
财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|-------------|--|-----------|-----------|
| 基金简称 | 财通资管鑫逸混合 | | |
| 基金主代码 | 004888 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2017年08月30日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 39,163,747.77份 | | |
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。 | | |
| 投资策略 | 1、资产配置策略；2、固定收益类投资策略；3、权益类投资策略；4、权证投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略。 | | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80% | | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 | | |
| 基金管理人 | 财通证券资产管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 财通资管鑫逸混合A | 财通资管鑫逸混合C | 财通资管鑫逸混合E |

| | | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|--------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 004888 | 004889 | 018041 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 20,234,795.44 份 | 18,675,096.02 份 | 253,856.31 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2023年07月01日 - 2023年09月30日) | | |
|----------------|--------------------------------|---------------|------------|
| | 财通资管鑫逸混合 A | 财通资管鑫逸混合 C | 财通资管鑫逸混合 E |
| 1.本期已实现收益 | -608,744.13 | -570,947.68 | -10,785.62 |
| 2.本期利润 | -1,417,224.17 | -1,374,088.70 | -23,729.31 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0689 | -0.0696 | -0.0751 |
| 4.期末基金资产净值 | 29,868,571.34 | 27,214,093.11 | 373,884.18 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4761 | 1.4572 | 1.4728 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

财通资管鑫逸混合A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -4.44% | 0.55% | -0.76% | 0.17% | -3.68% | 0.38% |
| 过去六个月 | -3.19% | 0.57% | -1.03% | 0.17% | -2.16% | 0.40% |
| 过去一年 | 1.30% | 0.63% | 0.08% | 0.19% | 1.22% | 0.44% |
| 过去三年 | 11.73% | 0.63% | -0.05% | 0.23% | 11.78% | 0.40% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去五年 | 56.02% | 0.59% | 8.98% | 0.24% | 47.04% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 47.61% | 0.59% | 8.39% | 0.24% | 39.22% | 0.35% |

财通资管鑫逸混合C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -4.49% | 0.55% | -0.76% | 0.17% | -3.73% | 0.38% |
| 过去六个月 | -3.29% | 0.57% | -1.03% | 0.17% | -2.26% | 0.40% |
| 过去一年 | 1.09% | 0.63% | 0.08% | 0.19% | 1.01% | 0.44% |
| 过去三年 | 11.06% | 0.63% | -0.05% | 0.23% | 11.11% | 0.40% |
| 过去五年 | 54.46% | 0.59% | 8.98% | 0.24% | 45.48% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 45.72% | 0.59% | 8.39% | 0.24% | 37.33% | 0.35% |

财通资管鑫逸混合E净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -4.54% | 0.55% | -0.76% | 0.17% | -3.78% | 0.38% |
| 过去六个月 | -3.38% | 0.57% | -1.03% | 0.17% | -2.35% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.85% | 0.55% | -0.86% | 0.16% | -1.99% | 0.39% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通资管鑫逸混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年08月30日-2023年09月30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-2023年09月30日)



财通资管鑫逸混合E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023年03月08日-2023年09月30日)



注：自 2023 年 03 月 07 日起，本基金增设 E 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 03 月 08 日，相关数据和指标自份额首次确认日起计算。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 宫志芳 | 本基金基金经理、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管双福9个月持有期债券型发起式证券投资基金、财通资管稳兴丰益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管稳 | 2017-08-30 | - | 13 | 硕士研究生学历、硕士学位。曾在浙江泰隆商业银行、宁波通商银行工作。2016年3月加入财通证券资产管理有限公司，现任固收公募投资部基金经理。 |

| | | | | | |
|-----|--|------------|---|----|--|
| | 兴增益六个月持有期混合型证券投资基金和财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。 | | | | |
| 李晶 | 本基金基金经理和财通资管稳兴丰益六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。 | 2021-11-02 | - | 15 | 本科学历、硕士学位。曾在上海申银万国证券研究所有限公司、民生证券股份有限公司、万达信息股份有限公司工作。2016年7月加入财通证券资产管理有限公司，曾任权益研究部研究员，现任权益研究部副总经理（主持工作）。 |
| 林伟 | 本基金基金经理和财通资管品质消费混合型发起式证券投资基金基金经理。 | 2022-02-25 | - | 13 | 硕士研究生学历、硕士学位。曾在毕马威华振会计师事务所上海分所、上海原点资产管理有限公司、上海混沌道然资产管理有限公司工作。2016年5月加入财通证券资产管理有限公司，曾任权益研究部高级研究员，现任权益公募投资部基金经理。 |
| 石玉山 | 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、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管双安债券型证券投资基金、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金、财通资管稳兴增益六个月持有期 | 2022-05-05 | - | 5 | 博士研究生学历、博士学位。曾在上海海通证券资产管理有限公司、永赢基金管理有限公司工作。2021年7月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收公募投资部基金经理助理，现任固收公募投资部基金经理。 |

| | | | | | |
|--|----------------------------------|--|--|--|--|
| | 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。 | | | | |
|--|----------------------------------|--|--|--|--|

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

从基本面来看，三季度随着各项政策逐步落地，经济指标有所改善。8月PMI环比修复，制造业PMI回升0.4个点至49.7%，新订单PMI环比上升至50.2%，内需整体贡献高于外需。8月CPI和PPI增速双双上行，其中CPI同比转正至0.1%，PPI同比回升至-3.0%，反映出经济运行的边际修复。8月社会融资新增3.12万亿元，同比多增0.65万亿元，存量社融增速9.0%，环比上升0.1%，显现见底企稳。8月末，M2余额286.93万亿元，同比增长10.6%，M1余额67.96万亿元，同比增长2.2%，M0余额10.65万亿元，同比增长9.5%。从

9月份各项高频数据来看，工厂生产、建筑施工、房地产销售均呈现弱修复，服务业降温、出口环比仍偏弱。同时，随着房地产政策的加码，二手房市场出现转暖迹象，叠加房贷利率调整，有望带来居民中长期信贷增长改观。

政策方面，7月下旬召开的中央政治局会议指出，当前我国经济运行面临新的困难挑战，要精准有力实施宏观调控，加强逆周期调节和政策储备。财政政策方面，8月财政赤字同比明显回升，地方专项债发行节奏加快。货币政策方面，8月15日，央行宣布降息，7天逆回购利率降10bp，MLF利率降15bp，超市场预期。8月下旬开始，房地产优化政策密集出台，以及特殊再融资债券可能发行用于置换地方隐债，这给债市带来利空扰动。随着这些政策调整效果的逐步显现，下半年我国经济有望呈现温和上升态势。

海外方面，美国9月非农就业人口增加33.6万人，增幅创今年以来最大，高于预期值17万人。就业市场的活力暗示企业对销售前景依然充满信心，但也令通胀继续面临上行压力。美国经济数据表现良好，叠加美联储加息会议释放维持高利率信号，对人民币汇率形成压力。随着后续稳经济政策进一步落地实施，预计国内经济将维持稳中向好的修复态势，后续对人民币的支撑或逐渐增强，同时央行和外管局启用稳汇率工具保障汇率在合理区间内稳定运行。

固收操作：无，持仓为现金比例。

转债操作：仓位较二季末微升，行业结构上：将高价券商转债止盈、替换为低价券商转债；电子板块标的也有所变化，替换掉若干性价比相对较差的标的；减配光伏产业链，替换为估值相对合理的新券；维持生猪、新能源板块持仓。

权益部分：

三季度市场进一步下挫，一方面7月政治局会议、8月央行降息等难形成强有力的刺激，9月以来地产、资本市场等领域政策加码的实际效果还有待数据进一步验证，市场对年内经济复苏的担忧持续；另一方面主线缺失，市场没有破局方向，资金流向呈部分无序状态，概念板块较为活跃，整体表现都相对较差。

出于产品追求稳健的考虑，3季度组合降低了对权益类资产的配置比例，精简个股，持仓结构没有大的变化，仍然以科技成长和高端制造板块为主，并保持行业的分散，仓位主要体现在机械设备、电子、通信、计算机、家电等板块。我们依然维持前期判断，在整体经济弱复苏的背景下，继续对科技创新和国产替代给予比较高的权重。从四季度来看，海外AI可能又进入技术的密集发布期，下游应用可能更多多样化，除了文本图片等延展到机器人和智能驾驶等领域，因此对国内相应产业链会继续拉动。另一方面，在国产化一些手机芯片密集突破的背景下，大家对相关国产产业链关注度显著提升，但要警惕中美在这个领域继续有比较大的冲突，因此保持关注。

在经济复苏领域，3季度政策密集落地的实际效果预计或将在四季度逐步体现，我们跟踪到一些草根数据也在呈现逐步回暖的态势，因此我们会继续加大这些板块的配置，包括机械、化工、建材、白酒等，保持组合在成长与价值之间的平衡，控制回撤的同时也希望能有比较好的上涨弹性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管鑫逸混合A基金份额净值为1.4761元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.44%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%；截至报告期末财通资管鑫逸混合C基金份额净值为1.4572元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.49%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%；截至报告期末财通资管鑫逸混合E基金份额净值为1.4728元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.54%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 6,929,952.73 | 10.41 |
| | 其中：股票 | 6,929,952.73 | 10.41 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 38,391,905.26 | 57.65 |
| | 其中：债券 | 38,391,905.26 | 57.65 |
| | 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 | 7,270,000.00 | 10.92 |
| | 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 | 13,342,662.74 | 20.03 |
| 8 | 其他资产 | 663,047.80 | 1.00 |
| 9 | 合计 | 66,597,568.53 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|---------|---------------|
|----|------|---------|---------------|

| | | | |
|---|------------------|--------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 6,379,747.33 | 11.10 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 308,504.00 | 0.54 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 108,644.40 | 0.19 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 133,057.00 | 0.23 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 6,929,952.73 | 12.06 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 603100 | 川仪股份 | 19,600 | 639,744.00 | 1.11 |
| 2 | 002156 | 通富微电 | 25,100 | 481,167.00 | 0.84 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 3 | 002463 | 沪电股份 | 21,000 | 472,710.00 | 0.82 |
| 4 | 002444 | 巨星科技 | 19,300 | 376,157.00 | 0.65 |
| 5 | 002705 | 新宝股份 | 20,600 | 363,178.00 | 0.63 |
| 6 | 002648 | 卫星化学 | 23,200 | 355,656.00 | 0.62 |
| 7 | 000777 | 中核科技 | 26,700 | 353,241.00 | 0.61 |
| 8 | 688283 | 坤恒顺维 | 4,882 | 335,930.42 | 0.58 |
| 9 | 002920 | 德赛西威 | 2,200 | 316,008.00 | 0.55 |
| 10 | 688629 | 华丰科技 | 14,880 | 308,611.20 | 0.54 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 3,649,545.86 | 6.35 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 34,742,359.40 | 60.47 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 38,391,905.26 | 66.82 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|--------|--------------|---------------|
| 1 | 019694 | 23国债01 | 36,000 | 3,649,545.86 | 6.35 |
| 2 | 127005 | 长证转债 | 30,000 | 3,271,765.89 | 5.69 |
| 3 | 113619 | 世运转债 | 20,000 | 2,496,734.25 | 4.35 |
| 4 | 111000 | 起帆转债 | 20,000 | 2,445,898.63 | 4.26 |
| 5 | 118023 | 广大转债 | 20,000 | 2,113,642.19 | 3.68 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 18,893.82 |
| 2 | 应收证券清算款 | 633,140.17 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 11,013.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 663,047.80 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 127005 | 长证转债 | 3,271,765.89 | 5.69 |
| 2 | 113619 | 世运转债 | 2,496,734.25 | 4.35 |
| 3 | 111000 | 起帆转债 | 2,445,898.63 | 4.26 |
| 4 | 118023 | 广大转债 | 2,113,642.19 | 3.68 |
| 5 | 110080 | 东湖转债 | 1,327,369.86 | 2.31 |
| 6 | 113061 | 拓普转债 | 1,323,192.60 | 2.30 |
| 7 | 113648 | 巨星转债 | 1,318,090.96 | 2.29 |
| 8 | 123099 | 普利转债 | 1,308,148.77 | 2.28 |
| 9 | 111011 | 冠盛转债 | 1,086,865.53 | 1.89 |
| 10 | 123059 | 银信转债 | 816,038.63 | 1.42 |
| 11 | 123174 | 精锻转债 | 693,684.59 | 1.21 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 财通资管鑫逸混合 | 财通资管鑫逸混合 | 财通资管鑫逸混合 |
|--|----------|----------|----------|
| | | | |

| | A | C | E |
|---------------------------|---------------|---------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 21,263,420.93 | 20,539,665.40 | 246,906.99 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,047,642.06 | 6,071,476.04 | 429,869.99 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,076,267.55 | 7,936,045.42 | 422,920.67 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 20,234,795.44 | 18,675,096.02 | 253,856.31 |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，2023年8月4日，胡珍珍同志离任本基金管理人财务负责人，由钱慧同志代任财务负责人。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金托管协议

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

9.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层
浙江省杭州市上城区新业路中国人寿大厦2幢22层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：400-116-7888

公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司

2023年10月25日