

财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09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

报告送出日期:2021年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2021年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年07月01日起至09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|--|-----------|
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 27,414,978.20份 | |
| 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 | 1、资产配置策略；2、固定收益类投资策略；3、权益类投资策略；4、权证投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略。 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 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 | 25,622,922.04份 | 1,792,056.16份 |
|-----------------|----------------|---------------|

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2021年07月01日 - 2021年09月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|--------------|
| | 财通资管鑫逸混合A | 财通资管鑫逸混合C |
| 1. 本期已实现收益 | 3,174,089.37 | 185,964.03 |
| 2. 本期利润 | 2,907,054.60 | 109,893.00 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0770 | 0.0564 |
| 4. 期末基金资产净值 | 35,907,583.95 | 2,489,241.31 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4014 | 1.3890 |

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、本期已实现收益指本期基金利息收入、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。

3.2 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净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 3.78% | 0.92% | -0.68% | 0.25% | 4.46% | 0.67% |
| 过去六个月 | 9.78% | 0.70% | 0.41% | 0.22% | 9.37% | 0.48% |
| 过去一年 | 6.08% | 0.72% | 3.20% | 0.25% | 2.88% | 0.47% |
| 过去三年 | 48.12% | 0.59% | 12.53% | 0.26% | 35.59% | 0.33% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 40.14% | 0.59% | 11.92% | 0.25% | 28.22% | 0.34% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

财通资管鑫逸混合C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 3.73% | 0.92% | -0.68% | 0.25% | 4.41% | 0.67% |
| 过去六个月 | 9.67% | 0.70% | 0.41% | 0.22% | 9.26% | 0.48% |
| 过去一年 | 5.86% | 0.72% | 3.20% | 0.25% | 2.66% | 0.47% |
| 过去三年 | 47.23% | 0.59% | 12.53% | 0.26% | 34.70% | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.90% | 0.59% | 11.92% | 0.25% | 26.98% | 0.34% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 40.14%，同期业绩比较基准收益率为 11.92%；财通资管鑫逸混合 C 基金份额净值增长率为 38.90%，同期业绩比较基准收益率为 11.92%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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、财通资管鸿达纯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、财通资管鸿盛12个月定期开放债券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。 | 2017-08-30 | - | 11 | 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、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、财通资管行业精选混合型证券投资基金、财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金和财通资管消费升级一年持有期混合型证券投资基金基金经理。 | 2018-09-14 | - | 14 | 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。 |
| 李杰 | 本基金基金经理、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、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基 | 2021-01-20 | - | 14 | 武汉大学理学学士、上海交通大学理学硕士。2007年1月加入国联安基金管理有限公司先后任数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012年4月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资 |

| | | | | |
|--|---|--|--|--|
| | <p>金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金和财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。</p> | | | <p>基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安优质精选灵活配置型证券投资基金、金元顺安津楹债券型证券投资基金的基金经理；固定收益与量化部执行总监；2018年4月加入财通证券资产管理有限公司。</p> |
|--|---|--|--|--|

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，在疫情反复、极端天气、部分地区限电限产的多重冲击下，经济增速出现回落。具体分项如下：

国内方面：

1-8月规模以上工业企业利润同比增49.5%，两年复合增长率为19.5%，继续回落0.7个百分点。8月工业生产延续放缓趋势，加上工业品价格居高不下，工业利润被进一步侵蚀，反映在工业企业利润增速加速回落。利润继续向上游集中，电力业利润受侵蚀严重。

7月制造业PMI较前值下降0.5个百分点至50.4%，且低于预期的50.8%，整体表现较弱。8月制造业PMI录得50.1%，比前值下行0.3个百分点。2021年9月官方制造业PMI为49.6%，较前值回落0.5个百分点，连续6个月回落。9月制造业PMI回落至荣枯线以下，制造业PMI疫情之后首次落入收缩区间。

8月新增社融2.96万亿元（同比少增6,353亿元）、余额同比增速10.3%（较上月下降0.4%），新增人民币贷款1.22万亿元（同比少增600亿元），广义货币M2增速环比下降0.1%至8.2%。

8月CPI同比增速录得0.8%，核心CPI同比增速录得1.2%。CPI走低主要受食品项，尤其是猪肉价格拖累。8月PPI同比增速录得9.5%，突破前值9.0%水平，其中PPI生产资料当月同比12.7%，较前值继续上扬0.7%，PPI生活资料当月同比0.3%，与前值持平。PPI同比继续走高主要由生产资料上涨所致。

货币政策方面，央行7月15日调降存款准备金率0.5个百分点至12.0%，释放1万亿资金。在货币供应方面，央行保持平衡宽松，整体资金利率围绕政策利率附近较为平稳波动。8月、9月MLF均续作6000亿元，略超预期，逆回购季末有所加码。

央行货币政策委员会9月24日召开2021年第三季度例会，指出货币政策将继续精准发力，也指出要维护房地产市场的健康发展，并且强调了加强财政、产业、监管政策之间的协调，未释放大幅宽松的信号。央行三季度例会新增3000亿元支小再贷款额度、支持银行补充资本金、降低实体融资成本。在防风险的政策基调之下，宽信用抓手不足，紧靠小微企业、制造业的投资意愿恐难以快速拉起社融。

国外方面：

海外修复或已进入边际放缓阶段，从主要国家的制造业PMI来看，从6月开始均出现不同程度的下滑，存在经济修复空间缩小后的自然回落、Delta疫情的扰动、海外电价高企对生产端的限制等等。

另外，美联储在9月底释放出信号，称可能会在11月份的议息会议上宣布缩债，并将加息时间提前至2022年，早于市场预期。业内认为，美联储的政策预期与利率开始正常化的紧缩步伐相一致，未来多国将面临货币政策正常化压力。欧洲方面，欧元区8月PPI同比增速再创新高，环比回落，能源价格上行及供给瓶颈对欧元区生产制造成本的影响逐步显现。

固收方面：三季度降准后，债券收益率加速下行，我们趁机获利了结部分债券，降低固收仓位。

转债：三季度，转债市场呈现先扬后抑走势，指数收涨6.23%，跑赢大盘，结构性特征明显。在报告期内，我们趁机增加转债仓位，通过波段操作增厚收益，9月下旬市场调整时，我们通过调整结构尽量分散风险。

权益部分：

三季度以来，在财政后置的影响下，叠加地产压制、限产政策以及国内疫情等因素，需求加速放缓，经济动能减弱。短期来看，当前影响最大的是能耗双控背景下各省相继加码防控措施，以及疫情反复对消费的冲击，暂时未看到转变的迹象。7/30政治局会议明确提出“合理把握预算内投资和地方政府债券发行进度，推动今年底明年初形成实物工作量”，8月开始政府债券发行开始放量，但真正形成实物投资可能至少要到四季度。因此，三季度处于经济加速下行和政府债券放量流动性边际趋紧的过度阶段，市场呈现震荡走势；但同时政策维度央行下调金融机构存款准备金率等操作来看，说明政策大概率不会再度收紧，央行后续仍有投放流动性的必要性和紧迫性，未来货币政策可能易松难紧，但政策节奏和力度不易判断。权益资产方面，三季度整体维持震荡向下，前期涨幅过大、交易拥挤的趋势赛道接连出现调整，28个申万一级行业多数收跌，分化进一步加大。

报告期内，组合仓位基本稳定，仍以成长类资产为主，主要以医药、半导体、科技成长等构建投资组合。本季度内，管理人逐步减持了估值上涨较为充分的部分个股，主要增加了医药板块的配置比例，涉及康复医疗行业、创新药企龙头等子领域。整体来看，医药板块在经历了前期政策面、资金面等带来的调整后，整体板块配置价值正逐渐突出。同时，继续增配并持有了景气度向好的半导体设备板块。展望四季度，在全球需求仍需要不断刺激复苏的背景下，边际宽裕的流动性环境仍有望保持。整体而言，我们对四季度市场偏谨慎乐观，A股仍有结构性机会，但市场的风格和行业值得我们研究和思考。未来一个季度的选股思路整体还是延续前期的思路，在成长板块中寻找投资机会、关注医药、半导体、消费成长，新能源等板块机会，其次是估值角度，我们依然长期看好行业前景广阔、商业模式出色、行业格局清晰、估值合理的优质公司，这类公司在结构性市场中会有比较突出的表现。

4.5 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1.4014元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.78%，同期业绩比较基准收益率为-0.68%；截至报告期末财通资管鑫逸混合C基金份额净值为1.3890元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.73%，同期业绩比较基准收益率为-0.68%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，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的情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 14,707,333.19 | 37.27 |
| | 其中：股票 | 14,707,333.19 | 37.27 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 18,457,219.56 | 46.78 |
| | 其中：债券 | 18,457,219.56 | 46.78 |
| | 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 | 6,146,798.29 | 15.58 |
| 8 | 其他资产 | 145,560.96 | 0.37 |
| 9 | 合计 | 39,456,912.00 | 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 14,681,713.19 | 38.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 25,620.00 | 0.07 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 14,707,333.19 | 38.30 |

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

5.2.2 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。

5.3 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

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 688516 | 奥特维 | 16,302 | 3,126,397.56 | 8.14 |
| 2 | 002371 | 北方华创 | 7,600 | 2,779,244.00 | 7.24 |
| 3 | 300122 | 智飞生物 | 15,912 | 2,529,848.88 | 6.59 |
| 4 | 300601 | 康泰生物 | 20,300 | 2,235,639.00 | 5.82 |
| 5 | 300382 | 斯莱克 | 64,800 | 1,627,776.00 | 4.24 |
| 6 | 688200 | 华峰测控 | 1,315 | 732,126.25 | 1.91 |
| 7 | 688617 | 惠泰医疗 | 1,689 | 682,356.00 | 1.78 |
| 8 | 300482 | 万孚生物 | 11,800 | 507,400.00 | 1.32 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 9 | 688085 | 三友医疗 | 16,670 | 460,925.50 | 1.20 |
| 10 | 600025 | 华能水电 | 3,000 | 25,620.00 | 0.07 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金投资范围未包含全国中小企业股份转让系统挂牌的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 2,488,000.00 | 6.48 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 5,801,500.00 | 15.11 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 10,167,719.56 | 26.48 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 18,457,219.56 | 48.07 |

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

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 1580187 | 15喀城投债 | 130,000 | 2,627,300.00 | 6.84 |
| 2 | 020438 | 21贴债41 | 25,000 | 2,488,000.00 | 6.48 |
| 3 | 132004 | 15国盛EB | 24,000 | 2,483,040.00 | 6.47 |
| 4 | 110034 | 九州转债 | 10,000 | 1,107,600.00 | 2.88 |
| 5 | 132015 | 18中油EB | 10,240 | 1,073,254.40 | 2.80 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金对股指期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行形势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 9,436.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 114,702.64 |
| 5 | 应收申购款 | 21,422.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 145,560.96 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 132004 | 15国盛EB | 2,483,040.00 | 6.47 |
| 2 | 110034 | 九州转债 | 1,107,600.00 | 2.88 |
| 3 | 132015 | 18中油EB | 1,073,254.40 | 2.80 |
| 4 | 113017 | 吉视转债 | 1,004,600.00 | 2.62 |
| 5 | 113013 | 国君转债 | 476,240.00 | 1.24 |
| 6 | 127006 | 敖东转债 | 455,320.00 | 1.19 |
| 7 | 132009 | 17中油EB | 316,020.00 | 0.82 |
| 8 | 113614 | 健20转债 | 270,440.00 | 0.70 |
| 9 | 128022 | 众信转债 | 259,268.76 | 0.68 |
| 10 | 113505 | 杭电转债 | 240,080.00 | 0.63 |
| 11 | 113026 | 核能转债 | 235,746.00 | 0.61 |
| 12 | 128105 | 长集转债 | 229,320.00 | 0.60 |
| 13 | 123023 | 迪森转债 | 218,831.40 | 0.57 |
| 14 | 123086 | 海兰转债 | 217,336.00 | 0.57 |
| 15 | 113024 | 核建转债 | 207,972.00 | 0.54 |

5.11.5 报告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。

§ 6 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 |
|-------------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 50,032,177.00 | 2,235,953.98 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 277,186.22 | 461,985.01 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 24,686,441.18 | 905,882.83 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 25,622,922.04 | 1,792,056.16 |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

9.3 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

2021年10月27日