.44
17	600028	中国石化	8,499,520.00	1.41
18	300413	快乐购	8,471,921.50	1.40
19	000002	万科A	7,948,004.50	1.32
20	002008	大族激光	7,913,242.20	1.31

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	859,481,368.31
卖出股票收入（成交）总额	973,458,570.42

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	12,547,500.00	5.91
	其中：政策性金融债	12,547,500.00	5.91
4	企业债券	114,087,244.40	53.69
5	企业短期融资券	15,060,500.00	7.09
6	中期票据	9,933,000.00	4.67
7	可转债(可交换债)	4,562,313.80	2.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	156,190,558.20	73.51

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	1480603	14清河小微02	150,000	15,153,000.00	7.13
2	018005	国开1701	125,000	12,547,500.00	5.91
3	1280336	12娄底债	400,000	10,152,000.00	4.78
4	041800028	18镇江交通C P001	100,000	10,028,000.00	4.72
5	1680014	16红果小微债	100,000	9,946,000.00	4.68

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

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

本基金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

本基金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

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

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	230,528.70
2	应收证券清算款	7,306,474.36
3	应收股利	-
4	应收利息	4,457,023.05
5	应收申购款	10,904.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,004,930.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113011	光大转债	101,480.00	0.05
2	110041	蒙电转债	40,635.00	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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	持有份额	占总份	

	(户)			份 额 比 例		额 比 例
财通 资管 鑫逸 混合A	1,768	111,412.91	-	-	196,978,021.39	100.00%
财通 资管 鑫逸 混合C	256	82,950.47	10,100,505.40	47.56%	11,134,814.76	52.44%
合计	2,024	107,812.92	10,100,505.40	4.63%	208,112,836.15	95.37%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	财通资管鑫逸混合A	1,983.13	0.00%
	财通资管鑫逸混合C	0.00	0.00%
	合计	1,983.13	0.00%

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	财通资管鑫逸混合 A	0
	财通资管鑫逸混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基	财通资管鑫逸混合	0

金	A	
	财通资管鑫逸混合	0
	C	
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管鑫逸混合A	财通资管鑫逸混合C
基金合同生效日(2017年08月30日)基金份额总额	565,631,646.43	187,174,938.35
本报告期期初基金份额总额	542,570,846.35	60,402,648.41
本报告期基金总申购份额	1,151,705.73	23,228.99
减：本报告期基金总赎回份额	346,744,530.69	39,190,557.24
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	196,978,021.39	21,235,320.16

§ 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，本基金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

本报告期内，无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，未涉及基金管理人、基金财产、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

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

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	
东兴证券	1	450,490,977.59	24.58%	329,308.29	29.29%	-
国金证券	1	282,261,618.49	15.40%	211,755.71	18.83%	-
兴业证券	1	308,838,792.81	16.85%	226,216.76	20.12%	-
财通证券	2	791,348,549.84	43.17%	357,004.15	31.75%	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券	7,990,910.00	3.40%	242,200,000.00	26.43%	-	-	-	-
国金证券	63,846,040.00	27.14%	79,500,000.00	8.68%	-	-	-	-
兴业证券	4,767,474.00	2.03%	18,900,000.00	2.06%	-	-	-	-
财通证券	158,639,976.15	67.44%	575,794,000.00	62.83%	-	-	-	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

基金交易单元的选择程序如下：

- 1、本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2、基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金本报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

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	关于财通证券资产管理有限公司旗下基金增加苏宁金融、众禄基金及盈米财富为销售机构的公告	中国证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)	2018-01-04
2	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2017年第4季度报告	同上	2018-01-20
3	财通证券资产管理有限公司关于修改财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同、托管协议并调整赎回费率的公告	同上	2018-03-23
4	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金托管协议-更新版20180323	同上	2018-03-23
5	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金合同摘要-更新版	同上	2018-03-23
6	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同-更新版20180323	同上	2018-03-23
7	财通证券资产管理有限公司	同上	2018-03-30

	关于财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告		
8	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2017年年度报告摘要	同上	2018-03-31
9	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2017年年度报告	同上	2018-03-31
10	财通资管鑫逸回报型混合型证券投资基金招募说明书（更新）2018年第1号	同上	2018-04-13
11	财通资管鑫逸回报型混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要2018年第1号	同上	2018-04-13
12	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2018年第1季度报告	同上	2018-04-20
13	关于财通证券资产管理有限公司旗下基金增加泰诚财富为销售机构的公告	同上	2018-06-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金相关批准文件

- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。
咨询电话：95336
公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司
二〇一八年八月二十九日