

财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 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:2019 年 08 月 27 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2019年08月22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2019年01月01日起至2019年06月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 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 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 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 | 13 |
| 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 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 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 | 14 |
| 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 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告(未经审计) | 15 |
| 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 | 18 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §7 投资组合报告 | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 45 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 48 |
| 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 | 49 |
| 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 | 49 |
| 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 | 49 |
| 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 | 49 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 49 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 50 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 50 |
| §8 基金份额持有人信息 | 50 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 50 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 51 |

| | |
|--|----|
| 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 | 51 |
| §9 开放式基金份额变动 | 52 |
| §10 重大事件揭示 | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 52 |
| 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 | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 53 |
| 10.8 其他重大事件 | 54 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 57 |
| 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 | 57 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 57 |
| §12 备查文件目录 | 57 |
| 12.1 备查文件目录 | 57 |
| 12.2 存放地点 | 57 |
| 12.3 查阅方式 | 57 |

§ 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 | 114,647,558.60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 | 97,927,006.70份 | 16,720,551.90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 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| 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 |
| 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 |

§ 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(2019年01月01日-2019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 | 9,047,041.61 | 1,246,374.53 |
| 本期利润 | 14,939,452.84 | 1,927,845.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1044 | 0.1015 |
| 本期加权平均净值利润率 | 10.45% | 10.16% |
| 本期基金份额净值增长率 | 10.91% | 10.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 3,981,392.61 | 605,032.70 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0407 | 0.0362 |
| 期末基金资产净值 | 103,866,927.17 | 17,658,347.55 |
| 期末基金份额净值 | 1.0607 | 1.0561 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 6.07% | 5.61% |

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 | 3.64% | 0.49% | 1.31% | 0.22% | 2.33% | 0.27% |
| 过去三个月 | 3.95% | 0.55% | -0.32% | 0.29% | 4.27% | 0.26% |
| 过去六个月 | 10.91% | 0.47% | 5.36% | 0.30% | 5.55% | 0.17% |
| 过去一年 | 8.90% | 0.45% | 4.51% | 0.29% | 4.39% | 0.16% |
| 自基金合同 生效起至今 | 6.07% | 0.52% | 3.80% | 0.26% | 2.27% | 0.26% |

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 | 3.63% | 0.49% | 1.31% | 0.22% | 2.32% | 0.27% |
| 过去三个月 | 3.90% | 0.55% | -0.32% | 0.29% | 4.22% | 0.26% |
| 过去六个月 | 10.80% | 0.47% | 5.36% | 0.30% | 5.44% | 0.17% |
| 过去一年 | 8.69% | 0.45% | 4.51% | 0.29% | 4.18% | 0.16% |
| 自基金合同 生效起至今 | 5.61% | 0.52% | 3.80% | 0.26% | 1.81% | 0.26% |

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：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 6.07%，同期业绩比较基准收益率为 3.80%；财通资管鑫逸混合 C 基金份额净值增长率为 5.61%，同期业绩比较基准收益率为 3.80%。

§ 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2019年06月30日，公司共管理15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、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、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、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、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、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金和财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）。

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和财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金基金经理。 | 2017-08-30 | - | 8 | 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。 |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|----|---|
| 于洋 | 本基金基金经理、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价值成长混合型证券投资基金基金经理。 | 2018-09-14 | - | 12 | 金融学硕士，历任申银万国证券研究所有限公司研究员；瑞银证券有限责任公司研究员、研究部副董事；富国基金管理有限公司投资经理。2018年4月加入财通证券资产管理有限公司。 |
|----|---|------------|---|----|---|

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

宏观数据回顾：上半年PMI偏弱，除3、4月份外，制造业PMI均位于荣枯线下方。投资方面，有所企稳但仍然偏弱，前五个月全国固定资产投资（不含农户）同比增长 5.6%，基建投资（不含电力）同比增长 4.0%，制造业投资增速约2.7%。消费方面，增速减慢，今年前五个月，社会消费品零售总额增长约8.1%，较去年同期下降约1.4个百分点，乘用车销售下降约 15%。就业方面5月城镇调查失业率报5.0%保持稳定，但城镇新增就业与PMI从业人员数据走弱。通胀方面，上半年CPI从1.7一路上行至2.7，主要受猪肉和水果价格的拉动；PPI整体持续偏弱，受到下游产业需求不振影响。上半年社融增速略有企稳；进出口增速均有所回落。

产品投资和运作分析：上半年主要以中高评级城投和优质产业债为主，维持适当杠杆，控制整体久期。密切关注各项宏观经济数据、政策面和市场资金面情况，对组合的信用风险和流动性风险实时监控，适度参与信用债波段操作，争取提高组合的超额收益，力争为投资人创造长期投资回报。

权益部分：上半年A股市场出现较为明显反弹，伴随年初流动性逐步宽裕，市场整体风险偏好也明显上行，带动个股明显上涨。从风格来看，依然延续白马价值，但部分优质成长类个股也出现筑底上行态势，预计后期风格因素或有所淡化，绩优个股将成为贯穿全年主线。

在报告期内，组合继续采用“自上而下”和“自下而上”相结合策略，精选行业和个股，并坚持“高胜率、低波动”原则，争取提升组合风险调整后收益水平。投资配置上，我们继续秉承深度研究、价值投资、长期持股的投资理念，希望通过精选景气行业和在景气行业中优选基本面良好的优秀公司，分享行业和公司长期成长所创造的价值。在选股层面，我们依然看好行业景气度稳步向上、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，这是在当前环境下比较稳妥的投资方向。具体而言，我们看好的方向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（食品、医药等），无论从需求还是消费升级来看，中国的消费品长期需求增长潜力巨大，相关品牌有望迎来长期发展空间；虽然短期受到贸易摩擦影响，但从中长期来看科技行业（消费电子，计算机、5G等）中也将涌现出一批头部公司，未来他们将成为中国经济发展和科技创新的核心动力。

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1.0607元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.91%，同期业绩比较基准收益率为5.36%；截至报告期末财通资管鑫逸混合C基金份额净值为1.0561元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.80%，同期业绩比较基准收益率为5.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年经济偏弱但仍具有韧性，具体表现为：投资中地产表现不弱、基建或小幅改善、制造业底部徘徊，但扣除价格后实际固定投资增速仍强；出口增速有所回落但顺差仍可支撑；居民消费或有望在减税政策持续促进下有所改善；通胀方面，下半年生猪补栏、夏令水果上市等或将对CPI 起到平抑作用，预计CPI温和上涨幅度可控；短期内下游产业需求不振或延续，PPI预计整体继续偏弱。

下半年“六稳”形势依然不容乐观，未来财政政策或进一步加大灵活性，有望使用更多政策工具精准发力进一步加快减税降费落地速度，更加注意与货币政策协同配合。货币政策方面：中国人民银行货币政策委员会2019年第二季度例会指出，坚持创新和完善宏观调控，适时适度实施逆周期调节，加强宏观政策协调。稳健的货币政策松紧适度，把好货币供给总闸门，不搞“大水漫灌”，保持广义货币M2和社会融资规模增速与国内生产总值名义增速相匹配。

下半年资金利率或短期内保持稳定、窄幅波动，但如果全球经济和贸易形势继续恶化，美联储转向降息，我国有跟进的可能性。

下半年信用债市场或分化更严重，信用利差特别是低评级债的信用利差可能会进一步走阔，市场机构风险偏好或一时难以好转，中高评级信用债收益率或呈现震荡小幅下行，但需要警惕金融供给侧改革可能对负债端稳定性造成的冲击，降低杠杆，进一步提高风险偏好。

权益部分：展望下半年，我们保持谨慎乐观态度，我们认为市场或将呈现先抑后扬的走势，未来仍有可能继续维持中枢上移的箱体震荡格局，板块结构性机会依然较多。首先，虽然整体经济下行趋势越发明显，但后期管理层或有望持续推出对冲政策，这将有利于稳定上市公司业绩增速和提升投资者风险偏好水平；其次，后期中美贸易纷争大概率将可能有一个结果，短期影响将逐步变为长期因素，市场将逐步消化其对估值和盈利的干扰，降低其权重占比；最后，随着中报业绩逐步开始披露，我们判断一些业绩可能超预期的白马品种或将迎来估值扩张阶段，结构性行情依然可以继续期待。因此在下一阶段，我们将继续保持中性偏高仓位进行操作，在个股筛选上，继续选择经营管理优秀、行业地位突出、抗风性能力强的优质行业龙头进行配置，通过分享企业长期内生增长动力来追求组合净值稳步增长。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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：2019年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019年06月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 15,088,297.89 | 39,906,663.93 |
| 结算备付金 | | 767,035.20 | 1,351,513.61 |
| 存出保证金 | | 40,962.66 | 117,037.46 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 121,201,600.78 | 168,618,507.45 |
| 其中：股票投资 | | 38,323,077.74 | 10,259,339.95 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 82,878,523.04 | 158,359,167.50 |
| 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 | - | 25,916,128.87 |
| 应收证券清算款 | | 7,778,378.00 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,349,033.22 | 3,422,634.91 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 5,143.83 | 99.88 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 147,230,451.58 | 239,332,586.11 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019年06月30日 | 上年度末 2018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 | | 21,631,872.45 | 33,100,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | 21,143,070.25 |
| 应付赎回款 | | 3,841,090.60 | 1,899.84 |
| 应付管理人报酬 | | 68,779.57 | 102,760.95 |
| 应付托管费 | | 15,872.24 | 23,714.07 |
| 应付销售服务费 | | 2,908.72 | 3,279.48 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 37,235.06 | 5,240.96 |
| 应交税费 | | 8,200.39 | 31,333.94 |
| 应付利息 | | 13,655.83 | -8,614.05 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 85,562.00 | 212,666.67 |
| 负债合计 | | 25,705,176.86 | 54,615,352.11 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 114,647,558.60 | 193,214,118.04 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 6,877,716.12 | -8,496,884.04 |
| 所有者权益合计 | | 121,525,274.72 | 184,717,234.00 |
| 负债和所有者权益总计 | | 147,230,451.58 | 239,332,586.11 |

注：报告截止日2019年6月30日，A类基金份额净值1.0607元，C类基金份额净值1.0561元；基金份额总额114,647,558.60份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额97,927,006.70份，C类基金份额总额16,720,551.90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：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期2019年01月01日至2019年06月30日 | 上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日 |
|----|-----|---------------------------|--------------------------------|
|----|-----|---------------------------|--------------------------------|

| | | 0日 | 8年06月30日 |
|------------------------|------------|---------------|---------------|
| 一、收入 | | 18,151,420.46 | 8,218,491.39 |
| 1. 利息收入 | | 3,225,463.13 | 8,520,008.74 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 74,930.85 | 68,586.73 |
| 债券利息收入 | | 3,129,177.30 | 8,267,261.77 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 21,354.98 | 184,160.24 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 8,351,636.15 | -2,307,061.33 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 6,070,707.64 | -1,580,963.12 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 1,947,681.89 | -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 | 333,246.62 | 681,997.64 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 6,573,881.88 | 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 | 439.30 | 272,385.16 |
| 减：二、费用 | | 1,284,122.44 | 5,805,603.62 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 523,096.39 | 1,189,100.91 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 120,714.54 | 274,407.86 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2. | 18,826.86 | 28,070.90 |

| | | | |
|---------------------|----------|---------------|--------------|
| | 3 | | |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 178,018.23 | 2,270,506.04 |
| 5. 利息支出 | | 328,721.93 | 1,925,698.35 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 328,721.93 | 1,925,698.35 |
| 6. 税金及附加 | | 9,447.98 | 28,580.18 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 105,296.51 | 89,239.38 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 16,867,298.02 | 2,412,887.77 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 16,867,298.02 | 2,412,887.77 |

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：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2019年01月01日至2019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） | 193,214,118.04 | -8,496,884.04 | 184,717,234.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 16,867,298.02 | 16,867,298.02 |
| 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） | -78,566,559.44 | -1,492,697.86 | -80,059,257.30 |
| 其中：1. 基金申购款 | 99,647.70 | 1,350.80 | 100,998.50 |
| 2. 基金赎回款 | -78,666,207.14 | -1,494,048.66 | -80,160,255.80 |

| | | | |
|--|------------------------------------|---------------|-----------------|
| 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） | 114,647,558.60 | 6,877,716.12 | 121,525,274.72 |
| 项 目 | 上年度可比期间 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数（本期利润） | - | 2,412,887.77 | 2,412,887.77 |
| 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 |

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。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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2019年06月30日 |
|------|--------------------|
| 活期存款 | 15,088,297.89 |

| | |
|--------------|---------------|
| 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 | 15,088,297.89 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末2019年06月30日 | | |
|---------------|-------|----------------|----------------|--------------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 32,202,560.68 | 38,323,077.74 | 6,120,517.06 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 35,437,333.61 | 35,655,702.04 | 218,368.43 |
| | 银行间市场 | 45,552,613.06 | 47,222,821.00 | 1,670,207.94 |
| | 合计 | 80,989,946.67 | 82,878,523.04 | 1,888,576.37 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 113,192,507.35 | 121,201,600.78 | 8,009,093.43 |

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 2019年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 3,473.56 |
| 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 | 310.68 |
| 应收债券利息 | 2,345,232.33 |
| 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 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 16.65 |
| 合计 | 2,349,033.22 |

注：其他包含应收保证金利息。

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 2019年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 35,744.82 |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,490.24 |
| 合计 | 37,235.06 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2019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 | 85,562.00 |
| 合计 | 85,562.00 |

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2019年01月01日至2019年06月30日 | |
|-------------------|---------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 173,051,166.41 | 173,051,166.41 |
| 本期申购 | 55,221.64 | 55,221.64 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -75,179,381.35 | -75,179,381.35 |
| 本期末 | 97,927,006.70 | 97,927,006.70 |

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2019年01月01日至2019年06月30日 | |
|-------------------|---------------------------|---------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 20,162,951.63 | 20,162,951.63 |
| 本期申购 | 44,426.06 | 44,426.06 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -3,486,825.79 | -3,486,825.79 |
| 本期末 | 16,720,551.90 | 16,720,551.90 |

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 | -4,689,451.03 | -2,863,310.63 | -7,552,761.66 |

| | | | |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 本期利润 | 9,047,041.61 | 5,892,411.23 | 14,939,452.84 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -376,197.97 | -1,070,572.74 | -1,446,770.71 |
| 其中：基金申购款 | 547.84 | 363.55 | 911.39 |
| 基金赎回款 | -376,745.81 | -1,070,936.29 | -1,447,682.10 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,981,392.61 | 1,958,527.86 | 5,939,920.47 |

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 | -611,578.75 | -332,543.63 | -944,122.38 |
| 本期利润 | 1,246,374.53 | 681,470.65 | 1,927,845.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -29,763.08 | -16,164.07 | -45,927.15 |
| 其中：基金申购款 | -118.76 | 558.17 | 439.41 |
| 基金赎回款 | -29,644.32 | -16,722.24 | -46,366.56 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 605,032.70 | 332,762.95 | 937,795.65 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期2019年01月01日至2019年06月30日 |
|-----------|---------------------------|
| 活期存款利息收入 | 62,536.06 |
| 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 | 11,931.43 |
| 其他 | 463.36 |
| 合计 | 74,930.85 |

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 |
|------------|-------------------------|
| | 2019年01月01日至2019年06月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 67,730,377.69 |
| 减：卖出股票成本总额 | 61,659,670.05 |
| 买卖股票差价收入 | 6,070,707.64 |

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 |
|-------------------------------|-------------------------|
| | 2019年01月01日至2019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 | 1,947,681.89 |
| 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 | 1,947,681.89 |

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 |
|-------------------------|-------------------------|
| | 2019年01月01日至2019年06月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 112,841,172.62 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 107,307,877.78 |
| 减：应收利息总额 | 3,585,612.95 |
| 买卖债券差价收入 | 1,947,681.89 |

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年01月01日至2019年06月30日 |
|-------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 333,246.62 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 333,246.62 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2019年01月01日至2019年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 6,573,881.88 |
| ——股票投资 | 6,463,525.54 |
| ——债券投资 | 110,356.34 |
| ——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 | 6,573,881.88 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2019年01月01日至2019年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 439.30 |
| 合计 | 439.30 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2019年01月01日至2019年06月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 176,820.73 |
| 银行间市场交易费用 | 1,197.50 |
| 合计 | 178,018.23 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|-------------------------|
| | 2019年01月01日至2019年06月30日 |
| 审计费用 | 18,843.91 |
| 信息披露费 | 57,651.42 |
| 汇划手续费 | 10,101.18 |
| 帐户维护费 | 18,000.00 |
| 银行间结算费用 | 100.00 |
| 银行间查询服务费 | 600.00 |
| 合计 | 105,296.51 |

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

截至财务报表批准报出日，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 |
| 财通证券股份有限公司 | 基金管理人的控股股东、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 2019年01月01日至2019年06月30日 | | 上年度可比期间 2018年01月01日至2018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 | 69,773,229.89 | 46.30% | 791,348,549.84 | 43.17% |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2019年01月01日至2019年06月30日 | | 上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 | |
|-------|-------------------------------|------------|------------------------------------|------------|
| | 成交金额 | 占当期 债券成 | 成交金额 | 占当期 债券成 |

| | | | | |
|--------------------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | 交总额的 比例 | | 交总额的 比例 |
| 财通证券 股份有限 公司 | 49,252,263.71 | 76.46% | 158,639,976.15 | 67.44% |

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 2019年01月01日至2019年06月30日 | | 上年度可比期间 2018年01月01日至2018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 | 1,188,500,000.00 | 86.67% | 575,794,000.00 | 62.83% |

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 2019年01月01日至2019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 额的比例 |
| 财通证券 股份有限 公司 | 34,967.95 | 36.67% | 15,937.93 | 44.59% |
| 关联方名 称 | 上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期 | 期末应付佣金余额 | 占期末应 |

| | | 佣金总量的比例 | | 付佣金总额的比例 |
|------------|------------|---------|------------|----------|
| 财通证券股份有限公司 | 357,004.15 | 31.75% | 111,969.30 | 24.91% |

注：1. 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、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 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 2019年01月01日至2019年06月30日 | 上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 523,096.39 | 1,189,100.91 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 340,608.20 | 803,838.78 |

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.65%的管理费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年01月01日至2019年06月30日 | 上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 120,714.54 | 274,407.86 |

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以0.15%的托管费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，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 2019年01月01日至2019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 | - | 9,908.49 | 9,908.49 |
| 财通证券股份有限公司 | - | 2,486.85 | 2,486.85 |
| 中国农业银行股份有限公司 | - | 6,423.46 | 6,423.46 |
| 合计 | - | 18,818.80 | 18,818.80 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 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 |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费；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，具体计算方法如下：每日C类基金份额应计提的基金销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×年费率÷当年天数，基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无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

本基金本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2019年01月01日至2019年06月30日 | | 上年度可比期间 2018年01月01日至2018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 | 15,088,297.89 | 62,536.06 | 1,193,248.32 | 40,211.67 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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（2019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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 601236 | 红塔证券 | 2019-06-26 | 2019-07-05 | 新发流通受限 | 3.46 | 3.46 | 9,789 | 33,869.94 | 33,869.94 | - |
| 300788 | 中信出版 | 2019-06-27 | 2019-07-05 | 新发流通受限 | 14.85 | 14.85 | 1,556 | 23,106.60 | 23,106.60 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2019年06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5,031,872.45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 |
|---------|-------|------------|--------|--------|--------------|
| 1580214 | 15江油债 | 2019-07-01 | 80.74 | 68,000 | 5,490,320.00 |
| 合计 | | | | 68,000 | 5,490,320.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019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16,600,000.00元，于2019年7月1日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。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的理念，建立规范科学有效的内部风险管理体系结构。董事会是公司风险管理的最高决策机构，授权公司经营管理层建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的具体规章制度，组织实施各类风险的识别与评估工作；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，风险管理部负责拟定公司的风险管理政策、风险管理流程和具体制度，并具体实施，确保公司整体风险得到有效的识别、监控和管理，确保公司各项内部管理制度得到有效执行。基金管理业务合规负责人对董事会负责并报告工作，负责监督检查公募基金业务的合法合规性并对内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，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。

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。

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 2019年06月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 9,294,720.00 | - |
| 合计 | 9,294,720.00 | - |

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。

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按短期信用评级列示的资产支持证券。

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按短期信用评级列示的同业存单。

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 2019年06月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 9,167,984.88 | 35,738,370.00 |
| AAA以下 | 64,414,815.56 | 111,598,897.50 |
| 未评级 | 1,002.60 | 11,021,900.00 |
| 合计 | 73,583,803.04 | 158,359,167.50 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为地方政府债。

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按长期信用评级列示的资产支持证券。

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按长期信用评级列示的同业存单。

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。

于2019年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有21,631,872.45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约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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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较重大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等利率敏感性资产，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2019年06月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------|---------------|---------------|--------------|---------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 15,088,297.89 | - | - | - | 15,088,297.89 |
| 结算备付金 | 767,035.20 | - | - | - | 767,035.20 |
| 存出保证金 | 40,962.66 | - | - | - | 40,962.66 |
| 交易性金融资 | 16,914,726.60 | 61,097,612.24 | 4,866,184.20 | 38,323,077.74 | 121,201,600.78 |

| | | | | | |
|-------------------|---------------|---------------|--------------|---------------|----------------|
| 产 | | | | | |
| 应收证 券清算 款 | - | - | - | 7,778,378.00 | 7,778,378.00 |
| 应收利 息 | - | - | - | 2,349,033.22 | 2,349,033.22 |
| 应收申 购款 | - | - | - | 5,143.83 | 5,143.83 |
| 资产总 计 | 32,811,022.35 | 61,097,612.24 | 4,866,184.20 | 48,455,632.79 | 147,230,451.58 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回 购金融 资产款 | 21,631,872.45 | - | - | - | 21,631,872.45 |
| 应付赎 回款 | - | - | - | 3,841,090.60 | 3,841,090.60 |
| 应付管 理人报 酬 | - | - | - | 68,779.57 | 68,779.57 |
| 应付托 管费 | - | - | - | 15,872.24 | 15,872.24 |
| 应付销 售服务 费 | - | - | - | 2,908.72 | 2,908.72 |
| 应付交 易费用 | - | - | - | 37,235.06 | 37,235.06 |
| 应交税 费 | - | - | - | 8,200.39 | 8,200.39 |
| 应付利 息 | - | - | - | 13,655.83 | 13,655.83 |
| 其他负 债 | - | - | - | 85,562.00 | 85,562.00 |
| 负债总 计 | 21,631,872.45 | - | - | 4,073,304.41 | 25,705,176.86 |
| 利率敏 感度缺 口 | 11,179,149.90 | 61,097,612.24 | 4,866,184.20 | 44,382,328.38 | 121,525,274.72 |
| 上年度 末2018 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | |
|-----------|----------------|---------------|--------------|---------------|----------------|
| 年12月31日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 39,906,663.93 | - | - | - | 39,906,663.93 |
| 结算备付金 | 1,351,513.61 | - | - | - | 1,351,513.61 |
| 存出保证金 | 117,037.46 | - | - | - | 117,037.46 |
| 交易性金融资产 | 54,457,087.60 | 99,230,079.90 | 4,672,000.00 | 10,259,339.95 | 168,618,507.45 |
| 买入返售金融资产 | 25,916,128.87 | - | - | - | 25,916,128.87 |
| 应收利息 | - | - | - | 3,422,634.91 | 3,422,634.91 |
| 应收申购款 | - | - | - | 99.88 | 99.88 |
| 资产总计 | 121,748,431.47 | 99,230,079.90 | 4,672,000.00 | 13,682,074.74 | 239,332,586.11 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 33,100,000.00 | - | - | - | 33,100,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 21,143,070.25 | 21,143,070.25 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,899.84 | 1,899.84 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 102,760.95 | 102,760.95 |
| 应付托管费 | - | - | - | 23,714.07 | 23,714.07 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 3,279.48 | 3,279.48 |

| | | | | | |
|---------|---------------|---------------|--------------|---------------|----------------|
| 应付交易费用 | - | - | - | 5,240.96 | 5,240.96 |
| 应交税费 | - | - | - | 31,333.94 | 31,333.94 |
| 应付利息 | - | - | - | -8,614.05 | -8,614.05 |
| 其他负债 | - | - | - | 212,666.67 | 212,666.67 |
| 负债总计 | 33,100,000.00 | - | - | 21,515,352.11 | 54,615,352.11 |
| 利率敏感度缺口 | 88,648,431.47 | 99,230,079.90 | 4,672,000.00 | -7,833,277.37 | 184,717,234.00 |

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 2019年06月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| | 1. 市场利率下降25个基点 | 341,651.10 | 692,212.50 |
| 2. 市场利率上升25个基点 | -338,610.20 | -685,967.41 | |

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的

决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中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%，其中现金类资产不包括结算备付金、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。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 2019年06月30日 | | 上年度末 2018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 | 38,323,077.74 | 31.54 | 10,259,339.95 | 5.55 |
| 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 | 38,323,077.74 | 31.54 | 10,259,339.95 | 5.55 |

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”指数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 2019年06月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| | 1. 上证综指、中小板指、创业板指指数均上升5% | 2,053,298.11 | 654,893.38 |
| | 2. 上证综指、中小板指、创业板指指数均下降5% | -2,053,298.11 | -654,893.38 |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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 | 38,323,077.74 | 26.03 |
| | 其中：股票 | 38,323,077.74 | 26.03 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 82,878,523.04 | 56.29 |
| | 其中：债券 | 82,878,523.04 | 56.29 |
| | 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 | 15,855,333.09 | 10.77 |
| 8 | 其他各项资产 | 10,173,517.71 | 6.91 |

| | | | |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 147,230,451.58 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

金额单位：人民币元

| 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 | 88,061.30 | 0.07 |
| C | 制造业 | 33,346,583.14 | 27.44 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,210.00 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,529,376.76 | 2.08 |
| J | 金融业 | 33,869.94 | 0.03 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 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 | 2,289,870.00 | 1.88 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 23,106.60 | 0.02 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 38,323,077.74 | 31.54 |

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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股票投资明细

7.3.1 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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000661 | 长春高新 | 14,000 | 4,732,000.00 | 3.89 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 4,600 | 4,526,400.00 | 3.72 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 36,400 | 4,293,380.00 | 3.53 |
| 4 | 000063 | 中兴通讯 | 118,100 | 3,841,793.00 | 3.16 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 111,600 | 3,728,556.00 | 3.07 |
| 6 | 600559 | 老白干酒 | 264,940 | 3,468,064.60 | 2.85 |
| 7 | 002216 | 三全食品 | 328,014 | 3,352,303.08 | 2.76 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 58,600 | 3,223,000.00 | 2.65 |
| 9 | 002410 | 广联达 | 75,700 | 2,489,773.00 | 2.05 |
| 10 | 300347 | 泰格医药 | 29,700 | 2,289,870.00 | 1.88 |
| 11 | 603068 | 博通集成 | 34,759 | 2,015,326.82 | 1.66 |
| 12 | 600968 | 海油发展 | 24,806 | 88,061.30 | 0.07 |
| 13 | 300782 | 卓胜微 | 743 | 80,927.56 | 0.07 |
| 14 | 601698 | 中国卫通 | 10,103 | 39,603.76 | 0.03 |
| 15 | 601236 | 红塔证券 | 9,789 | 33,869.94 | 0.03 |
| 16 | 300594 | 朗进科技 | 721 | 31,803.31 | 0.03 |
| 17 | 603867 | 新化股份 | 1,045 | 26,971.45 | 0.02 |
| 18 | 603863 | 松炆资源 | 1,129 | 26,057.32 | 0.02 |
| 19 | 300788 | 中信出版 | 1,556 | 23,106.60 | 0.02 |
| 20 | 600025 | 华能水电 | 3,000 | 12,210.00 | 0.01 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 6,855,349.66 | 3.71 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 5,546,203.00 | 3.00 |
| 3 | 002216 | 三全食品 | 4,610,435.04 | 2.50 |
| 4 | 002557 | 洽洽食品 | 4,606,686.00 | 2.49 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 4,521,146.00 | 2.45 |
| 6 | 000661 | 长春高新 | 4,337,502.00 | 2.35 |
| 7 | 601155 | 新城控股 | 4,332,544.88 | 2.35 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 4,324,425.00 | 2.34 |
| 9 | 600559 | 老白干酒 | 3,620,944.00 | 1.96 |
| 10 | 002044 | 美年健康 | 3,604,720.00 | 1.95 |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 2,792,626.00 | 1.51 |
| 12 | 600547 | 山东黄金 | 2,791,518.00 | 1.51 |
| 13 | 000975 | 银泰资源 | 2,773,109.80 | 1.50 |
| 14 | 000063 | 中兴通讯 | 2,170,280.00 | 1.17 |
| 15 | 603068 | 博通集成 | 1,878,289.88 | 1.02 |
| 16 | 002078 | 太阳纸业 | 1,857,991.00 | 1.01 |
| 17 | 600383 | XD金地集 | 1,854,969.00 | 1.00 |
| 18 | 002737 | 葵花药业 | 1,853,391.00 | 1.00 |
| 19 | 002230 | 科大讯飞 | 1,849,790.31 | 1.00 |
| 20 | 600570 | 恒生电子 | 1,847,164.00 | 1.00 |

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 | 002557 | 洽洽食品 | 5,428,776.00 | 2.94 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 4,900,242.00 | 2.65 |
| 3 | 601155 | 新城控股 | 4,762,486.85 | 2.58 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 4 | 000002 | 万 科 A | 3,505,892.00 | 1.90 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 3,175,602.90 | 1.72 |
| 6 | 002044 | 美年健康 | 3,019,450.00 | 1.63 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 2,986,745.00 | 1.62 |
| 8 | 000975 | 银泰资源 | 2,598,498.00 | 1.41 |
| 9 | 002216 | 三全食品 | 2,531,774.26 | 1.37 |
| 10 | 600547 | 山东黄金 | 2,503,809.00 | 1.36 |
| 11 | 600570 | 恒生电子 | 2,351,322.81 | 1.27 |
| 12 | 600383 | XD金地集 | 2,181,302.06 | 1.18 |
| 13 | 002230 | 科大讯飞 | 1,932,933.00 | 1.05 |
| 14 | 000651 | 格力电器 | 1,889,324.34 | 1.02 |
| 15 | 002737 | 葵花药业 | 1,863,478.00 | 1.01 |
| 16 | 600498 | 烽火通信 | 1,861,834.70 | 1.01 |
| 17 | 603369 | 今世缘 | 1,835,510.12 | 0.99 |
| 18 | 002078 | 太阳纸业 | 1,809,575.00 | 0.98 |
| 19 | 002821 | 凯莱英 | 1,741,140.00 | 0.94 |
| 20 | 600690 | 海尔智家 | 1,719,167.00 | 0.93 |

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 | 83,259,882.30 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 67,730,377.69 |

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 | 8,093,520.00 | 6.66 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,201,200.00 | 0.99 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| | 其中：政策性金融债 | 1,201,200.00 | 0.99 |
| 4 | 企业债券 | 62,272,310.05 | 51.24 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 10,338,000.00 | 8.51 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 972,490.39 | 0.80 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 1,002.60 | 0.00 |
| 10 | 合计 | 82,878,523.04 | 68.20 |

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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 | 139208 | 16渝新梁 | 100,000 | 9,500,000.00 | 7.82 |
| 2 | 155154 | 19渤海01 | 81,000 | 8,112,150.00 | 6.68 |
| 3 | 019611 | 19国债01 | 81,000 | 8,093,520.00 | 6.66 |
| 4 | 1580214 | 15江油债 | 100,000 | 8,074,000.00 | 6.64 |
| 5 | 1680243 | 16湘乡城建债 | 100,000 | 7,918,000.00 | 6.52 |

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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 | 40,962.66 |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,778,378.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,349,033.22 |
| 5 | 应收申购款 | 5,143.83 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,173,517.71 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末持有的前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 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) | 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 |
| 财通资管鑫逸混合A | 1,042 | 93,979.85 | 0.00 | 0.00% | 97,927,006.70 | 100.00% |
| 财通资管鑫逸混合C | 165 | 101,336.68 | 10,000,800.00 | 59.81% | 6,719,751.90 | 40.19% |
| 合计 | 1,207 | 94,985.55 | 10,000,800.00 | 8.72% | 104,646,758.60 | 91.28% |

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 | 991.59 | 0.00% |
| | 财通资管鑫逸混合C | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 991.59 | 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 | 财通资管鑫逸混合A | 0 |

| | | |
|-----------------|---------------|---|
| 基金 | 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金 | 财通资管鑫逸混合 A | 0 |
| | 财通资管鑫逸混合 C | 0 |
| | 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 | 173,051,166.41 | 20,162,951.63 |
| 本报告期基金总申购份额 | 55,221.64 | 44,426.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 75,179,381.35 | 3,486,825.79 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 97,927,006.70 | 16,720,551.90 |

§ 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，无基金管理人的重大人事变动。2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内，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 | 7,335,786.00 | 4.87% | 5,364.45 | 5.62% | - |
| 兴业证券 | 1 | 73,597,922.67 | 48.84% | 55,037.37 | 57.71% | - |
| 财通证券 | 2 | 69,773,229.89 | 46.30% | 34,967.95 | 36.67% | - |

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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 | - | - | 5,000,000.00 | 0.36% | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|----------|---------------|--------|------------------|--------|---|---|---|---|
| 兴业证 券 | 15,160,559.50 | 23.54% | 177,800,000.00 | 12.97% | - | - | - | - |
| 财通证 券 | 49,252,263.71 | 76.46% | 1,188,500,000.00 | 86.67% | - | - | - | - |

注：a. 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。

b. 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。

c. 国金证券退租交易单元1个。

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 | 财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2018年第四季度报告 | 中国证券报、管理人网站(www.ctzg.com) | 2019-01-19 |
| 2 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2019-01-31 |
| 3 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加乾道盈泰基金销售（北京）有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2019-01-31 |
| 4 | 关于财通证券资产管理有限公司 | 同上 | 2019-01-31 |

| | | | |
|----|---|----|------------|
| | 公司旗下部分基金增加凤凰金信（银川）基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | | |
| 5 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加沈阳麟龙投资顾问有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2019-02-25 |
| 6 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加奕丰基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2019-02-26 |
| 7 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加民商基金销售(上海)有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2019-03-14 |
| 8 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加扬州国信嘉利基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2019-03-27 |
| 9 | 财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2018年年度报告摘要 | 同上 | 2019-03-30 |
| 10 | 财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2018年年度报告 | 同上 | 2019-03-30 |
| 11 | 财通证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行费率优惠活动的公告 | 同上 | 2019-03-30 |
| 12 | 财通资管鑫逸回报混合型证 | 同上 | 2019-04-13 |

| | | | |
|----|---|----|------------|
| | 券投资基金招募说明书（更新）2019年第1号 | | |
| 13 | 财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要2019年第1号 | 同上 | 2019-04-13 |
| 14 | 财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2019年第一季度报告 | 同上 | 2019-04-22 |
| 15 | 财通证券资产管理有限公司关于在网上直销渠道开通基金转换业务及费率优惠活动的公告 | 同上 | 2019-04-29 |
| 16 | 财通证券资产管理有限公司关于在网上直销渠道开通基金定期定额投资业务及费率优惠活动的公告 | 同上 | 2019-04-29 |
| 17 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2019-05-13 |
| 18 | 财通证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购、定期定额投资最低金额限制的公告 | 同上 | 2019-06-06 |
| 19 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告 | 同上 | 2019-06-10 |
| 20 | 关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告 | 同上 | 2019-06-12 |

§ 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
二〇一九年八月二十七日