

财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年03月25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。

本报告期自2021年01月01日起至12月31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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
4.9 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	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	21
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	27
7.4 报表附注	29
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 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	58
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	59
§9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.3 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	61
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
11.2 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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息	65
12.1 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	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	财通资管丰和两年定开债券	
基金主代码	007913	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2019年12月04日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,967,010,695.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通资管丰和两年定开债券A	财通资管丰和两年定开债券C
下属分级基金的交易代码	007913	007914
报告期末下属分级基金的份额总额	7,966,958,912.15份	51,783.58份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	1、封闭期投资策略（包括封闭期配置策略、信用债投资策略、放大策略、资产支持证券投资策略、封闭期现金管理策略）；2、开放期投资策略。
业绩比较基准	封闭期起始日公布的两年期定期存款利率（税后）+1.0%。
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	交通银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	刘泉	陆志俊
	联系电话	021-20568203	95559
	电子邮箱	lq@ctzg.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95336	95559
传真		021-68753502	021-62701216
注册地址		浙江省杭州市上城区白云路26号143室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		马晓立	任德奇

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金年度报告备置地点	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
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
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1	2021年	2020年	2019年12月04日（基金
-------	-------	-------	----------------

期间数据和指标					合同生效日)-2019年12月31日	
	财通资管丰和两年定开债券A	财通资管丰和两年定开债券C	财通资管丰和两年定开债券A	财通资管丰和两年定开债券C	财通资管丰和两年定开债券A	财通资管丰和两年定开债券C
本期已实现收益	125,892,378.02	5,144.59	97,341,667.90	4,307.88	5,291,539.91	221.62
本期利润	125,892,378.02	5,144.59	97,341,667.90	4,307.88	5,291,539.91	221.62
加权平均基金份额本期利润	0.0352	0.0314	0.0291	0.0250	0.0016	0.0013
本期加权平均净值利润率	3.46%	3.10%	2.87%	2.47%	0.16%	0.13%
本期基金份额净值增长率	3.52%	3.10%	2.91%	2.50%	0.16%	0.13%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	40,021,391.08	224.99	19,132,900.26	226.73	5,291,539.91	221.62
期末可供分配基金份额利润	0.0050	0.0043	0.0057	0.0013	0.0016	0.0013

期末基金资产净值	8,006,980,303.23	52,008.57	3,359,145,206.45	173,145.56	3,345,303,841.62	172,363.62
期末基金份额净值	1.0050	1.0043	1.0057	1.0013	1.0016	1.0013
3.1.3 累计期末指标	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	6.70%	5.82%	3.07%	2.63%	0.16%	0.13%

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

财通资管丰和两年定开债券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
过去三个月	1.28%	0.03%	0.78%	0.01%	0.50%	0.02%
过去六个月	2.41%	0.02%	1.56%	0.01%	0.85%	0.01%
过去一年	3.52%	0.02%	3.10%	0.01%	0.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.70%	0.02%	6.44%	0.01%	0.26%	0.01%

财通资管丰和两年定开债券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
过去三个月	1.17%	0.03%	0.78%	0.01%	0.39%	0.02%
过去六个月	2.20%	0.02%	1.56%	0.01%	0.64%	0.01%
过去一年	3.10%	0.02%	3.10%	0.01%	0.00%	0.01%
自基金合同 生效起至今	5.82%	0.02%	6.44%	0.01%	-0.62%	0.01%

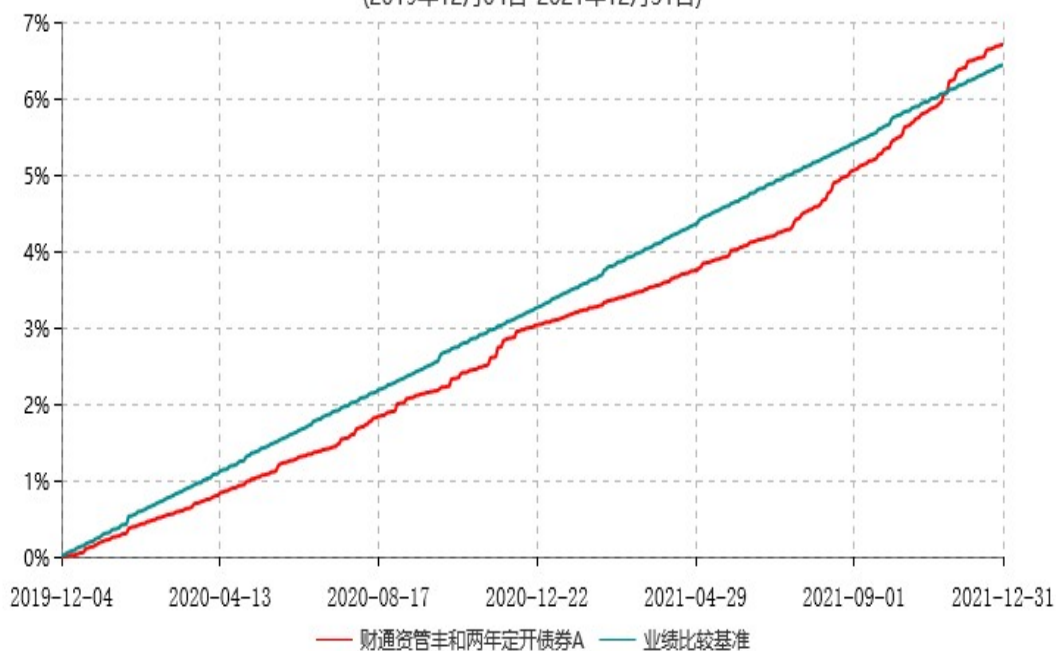
注：1、业绩比较基准：封闭期起始日公布的两年期定期存款利率（税后）+1.0%

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

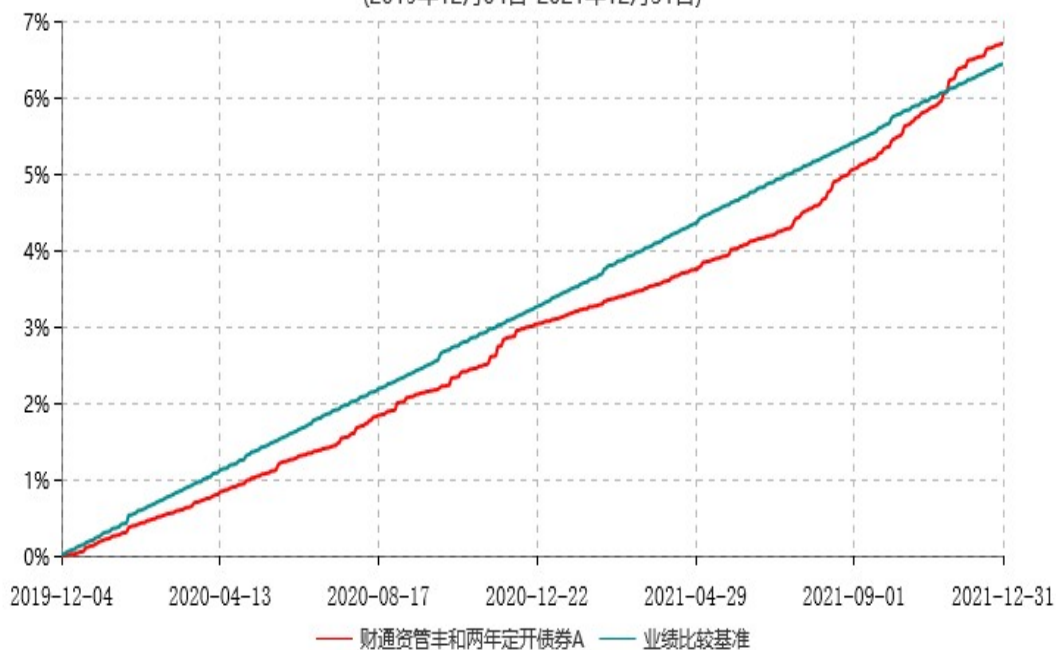
财通资管丰和两年定开债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年12月04日-2021年12月31日)

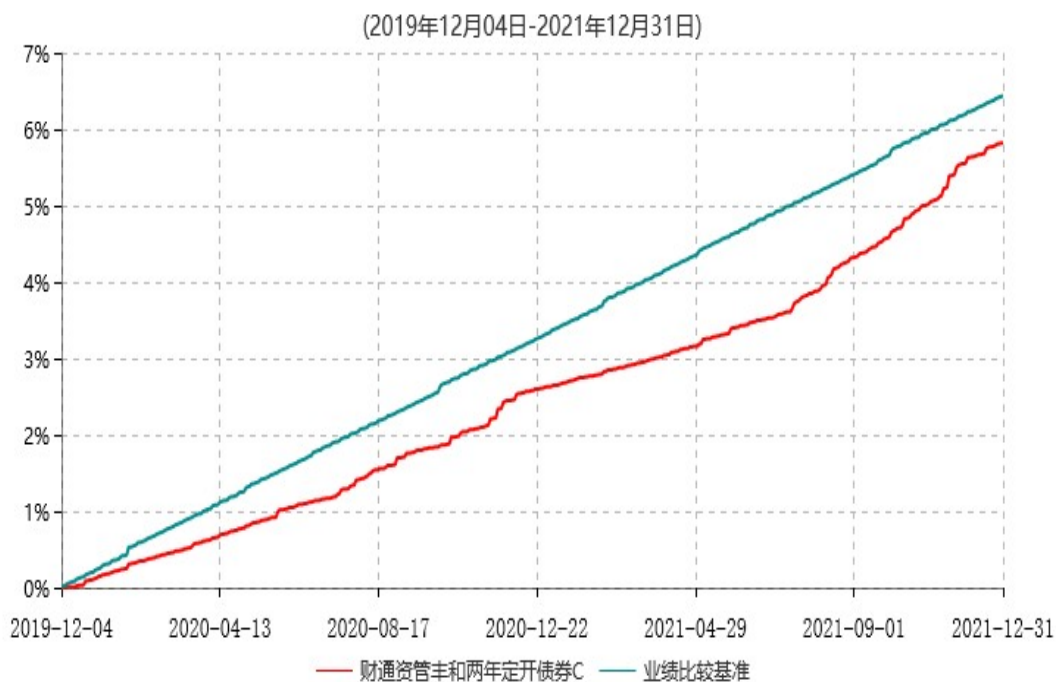


财通资管丰和两年定开债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年12月04日-2021年12月31日)

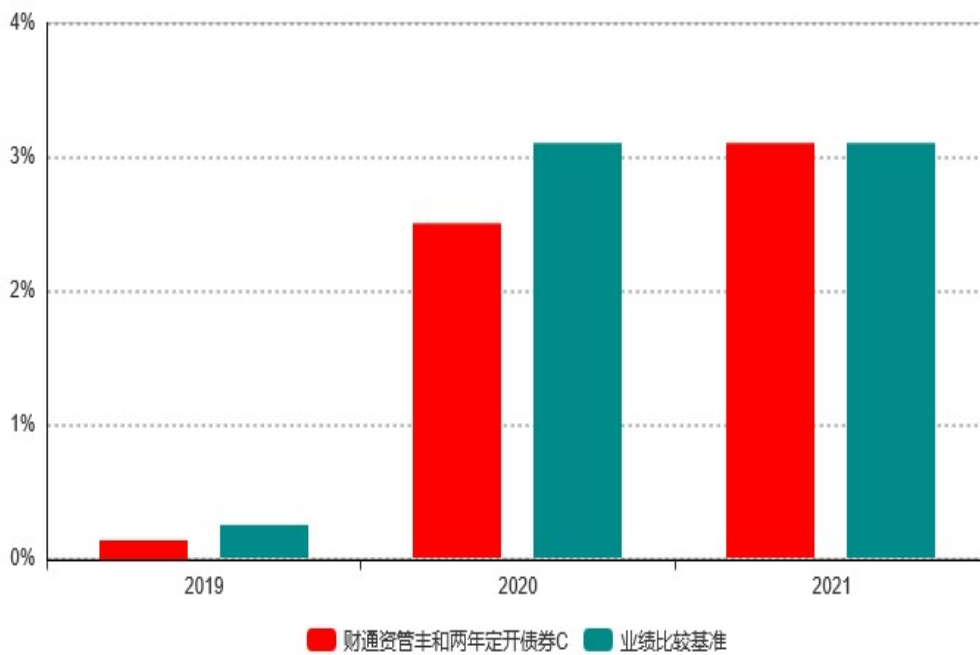
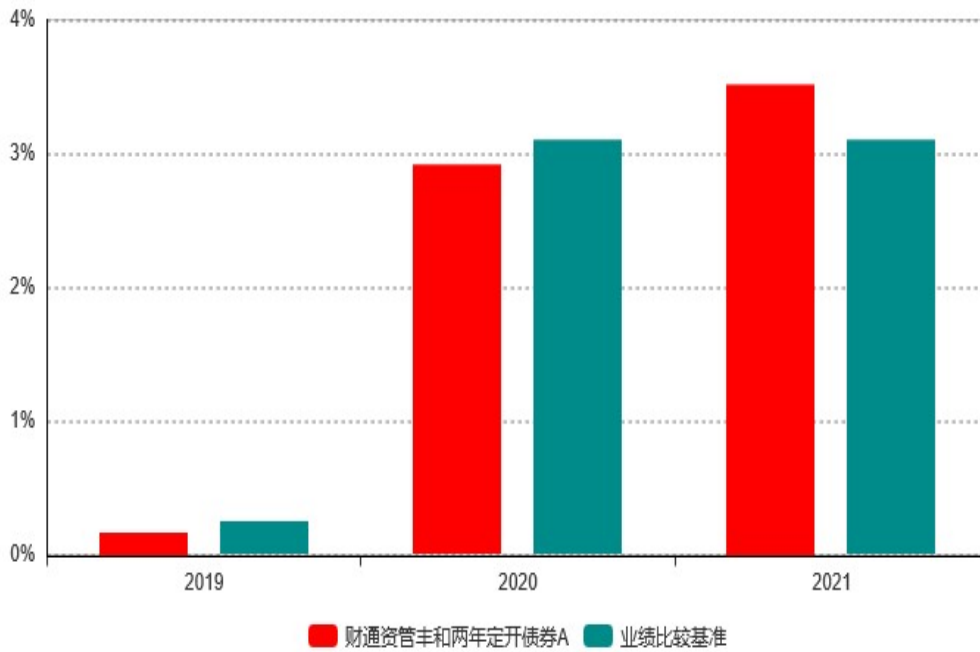


财通资管丰和两年定开债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：自基金合同生效至报告期末，财通资管丰和两年定开债券 A 基金份额净值增长率为 6.70%，同期业绩比较基准收益率为 6.44%；财通资管丰和两年定开债券 C 基金份额净值增长率为 5.82%，同期业绩比较基准收益率为 6.44%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

财通资管丰和两年定开债券A

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2021年	0.360	120,240,443.07	-	120,240,443.07	-
2020年	0.250	83,500,303.07	4.50	83,500,307.57	-
2019年	-	-	-	-	-
合计	0.610	203,740,746.14	4.50	203,740,750.64	-

财通资管丰和两年定开债券C

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2021年	0.280	4,841.74	-	4,841.74	-
2020年	0.250	3,525.94	777.60	4,303.54	-
2019年	-	-	-	-	-
合计	0.530	8,367.68	777.60	9,145.28	-

§ 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12月31日，公司共管理41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、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、财通资管消费升级一年持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿启90天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金、财通资管鸿享30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金、财通资管中证钢铁指数型发起式证券投资基金、财通资管新能源汽车混合型发起式证券投资基金、财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金、财通资管健康产业混合型证券投资基金、财通资管鸿佳60天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金和财通资管新聚益6个月持有期混合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		
夏金涛	本基金基金经理、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、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管睿慧1年定期开放债券型发起式证券投资基金和财通资管鸿享30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。	2020-07-01	-	5	上海交通大学应用统计硕士。2016年3月起加入财通证券资产管理有限公司，历任固定收益部产品经理助理、固收公募投资部基金经理助理。
王亚	本基金基金经理、财通资	2021-	-	2	金融学硕士，曾任北京银

<p>军</p>	<p>管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管睿智1年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金和财通资管鸿享30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。</p>	<p>09-27</p>			<p>行资金交易部交易员；工商银行金融市场部交易员；阜新银行北京拓展部副总经理；成都银行资金部副总经理。2019年4月加入财通证券资产管理有限公司。</p>
<p>李杰</p>	<p>本基金基金经理、财通资管鸿益中短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、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鑫逸回报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。</p>	<p>2019-12-04</p>	<p>2021-12-27</p>	<p>14</p>	<p>武汉大学理学学士、上海交通大学理学硕士。2007年1月加入国联安基金管理有限公司先后任数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012年4月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安优质精选灵活配置型证券投资基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金的基金经理；固定收益与量化部执行总监；2018年4月加入财通证券资产管理有限公司。</p>

朱红	本基金基金经理助理、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、财通资管丰乾39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、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金和财通资管鑫管家货币市场基金基金经理助理。	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。
费钦予	本基金基金经理助理、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿享30天滚动持有中短债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、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、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、财通资管鸿越3个月滚动持有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和财通资管鸿益中短债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。	2020-02-04	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。

3、2022年1月10日解除朱红和费钦予本基金基金经理助理的职务。

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《财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《财通资管丰和两年定期开放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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制、银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；2、对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理，确保公平对待所有投资组合。

事后评估及反馈表现为对各基金投资组合公平交易进行事后分析，于每季度对公司管理的不同基金投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗

口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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，全球各国经济走势共同的主题词是“修复”。经历了2020年疫情最为严重的一年，各国经济在宽松的政策环境中开始修复。虽然变异毒株侵扰、全球气候异常现象频发等外部冲击使修复的进程并非一帆风顺，但全球经济回归正常化的趋势并未改变。从修复的节奏上看，我国经济修复要领先海外，进而形成了我国经济外需偏强、内需偏弱的特征。

回顾21年的债券市场，核心交易逻辑在于经济增长压力的逐渐显现，叠加流动性充裕，债市处于顺风环境。具体来看，可将21年的收益率走势划分四个阶段：1-2月，经济修复动能尚强，货币环境趋于正常化，因而推动收益率快速上行并构成全年顶部；3-6月，收益率水平震荡下行，主要反映了经济增长压力逐步显现以及债券供给不足；7-8月，央行意外实施全面降准给予市场货币政策边际宽松的预期，同时使经济下行担忧升温，收益率明显下行；9-12月，这一阶段影响市场情绪的因素较多，包括银行理财估值整改、房地产政策边际松动、保供稳价举措等，收益率呈现震荡走势。全年来看，收益率整体为震荡下行。

本基金采用摊余成本法基金，买入高等级信用债和利率债并持有到期为主，降低信用风险。报告期内本基金合理施加杠杆，控制资金成本，以增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管丰和两年定开债券A基金份额净值为1.0050元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.52%，同期业绩比较基准收益率为3.10%；截至报告期末财通资管丰和两年定开债券C基金份额净值为1.0043元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.10%，同期业绩比较基准收益率为3.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，宏观经济仍是研判债市走势最重要的依据。2022年债券收益率大概率维持震荡，经济下行压力进一步增强而财政政策对冲也将更为积极，同时货币政策坚持“灵活适度”，流动性环境边际宽松，后续应密切关注基本面、政策面的边际变化等可能推动收益率突破震荡格局的因素。从长期的角度看，潜在经济增速下行仍是我们对债市保持乐观的核心逻辑。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年，合规负责人和合规稽核部持续完善合规管理制度体系，落实合规文化建设，全面有效地开展合规审查与稽核检查工作，进而提升合规与稽核管理工作的质量和实效，确保公司各项业务和日常经营合规、平稳运行。

（一）持续完善合规管理制度体系

公司根据法规政策的新变化、行业发展的新动态以及公司组织结构的新调整，持续加强制度体系建设，不断优化内控环节。牵头各部门完成了公司制度全面梳理与有效性评估工作，提升公司制度管理的有效性和精细化，进一步夯实公司合规运作和规范管理的制度基础。

（二）持续落实公司合规文化建设

2021年度，公司多措并举落实公司合规文化长效化建设机制。通过开展合规考试、组织合规培训、多维度和多渠道合规传导等方式，加强公司合规文化建设效果，有效推动“全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”合规文化理念的树立。

（三）全面有效开展日常合规管理

1、合规审查

依照法律法规、监管要求及公司制度规定，从法律合规角度向公司各大业务板块和职能部门提供全面支持和服务保障，持续更新完善各类法律文件模板，提高审核效率并对新业务、新产品、重大决策事项从管理程序、潜在风险和防控措施等方面提出法律合规审查意见，保障公司各项的业务合法合规开展。

2、合规咨询

在日常业务开展以及公司经营管理过程中，通过邮件、口头等方式提供合规咨询与建议服务，与公司各部门积极沟通并协调解决业务办理过程中遇到的各类难题，全程提供合规支持。

3、员工执业与投资行为管理

定期对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录执行合规检查，通过常态化的员工执业行为和投资行为合规管理机制，提升员工合规执业和廉洁从业意识，促使员工执业行为和投资行为持续符合监管要求。

4、反洗钱合规管理

2021年度持续完善反洗钱管理体系，进行反洗钱相关制度修订及新增，加强反洗钱管理工作，日常开展可疑交易监控排查、监控黑名单更新及回溯筛查、协助开展客户风险等级划分等相关工作。完成《2020年度反洗钱工作报告》，并按相关要求推进洗钱风险自评估工作。

（四）加强合规检查力度

按照法律法规以及监管机构的要求，定期对公司各业务部门执行制度的情况进行合规检查与专项审计，查漏补缺、排查隐患、防范潜在风险，并就检查中发现问题与相关部门制定整改方案。同时，加大整改跟踪力度，促进公司内部控制管理的完善，防范合规风险的进一步发生。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金A类份额每10份基金份额发放红利0.36元人民币，共计分配收益120,240,443.07元；本基金C类份额每10份基金份额发放红利0.28元人民币，共计分配收益4,841.74元，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.9 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，基金托管人在财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，财通证券资产管理有限公司在财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由财通证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第21947号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基

	金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容 我们审计了财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“财通资管丰和两年定开债券”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了财通资管丰和两年定开债券2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于财通资管丰和两年定开债券,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>财通资管丰和两年定开债券的基金管理人财通证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负</p>

	<p>责评估财通资管丰和两年定开债券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算财通资管丰和两年定开债券、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督财通资管丰和两年定开债券的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对财通资管丰和两年定开债券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发</p>

	表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致财通资管丰和两年定开债券不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	沈兆杰	叶尔甸
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2022-03-29	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,482,184.68	1,189,116.61
结算备付金		1,755,506.97	19,164,252.85
存出保证金		11,420.48	6,071.06
交易性金融资产	7.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	82,118,356.33	44,531,919.13
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	10,853,302,277.19	5,236,673,539.40
资产总计		10,938,669,745.65	5,301,564,899.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,929,943,050.83	1,940,498,097.25
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		759,801.29	434,273.09
应付托管费		253,267.10	144,757.71
应付销售服务费		27.49	59.50
应付交易费用	7.4.7.7	147,419.60	58,947.68
应交税费		-	-
应付利息		296,867.54	873,411.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	237,000.00	237,000.00
负债合计		2,931,637,433.85	1,942,246,547.04
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	7,967,010,695.73	3,340,185,225.02
未分配利润	7.4.7.10	40,021,616.07	19,133,126.99

所有者权益合计		8,007,032,311.80	3,359,318,352.01
负债和所有者权益总计		10,938,669,745.65	5,301,564,899.05

注：1、报告截止日2021年12月31日，A类基金份额净值1.0050元，C类基金份额净值1.0043元；基金份额总额7,967,010,695.73份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额7,966,958,912.15份，C类基金份额总额51,783.58份。

2、资产负债表中其他资产为分类为持有至到期投资的债券投资。

7.2 利润表

会计主体：财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		168,326,962.83	136,083,048.78
1. 利息收入		157,017,770.91	135,482,086.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	492,932.77	843,329.58
债券利息收入		132,349,767.03	134,544,425.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,175,071.11	94,331.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,309,191.92	600,962.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	11,309,191.92	600,962.62
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
减：二、费用		42,429,440.22	38,737,073.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,426,218.03	5,081,624.29
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,808,739.38	1,693,874.82
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	667.61	696.94
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		34,928,615.20	31,690,691.18
其中：卖出回购金融资产支出		34,928,615.20	31,690,691.18
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.19	265,200.00	270,185.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		125,897,522.61	97,345,975.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		125,897,522.61	97,345,975.78

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年01月01日至2021年12月31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)	3,340,185,225.02	19,133,126.99	3,359,318,352.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	125,897,522.61	125,897,522.61
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)	4,626,825,470.71	15,236,251.28	4,642,061,721.99
其中：1. 基金申购款	5,586,961,399.61	18,020,600.39	5,604,982,000.00
2. 基金赎回款	-960,135,928.90	-2,784,349.11	-962,920,278.01
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)	-	-120,245,284.81	-120,245,284.81
五、期末所有者权益(基金净值)	7,967,010,695.73	40,021,616.07	8,007,032,311.80
项 目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年12月31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)	3,340,184,443.71	5,291,761.53	3,345,476,205.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利	-	97,345,975.78	97,345,975.78

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)	781.31	0.79	782.10
其中: 1. 基金申购款	781.31	0.79	782.10
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-83,504,611.11	-83,504,611.11
五、期末所有者权益(基金净值)	3,340,185,225.02	19,133,126.99	3,359,318,352.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

财通资管丰和两年定期开放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[2019]1385号《关于准予财通资管丰和两年定期开放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《财通资管丰和两年定期开放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、定期开放式,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3,340,184,437.39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0682号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2019年12月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,340,184,443.71份基金份额,

其中认购资金利息折合6.32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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效日所对应的两年年度对日的前一日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的两年年度对日的前一日，以此类推。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

根据《财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购费用、申购费用、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。在投资者认购、申购基金时收取认购费、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，而不计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者认购、申购基金时不收取认购费、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。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《财通资管丰和两年定期开放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国内依法发行上市的债券（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、可分离交易可转债的纯债部分、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券等）、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、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。本基金不投资股票、可转换债券和可交换债券，但可以投资可分离交易可转债的纯债部分。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期，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；在封闭期，本基金不受前述5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为：该封闭期起始日公布的两年定期存款利率（税后）+1.0%。

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2022年3月30日批准报出。

7.4.2 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》、《财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021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2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产。

本基金采用买入持有至到期投资策略投资的债券投资和资产支持证券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定,且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

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。

7.4.4.4 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。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

对于应收款项、持有至到期投资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。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

于持有至到期投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。发生减值的客观证据包括评估日该金融工具可观察的市场价值出现严重下跌，发行方发生严重财务困难使该金融资产无法在活跃市场继续交易、无法履行合同条款(例如，无法按期偿付利息或本金)等。在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	1,482,184.68	1,189,116.61
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	1,482,184.68	1,189,116.61

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性金融资产。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	862.00	5,364.85
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	869.00	9,486.29
应收债券利息	82,116,619.72	44,517,065.02
应收资产支持证券利息	-	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	5.61	2.97
合计	82,118,356.33	44,531,919.13

注：其他包括应收保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
持有至到期投资	10,853,302,277.19	5,236,673,539.40
合计	10,853,302,277.19	5,236,673,539.40

注：于2021年12月31日，本基金持有的持有至到期投资为债券投资，银行间市场债券10,853,302,277.19元，无交易所市场债券(2020年12月31日：交易所市场债券1,730,512,789.69元，银行间市场债券3,506,160,749.71元)。上述持有至到期投资均无需计提减值准备(2020年12月31日：同)。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	996.39
银行间市场应付交易费用	147,419.60	57,951.29
合计	147,419.60	58,947.68

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	237,000.00	237,000.00
合计	237,000.00	237,000.00

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 财通资管丰和两年定开债券A

金额单位：人民币元

项目	本期
(财通资管丰和两年定开债券)	2021年01月01日至2021年12月31日

A)	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,340,012,306.19	3,340,012,306.19
本期申购	5,586,961,399.61	5,586,961,399.61
本期赎回（以“-”号填列）	-960,014,793.65	-960,014,793.65
本期末	7,966,958,912.15	7,966,958,912.15

7.4.7.9.2 财通资管丰和两年定开债券C

金额单位：人民币元

项目 (财通资管丰和两年定开债券 C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,918.83	172,918.83
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-121,135.25	-121,135.25
本期末	51,783.58	51,783.58

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 财通资管丰和两年定开债券A

单位：人民币元

项目 (财通资管丰和两年定 开债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,132,900.26	-	19,132,900.26
本期利润	125,892,378.02	-	125,892,378.02
本期基金份额交易产生的变动数	15,236,555.87	-	15,236,555.87
其中：基金申购款	18,020,600.39	-	18,020,600.39
基金赎回款	-2,784,044.52	-	-2,784,044.52
本期已分配利润	-120,240,443.07	-	-120,240,443.07
本期末	40,021,391.08	-	40,021,391.08

7.4.7.10.2 财通资管丰和两年定开债券C

单位：人民币元

项目 (财通资管丰和两年定 开债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	226.73	-	226.73
本期利润	5,144.59	-	5,144.59
本期基金份额交易产 生的变动数	-304.59	-	-304.59
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-304.59	-	-304.59
本期已分配利润	-4,841.74	-	-4,841.74
本期末	224.99	-	224.99

7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	318,341.22	665,345.53
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	174,426.05	177,010.70
其他	165.50	973.35
合计	492,932.77	843,329.58

注：其他包括存出保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——买卖股票差价收入。

7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31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	11,309,191.92	600,962.62
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	11,309,191.92	600,962.62

7.4.7.13.2 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12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	7,761,446,731.62	1,040,877,383.15
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	7,541,988,039.16	1,037,330,667.11
减：应收利息总额	208,149,500.54	2,945,753.42
买卖债券差价收入	11,309,191.92	600,962.62

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	108,000.00	100,324.92
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行间查询服务费	1,200.00	900.00
汇划手续费	-	12,960.85
合计	265,200.00	270,185.77

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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。

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
交通银行股份有限公司	基金托管人
财通证券股份有限公司	基金管理人的控股股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
财通证券 股份有限 公司	281,171,167.12	100.00%	953,698,624.69	100.00%

7.4.10.1.4 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12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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	20,896,660,000.00	100.00%	25,108,400,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 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12月31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	2,530.54	100.00%	-	-
关联方名 称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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	8,590.11	100.00%	996.39	100.00%

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后的净额列示。

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,426,218.03	5,081,624.29
其中：支付销售机构的客户维护费	1,110.32	128.75

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.15%的管理费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,808,739.38	1,693,874.82

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以0.05%的托管费率来计算，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。

7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管丰和两年定开债券A	财通资管丰和两年定开债券C	合计
财通证券资产管理有限公司	-	7.34	7.34
财通证券股份有限	-	-	-

公司			
交通银行 股份有限 公司	-	-	-
合计	-	7.34	7.34
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管丰和两年定开债券A	财通资管丰和两年定开债券C	合计
财通证券 资产管理 有限公司	-	7.33	7.33
财通证券 股份有限 公司	-	-	-
交通银行 股份有限 公司	-	-	-
合计	-	7.33	7.33

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%的年费率计提，具体计算方法如下：每日C类基金份额应计提的基金销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×年费率÷当年天数。基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	1,482,184.68	318,341.22	1,189,116.61	665,345.53

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

财通资管丰和两年定开债券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	2021-12-01	2021-12-01	0.360	120,240,443.07	-	120,240,443.07	-

合计			0.360	120,240,443.07	-	120,240,443.07	-
----	--	--	-------	----------------	---	----------------	---

财通资管丰和两年定开债券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	2021-12-01	2021-12-01	0.280	4,841.74	-	4,841.74	-
合计			0.280	4,841.74	-	4,841.74	-

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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2,929,943,050.83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
180211	18国开11	2022-01-04	101.82	13,010,000	1,324,649,685.70
180211	18国开11	2022-01-06	101.82	2,390,000	243,344,561.78
180413	18农发13	2022-01-06	101.74	770,000	78,341,101.87
200207	20国开07	2022-01-04	100.65	5,400,000	543,494,614.53
200407	20农发07	2022-01-04	100.71	1,368,000	137,770,770.25
210322	21进出22	2022-01-04	100.15	7,870,000	788,211,254.57
合计				30,808,000	3,115,811,988.70

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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交通银行股份有限公司。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。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	59,996,582.80
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	59,996,582.80

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债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,412,772,332.95	343,310,615.42
合计	1,412,772,332.95	343,310,615.42

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。

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	3,006,929,535.39	4,395,216,616.10
AAA以下	-	6,075,255.12
未评级	6,433,600,408.85	432,074,469.96
合计	9,440,529,944.24	4,833,366,341.18

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 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。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内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12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有2,929,943,050.83元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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。

7.4.13.3.1 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》且于基金开放期内按照《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7.4.12。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。于开放期内，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%。

于开放期内，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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2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	1,482,184.68	-	-	-	1,482,184.68
结算备付金	1,755,506.97	-	-	-	1,755,506.97
存出保证金	11,420.48	-	-	-	11,420.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	82,118,356.33	82,118,356.33
其他资产	1,412,772,332.95	9,440,529,944.24	-	-	10,853,302,277.19
资产总计	1,416,021,445.08	9,440,529,944.24	-	82,118,356.33	10,938,669,745.65
负债					
卖出回购金融资产款	2,929,943,050.83	-	-	-	2,929,943,050.83
应付管理人报酬	-	-	-	759,801.29	759,801.29
应付托管费	-	-	-	253,267.10	253,267.10
应付销售服务费	-	-	-	27.49	27.49
应付交易费用	-	-	-	147,419.60	147,419.60
应付利息	-	-	-	296,867.54	296,867.54
其他负债	-	-	-	237,000.00	237,000.00
负债总计	2,929,943,050.83	-	-	1,694,383.02	2,931,637,433.85
利率敏	-1,513,921,605.75	9,440,529,944.24	-	80,423,973.31	8,007,032,311.80

感度缺口					
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	1,189,116.61	-	-	-	1,189,116.61
结算备付金	19,164,252.85	-	-	-	19,164,252.85
存出保证金	6,071.06	-	-	-	6,071.06
应收利息	-	-	-	44,531,919.13	44,531,919.13
其他资产	5,236,673,539.40	-	-	-	5,236,673,539.40
资产总计	5,257,032,979.92	-	-	44,531,919.13	5,301,564,899.05
负债					
卖出回购金融资产款	1,940,498,097.25	-	-	-	1,940,498,097.25
应付管理人报酬	-	-	-	434,273.09	434,273.09
应付托管费	-	-	-	144,757.71	144,757.71
应付销售服务费	-	-	-	59.50	59.50
应付交易费用	-	-	-	58,947.68	58,947.68
应付利息	-	-	-	873,411.81	873,411.81
其他负债	-	-	-	237,000.00	237,000.00
负债总计	1,940,498,097.25	-	-	1,748,449.79	1,942,246,547.04
利率敏感度缺口	3,316,534,882.67	-	-	42,783,469.34	3,359,318,352.01

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金持有的债券投资均为以摊余成本计量的固定利率债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具(2020年12月31日：同)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、持有至到期投资和其他金融负债等。

除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于2021年12月31日，本基金持有的持有至到期投资账面价值为10,853,302,277.19元，公允价值为10,860,193,000.00元(2020年12月31日，本基金持有的持有至到期投资账面价值为5,236,673,539.40元，公允价值为5,240,557,300.00元)。

持有至到期投资按如下原则确定公允价值：(i) 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。(ii) 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。(iii) 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。

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》的有关规定，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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于2021年12月31日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次(2020年12月31日：同)。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	10,853,302,277.19	99.22
	其中：债券	10,853,302,277.19	99.22
	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	3,237,691.65	0.03
8	其他各项资产	82,129,776.81	0.75
9	合计	10,938,669,745.65	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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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。

8.4.2 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。

8.4.3 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。

8.5 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	9,440,529,944.24	117.90
	其中：政策性金融债	6,433,600,408.85	80.35
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)	-	-
8	同业存单	1,412,772,332.95	17.64
9	其他	-	-
10	合计	10,853,302,277.19	135.55

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

8.6 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	210322	21进出22	28,800,000	2,884,432,54	36.02

				5.32	
2	180211	18国开11	15,400,000	1,567,994,247.48	19.58
3	2028043	20建设银行双创债	7,600,000	771,343,771.16	9.63
4	200313	20进出13	7,000,000	708,544,637.28	8.85
5	112114179	21江苏银行CD179	7,000,000	681,873,092.66	8.52

8.7 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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策
本基金投资范围未包含国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券中21进出22(证券代码: 210322)、20建设银行双创债(证券代码: 2028043)、20进出13(证券代码: 200313)、20华夏银行(证券代码: 2028054)、20北京银行小微债01(证券代码: 2020007)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一21进出22(证券代码: 210322)、20进出13(证券代码: 200313)的发行主体中国进出口银行于2021年7月13日收到处罚决定书(银保监罚决字(2021)31号),罚没人民币7345.6万元。

报告期内本基金投资的前十名证券之一20建设银行双创债(证券代码: 2028043)的发行主体中国建设银行股份有限公司于2021年8月13日收到处罚决定书(银罚字(2021)22号),并处人民币388万元的罚款。

报告期内本基金投资的前十名证券之一20华夏银行(证券代码: 2028054)的发行主体华夏银行股份有限公司于2021年8月13日收到处罚决定书(银罚字(2021)25号),并处人民币486万元罚款;于2021年5月17日收到处罚决定书(银保监罚决字(2021)19号),并处人民币9830万元罚款。

报告期内本基金投资的前十名证券之一20北京银行小微债01(证券代码: 2020007)的发行主体北京银行股份有限公司于2021年11月24日收到处罚决定书(京银保监罚决字(2021)30号),并处人民币40万元的罚款;于2021年9月26日收到处罚决定书(京银保监罚决字(2021)26号),责令改正,并处人民币820万元罚款;于2021年2月5日收到处罚决定书(银管罚(2021)4号),没收违法所得50.32万元,罚款人民币451万元,罚没合计人民币501.32万元。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	11,420.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	82,118,356.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	82,129,776.81

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
财通资管丰和两年定开债券A	154	51,733,499.43	7,966,952,399.61	100.00%	6,512.54	-
财通	91	569.05	-	-	51,783.58	100.0

资管 丰和 两年 定开 债券C						0%
合计	245	32,518,411.00	7,966,952,399.61	100.00%	58,296.12	-

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）。

9.2 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	财通资管丰和两年定开债券A	5,688.32	0.00%
	财通资管丰和两年定开债券C	1,411.25	2.73%
	合计	7,099.57	0.00%

9.3 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	财通资管丰和两年定开债券A	0~10
	财通资管丰和两年定开债券C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	财通资管丰和两年定开债券A	0~10
	财通资管丰和两年定开债券C	0~10
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管丰和两年定开 债券A	财通资管丰和两年定开 债券C
基金合同生效日(2019年12月04日)基金份额总额	3,340,012,301.71	172,142.00
本报告期期初基金份额总额	3,340,012,306.19	172,918.83
本报告期基金总申购份额	5,586,961,399.61	-
减：本报告期基金总赎回份额	960,014,793.65	121,135.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,966,958,912.15	51,783.58

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，2021年7月20日，基金管理人聘任易勇同志为公司副总经理。本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

11.3 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为108,000.00元人民币。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。

11.6 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，本基金管理人及其高级管理人员、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
财通证券	2	-	-	2,530.54	100.00%	-

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。

11.7.2 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
财通证券	281,171,167.12	100.00%	20,896,660.00	100.00%	-	-	-	-

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
- 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。

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，无新增交易单元。

11.8 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	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金风险揭示书	证券日报、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	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
3	财通资管丰和两年定期开放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
4	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-04-20
5	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金合同	同上	2021-04-20
6	财通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	同上	2021-07-21
7	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2021-09-28
8	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第2号	同上	2021-09-30

9	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-09-30
10	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金分红公告	同上	2021-11-30
11	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	同上	2021-12-02
12	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金2021年暂停向个人投资者开放申购、定期定额投资业务的公告	同上	2021-12-07
13	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金恢复个人投资者申购、定期定额投资业务公告	同上	2021-12-13
14	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2021-12-28
15	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-12-30
16	财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第3号	同上	2021-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

类别		20%的时间区间					
机构	1	20210101-20211216	1,499,999,000.00	-	-	1,499,999,000.00	18.83%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、财通资管丰和两年定期开放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、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管丰和两年定期开放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

13.2 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

13.3 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

二〇二二年三月三十一日