

# 财通资管鑫达回报混合型证券投资基金

## 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:宁波银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月24日起至06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
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	41
7.9 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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43

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 .....	43
§9 开放式基金份额变动 .....	43
§10 重大事件揭示 .....	44
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
§12 备查文件目录 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金	
基金简称	财通资管鑫达混合	
基金主代码	005307	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年01月24日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,799,747.94份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通资管鑫达混合A	财通资管鑫达混合C
下属分级基金的交易代码	005307	005308
报告期末下属分级基金的份额总额	5,185,848.12份	47,613,899.82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	宁波银行股份有限公司
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	95574
传真	021-68753502	0574-89103213
注册地址	浙江省杭州市上城区白云路26号143室	浙江省宁波市鄞州区宁东路345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	浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码	200122	315100
法定代表人	马晓立	陆华裕

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月24日(基金合同生效日)-2018年06月30日)
---------------	---------------------------------------

	财通资管鑫达混合A	财通资管鑫达混合C
本期已实现收益	228,139.60	3,946,576.44
本期利润	193,434.70	4,288,412.81
加权平均基金份额本期利润	0.0250	0.0255
本期加权平均净值利润率	2.48%	2.53%
本期基金份额净值增长率	2.21%	1.83%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	21,138.29	103,688.71
期末可供分配基金份额利润	0.0041	0.0022
期末基金资产净值	5,206,986.41	47,717,588.53
期末基金份额净值	1.0041	1.0022
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.21%	1.83%

注：1、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；

2、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、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；

4、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

### 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

财通资管鑫达混合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	0.26%	0.04%	-1.28%	0.25%	1.54%	-0.21%

过去三 个月	0.71%	0.05%	-1.22%	0.23%	1.93%	-0.18%
自基金 合同生 效起至 今	2.21%	0.05%	-2.56%	0.24%	4.77%	-0.19%

财通资管鑫达混合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	0.23%	0.04%	-1.28%	0.25%	1.51%	-0.21%
过去三 个月	0.49%	0.05%	-1.22%	0.23%	1.71%	-0.18%
自基金 合同生 效起至 今	1.83%	0.05%	-2.56%	0.24%	4.39%	-0.19%

注：1、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%。

2、本基金的业绩比较基准是根据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



财通资管鑫达混合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

(2018年01月24日-2018年06月30日)



财通资管鑫达混合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

(2018年01月24日-2018年06月30日)



注：1、本基金合同于2018年1月24日生效，截至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六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。本报告期本基金已建仓完毕，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3、自基金合同生效至报告期末，财通资管鑫达回报A基金份额净值增长率为2.21%，同期业绩比较基准收益率为-2.56%；财通资管鑫达回报C基金份额净值增长率为1.83%，同期业绩比较基准收益率为-2.56%。

## § 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锐回报混合型证券投资基金基金经理	2018-01-24	-	7	武汉大学数理金融硕士，中级经济师，2010年7月进入浙江泰隆银行资金运营部先后从事外汇交易和债券交易。2012年3月进入宁波通商银行金融市场部筹备债券业务，主要负责资金、债券投资交易，同时15年初筹备并开展贵金属自营业务；2016年3月加入财通证券资产管理有限公司。

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

### 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达混合A基金份额净值为1.0041元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.21%，同期业绩比较基准收益率为-2.56%；截至报告期末财通资管鑫达混合C基金份额净值为1.0022元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.83%，同期业绩比较基准收益率为-2.56%。

#### 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。

#### 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

根据本基金合同第十六部分基金的收益与分配相关约定三、基金收益分配原则。1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；3、同一类别每一基金份额享有同等分配权；4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。四、收益分配方案基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。截止本报告期末 A 类份额可供分配利润为 21,138.29 元，C 类份额可供分配利润为 103,688.71 元。

2018 年 5 月 18 日（以 2018 年 5 月 15 日为收益分配基准日）本基金进行了利润分配，向 A 类基金份额持有人每 10 份基金份额分配 0.180 元，向 C 类基金份额持有人每 10 份基金份额分配 0.161 元。

#### 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，本托管人在财通资管鑫达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：财通资管鑫达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
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	226,781.46
结算备付金		529,769.43
存出保证金		51,817.25
交易性金融资产	6.4.7.2	54,564,598.45

其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		51,532,159.40
资产支持证券投资		3,032,439.05
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		96,786.50
应收利息	6.4.7.5	1,671,245.83
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		57,140,998.92
<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>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		4,000,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		33,979.03
应付管理人报酬		27,753.20
应付托管费		4,269.74
应付销售服务费		7,655.01
应付交易费用	6.4.7.7	54,219.51
应交税费		6,699.93
应付利息		-1,071.16
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	6.4.7.8	82,918.72
负债合计		4,216,423.98
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	52,799,747.94
未分配利润	6.4.7.10	124,827.00
所有者权益合计		52,924,574.94
负债和所有者权益总计		57,140,998.92

注：1、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，鑫达回报 A 类基金份额净值：1.0041 元，基金份额总额：52,799,747.94 份；鑫达回报 C 类基金份额净值：1.0022 元，基金份额总额：47,613,899.82 份；总基金份额合计为：52,799,747.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通资管鑫达回报混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日
<b>一、收入</b>		5,719,451.08
1. 利息收入		3,968,365.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	144,071.49
债券利息收入		3,461,912.50
资产支持证券利息收入		10,724.74
买入返售金融资产收入		351,656.72
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,420,621.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,420,621.47
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-

衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	307,131.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	23,332.69
<b>减：二、费用</b>		<b>1,237,603.57</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	505,988.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	77,844.40
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	148,899.59
4. 交易费用	6.4.7.18	60,144.08
5. 利息支出		348,754.78
其中：卖出回购金融资产支出		348,754.78
6. 税金及附加		11,553.71
7. 其他费用	6.4.7.19	84,418.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,481,847.51</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,481,847.51</b>

注：本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管鑫达回报混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2018年01月24日（基金合同生效日）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）	293,399,094.00	-	293,399,094.00
二、本期经营活动产	-	4,481,847.51	4,481,847.51



生的基金净值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-240,599,346.06	-2,328,258.33	-242,927,604.39
其中:1.基金申购款	24,723,858.65	139,055.80	24,862,914.45
2.基金赎回款	-265,323,204.71	-2,467,314.13	-267,790,518.84
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)	-	-2,028,762.18	-2,028,762.18
五、期末所有者权益(基金净值)	52,799,747.94	124,827.00	52,924,574.94

注:本基金合同于2018年1月24日生效,实际报告期间为2018年1月24日至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

马晓立

刘博

刘博

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

财通资管鑫达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]843号《关于准予财通资管鑫达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《财通资管鑫达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293,375,676.38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(2018)第0053号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同》于2018年1月24日正式生效,基金合同生效

日的基金份额总额为 293,399,094.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 23,417.62 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，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

#### 6.4.4 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。本期财务报表的实际编制期间为2018年1月24日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 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、资产支持证券投资和衍生工具（主要为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。

#### 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、市盈率法和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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策

有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	226,781.46
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	226,781.46

注：本基金合同于2018年1月24日生效，实际报告期间为2018年1月24日至2018年6月30日。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2018年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	16,871,205.21	17,045,759.40	174,554.19
	银行间市场	34,353,822.72	34,486,400.00	132,577.28
	合计	51,225,027.93	51,532,159.40	307,131.47
资产支持证券		3,032,439.05	3,032,439.05	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		54,257,466.98	54,564,598.45	307,131.47

注：本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产期末余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应收活期存款利息	116.35
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	193.40
应收债券利息	1,531,910.04
应收资产支持证券利息	139,002.74
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	23.30
合计	1,671,245.83

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	49,228.48
银行间市场应付交易费用	4,991.03
合计	54,219.51

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	82,918.72
合计	82,918.72

注：预提费用为按日计提的审计费、银行间账户维护费和信息披露费。

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 财通资管鑫达混合A

金额单位：人民币元

项目 (财通资管鑫达混合A)	本期2018年01月24日(基金合同生效日)至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	9,443,930.09	9,443,930.09
本期申购	2,393,126.88	2,393,126.88
本期赎回(以“-”号填列)	-6,651,208.85	-6,651,208.85
本期末	5,185,848.12	5,185,848.12

#### 6.4.7.9.2 财通资管鑫达混合C

金额单位：人民币元

项目 (财通资管鑫达混合C)	本期2018年01月24日(基金合同生效日)至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	283,955,163.91	283,955,163.91
本期申购	22,330,731.77	22,330,731.77
本期赎回(以“-”号填列)	-258,671,995.86	-258,671,995.86
本期末	47,613,899.82	47,613,899.82

注：1、本基金合同于2018年1月24日生效，实际报告期间为2018年1月24日至2018年6月30日。

2、本期申购包含红利再投、基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

3、本基金自2017年12月1日至2018年1月19日止期间公开发售，共募集有效净认购资金293,375,676.38元，折算为293,375,676.38份基金份额。根据《财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，经本基金注册登记人计算并确认，本基金认购资金在募集期内产生的利息人民币23,417.62元，折算为23,417.62份基金份额，划入基金持有人账户，两者合计293,399,094.00份基金份额。

4、根据《财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于2018年1月24日(基金合同生效日)至2018年3月25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2018年3月26日起开始办理。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 财通资管鑫达混合A

单位：人民币元

项目 (财通资管鑫达混合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	228,139.60	-34,704.90	193,434.70
本期基金份额交易产生的变动数	-65,462.74	-9,856.22	-75,318.96
其中：基金申购款	16,153.97	13,243.03	29,397.00
基金赎回款	-81,616.71	-23,099.25	-104,715.96
本期已分配利润	-96,977.45	-	-96,977.45
本期末	65,699.41	-44,561.12	21,138.29

注：本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。

#### 6.4.7.10.2 财通资管鑫达混合C

单位：人民币元

项目 (财通资管鑫达混合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	3,946,576.44	341,836.37	4,288,412.81
本期基金份额交易产生的变动数	-1,503,325.14	-749,614.23	-2,252,939.37
其中：基金申购款	170,054.92	-60,396.12	109,658.80
基金赎回款	-1,673,380.06	-689,218.11	-2,362,598.17
本期已分配利润	-1,931,784.73	-	-1,931,784.73
本期末	511,466.57	-407,777.86	103,688.71

注：本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日
活期存款利息收入	133,065.79
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	10,755.25

其他	250.45
合计	144,071.49

注：其他包括存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018 年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,420,621.47
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	1,420,621.47

注：本基金合同于2018年1月24日生效，实际报告期间为2018年1月24日至2018年6月30日。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018 年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	347,506,894.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	337,075,100.12
减：应收利息总额	9,011,173.02
买卖债券差价收入	1,420,621.47

注：本基金合同于2018年1月24日生效，实际报告期间为2018年1月24日至2018年6月30日。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06 月30日
1. 交易性金融资产	307,131.47
——股票投资	-
——债券投资	307,131.47
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	307,131.47

注：本基金合同于2018年1月24日生效，实际报告期间为2018年1月24日至2018年6月30日。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30 日
基金赎回费收入	23,332.69
合计	23,332.69

注：1、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。

2、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日
交易所市场交易费用	54,904.08
银行间市场交易费用	5,240.00
合计	60,144.08

注：本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日
审计费用	27,719.52
信息披露费	46,199.20
帐户维护费	10,500.00
合计	84,418.72

注：本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财通证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	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”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
财通证券股份有限公司	504,425,084.92	100.00%

注：本基金合同于2018年1月24日生效，实际报告期间为2018年1月24日至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，无同期对比数据。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财通证券股份有限公司	1,235,104,000.00	100.00%

注：本基金合同于2018年1月24日生效，实际报告期间为2018年1月24日至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，无同期对比数据。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）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	49,228.48	100.00%	49,228.48	100.00%

注：1、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，无同期对比数据。

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	505,988.29
其中：支付销售机构的客户维护费	206,560.19

注：1、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，无同期对比数据。

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	77,844.40

注：1、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，无同期对比数据。

2、本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 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×0.1%÷当年天数。基金托管费每日计提，按月支付。



### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管鑫达混合A	财通资管鑫达混合C	合计
财通证券资产管理有限公司	-	0.15	0.15
财通证券股份有限公司	-	134,899.53	134,899.53
宁波银行股份有限公司	-	13,999.91	13,999.91
合计	-	148,899.59	148,899.59

注：1、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，无同期对比数据。

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期 2018 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期 2018 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日，基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期 2018 年 1 月 24 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日，无各关联方投资本基金的情况。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期
	2018年01月24日（基金合同生效日）至2018年06月30日

	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司	226,781.46	133,065.79

注：1、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，无同期对比数据。

2、本基金的银行存款由基金托管人宁波银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

财通资管鑫达混合A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2018-05-18	2018-05-18	0.18	91,024.97	5,952.48	96,977.45	-
合计			0.18	91,024.97	5,952.48	96,977.45	-

财通资管鑫达混合C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2018-05-18	2018-05-18	0.161	1,929,612.99	2,171.74	1,931,784.73	-
合计			0.161	1,929,612.99	2,171.74	1,931,784.73	-

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限证券。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，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 4,000,000.00 元，于 2018 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益水平的投资品种。本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货等）、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，

确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日
A-1	4,011,200.00
A-1以下	-
未评级	2,819,674.20
合计	6,830,874.20

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券和同业存单。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用同业存单。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末
--------	-----

	2018年06月30日
AAA	5,002,582.00
AAA以下	39,698,703.20
未评级	-
合计	44,701,285.20

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年06月30日
AAA	-
AAA以下	3,032,439.05
未评级	-
合计	3,032,439.05

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让

的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	226,781.46	-	-	-	-	-	226,781.46
结算备付金	529,769.43	-	-	-	-	-	529,769.43
存出保证金	51,817.25	-	-	-	-	-	51,817.25
交易性金融资产	2,487,250.00	7,117,508.95	14,938,737.30	26,297,502.20	3,723,600.00	-	54,564,598.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-	96,786.50	96,786.50
应收利息	-	-	-	-	-	1,671,245.83	1,671,245.83
资产总计	3,295,618.14	7,117,508.95	14,938,737.30	26,297,502.20	3,723,600.00	1,768,032.33	57,140,998.92
负债							
卖出回购金融资产款	4,000,000.00	-	-	-	-	-	4,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	33,97	33,979.03

						9.03	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,753.20	27,753.20
应付托管费	-	-	-	-	-	4,269.74	4,269.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,655.01	7,655.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	54,219.51	54,219.51
应交税费	-	-	-	-	-	6,699.93	6,699.93
应付利息	-	-	-	-	-	-1,071.16	-1,071.16
其他负债	-	-	-	-	-	82,918.72	82,918.72
负债总计	4,000,000.00	-	-	-	-	216,423.98	4,216,423.98
利率敏感度缺口	-704,381.86	7,117,508.95	14,938,737.30	26,297,502.20	3,723,600.00	1,551,608.35	52,924,574.94

注：1、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。

2、本基金合同于 2018 年 1 月 24 日生效，实际报告期间为 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，无同期对比数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2018年06月30日
	1. 市场利率下降25个基点	180,931.12
	2. 市场利率上升25个基点	-179,640.21

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金报告期末无股票投资、权证投资等权益性投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

截止本报告期末，本基金未持有股票投资、权证投资等权益性投资，若除市场利率和外汇利率外的其他市场因素变化导致本基金所持有的权益性投资的市场价格上升或下降 5%且其他市场变量保持不变，对于本基金的基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,564,598.45	95.49
	其中：债券	51,532,159.40	90.18
	资产支持证券	3,032,439.05	5.31
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	756,550.89	1.32



8	其他各项资产	1,819,849.58	3.18
9	合计	57,140,998.92	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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通过港股通投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.2 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

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

## 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	2,819,674.20	5.33
	其中：政策性金融债	2,819,674.20	5.33
4	企业债券	40,759,285.20	77.01
5	企业短期融资券	4,011,200.00	7.58
6	中期票据	3,942,000.00	7.45
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	51,532,159.40	97.37

### 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	1580229	15昌投小微债	40,000	4,036,800.00	7.63
2	1380083	13余开投债	100,000	4,017,000.00	7.59
3	127072	PR泾河债	50,000	4,014,000.00	7.58
4	041800028	18镇江交通CP001	40,000	4,011,200.00	7.58
5	1580246	15内兴元小微债	40,000	4,010,800.00	7.58

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123842	15鹤热03	30,000	3,032,439.05	5.73

### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	51,817.25
2	应收证券清算款	96,786.50
3	应收股利	-
4	应收利息	1,671,245.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,819,849.58

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	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
财通资管鑫达混合A	42	123,472.57	0.00	0.00%	5,185,848.12	100.00%
财通资	169	281,739.05	27,797,750.64	58.38%	19,816,149.18	41.62%

管鑫达混合C						
合计	211	250,235.77	27,797,750.64	52.65%	25,001,997.30	47.35%

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	财通资管鑫达混合A	0.00	0.00%
	财通资管鑫达混合C	1,984.16	0.00%
	合计	1,984.16	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	财通资管鑫达混合A	0
	财通资管鑫达混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	财通资管鑫达混合A	0
	财通资管鑫达混合C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管鑫达混合A	财通资管鑫达混合C
基金合同生效日(2018年01月24)	9,443,930.09	283,955,163.91

日)基金份额总额		
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,393,126.88	22,330,731.77
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,651,208.85	258,671,995.86
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	5,185,848.12	47,613,899.82

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,未涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交	佣金	占当期佣金总	

			总额的比例		量的比例	
兴业期货	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	49,228.48	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业期货	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	504,425,084.92	100.00%	1,333,094,000.00	100.00%	-	-	-	-

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。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于财通资管鑫达回报混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证券日报、管理人网站（www.ctzg.com）	2018-01-19
2	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2018-01-25
3	财通资管鑫达混合基金开放日常申购、赎回业务公告	同上	2018-03-23
4	财通资管鑫达回报混合型证	同上	2018-03-29

	券投资基金暂停申购业务公告		
5	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金2018年第1季度报告	同上	2018-04-20
6	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金暂停大额申购业务公告	同上	2018-05-14
7	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金分红公告	同上	2018-05-17
8	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金恢复申购业务公告	同上	2018-05-24
9	关于财通证券资产管理有限公司旗下基金增加泰诚财富为销售机构的公告	同上	2018-06-27
10	财通证券资产管理有限公司关于财通资管鑫达回报混合型证券投资基金增加E类份额并修改基金合同、托管协议的公告	同上	2018-06-30
11	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金托管协议（20180630）	同上	2018-06-30
12	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同合同摘要（20180630）	同上	2018-06-30
13	财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同（20180630）	同上	2018-06-30

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180124至20180630	100,003,500.00	0.00	80,000,000.00	20,003,500.00	37.89%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性风险，从而影响基金的投资运作和收益水平。管理人将在基金运作中加强流动性管理，保持合适的流动性水平，对申购赎回进行合理的应对，防范流动性风险，保障持有人利益。							

注：本期申购包含红利再投、基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足广大投资者的需求，财通证券资产管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和《财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人宁波银行股份有限公司协商一致并报中国证券监督管理委员会备案，将对本公司管理的财通资管鑫达回报混合型证券投资基金增加 E 类基金份额，自 2018 年 7 月 4 日起接受投资者对 E 类基金份额的申购与赎回，同时对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、财通资管鑫达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、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼



浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

### 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)

财通证券资产管理有限公司

二〇一八年八月二十九日