
财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金

2024年第1季度报告

2024年03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

报告送出日期:2024年04月22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2024年04月17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2024年01月01日起至03月31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	31,159,197.72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	16,392,365.04份	14,442,342.45份	324,490.23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(2024年01月01日 - 2024年03月31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	-1,439,151.14	-1,211,498.76	-26,021.46
2.本期利润	-1,251,163.11	-1,211,934.11	-25,743.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0726	-0.0802	-0.0882
4.期末基金资产净值	22,814,499.72	19,823,757.37	449,721.01
5.期末基金份额净值	1.3918	1.3726	1.3859

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	-4.62%	0.89%	1.75%	0.20%	-6.37%	0.69%
过去六个月	-5.71%	0.72%	0.97%	0.18%	-6.68%	0.54%
过去一年	-8.72%	0.65%	-0.07%	0.18%	-8.65%	0.47%
过去三年	9.03%	0.63%	-1.81%	0.21%	10.84%	0.42%

过去五年	36.40%	0.63%	5.10%	0.23%	31.30%	0.40%
自基金合同生效起至今	39.18%	0.60%	9.45%	0.24%	29.73%	0.36%

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	-4.67%	0.89%	1.75%	0.20%	-6.42%	0.69%
过去六个月	-5.81%	0.72%	0.97%	0.18%	-6.78%	0.54%
过去一年	-8.91%	0.65%	-0.07%	0.18%	-8.84%	0.47%
过去三年	8.38%	0.63%	-1.81%	0.21%	10.19%	0.42%
过去五年	35.03%	0.63%	5.10%	0.23%	29.93%	0.40%
自基金合同生效起至今	37.26%	0.60%	9.45%	0.24%	27.81%	0.36%

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	-4.72%	0.89%	1.75%	0.20%	-6.47%	0.69%
过去六个月	-5.90%	0.72%	0.97%	0.18%	-6.87%	0.54%
过去一年	-9.09%	0.65%	-0.07%	0.18%	-9.02%	0.47%
自基金合同生效起至今	-8.58%	0.63%	0.10%	0.17%	-8.68%	0.46%

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-2024年03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-2024年03月31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



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、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管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、财通资管双鑫	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。

	一年持有期债券型证券投资基金、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、财通资管产业优选混合型发起式证券投资基金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、权益研究部副总经理（主持工作），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。	2022-05-05	-	6	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。

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合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，随着宏观组合政策靠前发力，经济运行持续恢复，国民经济起步平稳、稳中有升。具体分项如下：

国内方面：

中国1-2月规模以上工业增加值同比增长7.0%，比2023年12月份加快0.2个百分点。从环比看，2月规模以上工业增加值比上月增长0.56%。中国1-2月份全国规模以上工业企业实现利润总额9140.6亿元，同比增长10.2%，利润由上年全年下降2.3%转为正增长。

中国3月官方制造业PMI为50.8，前值49.1，高于临界点，制造业景气回升。中国3月官方非制造业PMI值为53.0，前值51.4。

中国2月M2同比增长8.7%，预期8.8%，前值8.7%，M2增速与1月持平；今年前两个月人民币贷款增加6.37万亿元，创历史同期次高水平；今年前两个月社会融资规模增量累计为8.06万亿元，比上年同期少1.1万亿元。在各项贷款中，对实体经济发放的人民币贷款增加5.82万亿元，同比少增9324亿元。

中国2月CPI同比上涨0.7%，环比上涨1.0%。1-2月平均，全国居民消费价格与上年同期持平。2月PPI同比下降2.7%，环比下降0.2%。1-2月平均，工业生产者出厂价格比上年同期下降2.6%。

公开市场操作方面，一季度逆回购到期117,640亿元，投放97,750亿元；MLF到期17,590亿元，投放18,820亿元。合计一季度央行净回笼18,660亿元。政策方面，2月20日，中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布：2024年2月20日贷款市场报价利率（LPR）：1年期LPR为3.45%，与上月报价持平；5年期以上LPR为3.95%，较上月报价下调25个基点。5年期以上LPR下行幅度为LPR改革以来最大降幅，将有效带动贷款利率的持续下降。

一季度，债券市场方面，债市走势呈现出稳步走强态势。1月，中共中央政治局第十一次集体学习时强调，发展新质生产力是推动高质量发展的内在要求和重要着力点，必须继续做好创新这篇大文章，推动新质生产力加快发展。3月，政府工作报告中提出，积极的财政政策要适度加力、提质增效。综合考虑发展需要和财政可持续，用好财政政策空间，优化政策工具组合。赤字率拟按3%安排，赤字规模4.06万亿元，比上年年初预算增加1800亿元。预计今年财政收入继续恢复增长，加上调入资金等，一般公共预算支出规模28.5万亿元、比上年增加1.1万亿元。拟安排地方政府专项债券3.9万亿元、比上年增加1000亿元。为系统解决强国建设、民族复兴进程中一些重大项目建设的资金问题，从今年开始拟连续几年发行超长期特别国债，专项用于国家重大战略实施和重点领域安全能力建设，今年先发行1万亿元。同月，国务院防范化解地方债务风险工作视频会议上强调，进一步强化责任意识和系统观念，持续推进地方债务风险防范化解工作。3月，在十四届全国人大二次会议经济主题记者会上，央行表示目前法定存款准备金率平均为7%，后续仍有降准空间。将综合运用多种货币政策工具，加大逆周期调节力度，保持流动性合理充裕，支持社会融资规模和货币信贷总量稳定增长、均衡投放。

国外：3月30日，美联储主席鲍威尔出席活动时称，美联储并不急于降息。鲍威尔说，早些时候发布的最新核心PCE通胀数据“基本符合我们的预期”。但鲍威尔重申，直到官员们对通胀正朝着他们2%的目标前进有信心之前，降低利率是不合适的。欧洲方面，3月，欧洲央行表示预计2024年经济增长将加速，主要受到购买力增加的推动；预计欧元区通胀下降将持续。

无纯债操作，仅持有现金比例。

转债操作：今年一季度，转债市场行情大致分为三段：超预期大跌→反弹→横盘。年初至2024年2月5日，转债市场随权益市场一起超预期下跌，中证转债指数跌-5.10%、万得可转债等权指数跌-10.84%。后随汇金扩大救市范围，阻断流动性负反馈，转债市场跟随中小盘企稳反弹至2月底、3月初。上证指数反弹至关键点位后（3000点附近），

权益市场开始呈现震荡走势，转债市场亦进入一种滞涨状态，一直维持到季末。全季度来看，中证转债指数跌-0.81%，转债等权指数跌-4.20%。分类型看，平衡型转债和股性转债的跌幅依然相对较大。转债仓位先降低后上升，在年初的超预期下跌过程中，通过逐渐降仓来相对控制回撤，2月初，观测到中小市值板块的右侧止跌信号，后随市场反弹，以及产品净值的修复，逐渐提升了转债仓位，截至季末，转债仓位约在上限。之所以把仓位提升到上限，是因为转债市场在3月进入滞涨状态。原因有二：

第一，年初以来，转债除了跌平价、还跌估值，在年初时，转债整体依然处于偏高估状态，即使经历了后面的超预期下跌以及弱反弹，到了3月初开始进入所谓的滞涨状态，其实就是把过往的高估值状态修复到一个偏合理的位置，当前转债市场的估值大致处于2019年以来，30%分位左右。

第二，转债估值修复到合理位置之后，转债能否继续上涨取决于两方面，一是权益还能不能涨，二就是固收+产品是否有增量资金。先看权益，上证指数回到3000点之后，权益市场（包括宽基和行业）就开始进入震荡状态，转债平价缺乏持续向上的推动。再看增量资金，今年的固收+缺乏增量资金，尤其是转债型固收+产品，因为今年以来转债的赚钱效应逊于权益（比如红利类资产、比如前期的TMT）、甚至逊于长端利率资产，导致部分机构减仓转债。

但也正因为转债处于滞涨状态，所以转债市场整体处于低位，考虑到权益市场即使调整，幅度可能也有限，以及债券收益率低位等因素，转债值得左侧布局，因此倾向于高仓位运作。不过仍值得一提的是，权益市场在4月即进入财报季，风格或回归基本面主线，此外，严监管成常态，后续A股市场退市力度或有所加强，长期不分红标的或有被ST风险，因此从配置角度，适当减少小盘、长期不分红标的的暴露。

在转债的持仓结构上：（1）认为权益市场下跌幅度有限，所以在转债类型选择上，倾向于平衡型转债。（2）在风格上，倾向于向红利类靠拢，尽量减少小盘股的暴露。

权益部分：

2024年以来市场波动较大，但我们始终坚持配置科技成长和先进制造，聚焦“新质生产力”，并保持行业的分散，兼顾成长性与控制风险。行业方面，我们聚焦AI产业链的算力方向，仓位主要体现在通信、电子、半导体等行业；另一方面我们也非常看好制造业的持续景气上行，配置集中在机械设备、新能源、交通运输等行业。在整体经济弱复苏的背景下，科技创新和国产替代仍是主要抓手，以AI为代表的科技创新能实现全球产业共振，相关公司积极参与全球产业分工，国内也有完整的产业链布局。先进制造方向坚持国产替代和科技自立的思路，将国产化领域从半导体拓展到先进封装、机械设备、新材料、基础软件等方面，积极挖掘相关领域机会。从24年上半年来看，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，另外硬件也呈现不断创新趋势，包括AI手机、AI PC、AI PIN等，因此对国内相应产业链或将会继续拉动。在经济层面，我们看到制造业在持续复苏，设备更新及海外需求旺盛可能带动新一轮资本开支，因此我们会继续沿着先进制造方向挖掘设备、新材料、消费等机会。

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1.3918元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.62%，同期业绩比较基准收益率为1.75%；截至报告期末财通资管鑫逸混合C基金份额净值为1.3726元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.67%，同期业绩比较基准收益率为1.75%；截至报告期末财通资管鑫逸混合E基金份额净值为1.3859元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.72%，同期业绩比较基准收益率为1.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金出现连续超过二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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	13,545,237.68	31.36
	其中：股票	13,545,237.68	31.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,229,227.81	65.36
	其中：债券	28,229,227.81	65.36
	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	655,675.53	1.52
8	其他资产	762,393.67	1.77
9	合计	43,192,534.69	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	12,383,765.68	28.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	666,400.00	1.55
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	495,072.00	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,545,237.68	31.44

注：本基金本报告期股票行业分类由中国证监会行业分类切换为中国上市公司协会行业分类。

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	002463	沪电股份	48,230	1,455,581.40	3.38
2	002156	通富微电	55,900	1,257,191.00	2.92
3	002648	卫星化学	58,100	1,074,850.00	2.49
4	601138	工业富联	40,900	931,293.00	2.16
5	002444	巨星科技	36,000	908,280.00	2.11
6	000100	TCL科技	158,000	737,860.00	1.71
7	688629	华丰科技	26,564	702,086.52	1.63
8	605090	九丰能源	23,800	666,400.00	1.55
9	600183	生益科技	33,400	575,482.00	1.34
10	002436	兴森科技	45,500	558,740.00	1.30

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,533,390.41	5.88
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）	25,695,837.40	59.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,229,227.81	65.52

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	019727	23国债24	25,000	2,533,390.41	5.88
2	118025	奕瑞转债	20,000	2,464,587.95	5.72
3	113619	世运转债	20,000	2,461,668.49	5.71

4	127086	恒邦转债	20,000	2,412,008.77	5.60
5	111000	起帆转债	17,000	1,986,685.21	4.61

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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,246.99
2	应收证券清算款	751,417.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,728.93
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	762,393.67

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	118025	奕瑞转债	2,464,587.95	5.72
2	113619	世运转债	2,461,668.49	5.71
3	127086	恒邦转债	2,412,008.77	5.60
4	111000	起帆转债	1,986,685.21	4.61
5	118038	金宏转债	1,914,193.95	4.44
6	127020	中金转债	1,223,039.04	2.84
7	118003	华兴转债	1,197,195.89	2.78
8	113061	拓普转债	1,192,488.22	2.77
9	113637	华翔转债	1,183,291.78	2.75
10	123224	宇邦转债	1,175,450.41	2.73
11	128137	洁美转债	1,158,145.75	2.69
12	118042	奥维转债	1,141,925.75	2.65
13	127074	麦米转2	1,123,223.01	2.61
14	123169	正海转债	1,092,050.96	2.53
15	123210	信服转债	874,408.55	2.03

16	113674	华设转债	622,585.07	1.44
----	--------	------	------------	------

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 A	财通资管鑫逸混合 C	财通资管鑫逸混合 E
报告期期初基金份额总额	18,162,927.92	16,441,503.97	337,373.98
报告期期间基金总申购份额	129,956.28	3,435,645.51	187,735.05
减：报告期期间基金总赎回份额	1,900,519.16	5,434,807.03	200,618.80
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	16,392,365.04	14,442,342.45	324,490.23

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层
浙江省杭州市上城区新业路300号中国人寿大厦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

2024年04月22日