财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 30 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月24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2021年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 中期财务会计报告(未经审计) 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 20
6.4 报表附注 21
§7 投资组合报告 46
7.1 期末基金资产组合情况 47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 47
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 47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 48
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 48
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 49
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 49
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 49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 49
7.12 投资组合报告附注 50
§8 基金份额持有人信息 51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52

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 52
§9 开放式基金份额变动 53
§10 重大事件揭示 54
10.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
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 54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 54
10.8 其他重大事件 58
§11 影响投资者决策的其他重要信息 59
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 59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 60
§12 备查文件目录 60
12.1 备查文件目录 60
12.2 存放地点 60
12.3 查阅方式 60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金		
基金简称	财通资管鸿运中短债债券		
基金主代码	006799		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019年01月21日		
基金管理人	财通证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,940,902,467.96份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	财通资管鸿运中短债债券A	财通资管鸿运中短债债券C	财通资管鸿运中短债债券E
下属分级基金的交易代码	006799	006800	008922
报告期末下属分级基金的份额总额	931,519,066.64份	2,367,139,161.16份	1,642,244,240.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资中短债主题证券，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。
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。
业绩比较基准	中债总财富(1-3年)指数收益率×85%+一年期定期存款利率(税后)×15%
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘泉	郭明
	联系电话	021-20568203	（010）66105799
	电子邮箱	lq@ctzg.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95336	95588
传真		021-68753502	（010）66105798
注册地址		浙江省杭州市上城区白云路26号143室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		马晓立	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金中期报告备置地点	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

§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(2021年01月01日-2021年06月30日)		
	财通资管鸿运中短债债券A	财通资管鸿运中短债债券C	财通资管鸿运中短债债券E
本期已实现收益	9,193,536.30	19,675,104.80	11,200,685.17
本期利润	10,839,160.52	24,600,434.37	12,723,634.75
加权平均基金份额本期利润	0.0191	0.0158	0.0168
本期加权平均净值利润率	1.76%	1.46%	1.63%
本期基金份额净值增长率	1.98%	1.77%	1.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)		
期末可供分配利润	89,228,801.67	201,069,450.62	62,168,243.54
期末可供分配基金份额利润	0.0958	0.0849	0.0379
期末基金资产净值	1,020,747,868.31	2,568,208,611.78	1,704,412,483.70
期末基金份额净值	1.0958	1.0849	1.0379
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	10.63%	9.54%	3.79%

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

财通资管鸿运中短债债券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	0.22%	0.01%	0.25%	0.02%	-0.03%	-0.01%
过去三个月	0.83%	0.01%	0.97%	0.02%	-0.14%	-0.01%
过去六个月	1.98%	0.02%	1.57%	0.03%	0.41%	-0.01%
过去一年	4.03%	0.02%	2.42%	0.03%	1.61%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.63%	0.03%	7.21%	0.04%	3.42%	-0.01%

财通资管鸿运中短债债券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	0.18%	0.01%	0.25%	0.02%	-0.07%	-0.01%
过去三个月	0.72%	0.01%	0.97%	0.02%	-0.25%	-0.01%
过去六个月	1.77%	0.01%	1.57%	0.03%	0.20%	-0.02%
过去一年	3.61%	0.02%	2.42%	0.03%	1.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	9.54%	0.03%	7.21%	0.04%	2.33%	-0.01%

财通资管鸿运中短债债券E

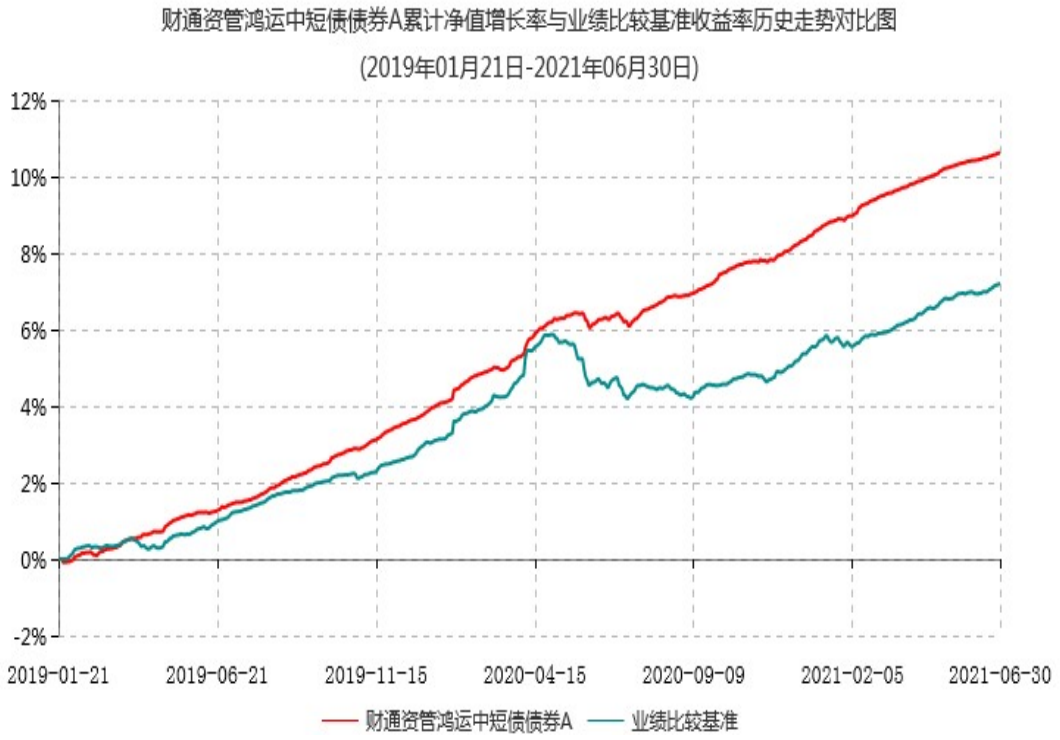
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.21%	0.01%	0.25%	0.02%	-0.04%	-0.01%
过去三个月	0.78%	0.01%	0.97%	0.02%	-0.19%	-0.01%
过去六个月	1.87%	0.02%	1.57%	0.03%	0.30%	-0.01%
过去一年	3.72%	0.02%	2.42%	0.03%	1.30%	-0.01%

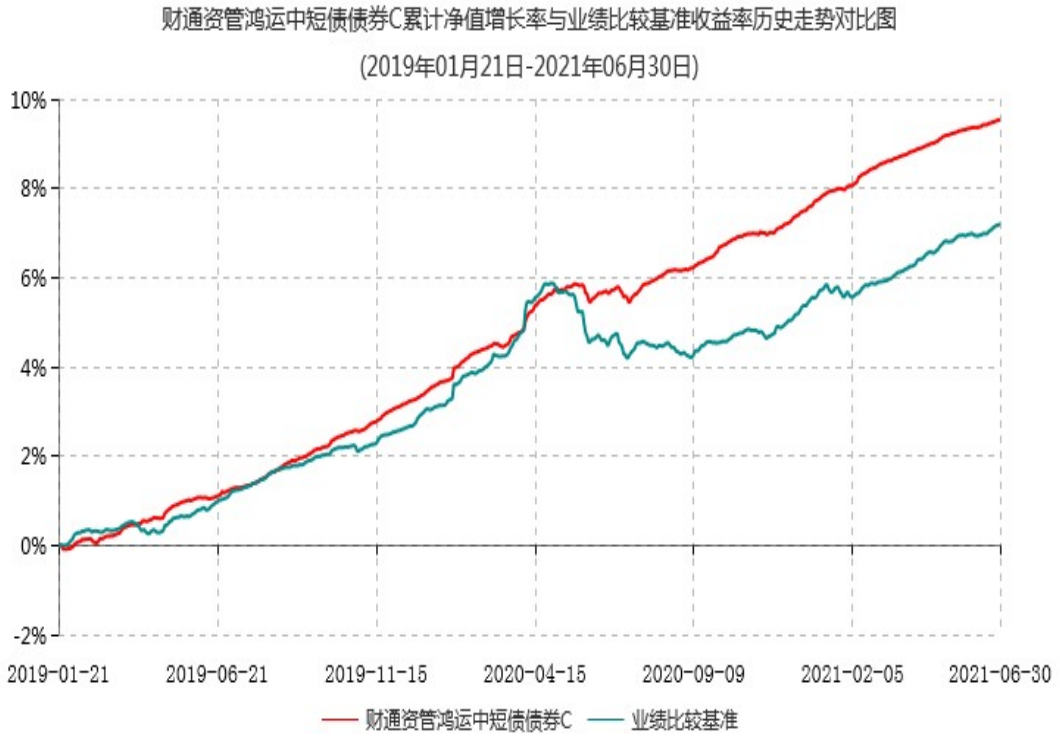
自基金合同生效起至今	3.79%	0.02%	1.35%	0.04%	2.44%	-0.02%

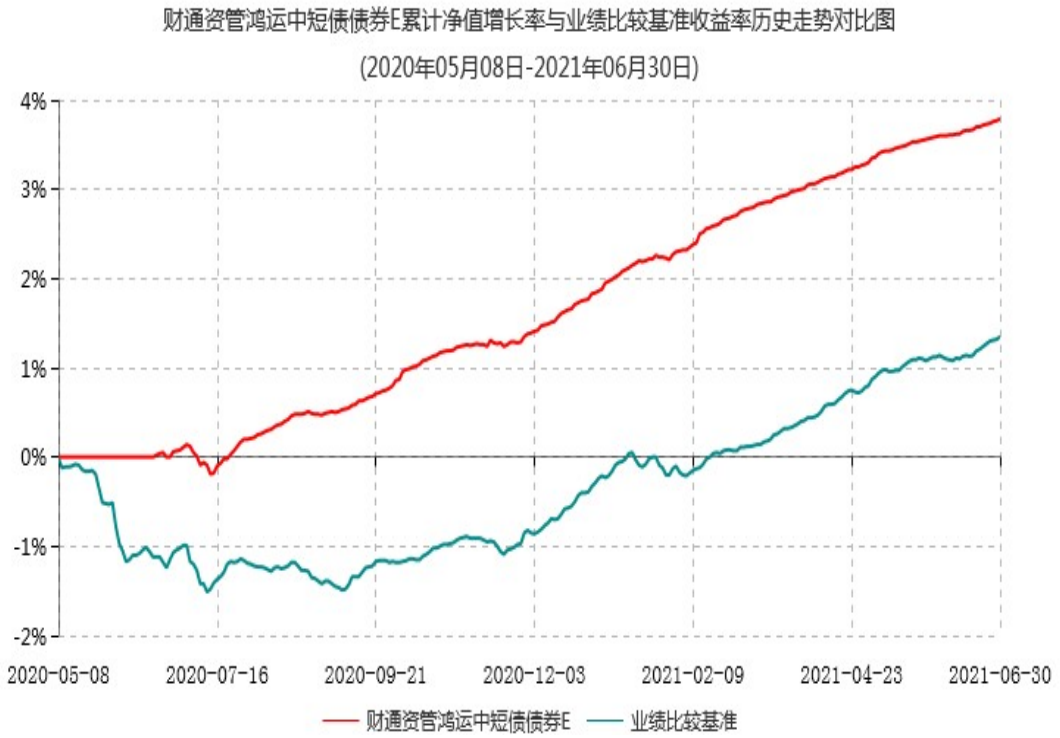
注：1、业绩比较基准：中债总财富(1-3 年)指数收益率×85%+一年期定期存款利率(税后)×15%。

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







注：自基金合同生效至报告期末，财通资管鸿运中短债债券 A 基金份额净值增长率为 10.63%，同期业绩比较基准收益率为 7.21%；财通资管鸿运中短债债券 C 基金份额净值增长率为 9.54%，同期业绩比较基准收益率为 7.21%；自 E 类份额开放申购日（2020 年 5 月 8 日）至报告期末，财通资管鸿运中短债债券 E 基金份额净值增长率为 3.79%，同期业绩比较基准收益率为 1.35%

§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2021年6月30日，公司共管理29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、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、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、财通资管消费精选灵活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、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿益中短债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、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管价值发现混合型证券投资基金、财通资管行业精选混合型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金、财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管睿慧1年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金和财通资管鸿安30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金。

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、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管积极收	2019-07-03	-	10	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

	益债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金和财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。				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。
周庆	本基金基金经理。	2020-10-29	-	5	复旦大学工商管理硕士，2016年3月加入财通证券资产管理有限公司，历任固收私募投资部高级产品经理、固收私募投资部投资经理助理、固收私募业务投资决策委员会委员、固收公募投资部高级经理。
朱红	本基金基金经理助理、财通资管鑫逸回报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、财通资管鑫锐回报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、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿利中	2020-02-04	-	5	华东理工大学金融学硕士。2016年1月起加入财通证券资产管理有限公司，历任交易部交易助理，现任固收公募投资部基金经理助理。

	短债债券型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金和财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。				
费钦予	本基金基金经理助理、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金和财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。	2021-05-31	-	3	杜伦大学理学硕士。2018年3月起加入财通证券资产管理有限公司，历任固收私募投资部部门助理、固收研究部研究助理，现任固收公募投资部基金经理助理。
王珊	本基金基金经理助理。	2019-04-08	2021-06-04	5	上海理工大学国际商务硕士。2016年3月起加入财通证券资产管理有限公司，历任固收公募投资部和固收私募投资部研究员，主要负责产品研究以及信用债分析。

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。

4.1.3 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《财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金合同》、《财通资管鸿运中短债债券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

2021年上半年，全球经济发展总体向好，我国基本管控住了疫情扩散的风险，保障了社会各项经济活动的稳健运行，总体延续了去年以来经济复苏的势头，但节奏放缓。具体来看，制造业PMI持续位于荣枯线以上，但连续4个月下降，生产扩张步伐放缓，需求端稳步修复，进出口景气度下滑，基本面复苏边际走弱；投资方面，投资数据同比边际放缓，1-5月固定资产投资同比增长15.4%，其中，基建投资增速11.8%，房地产投资增速为18.3%，制造业投资增速为20.4%，基建温和修复，地产小幅回落，制造业增速改善，修复仍有空间；消费方面，1-5月社零总额同比增长25.7%，受就业尚未充分恢复、居民消费意愿不足、疫情局部反复等拖累，消费修复偏慢；物价指数方面，上半年CPI同比从-0.3%上行至1.1%,但仍受猪肉价格拖累，目前通胀主因供给侧驱动，并非影响市场的主要因素。金融数据来看，在2021年上半年，随着经济恢复持续，货币金融指标均有明显回落。截至2021年5月，我国累计社融规模14.01万亿元，较去年同期下降了19.34%；M2同比增速下滑至8.3%，与去年增速相比也明显回落。政策方面，货币政策保

持稳健，资金面平衡宽松。上半年受基本面、货币政策以及海外政策波动等影响，债券收益率先升后降，整体呈现震荡走势，10年期国债收益率振幅在24BP左右。

上半年本基金维持合理杠杆区间，把握资金面宽裕的配置机会，提升高评级债券持仓比例，并辅以利率债波段操作，在保证组合流动性前提下持续增厚产品收益，力争为投资者创造长期稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管鸿运中短债债券A基金份额净值为1.0958元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.98%，同期业绩比较基准收益率为1.57%；截至报告期末财通资管鸿运中短债债券C基金份额净值为1.0849元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.77%，同期业绩比较基准收益率为1.57%；截至报告期末财通资管鸿运中短债债券E基金份额净值为1.0379元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.87%，同期业绩比较基准收益率为1.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球经济可能进入共振复苏阶段，国内经济复苏仍然稳健。货币政策将有望延续中性稳健导向，财政政策对总需求仍会进行保障。债券收益率大概率会维持区间震荡格局。从资产配置的角度看，信用债和利率债仍具有配置价值，同时应着重关注波段操作机会，以票息策略为主，整体对于下半年市场行情持谨慎乐观态度。

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。

本基金管理人设有估值工作小组，估值工作小组成员由公司分管高管、研究及投资部门、合规稽核部、风险管理部、运营保障部等人员组成。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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，本基金托管人在对财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金的管理人——财通证券资产管理有限公司在财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人依法对财通证券资产管理有限公司编制和披露的财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	24,345,998.87	8,384,960.89
结算备付金		20,034,134.68	3,315,812.48

存出保证金		8,364.21	2,513.89
交易性金融资产	6.4.7.2	5,188,742,269.49	437,336,857.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,128,308,247.57	413,280,436.00
资产支持证券投资		60,434,021.92	24,056,421.92
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	116,270,824.44	65,000,457.50
应收证券清算款		171,554,011.64	-
应收利息	6.4.7.5	60,267,369.03	7,713,065.68
应收股利		-	-
应收申购款		26,916,990.96	21,314,404.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,608,139,963.32	543,068,073.12
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		264,423,668.17	39,899,740.15
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		46,761,785.37	5,123,287.58
应付管理人报酬		1,370,818.00	105,276.98
应付托管费		365,551.44	28,073.84
应付销售服务费		1,212,813.89	60,695.32
应付交易费用	6.4.7.7	88,531.91	42,769.28
应交税费		405,033.03	28,366.15

应付利息		49,495.16	6,305.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,302.56	179,000.00
负债合计		314,770,999.53	45,473,514.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,940,902,467.96	479,257,330.99
未分配利润	6.4.7.10	352,466,495.83	18,337,227.63
所有者权益合计		5,293,368,963.79	497,594,558.62
负债和所有者权益总计		5,608,139,963.32	543,068,073.12

注：报告截止日2021年06月30日，A类基金份额净值1.0958元，C类基金份额净值1.0849元，E类基金份额净值1.0379元；基金份额总额4,940,902,467.96份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额931,519,066.64份，C类基金份额总2,367,139,161.16份，E类基金份额总额1,642,244,240.16份。

6.2 利润表

会计主体：财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		60,127,592.76	7,587,690.56
1.利息收入		52,686,021.74	8,561,428.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	75,154.41	20,303.39
债券利息收入		46,233,429.95	8,313,460.84
资产支持证券利息收入		828,102.00	222,143.83
买入返售金融资产收入		5,549,335.38	5,520.73
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,379,672.02	-832,652.33
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	-545,422.02	-852,691.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	621.99
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-834,250.00	19,417.48
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	8,093,903.37	-168,486.57
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	727,339.67	27,400.67
减：二、费用		11,964,363.12	1,443,273.98
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,509,528.13	381,774.11
2．托管费	6.4.10.2.2	1,202,540.87	101,806.45
3．销售服务费	6.4.10.2.3	4,041,294.15	144,817.40
4．交易费用	6.4.7.18	114,631.59	9,576.38
5．利息支出		1,824,642.69	662,465.24
其中：卖出回购金融资产支出		1,824,642.69	662,465.24
6．税金及附加		135,371.58	29,898.51
7．其他费用	6.4.7.19	136,354.11	112,935.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		48,163,229.64	6,144,416.58

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		48,163,229.64	6,144,416.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021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)	479,257,330.99	18,337,227.63	497,594,558.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,163,229.64	48,163,229.64
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）	4,461,645,136.97	285,966,038.56	4,747,611,175.53
其中：1.基金申购款	8,277,299,373.44	499,765,635.10	8,777,065,008.54
2.基金赎回款	-3,815,654,236.47	-213,799,596.54	-4,029,453,833.01
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）	4,940,902,467.96	352,466,495.83	5,293,368,963.79
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	304,479,135.54	11,302,007.06	315,781,142.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,144,416.58	6,144,416.58
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)	-142,707,609.82	-6,834,163.67	-149,541,773.49
其中:1.基金申购款	154,966,457.51	6,861,014.47	161,827,471.98
2.基金赎回款	-297,674,067.33	-13,695,178.14	-311,369,245.47
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)	-	-2,348,149.42	-2,348,149.42
五、期末所有者权益(基金净值)	161,771,525.72	8,264,110.55	170,035,636.27

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:

钱慧	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

财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金(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[2018]2051号《关于准予财通资管鸿运中短债债券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《财通资管鸿运中短债债券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3,686,352,942.49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(2019)第0049号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《财通资

管鸿运中短债债券型证券投资基金基金合同》于2019年1月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,687,139,849.36份基金份额，其中认购资金利息折合786,906.87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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金合同》和《财通资管鸿运中短债债券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。在投资者认、申购时收取认、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但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；在投资者认、申购时不收取认、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提0.40%销售服务费的基金份额，称为C类基金份额；在投资者认、申购时不收取认、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提0.40%销售服务费的基金份额，称为E类基金份额。本基金A类、C类、E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、C类基金份额和E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《财通资管鸿运中短债债券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具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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。本基金的业绩比较基准为：中债总财富(1-3年)指数收益率×85%+一年期定期存款利率(税后)×15%。

本财务报表由本基金的基金管理人财通证券资产管理有限公司于2021年8月27日批准报出。

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<年度报告和中期报告>》、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》、《财通资管鸿运中短债债券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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计，与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 2021年06月30日
活期存款	24,345,998.87
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	24,345,998.87

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021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	89,437,096.86	89,348,647.57	-88,449.29
	银行间市场	5,030,828,596.91	5,038,959,600.00	8,131,003.09
	合计	5,120,265,693.77	5,128,308,247.57	8,042,553.80
资产支持证券		60,434,021.92	60,434,021.92	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	5,180,699,715.69	5,188,742,269.49	8,042,553.80

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	116,270,824.44	-
合计	116,270,824.44	-

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 2021年06月30日
应收活期存款利息	3,180.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,907.67
应收债券利息	59,803,326.00
应收资产支持证券利息	236,602.74
应收买入返售证券利息	221,348.36
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	3.80
合计	60,267,369.03

注：其他包括应收保证金利息。

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 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	7,289.59
银行间市场应付交易费用	81,242.32
合计	88,531.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,302.56
合计	93,302.56

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 财通资管鸿运中短债债券A

金额单位：人民币元

项目 (财通资管鸿运中短债债券A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	124,819,293.73	124,819,293.73
本期申购	1,027,978,545.52	1,027,978,545.52
本期赎回（以“-”号填列）	-221,278,772.61	-221,278,772.61
本期末	931,519,066.64	931,519,066.64

6.4.7.9.2 财通资管鸿运中短债债券C

金额单位：人民币元

项目（财通资管鸿运中短债债券C）	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,975,617.46	49,975,617.46
本期申购	3,916,995,219.86	3,916,995,219.86
本期赎回（以“-”号填列）	-1,599,831,676.16	-1,599,831,676.16
本期末	2,367,139,161.16	2,367,139,161.16

6.4.7.9.3 财通资管鸿运中短债债券E

金额单位：人民币元

项目（财通资管鸿运中短债债券E）	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,462,419.80	304,462,419.80
本期申购	3,332,325,608.06	3,332,325,608.06
本期赎回（以“-”号填列）	-1,994,543,787.70	-1,994,543,787.70
本期末	1,642,244,240.16	1,642,244,240.16

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 财通资管鸿运中短债债券A

单位：人民币元

项目（财通资管鸿运中短债债券A）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	9,923,407.83	-620,795.00	9,302,612.83
本期利润	9,193,536.30	1,645,624.22	10,839,160.52
本期基金份额交易产生的变动数	72,217,254.69	-3,130,226.37	69,087,028.32
其中：基金申购款	92,753,018.02	-3,791,433.81	88,961,584.21
基金赎回款	-20,535,763.33	661,207.44	-19,874,555.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	91,334,198.82	-2,105,397.15	89,228,801.67

6.4.7.10.2 财通资管鸿运中短债债券C

单位：人民币元

项目（财通资管鸿运中短债债券C）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,542,791.17	-245,733.93	3,297,057.24
本期利润	19,675,104.80	4,925,329.57	24,600,434.37
本期基金份额交易产生的变动数	183,130,520.02	-9,958,561.01	173,171,959.01
其中：基金申购款	317,652,767.12	-14,087,408.29	303,565,358.83
基金赎回款	-134,522,247.10	4,128,847.28	-130,393,399.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	206,348,415.99	-5,278,965.37	201,069,450.62

6.4.7.10.3 财通资管鸿运中短债债券E

单位：人民币元

项目（财通资管鸿运中短债债券E）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,726,362.17	-1,988,804.61	5,737,557.56
本期利润	11,200,685.17	1,522,949.58	12,723,634.75
本期基金份额交易产生的变动数	49,748,787.15	-6,041,735.92	43,707,051.23

其中：基金申购款	122,940,997.97	-15,702,305.91	107,238,692.06
基金赎回款	-73,192,210.82	9,660,569.99	-63,531,640.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,675,834.49	-6,507,590.95	62,168,243.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	42,679.57
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	32,417.18
其他	57.66
合计	75,154.41

注：其他包括存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益—买卖股票差价收入。

6.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益—证券出借差价收入。

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 2021年01月01日至2021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	-545,422.02
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	-545,422.02

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 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,270,301,739.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,221,909,372.77
减：应收利息总额	48,937,789.04
买卖债券差价收入	-545,422.02

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	3,722,288.80
减：卖出资产支持证券成本总额	3,622,400.00
减：应收利息总额	99,888.80
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额

	2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	-834,250.00

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	8,093,903.37
——股票投资	-
——债券投资	8,093,903.37
——资产支持证券投资	-
——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	8,093,903.37

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	727,325.62
转换费收入	14.05
合计	727,339.67

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费用全额归入基金资产。
2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的全额归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	21,372.01
银行间市场交易费用	91,697.50
期货市场交易费用	1,562.08
合计	114,631.59

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	33,451.55
帐户维护费	18,000.00
银行间查询服务费	600.00
合计	136,354.11

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
财通证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	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	13,137,847.77	6.15%	35,441,460.72	92.83%

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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	113,000,000.00	20.62%	634,000,000.00	99.69%

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 2021年01月01日至2021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	2,665.78	13.87%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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	14,116.13	98.45%	4,824.92	97.64%

注：1.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。

2.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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,509,528.13	381,774.11
其中：支付销售机构的客户维护费	1,611,608.95	217,267.72

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.3%的管理费年费率来计算，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，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,202,540.87	101,806.45

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以0.08%的托管费年费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金托管费=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，逐日累计至每月月末，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 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	财通资管鸿运中短债债券A	财通资管鸿运中短债债券C	财通资管鸿运中短债债券E	合计
财通证券	-	45,539.50	-	45,539.

股份有限公司				50
财通证券资产管理有限公司	-	500.25	133,964.22	134,464.47
中国工商银行股份有限公司	-	82,172.98	-	82,172.98
合计	-	128,212.73	133,964.22	262,176.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	财通资管鸿运中短债债券A	财通资管鸿运中短债债券C	财通资管鸿运中短债债券E	合计
财通证券股份有限公司	-	2,622.27	-	2,622.27
财通证券资产管理有限公司	-	502.71	-	502.71
中国工商银行股份有限公司	-	126,701.70	-	126,701.70
合计	-	129,826.68	-	129,826.68

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金份额的年销售服务费率为0.40%，E类基金份额的年销售服务费率为0.40%。根据《财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金销售服务费费率优惠的公告》，自2020年10月28日起，E类基金份额的年销售服务费率调整为0.20%，具体计算方法如下：每日该类基金份额应计提的基金销售服务费＝前一日该类基金份额的基金资产净值×该类基金份额年销售服务费率÷当年天数。基金销售服务费每日计提，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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
中国工商银行股份有限公司	24,345,998.87	42,679.57	225,940.20	14,982.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
012102384	21长寿经开SCP001	2021-06-30	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
179315	新城01优	2021-06-29	2021-07-14	资产支持证券未上市	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2021年06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183,649,668.17元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210202	21国开02	2021-07-01	100.09	350,000	35,031,500.00
210206	21国开06	2021-07-01	100.01	1,600,000	160,016,000.00
合计				1,950,000	195,047,500.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年06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80,774,000.00元，截至2021年07月27日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立规范科学有效的内部风险管理体系结构。董事会是公司风险管理的最高决策机构，授权公司经营管理层建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的具体规章制度，组织实施各类风险的识别与评估工作；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，风险管理部负责拟定公司的风险管理政策、风险管理流程和具体制度，并具体实施，确保公司整体风险得到有效的识别、监控和管理，确保公司各项内部管理制度得到有效执行。基金管理业务合规负责人对董事会负责并报告工作，负责监督检查公募基金业务的合法合规性并对内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。

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、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	1,061,436,900.00	112,861,510.00
A-1以下	-	-
未评级	3,266,774,000.00	97,172,116.00
合计	4,328,210,900.00	210,033,626.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为短期融资券、政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	3,622,400.00
未评级	-	-
合计	-	3,622,400.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	78,949,000.00	-
合计	78,949,000.00	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为同业存单。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	74,717,300.00	54,452,100.00
AAA以下	272,948,600.00	69,777,500.00
未评级	373,482,447.57	79,017,210.00
合计	721,148,347.57	203,246,810.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为政策性金融债。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日

AAA	40,000,000.00	-
AAA以下	20,434,021.92	20,434,021.92
未评级	-	-
合计	60,434,021.92	20,434,021.92

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

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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。

于2021年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有264,423,668.17元将在一个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出

回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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未来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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售证券等利率敏感性资产，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2021年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,345,998.87	-	-	-	24,345,998.87

结算备付金	844,689.07	-	-	19,189,445.61	20,034,134.68
存出保证金	8,364.21	-	-	-	8,364.21
交易性金融资产	4,835,082,369.49	351,644,300.00	2,015,600.00	-	5,188,742,269.49
买入返售金融资产	116,270,824.44	-	-	-	116,270,824.44
应收证券清算款	-	-	-	171,554,011.64	171,554,011.64
应收利息	-	-	-	60,267,369.03	60,267,369.03
应收申购款	-	-	-	26,916,990.96	26,916,990.96
资产总计	4,976,552,246.08	351,644,300.00	2,015,600.00	277,927,817.24	5,608,139,963.32
负债					
卖出回购金融资产款	264,423,668.17	-	-	-	264,423,668.17
应付赎回款	-	-	-	46,761,785.37	46,761,785.37
应付管理人报酬	-	-	-	1,370,818.00	1,370,818.00
应付托管费	-	-	-	365,551.44	365,551.44
应付销售服务费	-	-	-	1,212,813.89	1,212,813.89
应付交易费用	-	-	-	88,531.91	88,531.91
应交税费	-	-	-	405,033.03	405,033.03
应付利息	-	-	-	49,495.16	49,495.16
其他负债	-	-	-	93,302.56	93,302.56
负债总计	264,423,668.17	-	-	50,347,331.36	314,770,999.53
利率敏感度缺口	4,712,128,577.91	351,644,300.00	2,015,600.00	227,580,485.88	5,293,368,963.79

上年度末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,384,960.89	-	-	-	8,384,960.89
结算备付金	1,812,488.62	-	-	1,503,323.86	3,315,812.48
存出保证金	2,513.89	-	-	-	2,513.89
交易性金融资产	376,499,036.00	58,818,821.92	2,019,000.00	-	437,336,857.92
买入返售金融资产	65,000,457.50	-	-	-	65,000,457.50
应收利息	-	-	-	7,713,065.68	7,713,065.68
应收申购款	-	-	-	21,314,404.76	21,314,404.76
资产总计	451,699,456.90	58,818,821.92	2,019,000.00	30,530,794.30	543,068,073.12
负债					
卖出回购金融资产款	39,899,740.15	-	-	-	39,899,740.15
应付赎回款	-	-	-	5,123,287.58	5,123,287.58
应付管理人报酬	-	-	-	105,276.98	105,276.98
应付托管费	-	-	-	28,073.84	28,073.84
应付销售服务费	-	-	-	60,695.32	60,695.32
应付交易费用	-	-	-	42,769.28	42,769.28
应交税费	-	-	-	28,366.15	28,366.15
应付利息	-	-	-	6,305.20	6,305.20
其他负债	-	-	-	179,000.00	179,000.00

负债总计	39,899,740.15	-	-	5,573,774.35	45,473,514.50
利率敏感度缺口	411,799,716.75	58,818,821.92	2,019,000.00	24,957,019.95	497,594,558.62

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	5,605,431.79	556,748.22
	2.市场利率上升25个基点	-5,581,262.75	-554,621.69

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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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	5,188,742,269.49	92.52
	其中：债券	5,128,308,247.57	91.44
	资产支持证券	60,434,021.92	1.08
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	116,270,824.44	2.07
	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	44,380,133.55	0.79
8	其他各项资产	258,746,735.84	4.61
9	合计	5,608,139,963.32	100.00

注：由于四舍五入的原因，金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

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

本基金本报告期内未投资股票。

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投资股票。

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	553,500,447.57	10.46
	其中：政策性金融债	553,500,447.57	10.46
4	企业债券	48,555,900.00	0.92
5	企业短期融资券	4,148,192,900.00	78.37
6	中期票据	299,110,000.00	5.65
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	78,949,000.00	1.49
9	其他	-	-
10	合计	5,128,308,247.57	96.88

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

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	210206	21国开06	1,800,000	180,018,000.00	3.40
2	180211	18国开11	1,500,000	152,640,000.00	2.88

3	210202	21国开02	1,400,000	140,126,000.00	2.65
4	132100023	21三峡GN003	1,200,000	120,132,000.00	2.27
5	072100071	21招商证券CP004BC	1,100,000	110,066,000.00	2.08

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	146285	武夷优03	200,000	20,434,021.92	0.39
2	189503	惠科02	200,000	20,000,000.00	0.38
3	179315	新城01优	200,000	20,000,000.00	0.38

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 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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包含股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-834,250.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：期货投资本期收益为扣除相关税费后的金额。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金对国债期货的投资以套期保值，降低净值波动为主要目的。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，以期获取超额收益。

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中21招商证券CP004BC（证券代码：072100071）的发行主体在本报告编制日前一年内受到公开处罚。报告期内本基金投资的前十名证券的其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一的21招商证券CP004BC（证券代码：072100071）的发行主体招商证券股份有限公司于2021年5月26日收到处罚决定书（深人银罚〔2021〕10号），并处以人民币173万元的罚款。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资有严格的投资决策流程控制，本基金对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，本基金严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中，研究员密切关注证券发行主体动向，在上述处罚发生时及时分析其对该投资决策的影响。经过分析认为此事件对该证券发行主体的财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此不影响对该证券基本面和投资价值的判断。

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	8,364.21
2	应收证券清算款	171,554,011.64
3	应收股利	-
4	应收利息	60,267,369.03
5	应收申购款	26,916,990.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	258,746,735.84

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

本基金本报告期末未持有股票。

§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
财通资管鸿运中短债债券A	8,803	105,818.36	632,845,263.61	67.94%	298,673,803.03	32.06%

财通资管鸿运中短债债券C	197,610	11,978.84	3,263,975.84	0.14%	2,363,875,185.32	99.86%
财通资管鸿运中短债债券E	115,890	14,170.72	333,827,123.33	20.33%	1,308,417,116.83	79.67%
合计	322,303	15,329.99	969,936,362.78	19.63%	3,970,966,105.18	80.37%

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	财通资管鸿运中短债债券A	216,084.29	0.02%
	财通资管鸿运中短债债券C	178,590.39	0.01%
	财通资管鸿运中短债债券E	247,944.67	0.02%
	合计	642,619.35	0.01%

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	财通资管鸿运中短	0~10

和研究部门负责人持有本开放式基金	债债券A	
	财通资管鸿运中短债债券C	0~10
	财通资管鸿运中短债债券E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	财通资管鸿运中短债债券A	0
	财通资管鸿运中短债债券C	0
	财通资管鸿运中短债债券E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管鸿运中短债债券A	财通资管鸿运中短债债券C	财通资管鸿运中短债债券E
基金合同生效日(2019年01月21日)基金份额总额	2,233,182,129.29	1,453,957,720.07	-
本报告期期初基金份额总额	124,819,293.73	49,975,617.46	304,462,419.80
本报告期基金总申购份额	1,027,978,545.52	3,916,995,219.86	3,332,325,608.06
减：本报告期基金总赎回份额	221,278,772.61	1,599,831,676.16	1,994,543,787.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	931,519,066.64	2,367,139,161.16	1,642,244,240.16

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§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，无基金管理人的重大人事变动。中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任资产托管部总经理职务。

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

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

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	
安信证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	16,550.20	86.13%	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	2,665.78	13.87%	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	200,450,796.82	93.85%	435,142,000.00	79.38%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	13,137,847.77	6.15%	113,000,000.00	20.62%	-	-	-	-

注：a.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。

b.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。

c.本报告期内本基金无减少交易单元，新增华安证券、东方证券各一个交易单元。

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	财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金风险揭示书	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2021-01-06
2	财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	同上	2021-02-06
3	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司新增定期定额投资业务和转换业务的公告	同上	2021-02-25
4	财通证券资产管理有限公司关于在网上直销渠道开通基金定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2021-03-02
5	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司新增定期定额投资、转换业务的公告	同上	2021-04-16

6	关于财通证券资产管理有限公司旗下11只基金增加侧袋机制并修改相应法律文件的公告	同上	2021-04-20
7	财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-04-20
8	财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第1号	同上	2021-04-20
9	财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金合同	同上	2021-04-20
10	财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金托管协议	同上	2021-04-20
11	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在阳光人寿保险股份有限公司新增定期定额投资业务和转换业务的公告	同上	2021-04-23
12	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在腾安基金销售（深圳）有限公司开通转换业务的公告	同上	2021-04-29
13	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司新增定期定额投资业务和转换业务的公告	同上	2021-06-08

§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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、财通资管鸿运中短债债券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、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金托管协议

4、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金合同

5、财通资管鸿运中短债债券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

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层

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

财通证券资产管理有限公司

二〇二一年八月三十日