

财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金2017年年度报告

2017年12月31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03月31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03月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2017年08月30日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 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	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合	51
8.3 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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 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	58
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	58
§ 9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
9.3 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	60
§ 10 开放式基金份额变动	60
§ 11 重大事件揭示	61
11.1 基金份额持有人大会决议	61
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	63
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 13 备查文件目录	65

§ 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	602,973,494.76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	542,570,846.35份	60,402,648.41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	贺倩
	联系电话	021-20568207	010-66060069
	电子邮箱	qianh@ctzg.com	tgxxpl@abchina.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》
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年08月30日-2017年12月31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	103,754.28	639,169.09
本期利润	353,505.15	19,533.64
加权平均基金份额本期利润	0.0006	0.0001
本期加权平均净值利润率	0.06%	0.01%
本期基金份额净值增长率	0.07%	-0.01%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	
期末可供分配利润	16,995.59	-43,246.18
期末可供分配基金份额利润	—	-0.0007
期末基金资产净值	542,929,121.94	60,397,624.25
期末基金份额净值	1.0007	0.9999
3.1.3 累计期末指标	2017年末	
基金份额累计净值增长率	0.07%	-0.01%

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. 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。

3. 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。

4. 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

阶段 (财通资管鑫逸混合A)	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
过去三个月	-0.29%	0.40%	0.09%	0.16%	-0.38%	0.24%
自基金合同生效日起	0.07%	0.34%	0.25%	0.14%	-0.18%	0.20%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

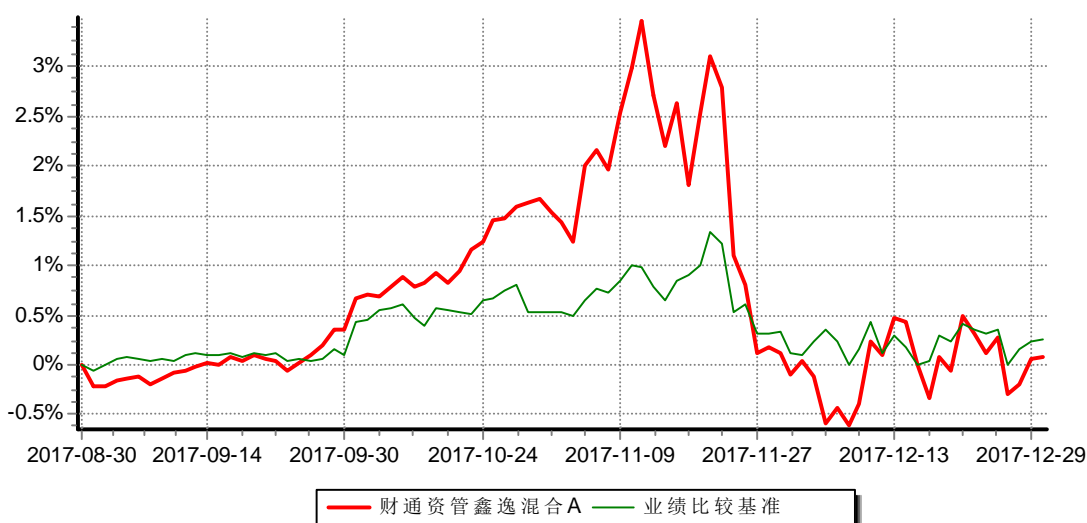
阶段 (财通资管鑫逸混合C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.36%	0.40%	0.09%	0.16%	-0.45%	0.24%
自基金合同生效日起至今	-0.01%	0.34%	0.25%	0.14%	-0.26%	0.20%

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

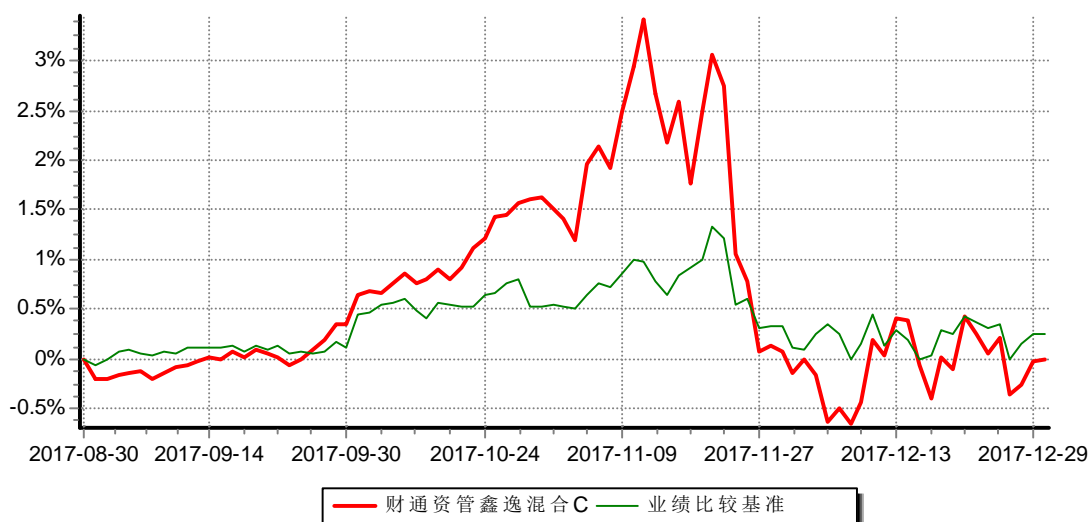
(2017年08月30日-2017年12月31日)



财通资管鑫逸混合C

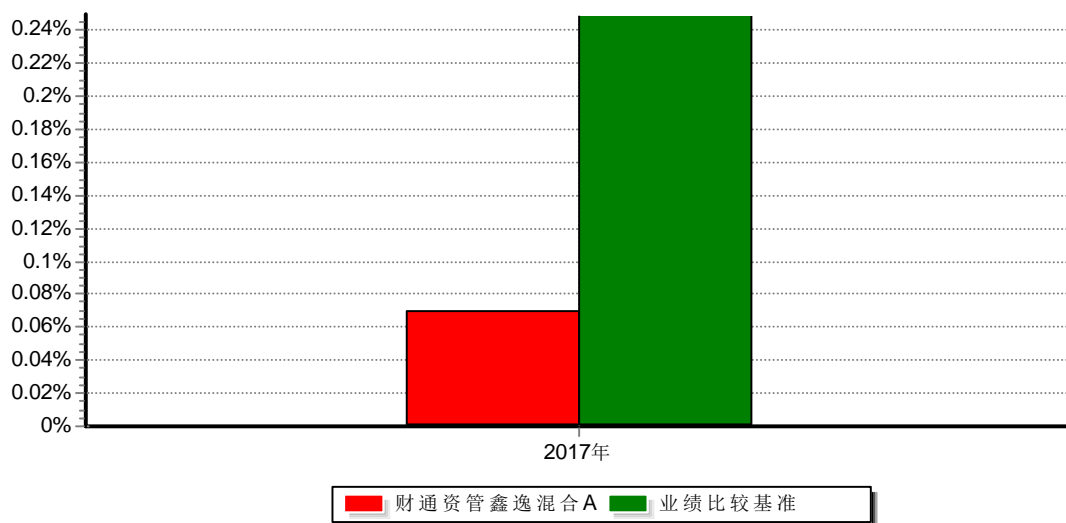
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

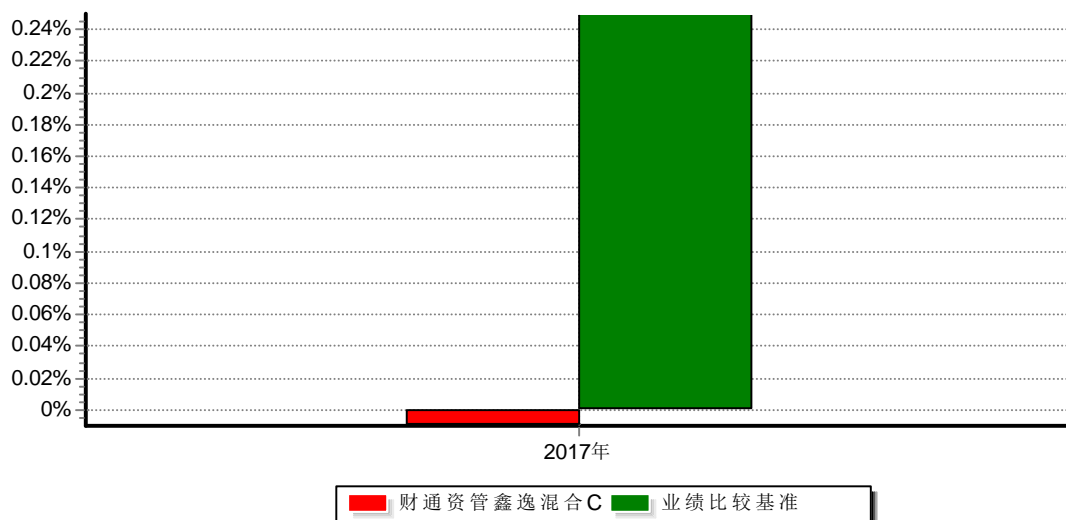
(2017年08月30日-2017年12月31日)



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、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金合同于2017年8月30日生效，本基金年度按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于2017年8月30日生效，本基金本报告期内无利润分配。

§ 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2017年12月31日，公司共管理4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、财通资管鑫锐回报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	2017年08月30日	—	6	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

	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和财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金基金经理				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。
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基金经理	2017年09月12日	—	14	复旦大学工商管理硕士，基金从业9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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制、银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；2、对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理，确保公平对待所有投资组合。

事后评估及反馈表现为对各基金投资组合公平交易进行事后分析，于每季度对公司管理的不同基金投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年宏观经济数据表现整体优于预期：2017年全年GDP同比增长6.9%，是七年来首次增速回升，显示经济整体运行向好。实体经济表现良好，规模以上工业同比增长6.6%，快于2016年0.6个百分点，创2014年以来新高；服务业保持较快发展，2017年全年全国服务业生产指数同比增长8.2%，增速比上年快0.1个百分点。投资增速前高后低走势显著，年末回落逐渐平稳：基建投资累计同比增速从年初超过20%降至年末的15%左右；地产开发投资增速持续下行，销售连续两个月回暖，但持续性有待观察；制造业投资受去产能与环保限产影响，全年增速较低；民间投资增速年末显著回暖，民间投资增速由2016年的3.2%回升至6.0%，企业投资意愿持续复苏。消费全年保持稳健增长，全年增长10.2%，消费升级态势明显。进出口结束了连续两年的负增长局面，成为经济增速超预期的重要支撑；2017年进出口（按美元计）同比增长11.4%，其中出口同比增长7.9%，进口同比增长15.9%，实现贸易顺差4225亿美元，为历史第三高位，贸易结构也明显优化。物价保持平稳，PPI走出通缩前高后低；2017年全年CPI同比上涨1.6%，较2016年下降0.4个百分点，通胀压力较为温和，主要源于食品价格罕见下跌；2017年全年PPI同比上涨6.3%，较2016年-1.4%的增速大幅提升，反映出在供给侧结构性改革压缩产能、国内外需求复苏及企业补库存周期下，工业品供需平衡的反转。12月新增信贷创年内最低值，2017年全年新增人民币贷款较2016年低1个百分点；2017年社会融资规模增量累计为19.44万亿元，比上年多1.63万亿元；2017年M2创历史新低，反映金融去杠杆取得一定成效。人民币汇率先贬后升，外汇储备持续增长，热钱流出减少；2017年，我国外汇储备环比增加1294亿美元，升幅4.3%，为三年来首次年度增长。

全球经济方面：美国经济稳健增长，通胀有所上升，全面税改通过，吸引资金回流，2017年渐进式加息三次，带动全球货币政策收紧；欧洲经济持续稳健复苏，通胀低位运行，欧央行上调经济增长预期，或考虑在2018年初逐渐调整前瞻指引；日本经济形势好转，2018年1月削减购债规模，释放收紧货币政策信号；新兴经济总体向好。

2017年信用债和利率债收益率大幅上行。2017年四季度，10年国债上行89bp，10国开上行150bp，3年AAA企业债和AA+企业债分别上行139bp和130bp。

分阶段看，2017年1季度是债市调整期，国债收益率平稳中小幅抬升，信用债收益率上行幅度较大，信用利差逐渐走阔；4月受市场传言冲击委外出现大规模赎回，利率债和信用债同步大幅调整，信用利差保持相对稳定；6月监管环境、资金面缓和，债市迎来久违的反弹行情，信用债走势好于利率债，但并未持续多久；从10月中旬开始债市又出现了大幅调整：一是经济基本面好于市场预期；二是市场对金融监管加强的担忧；三是美国经济超预期、美债利率大幅上行的影响；行情持续到12月初调整有所缓和，特别是利率债收益开始小幅下行。

相对于2016年，2017年公募债券信用违约情况稍有好转。截至11月底有24只公募债

券实质性违约，涉及发行主体13家、新增违约主体只有4家，相较于2016年大有好转。城投债尚未发生实质性违约。时间上来看，违约集中在上半年。

固收方面：2017年金融监管进一步升级，“三三四”、资管新规征求意见稿、流动性新规等，去杠杆、防风险奠定本年的基调；货币政策中性偏紧，央行3次上调公开市场利率，资金面呈阶段性偏紧现象。2017年我们坚持年初制定的低杠杆短久期策略，配置方面重点关注周期性企业，规避中小房企，严格甄选城投企业，回避负债率过高、行政级别低及争议地区的城投债；组合整体风格稳健，我们抓住5、6月份市场机会进行债券波段操作，把握转债的机会进行波段和套利操作增厚收益；四季度及时减仓，为客户保留收益，静待市场机会，甄选低估债券进行研究配置。

权益方面：2017年权益市场涨幅最大的是上证50，涨幅为25.08%，主要是消费白马和核心资产两个方向，机构投资占据主导，随着均值回归，未来机构低配的行业存在配置回升的机会。组合以白马、龙头及低估板块逐步建仓、分散化投资，右侧操作思路，把握确定性机会，四季度市场调整期及时减仓，为客户保留收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，财通资管鑫逸混合A基金份额净值增长率为0.07%，同期业绩比较基准收益率为0.25%，落后同期业绩比较基准0.18%；财通资管鑫逸混合C基金份额净值增长率为-0.01%，同期业绩比较基准收益率为0.25%，落后同期业绩比较基准0.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年展望和策略方面，预计2018年经济保持稳中求进，经济结构有望继续改善。2018年工业企业能否回暖，核心在于上游企业利润能否逐渐向下游传导，在于全行业盈利能否持续回升，目前尚未看到盈利持续回升迹象预计2018年上半年工业企业利润放缓趋势或延续。2018年投资增速预计继续下行，分项来看：基建投资和房地产开发投资延续回落趋势，但韧性仍在；制造业投资或将在需求持续改善的带动下继续回升。2018年消费在居民收入稳步增长、消费升级步伐加快、消费区域结构不断优化等因素支撑下，预计继续保持平稳较快增长。CPI中枢抬升，通胀预计前高后稳，在全球货币收紧背景下，2018年货币政策易紧难松，PPI预计前高后低逐步回落。2017年12月进口增速下降较多，显示内需有所回落，出口先导指数下降，预计2018年外需对经济增长贡献或降低。2018年保持人民币汇率基本稳定或依然是汇率政策的基调，预计未来人民币汇率仍将保持双向波动、整体稳定格局。

固收方面：本组合继续维持适度杠杆水平，保持良好的流动性，配置方面以中短久期高评级为主，对中长期品种保持谨慎，在确定性大的前提下适度进行右侧交易，控制久期；板块方面关注周期性行业的配置价值，规避中小地产企业，防范城投债的灰犀牛风险；重视转债的一级打新机会，择机参与利率债、国债期货和转债的波段操作，力争

在保证安全性和流动性的前提下增厚整体收益。

权益方面：2018年的A股或仍然是结构性行情为主的市场，市场风格有望逐步转向新兴成长和优质白马的“精中选精”。在选股层面，我们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，这是在当前环境下较稳妥的投资方向，看好以下几方面：泛消费领域、科技行业（消费电子，计算机、传媒娱乐等）、医疗服务和健康领域，并将其作为重点考虑投资方向。本组合大部分权益仓位会用于配置“现金牛”标的，寻找供求关系趋势性向好的子行业或细分子行业及其对应的个股，还有小部分仓位可能会参与一些博弈品种，尤其是那些商业模式、技术、业态出现变化和竞争策略领先的企业，重点考察收入增长的爆发力和盈利拐点，但须辅以非常严格的风险控制策略，严格止盈止损机制。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017年，合规负责人和合规稽核部持续完善合规管理制度体系，扎实推进合规文化建设，全面有效地开展合规审查与检查工作，确保公司各项业务和日常经营合规、平稳和高效运行。

（一）扎实推进合规文化建设

通过专业人员授课、合规风控岗培训、全员合规考试、重要法规政策解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种方式，确保常态化的合规文化建设机制正常运行，使得公司广大员工守法合规和诚实守信的意识得到提高，有效推动了“全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”企业合规文化理念的树立，为公司业务的规范和健康发展提供良好的文化土壤。

（二）持续完善合规管理制度体系

根据法律法规的新变化、结合行业发展的新动态、围绕业务开展的新需要，适时组织更新合规稽核管理制度，不断优化内控环节，持续创新操作流程，使得合规管理制度体系的效用得到进一步提高，业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性都明显提升，为公司规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

（三）全面有效开展日常合规审核

依照法律法规、监管要求及公司制度规定，从合规角度向公司各大业务板块和职能部门提供全面支持和服务保障，并对新业务、新产品、重大决策事项从管理程序、潜在风险和防控措施等方面提出合规审查意见、提供相关咨询解答，确保公司各项的业务能够合法合规开展。

（四）员工执业与投资行为管理

督促新员工入职时完善基本信息、完成相关投资申报工作。定期提示并持续跟进监督公募人员进行依照法规要求投资申报。对投资管理人员通讯工具集中管理予以督促并

且定期检查。对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期执行合规检查。通过常态化的员工执业和投资行为合规管理机制，促使员工执业和投资行为持续符合监管要求，有效地进行敏感信息管控，防范内幕交易和利益输送等违法违规行为。

（五）反洗钱合规管理

依照法规及公司制度要求，开展日常可疑交易监控排查及客户风险等级划分，修订反洗钱内控管理制度，完成2017年度反洗钱工作报告，开展2017年度反洗钱金融机构分类评级自评工作，开展“引导投资者远离非法证券期货活动”以及金融知识普及月等反洗钱宣传及自查工作。

（六）加强合规检查与专项审计

按照法律法规以及监管机构的要求，定期对公司各业务部门执行法规及制度的情况进行合规检查和专项审计，查漏补缺、排查隐患、防范潜在风险，并就检查和审计中发现问题与相关部门制定整改方案，同时加大整改跟踪力度。专项审计和合规检查工作促进了公司内部控制管理的完善，防范了合规风险的发生。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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，对本基金管理人—财通证券资产管理有限公司2017年8月30日至2017年12月31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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第20891号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企

	<p>业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了财通资管鑫逸回报混合基金2017年12月31日的财务状况以及2017年8月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于财通资管鑫逸回报混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>无</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任段</p>	<p>财通资管鑫逸回报混合基金的基金管理人财通证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估财通资管鑫逸回报混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算财通资管鑫逸回报混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督财通资管鑫逸回报混合基金的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对财通资管鑫逸回报混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致财通资管鑫逸回报混合基金不能持续经营。

	(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞 沈兆杰
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2018年03月30日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	6,421,771.74
结算备付金		6,370,158.44
存出保证金		254,895.84
交易性金融资产	7.4.7.2	622,645,807.65
其中：股票投资		200,905,175.35
基金投资		—
债券投资		421,740,632.30
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	84,736,867.11
应收证券清算款		—

应收利息	7.4.7.5	10,361,335.39
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		730,790,836.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		121,044,707.95
应付证券清算款		3,793,761.87
应付赎回款		1,082,597.77
应付管理人报酬		345,700.49
应付托管费		79,777.03
应付销售服务费		12,893.07
应付交易费用	7.4.7.7	916,668.81
应交税费		—
应付利息		10,937.87
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	177,045.12
负债合计		127,464,089.98
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	602,973,494.76
未分配利润	7.4.7.1 0	353,251.43
所有者权益合计		603,326,746.19
负债和所有者权益总计		730,790,836.17

注：1、本基金合同生效日为2017年8月30日，2017年度实际报告期间为2017年8月30日至2017年12月31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。

2、报告截止日2017年12月31日，A类基金份额净值1.0007元，C类基金份额净值0.9999元；基金份额总额602,973,494.764份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额542,570,846.35份，C类基金份额总额60,402,648.41份。

7.2 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：2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入		5,100,540.68
1. 利息收入		11,659,299.68
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	202,521.37
债券利息收入		8,612,959.12
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		2,843,819.19
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,246,989.06
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	-4,797,869.36
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.1 3	-1,465,481.70
资产支持证券投资收益		—

贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.1 4	—
股利收益	7.4.7.1 5	16,362.00
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.1 6	-369,884.58
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.1 7	58,114.64
减：二、费用		4,727,501.89
1. 管理人报酬		1,589,850.18
2. 托管费		366,888.49
3. 销售服务费		108,056.88
4. 交易费用	7.4.7.1 8	1,988,274.41
5. 利息支出		477,271.98
其中：卖出回购金融资产支出		477,271.98
6. 其他费用	7.4.7.1 9	197,159.95
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		373,038.79
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		373,038.79

注：本基金合同生效日为2017年8月30日，2017年度实际报告期间为2017年8月30日至2017年12月31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。

7.3 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：2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	752,806,584.78	—	752,806,584.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	373,038.79	373,038.79
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)	-149,833,090.02	-19,787.36	-149,852,877.38
其中：1. 基金申购款	289,166.48	-146.87	289,019.61
2. 基金赎回款	-150,122,256.50	-19,640.49	-150,141,896.99
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)	602,973,494.76	353,251.43	603,326,746.19

注：本基金合同生效日为2017年8月30日，2017年度实际报告期间为2017年8月30日至2017年12月31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7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 20%+中债综合指数收益率 \times 80%。

本财务报表由本基金的基金管理人财通证券资产管理有限公司于2018年3月30日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编

制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年8月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间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2017年12月31日的财务状况以及2017年8月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2017年8月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资和权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款

项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资和权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应

对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换

债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
活期存款	6,421,771.74
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	6,421,771.74

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	198,216,890.62	200,905,175.35	2,688,284.73
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	158,918,132.30	-257,006.74
	银行间市场	262,822,500.00	-2,801,162.57
	合计	421,740,632.30	-3,058,169.31
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	623,015,692.23	622,645,807.65	-369,884.58

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2017年12月31日
----	----------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	—	—
银行间市场	84,736,867.11	—
合计	84,736,867.11	—

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2017年12月31日
应收活期存款利息	1,851.06
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	2,416.60
应收债券利息	10,079,332.06
应收买入返售证券利息	277,620.97
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	114.70
合计	10,361,335.39

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	906,706.58
银行间市场应付交易费用	9,962.23
合计	916,668.81

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,045.12
预提费用	176,000.00
合计	177,045.12

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (财通资管鑫逸混合A)	本期2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	565,631,646.43	565,631,646.43
本期申购	189,116.25	189,116.25
本期赎回(以“-”号填列)	-23,249,916.33	-23,249,916.33
本期末	542,570,846.35	542,570,846.35
项目 (财通资管鑫逸混合C)	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	187,174,938.35	187,174,938.35
本期申购	100,050.23	100,050.23
本期赎回(以“-”号填列)	-126,872,340.17	-126,872,340.17
本期末	60,402,648.41	60,402,648.41

注：1. 本基金自2017年7月25日至2017年8月25日止期间公开发售，共募集有效净认购资金752,401,753.52元。根据《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入404,831.26元在本基金成立后，折算为404,831.26份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于2017年8月30日(基金合同生效日)至2017年11月28日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自2017年11月29日起开始办理。

3. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	103,754.28	249,750.87	353,505.15
本期基金份额交易 产生的变动数	-86,758.69	91,529.13	4,770.44
其中：基金申购款	246.16	-222.94	23.22
基金赎回款	-87,004.85	91,752.07	4,747.22
本期已分配利润	—	—	—
本期末	16,995.59	341,280.00	358,275.59

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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	639,169.09	-619,635.45	19,533.64
本期基金份额交易 产生的变动数	-682,415.27	657,857.47	-24,557.80
其中：基金申购款	457.48	-627.57	-170.09
基金赎回款	-682,872.75	658,485.04	-24,387.71
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-43,246.18	38,222.02	-5,024.16

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
活期存款利息收入	186,787.28
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	15,204.03
其他	530.06
合计	202,521.37

注：其他包括存出保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出股票成交总额	812,233,714.38
减：卖出股票成本总额	817,031,583.74
买卖股票差价收入	-4,797,869.36

注：本基金本报告期内无认沽权证行权产生的买卖股票差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31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	-1,465,481.70
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	-1,465,481.70

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	177,317,170.10
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	169,151,307.70
减:应收利息总额	9,631,344.10
买卖债券差价收入	-1,465,481.70

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期
	2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	16,362.00
基金投资产生的股利收益	—
合计	16,362.00

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
	2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
1.交易性金融资产	-369,884.58
——股票投资	2,688,284.73
——债券投资	-3,058,169.31
——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	—
合计	-369,884.58

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金赎回费收入	58,114.64
合计	58,114.64

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
交易所市场交易费用	1,985,726.73
银行间市场交易费用	2,547.68
合计	1,988,274.41

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年08月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日
审计费用	67,000.00
信息披露费	100,000.00
帐户维护费	9,490.00
汇划手续费	20,669.95
合计	197,159.95

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
财通证券股份有限公司（“财通证券”）	基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券	1,250,541,929.07	68.43%

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。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券	391,133,147.00	98.00%

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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财通证券	2,194,136,000.00	96.38%

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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31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	576,630.84	57.74%	484,738.86	53.46%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,589,850.18
其中：支付销售机构的客户维护费	1,018,612.97

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	366,888.49

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。

7.4.10.2.3 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		
	2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	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	—	16,950.59	16,950.59
中国农业银行	—	19,100.33	19,100.33
财通证券	—	71,997.66	71,997.66
合计	—	108,048.58	108,048.58

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	6,421,771.74	186,787.28

注：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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券									
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：张）	期末成本总额	期末估值总额
110042	航电转债	2017-12-28	2018-01-15	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00
128024	宁行转债	2017-12-08	2018-01-12	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00
128026	众兴转债	2017-12-18	2018-01-	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00

			03						
--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

7.4.12.2 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
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	151,900	4,521,227.00	4,017,755.00
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	48,000	1,519,200.00	1,542,720.00

注：本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额34,699,707.95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
1180008	11新余债	2018-01-05	101.31	200,000	20,262,000.00
011751104	17融德资产SCP001	2018-01-04	99.81	150,000	14,971,500.00
合计				350,000	35,233,500.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31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86,345,000.00元，于2018年1月12日(先后)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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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，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。

7.4.13.2.1 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 2017年12月31日
A-1	—
A-1以下	—
未评级	61,386,600.00
合计	61,386,600.00

注：未评级部分为国债、政策性金融债和超短期融资券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年12月31日
AAA	81,105,944.80
AAA以下	279,248,087.50
未评级	—
合计	360,354,032.30

7.4.13.3 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2017年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有121,044,707.95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。

7.4.13.3.1 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上述比例限制)。

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7.4.12。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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

注:流动性受限资产、7个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 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	60,576,	172,193	129,609	18,814,	211,266	730,790

	, 693. 13	000. 00	, 600. 00	, 532. 30	500. 00	, 510. 74	, 836. 17
负债							
卖出回购金 融资产款	121, 044 , 707. 95	—	—	—	—	—	121, 044 , 707. 95
应付证券清 算款	—	—	—	—	—	3, 793, 7 61. 87	3, 793, 7 61. 87
应付赎回款	—	—	—	—	—	1, 082, 5 97. 77	1, 082, 5 97. 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, 3 82. 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。

7. 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

		2017年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	525, 611. 20
	2. 市场利率上升25个基点	-521, 666. 49

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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%，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，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	200, 905, 175. 3 5	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	200,905,175.35	33.30

7.4.13.4.3.2 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 2017年12月31日
	1. 上证综指、中小板指、创业板指”指数均上升5%	12,013,050.72
	2. 上证综指、中小板指、创业板指”指数均下降5%	-12,013,050.72

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为195,344,700.35元，属于第二层次的余额为427,301,107.30

元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	200,905,175.35	27.49
	其中：股票	200,905,175.35	27.49
2	固定收益投资	421,740,632.30	57.71
	其中：债券	421,740,632.30	57.71
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	84,736,867.11	11.60
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	12,791,930.18	1.75
7	其他各项资产	10,616,231.23	1.45
8	合计	730,790,836.17	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,131,680.00	0.19
B	采矿业	4,976,694.00	0.82
C	制造业	136,025,635.47	22.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,900.00	—
E	建筑业	8,542,168.72	1.42
F	批发和零售业	6,882,048.00	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,031,176.00	0.17
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,548,033.20	3.07
J	金融业	2,481,799.60	0.41
K	房地产业	14,450,377.00	2.40

L	租赁和商务服务业	1,788,559.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	1,625,487.36	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	869,139.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	2,536,478.00	0.42
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	200,905,175.35	33.30

8.3 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	000671	阳光城	659,000	5,186,330.00	0.86
2	000039	中集集团	219,500	5,015,575.00	0.83
3	000538	云南白药	46,000	4,682,340.00	0.78
4	600048	保利地产	311,100	4,402,065.00	0.73
5	002366	台海核电	151,900	4,017,755.00	0.67
6	600276	恒瑞医药	58,240	4,017,395.20	0.67
7	601766	中国中车	328,400	3,976,924.00	0.66
8	002081	金螳螂	255,496	3,914,198.72	0.65
9	600519	贵州茅台	5,600	3,905,944.00	0.65
10	600196	复星医药	86,400	3,844,800.00	0.64
11	600521	华海药业	126,200	3,801,144.00	0.63
12	000333	美的集团	61,300	3,397,859.00	0.56
13	603355	莱克电气	66,600	3,282,048.00	0.54
14	600028	中国石化	533,600	3,270,968.00	0.54
15	601668	中国建筑	341,000	3,075,820.00	0.51
16	000963	华东医药	54,800	2,952,624.00	0.49
17	002153	石基信息	106,100	2,828,626.00	0.47

18	600055	万东医疗	174,770	2,787,581.50	0.46
19	002271	东方雨虹	68,000	2,717,280.00	0.45
20	000425	徐工机械	584,400	2,705,772.00	0.45
21	300088	长信科技	342,000	2,677,860.00	0.44
22	600771	广誉远	63,600	2,593,608.00	0.43
23	600570	恒生电子	54,700	2,538,080.00	0.42
24	600703	三安光电	99,943	2,537,552.77	0.42
25	300347	泰格医药	72,100	2,536,478.00	0.42
26	000858	五粮液	31,600	2,524,208.00	0.42
27	600340	华夏幸福	79,800	2,504,922.00	0.42
28	600030	中信证券	137,116	2,481,799.60	0.41
29	603899	晨光文具	100,504	2,478,428.64	0.41
30	002304	洋河股份	20,900	2,403,500.00	0.40
31	000568	泸州老窖	36,100	2,382,600.00	0.39
32	300458	全志科技	83,000	2,362,180.00	0.39
33	603658	安图生物	44,340	2,359,774.80	0.39
34	600641	万业企业	175,900	2,357,060.00	0.39
35	000977	浪潮信息	117,176	2,329,458.88	0.39
36	000513	丽珠集团	34,800	2,312,460.00	0.38
37	002463	沪电股份	432,600	2,305,758.00	0.38
38	300188	美亚柏科	111,200	2,221,776.00	0.37
39	603708	家家悦	109,200	2,186,184.00	0.36
40	300316	晶盛机电	103,000	2,153,730.00	0.36
41	600584	长电科技	99,800	2,128,734.00	0.35
42	603816	顾家家居	34,600	2,040,362.00	0.34
43	002439	启明星辰	86,700	2,024,445.00	0.34
44	300054	鼎龙股份	176,800	2,017,288.00	0.33
45	600267	海正药业	131,300	1,987,882.00	0.33
46	002008	大族激光	40,000	1,976,000.00	0.33
47	603989	艾华集团	50,799	1,951,697.58	0.32
48	600271	航天信息	90,100	1,940,754.00	0.32

49	002410	广联达	96,692	1,895,163.20	0.31
50	603579	荣泰健康	30,000	1,889,700.00	0.31
51	300630	普利制药	24,500	1,875,720.00	0.31
52	600138	中青旅	85,700	1,788,559.00	0.30
53	002217	合力泰	177,900	1,779,000.00	0.29
54	300413	快乐购	58,400	1,743,240.00	0.29
55	002557	洽洽食品	109,400	1,727,426.00	0.29
56	300146	汤臣倍健	114,322	1,717,116.44	0.28
57	600256	广汇能源	337,100	1,705,726.00	0.28
58	603458	勘设股份	21,504	1,625,487.36	0.27
59	300604	长川科技	25,900	1,605,800.00	0.27
60	000553	沙隆达A	100,360	1,590,706.00	0.26
61	601390	中国中铁	185,000	1,552,150.00	0.26
62	600332	白云山	48,000	1,542,720.00	0.26
63	603515	欧普照明	35,700	1,529,388.00	0.25
64	600845	宝信软件	82,300	1,525,842.00	0.25
65	300456	耐威科技	33,700	1,519,196.00	0.25
66	600206	有研新材	123,500	1,479,530.00	0.25
67	000938	紫光股份	20,400	1,469,412.00	0.24
68	603595	东尼电子	18,500	1,420,800.00	0.24
69	300558	贝达药业	22,400	1,417,696.00	0.23
70	603160	汇顶科技	14,600	1,415,324.00	0.23
71	300357	我武生物	28,000	1,377,880.00	0.23
72	300415	伊之密	77,600	1,341,704.00	0.22
73	300271	华宇软件	87,600	1,303,488.00	0.22
74	300577	开润股份	21,000	1,292,970.00	0.21
75	002773	康弘药业	20,398	1,258,148.64	0.21
76	300613	富瀚微	5,900	1,238,292.00	0.21
77	300327	中颖电子	39,100	1,216,792.00	0.20
78	002859	洁美科技	33,300	1,187,145.00	0.20
79	300310	宜通世纪	100,900	1,169,431.00	0.19

80	603338	浙江鼎力	14,500	1,140,280.00	0.19
81	000998	隆平高科	44,000	1,131,680.00	0.19
82	002080	中材科技	40,100	1,056,635.00	0.18
83	600115	东方航空	125,600	1,031,176.00	0.17
84	603337	杰克股份	19,700	1,015,338.00	0.17
85	300638	广和通	21,200	954,636.00	0.16
86	300170	汉得信息	80,000	952,000.00	0.16
87	002456	欧菲科技	45,978	946,687.02	0.16
88	000063	中兴通讯	25,200	916,272.00	0.15
89	002185	华天科技	105,300	897,156.00	0.15
90	300009	安科生物	34,300	889,399.00	0.15
91	000888	峨眉山A	80,700	869,139.00	0.14
92	002396	星网锐捷	40,000	863,600.00	0.14
93	300166	东方国信	67,800	850,890.00	0.14
94	002792	通宇通讯	23,100	821,205.00	0.14
95	600201	生物股份	19,900	631,626.00	0.10
96	603501	韦尔股份	14,900	622,373.00	0.10
97	600025	华能水电	3,000	15,900.00	—

注：本基金本报告期末前十名股票中“台海核电”处于停牌。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	20,369,541.00	3.38
2	600036	招商银行	17,121,404.53	2.84
3	600028	中国石化	15,646,690.00	2.59
4	002142	宁波银行	15,388,113.38	2.55
5	600016	民生银行	15,333,931.22	2.54
6	601166	兴业银行	15,096,773.00	2.50

7	600048	保利地产	12,738,431.45	2.11
8	600584	长电科技	11,301,294.26	1.87
9	000002	万科A	11,021,340.00	1.83
10	000963	华东医药	10,985,273.33	1.82
11	601601	中国太保	9,686,495.00	1.61
12	600197	伊力特	9,497,647.00	1.57
13	000333	美的集团	9,227,019.00	1.53
14	000063	中兴通讯	8,996,346.80	1.49
15	000538	云南白药	8,976,639.00	1.49
16	603515	欧普照明	8,593,909.00	1.42
17	000568	泸州老窖	8,506,603.78	1.41
18	002217	合力泰	8,226,984.09	1.36
19	000039	中集集团	8,119,442.43	1.35
20	300136	信维通信	8,035,910.44	1.33

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	19,233,200.51	3.19
2	600036	招商银行	17,579,523.85	2.91
3	002142	宁波银行	14,619,463.18	2.42
4	600016	民生银行	14,568,116.00	2.41
5	601166	兴业银行	14,549,990.20	2.41
6	600028	中国石化	11,981,664.00	1.99
7	000002	万科A	10,772,767.00	1.79
8	601601	中国太保	9,882,025.00	1.64
9	600197	伊力特	9,277,772.56	1.54
10	600584	长电科技	8,855,518.62	1.47
11	000063	中兴通讯	8,719,950.70	1.45
12	600048	保利地产	8,646,896.00	1.43

13	300136	信维通信	8,264,897.00	1.37
14	601318	中国平安	8,054,831.04	1.34
15	000963	华东医药	7,949,286.66	1.32
16	600050	中国联通	7,266,050.00	1.20
17	603515	欧普照明	7,243,336.60	1.20
18	300433	蓝思科技	6,684,838.62	1.11
19	601933	永辉超市	6,677,710.24	1.11
20	600702	舍得酒业	6,423,017.00	1.06

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,015,248,474.36
卖出股票收入（成交）总额	812,233,714.38

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	29,448,000.00	4.88
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,995,600.00	0.33
	其中：政策性金融债	1,995,600.00	0.33
4	企业债券	360,224,223.10	59.71
5	企业短期融资券	29,943,000.00	4.96
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	129,809.20	0.02
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	421,740,632.30	69.90

8.6 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	1280447	12金湖债	500,000	50,720,000.00	8.41
2	1480447	14福鼎债	500,000	40,795,000.00	6.76
3	1180047	11华泰债	400,000	40,332,000.00	6.68
4	122392	15恒大02	311,810	31,205,944.80	5.17
5	011751104	17融德资产 SCP001	300,000	29,943,000.00	4.96

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	254,895.84
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	10,361,335.39
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,616,231.23

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002366	台海核电	4,017,755.00	0.67	筹划重大资产重组事项

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
财通资管鑫逸	4,130	131,373.09	498,504.49	0.09%	542,072,341.86	99.91%

混合A						
财通资管鑫逸混合C	894	67,564.48	10,694,888.81	17.71%	49,707,759.60	82.29%
合计	5,024	120,018.61	11,193,393.30	1.86%	591,780,101.46	98.14%

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）。

9.2 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	2,974.72	—
	财通资管鑫逸混合C	—	—
	合计	2,974.72	—

9.3 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、基金投资和研发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金	财通资管鑫逸混合A	0
	财通资管鑫逸混合C	0
	合计	0

§ 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基 金总申购份额	189,116.25	100,050.23
减:基金合同生效日起至报告期期末 基金总赎回份额	23,249,916.33	126,872,340.17
基金合同生效日起至报告期期末基 金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	542,570,846.35	60,402,648.41

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人于2016年8月29日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于2017年3月8日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，公司作为被告收到天津市和平区人民法院于2017年4月27日出具的传票，原告为汉华易美（天津）图像技术有限公司，起诉事由为公司公众号未经授权使用其拥有著作权的图片侵害其信息网络传播权，索赔金额为33000元。2017年12月，法院一审判决部分支持原告请求，判令我司删除微信公众号上的涉案图片，支付原告经济损失合理开支共计5000元，同时承担诉讼受理费325元。我司已执行该生效判决。该等诉讼涉案金额较小，未对我司正常经营活动造成影响。除此之外，公司不存在其他尚未了结的重大诉讼、仲裁案件，也未发生其他新的重大诉讼、仲裁案件。本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为67,000.00元人民币。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	1,250,541,929.07	68.43%	576,630.84	57.74%	
长江证券	0		—	—	—	
东兴证券	1	254,666,637.89	13.94%	186,135.01	18.64%	
广发证券	0		—	—	—	
国金证券	1	173,017,594.49	9.47%	126,527.83	12.67%	
海通证券	0		—	—	—	
华宝证券	0		—	—	—	
华泰证券	0		—	—	—	
天风证券	0		—	—	—	
兴业期货	0		—	—	—	
兴业证券	1	149,249,517.29	8.17%	109,304.88	10.95%	
永安期货	0		—	—	—	
招商期货	0		—	—	—	
中泰证券	0		—	—	—	

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
财通证券	391,133,147.00	98.00%	2,194,136,000.00	96.38%	—	—
长江证券		—		—		—
东兴证券	5,976,960.00	1.50%	—	—	—	—
广发证券		—		—		—
国金证券	—	—	—	—	—	—
海通证券		—		—		—
华宝证券		—		—		—
华泰证券		—		—		—
天风证券		—		—		—
兴业期货		—		—		—
兴业证券	1,994,000.00	0.50%	82,445,000.00	3.62%	—	—
永安期货		—		—		—
招商期货		—		—		—
中泰证券		—		—		—

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、个股分析的报告及丰富全面的信息；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。

11.8 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基金份额发售公告	中国证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)	2017-07-21

2	财通资管鑫逸回报型混合型证券投资基金招募说明书	同上	2017-07-21
3	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金托管协议	同上	2017-07-21
4	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同	同上	2017-07-21
5	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同摘要	同上	2017-07-21
6	关于财通证券资产管理有限公司旗下基金增加工商银行作为销售机构的公告	同上	2017-07-25
7	财通证券资产管理有限公司关于旗下公募基金参加销售机构费率优惠活动的公告	同上	2017-07-25
8	关于财通证券资产管理有限公司旗下基金增加天天基金为销售机构的公告	同上	2017-07-28
9	关于财通证券资产管理有限公司旗下基金增加兴业银行为销售机构的公告	同上	2017-08-04
10	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2017-08-31
11	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2017-09-13
12	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	同上	2017-11-27
13	关于财通证券资产管理有限公司旗下基金增加上海挖财为销售机构的公告	同上	2017-12-01
14	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基金定投优惠活动的公告	同上	2017-12-28

15	财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金开放日常定期定额投资业务的公告	同上	2017-12-28
16	财通证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行基金交易费率优惠活动的公告	同上	2017-12-28

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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
二〇一八年三月三十一日