

# 财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金

## 2018 年半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	财通资管鑫锐混合	
基金主代码	004900	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月06日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	139,465,574.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通资管鑫锐混合A	财通资管鑫锐混合C
下属分级基金的交易代码	004900	004901
报告期末下属分级基金的份额总额	115,448,274.16份	24,017,300.48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，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	95566
传真	021-68753502	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	财通资管鑫锐混合A	财通资管鑫锐混合C
本期已实现收益	7,101.99	-360,880.61
本期利润	-1,457,049.82	-240,368.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0078	-0.0045
本期基金份额净值增长率	-3.53%	-3.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0305	-0.0336

期末基金资产净值	111,922,967.65	23,211,434.83
期末基金份额净值	0.9695	0.9664

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

财通资管鑫锐混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.13%	0.79%	-1.28%	0.25%	-2.85%	0.54%
过去三个月	-6.19%	0.73%	-1.22%	0.23%	-4.97%	0.50%
过去六个月	-3.53%	0.72%	-0.92%	0.23%	-2.61%	0.49%
自基金合同生效起至今	-3.05%	0.68%	-1.00%	0.22%	-2.05%	0.46%

财通资管鑫锐混合C

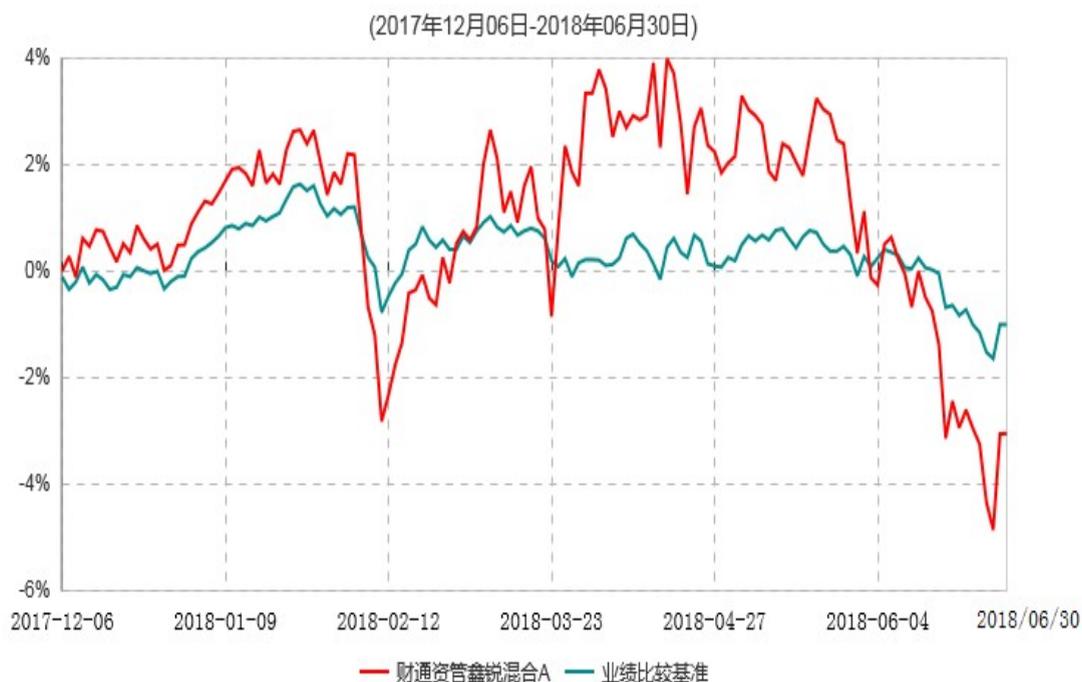
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.16%	0.79%	-1.28%	0.25%	-2.88%	0.54%
过去三个月	-6.37%	0.73%	-1.22%	0.23%	-5.15%	0.50%
过去六个月	-3.83%	0.72%	-0.92%	0.23%	-2.91%	0.49%

自基金合同生效起至今	-3.36%	0.68%	-1.00%	0.22%	-2.36%	0.46%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

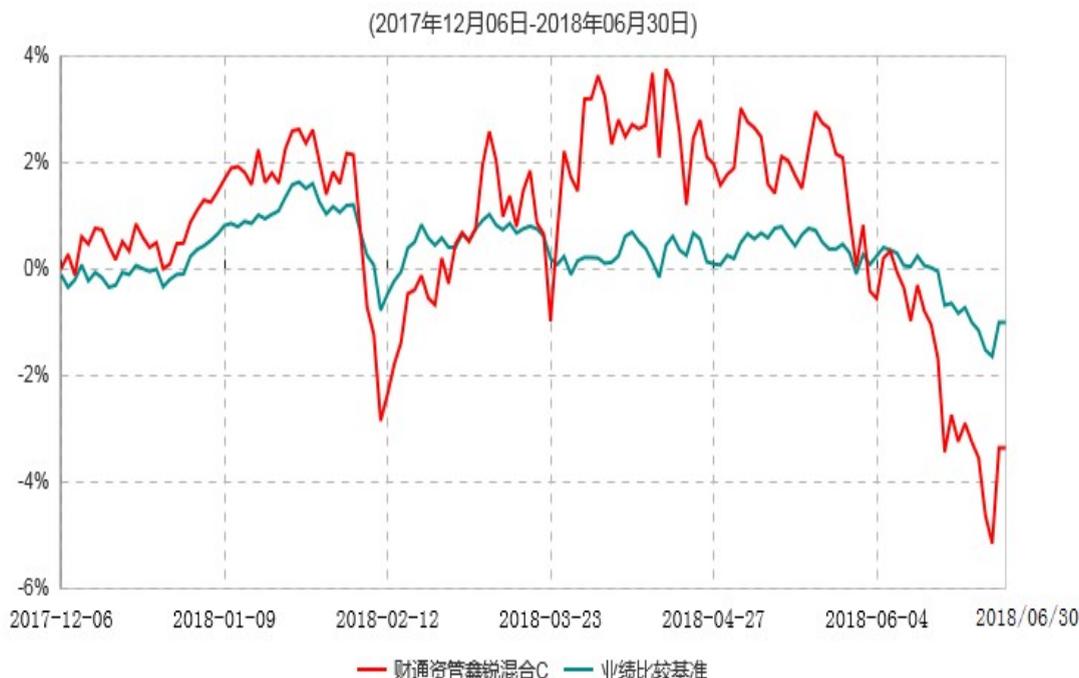
注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。 2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

### 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

财通资管鑫锐混合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



财通资管鑫锐混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2017 年 12 月 06 日生效，自合同起至本报告期末不满一年。

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

3、自基金合同生效至报告期末，财通资管鑫锐混合 A 基金份额净值增长率为-3.05%，同期业绩比较基准收益率为-1.00%；财通资管鑫锐回报 C 基金份额净值增长率为-3.36%，同期业绩比较基准收益率为-1.00%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫志芳	本基金基金经理、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金和财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金经理	2017-12-06	-	7年	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。
杨坤	本基金基金经理、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管消费精选灵活	2017-12-06	-	15年	复旦大学工商管理硕士，基金从业10年。历任光大保德信基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理；中欧基金管理有限公司行业研究员、研究部副总监、专户事业部投资经理助理；海富通基金管理有限公司投资经理；富国基金管理有限公司投资经理。

	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基金经理				
--	--	--	--	--	--

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《财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从基本面数据来看，上半年宏观经济数据弱于预期，特别是需求数据持续弱势。生产数据在一季度之后迎来了短暂的恢复，6月份PMI、发电量以及高炉开工等多项生产回暖，而需求数据回落并创出新低。生产和需求数据出现显著背离，6月上半月生产数据相继回落，经济增速承压明显。外部风险也在不断加剧，中美贸易摩擦不断升级，美元不断走强，人民币贬值压力陡增。6月下旬，央行在公开市场操作释放流动性的同时，进行2次降准，通过货币形式来稳定市场情绪，刺激经济发展。同时，个税改革再次提上日程，进一步降低居民税负，以期提振消费、扩大内需；从政策面来看，去杠杆是今年上半年的政策主线，M2、社融等数据大幅走弱，伴随而来的是社会需求快速下降，信用违约频现，及金融行业规模的收缩。短期来看，金融监管、市场对基本面和流动性预期仍是左右债市的主因，而债市在一系列利好因素支撑下，收益率震荡下行。中长期来看，在严监管、稳杠杆背景下，社融持续回落，货币政策难收紧，而内外需不强影响消费，基建、地产和制造业投资增速在“紧信用”背景下或难超去年，叠加中美贸易摩擦不确定性较大影响进出口，下半年经济下行压力较大，债市慢牛格局仍在。

产品投资策略方面，上半年抓住市场机会卖出部分长久期信用债，降低产品的久期及杠杆，同时关注市场错杀的AA+及以上评级的优质旧城投债，同时辅以转债的波段操作，在保证流动性的情况下增厚产品收益。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管鑫锐混合A基金份额净值为0.9695元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.53%，同期业绩比较基准收益率为-0.92%；截至报告期末财通资管鑫锐混合C基金份额净值为0.9664元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.83%，同期业绩比较基准收益率为-0.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政策层面，下半年去杠杆有望从缩减债务过渡到缩减债务与稳定经济增长混合搭配，货币政策有边际宽松的可能，后续可重点观察相关部门对于降准、社融、去杠杆路径的表述；基本面上下半年经济下行压力较大，债市慢牛格局仍在；权益方面，虽然股票价格短期会在一定程度上偏离公司的价值，但长期终将回归到基本面的投资逻辑，

目前无论是从历史估值角度，还是上市公司盈利增速来判断，我们都认为现在是一个很好的投资时点。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内无利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的

计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		1,754,139.09	1,807,199.32
结算备付金		682,705.45	-
存出保证金		89,930.45	-
交易性金融资产		150,004,346.10	252,848,802.76
其中：股票投资		53,396,634.03	109,438,113.36
基金投资		-	-
债券投资		96,607,712.07	143,410,689.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	131,302,366.57
应收证券清算款		-	2,937,018.74
应收利息		2,995,996.22	3,352,712.79
应收股利		-	-
应收申购款		9,904.91	-

递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		155,537,022.22	392,248,100.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年06月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		19,599,730.60	41,216,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		282,683.96	-
应付管理人报酬		74,831.28	155,961.12
应付托管费		17,268.77	35,991.01
应付销售服务费		4,105.29	12,501.37
应付交易费用		295,816.48	106,879.18
应交税费		11,741.60	-
应付利息		22,911.59	-18,047.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		93,530.17	54,388.80
负债合计		20,402,619.74	41,563,673.50
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		139,465,574.64	348,956,049.71
未分配利润		-4,331,172.16	1,728,376.97
所有者权益合计		135,134,402.48	350,684,426.68
负债和所有者权益总计		155,537,022.22	392,248,100.18

注：报告截止日2018年6月30日，A类基金份额净值0.9695元，C类基金份额净值0.9664元；基金份额总额139,465,574.64份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额115,448,274.16份，C类基金份额总额24,017,300.48份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日
<b>一、收入</b>		2,035,080.59
1. 利息收入		4,574,164.44
其中：存款利息收入		52,730.78
债券利息收入		4,177,026.13
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		344,407.53
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,551,817.72
其中：股票投资收益		-2,245,623.44
基金投资收益		-
债券投资收益		245,377.40
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		448,428.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-1,343,639.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		356,373.24
<b>减：二、费用</b>		3,732,498.58
1. 管理人报酬		789,438.25

2. 托管费		182,178.06
3. 销售服务费		54,797.44
4. 交易费用		1,574,673.12
5. 利息支出		1,002,898.23
其中：卖出回购金融资产支出		1,002,898.23
6. 税金及附加		14,259.01
7. 其他费用		114,254.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,697,417.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,697,417.99

注：本基金合同于2017年12月06日生效，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	348,956,049.71	1,728,376.97	350,684,426.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,697,417.99	-1,697,417.99
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）	-209,490,475.07	-4,362,131.14	-213,852,606.21
其中：1. 基金申购款	2,424,212.41	83,006.72	2,507,219.13
2. 基金赎回款	-211,914,687.48	-4,445,137.86	-216,359,825.34

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）	139,465,574.64	-4,331,172.16	135,134,402.48

注：本基金合同生效日为2017年12月06日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

马晓立

刘博

刘博

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

财通资管鑫锐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]870号《关于准予财通资管鑫锐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《财通资管鑫锐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348,759,887.15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1048号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为348,956,049.71份基金份额，其中认购资金利息折合196,162.56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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金基金合同》和《财通资管鑫锐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《财通资管鑫锐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、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货等）、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为0%-40%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证、期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会（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》、《财通资管鑫锐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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。此外，本财务报表同时符合如会计报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

### 6.4.4.3 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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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、资产支持证券和衍生工具(主要为权证投资)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,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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[2008]38号《关于进一步规范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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金报告期末未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 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	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券股份有限公司	562,120,692.66	44.81%	—	—

注：本基金合同生效日为2017年12月06日，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券股份有限	171,398,870.13	90.69%	—	—

公司				
----	--	--	--	--

注：本基金合同生效日为2017年12月06日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财通证券股份有限公司	713,100,000.00	63.65%	—	—

注：本基金合同生效日为2017年12月06日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	298,200.42	37.12%	84,764.26	29.01%
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	—	—	—	—

司				
---	--	--	--	--

注：1、本基金合同生效日为2017年12月06日，无上年度可比期间数据。

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

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

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月 30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	789,438.25	—
其中：支付销售机构的客户维护费	462,572.87	—

注：1、本基金合同生效日为2017年12月06日，无上年度可比期间数据。

2、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，按月支付。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月3 0日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月3 0日
当期发生的基金应支付的托管费	182,178.06	—

注：1、本基金合同生效日为2017年12月06日，无上年度可比期间数据。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：每日应

计提的基金托管费=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，按月支付。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称		本期 2018年01月01日至2018年06月30日		
		当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管鑫锐混合A	财通资管鑫锐混合C	合计	
财通证券 资产管理 有限公司	-	7,995.62	7,995.62	
财通证券 股份有限 公司	-	1,164.69	1,164.69	
中国银行 股份有限 公司	-	44,034.40	44,034.40	
合计	-	53,194.71	53,194.71	
获得销售 服务费的 各关联方 名称		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日		
		当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管鑫锐混合A	财通资管鑫锐混合C	合计	
财通证券 资产管理 有限公司	-	-	-	
财通证券 股份有限 公司	-	-	-	
中国银行 股份有限 公司	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：1. 本基金合同生效日为2017年12月06日，无上年度可比期间数据。  
 2. 本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.20%的年费率计提。其销售服务费计提的计算公式为：每日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值\*0.20%/当年天数。基金销售服务费每日累计，按月支付。

### 6.4.8.3 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。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

#### 6.4.8.4.2 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

本报告期末无其他关联方投资本基金。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年01月01日至2018年06月30日		2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,754,139.09	30,995.54	-	-

注：1、本基金的银行存款由托管人中国银行保管，按同业利率计息。  
 2、本基金合同生效日为2017年12月06日，无上年度可比期间数据。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

### 6.4.9 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。

### 6.4.10 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300146	汤臣倍健	2018-01-31	筹划重大资产重组事项	16.60	2018-07-31	16.5	107,500	1,647,664.00	1,784,500.00	-

#### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 19,599,730.60 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1580214	15江油债	2018-07-03	97.81	100,000	9,781,000.00
1680276	16岳云债01	2018-07-02	94.73	100,000	9,473,000.00
合计				200,000	19,254,000.00

##### 6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

### 6.4.11 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

#### 6.4.11.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	53,396,634.03	39.51	109,438,113.36	31.21
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	53,396,634.03	39.51	109,438,113.36	31.21

#### 6.4.11.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证综指、中小板指、创业板指”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年06月	上年度末 2017年12月

	30日	31日
上证综指、中小板指、创业板指”指数上升5%	3,123,372.78	-
”上证综指、中小板指、创业板指”指数下降5%	-3,123,372.78	-

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

#### 6.4.12 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	53,396,634.03	34.33
	其中:股票	53,396,634.03	34.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	96,607,712.07	62.11
	其中:债券	96,607,712.07	62.11
	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	2,436,844.54	1.57
8	其他各项资产	3,095,831.58	1.99
9	合计	155,537,022.22	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	33,154,727.96	24.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,827,757.00	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,341,173.52	0.99
H	住宿和餐饮业	927,696.00	0.69
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,041,330.00	6.69
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,141,304.55	0.84
L	租赁和商务服务业	1,429,902.00	1.06
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	2,769,323.00	2.05
R	文化、体育和娱乐业	763,420.00	0.56
S	综合	-	-
	合计	53,396,634.03	39.51

### 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002859	洁美科技	73,900	2,878,405.00	2.13
2	002912	中新赛克	30,100	2,829,400.00	2.09
3	600763	通策医疗	56,900	2,769,323.00	2.05
4	600690	青岛海尔	105,900	2,039,634.00	1.51
5	600309	万华化学	44,500	2,021,190.00	1.50
6	600519	贵州茅台	2,700	1,974,942.00	1.46
7	300146	汤臣倍健	107,500	1,784,500.00	1.32
8	603883	老百姓	17,700	1,471,932.00	1.09
9	300596	利安隆	59,902	1,467,599.00	1.09
10	600271	航天信息	57,900	1,463,133.00	1.08

### 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	600036	招商银行	12,773,660.81	3.64
2	601166	兴业银行	11,276,635.00	3.22
3	601288	农业银行	10,701,084.00	3.05

4	001979	招商蛇口	8,661,386.06	2.47
5	002304	洋河股份	8,379,472.00	2.39
6	601318	中国平安	7,285,977.00	2.08
7	600703	三安光电	7,211,613.00	2.06
8	000651	格力电器	7,002,141.00	2.00
9	600763	通策医疗	6,919,481.50	1.97
10	002008	大族激光	5,994,423.90	1.71
11	600570	恒生电子	5,657,035.90	1.61
12	300413	快乐购	5,458,559.00	1.56
13	601766	中国中车	5,453,037.00	1.55
14	600690	青岛海尔	5,318,732.00	1.52
15	600519	贵州茅台	5,277,509.00	1.50
16	600019	宝钢股份	5,046,620.00	1.44
17	000338	潍柴动力	5,000,105.00	1.43
18	300188	美亚柏科	4,996,997.00	1.42
19	600845	宝信软件	4,945,532.00	1.41
20	000661	长春高新	4,799,745.10	1.37

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	600036	招商银行	11,894,744.57	3.39
2	601288	农业银行	11,309,314.00	3.22
3	601166	兴业银行	10,968,197.00	3.13
4	002304	洋河股份	8,969,267.72	2.56
5	600703	三安光电	7,871,538.51	2.24
6	600570	恒生电子	7,338,207.69	2.09
7	001979	招商蛇口	7,305,471.88	2.08
8	002008	大族激光	7,119,708.18	2.03

9	300188	美亚柏科	6,698,886.59	1.91
10	601318	中国平安	6,552,570.00	1.87
11	601766	中国中车	6,328,286.00	1.80
12	600845	宝信软件	6,257,350.60	1.78
13	000651	格力电器	5,961,430.00	1.70
14	600340	华夏幸福	5,923,656.98	1.69
15	300413	芒果超媒	5,879,715.85	1.68
16	002081	金螳螂	5,791,292.00	1.65
17	000977	浪潮信息	5,568,744.00	1.59
18	600019	宝钢股份	5,220,984.00	1.49
19	600028	中国石化	5,219,721.00	1.49
20	600519	贵州茅台	5,154,508.00	1.47

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	600,659,335.25
卖出股票收入（成交）总额	653,708,434.40

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,378,718.60	6.20
	其中：政策性金融债	8,378,718.60	6.20
4	企业债券	64,465,920.00	47.71
5	企业短期融资券	5,014,000.00	3.71
6	中期票据	15,846,000.00	11.73
7	可转债（可交换债）	2,903,073.47	2.15

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,607,712.07	71.49

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1480603	14清河小微02	100,000	10,102,000.00	7.48
2	1580246	15内兴元小微债	100,000	10,027,000.00	7.42
3	101800024	18滨海新城MTN001	100,000	9,933,000.00	7.35
4	1580214	15江油债	100,000	9,781,000.00	7.24
5	1680113	16枣阳城投债	100,000	9,522,000.00	7.05

### 7.7 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。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	89,930.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,995,996.22
5	应收申购款	9,904.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,095,831.58

### 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

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	300146	汤臣倍健	1,784,500.00	1.32	筹划重大资产重组事项

## § 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
财通资管鑫锐混合A	851	135,661.90	505,058.51	0.44%	114,943,215.65	99.56%
财通资管鑫锐混合C	91	263,926.38	15,742,582.18	65.55%	8,274,718.30	34.45%
合计	942	148,052.63	16,247,640.69	11.65%	123,217,933.95	88.35%

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	财通资管鑫锐混合A	991.32	0.00%
	财通资管鑫锐混合C	999,500.25	4.16%
	合计	1,000,491.57	0.72%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	财通资管鑫锐混合 A	0
	财通资管鑫锐混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	财通资管鑫锐混合 A	0
	财通资管鑫锐混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管鑫锐混合A	财通资管鑫锐混合C
基金合同生效日(2017年12月06日)基金份额总额	258,045,174.12	90,910,875.59
本报告期期初基金份额总额	258,045,174.12	90,910,875.59
本报告期基金总申购份额	454,201.50	1,970,010.91
减：本报告期基金总赎回份额	143,051,101.46	68,863,586.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	115,448,274.16	24,017,300.48

## § 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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	180,460,129.77	14.39%	131,970.83	16.43%	-
广发证券	1	114,882,207.21	9.16%	84,707.46	10.55%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	136,010,382.17	10.84%	96,748.95	12.04%	-
海通证券	1	113,615,776.19	9.06%	83,913.06	10.45%	-
华宝证券	1	147,278,581.65	11.74%	107,704.72	13.41%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	562,120,692.66	44.81%	298,200.42	37.12%	-

#### 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	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的 比例		购成交 总额的 比例		交总额的 比例		交总额的 比例
长江证券	2,016.70	0.00%	252,500,000.00	22.54%	-	-	-	-
广发证券	7,492,089.22	3.96%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	103,771.04	0.05%	12,000,000.00	1.07%	-	-	-	-
海通证券	9,999,420.00	5.29%	28,000,000.00	2.50%	-	-	-	-
华宝证券	1,025.01	0.00%	114,800,000.00	10.25%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	171,398,870.13	90.69%	713,100,000.00	63.65%	-	-	-	-

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

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

基金交易单元的选择程序如下：

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

## § 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

财通证券资产管理有限公司

二〇一八年八月二十九日