

国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:上海银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2022年8月19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2022年1月1日起至2022年6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 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 13 |
| 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 | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 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 | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计) | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 17 |
| 6.3 净资产(基金净值)变动表 | 19 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §7 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 45 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 46 |
| 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 | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 46 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 48 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 48 |
| §8 基金份额持有人信息 | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 49 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 49 |

| | |
|---|----|
| 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..... | 50 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 50 |
| §10 重大事件揭示..... | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 51 |
| 10.8 其他重大事件..... | 52 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 53 |
| §12 备查文件目录..... | 53 |
| 12.1 备查文件目录..... | 54 |
| 12.2 存放地点..... | 54 |
| 12.3 查阅方式..... | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------------|-------------------|
| 基金名称 | 国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 国泰君安30天滚动持有中短债 | |
| 基金主代码 | 013281 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021年09月01日 | |
| 基金管理人 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,349,116,132.39份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰君安30天滚动持有中短债A | 国泰君安30天滚动持有中短债C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013281 | 013282 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 137,280,291.66份 | 1,211,835,840.73份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（1-3年）指数收益率*80%+一年期定期存款基准利率（税后）*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

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 | | 上海国泰君安证券资产管理 有限公司 | 上海银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 吕巍 | 周直毅 |
| | 联系电话 | 021-38676022 | 021-68475608 |
| | 电子邮箱 | zgxxpl@gtjas.com | custody@bosscn.cn |
| 客户服务电话 | | 95521 | 95594 |
| 传真 | | 021-38871190 | 021-68476936 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区南苏州路381号 409A10室 | 中国（上海）自由贸易试验区 银城中路168号 |
| 办公地址 | | 上海市静安区新闻路669号博 华广场22-23层及25层 | 中国（上海）自由贸易试验区 银城中路168号27层 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200120 |
| 法定代表人 | | 谢乐斌 | 金煜 |

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 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.gtjazg.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------------|---------------------------------|
| 注册登记机构 | 上海国泰君安证券资产管理 有限公司 | 上海市静安区新闻路669号博华广场 22-23层及25层 |

§ 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 (2022年01月01日-2022年06月30日) | |
|---------------|----------------------------------|---------------------|
| | 国泰君安30天滚动 持有中短债A | 国泰君安30天滚动 持有中短债C |
| 本期已实现收益 | 2,529,630.77 | 7,427,315.38 |
| 本期利润 | 2,763,313.65 | 6,624,188.58 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0198 | 0.0148 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.94% | 1.44% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.99% | 1.88% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2022年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 4,096,871.68 | 34,165,482.98 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0298 | 0.0282 |
| 期末基金资产净值 | 141,630,764.93 | 1,248,236,028.21 |
| 期末基金份额净值 | 1.0317 | 1.0300 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2022年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 3.17% | 3.00% |

注：1、上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、期末可供分配利润，采用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。

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

国泰君安30天滚动持有中短债A

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

| | 增长率① | 增长率标准差② | 基准收益率③ | 基准收益率标准差④ | | |
|------------|-------|---------|--------|-----------|-------|-------|
| 过去一个月 | 0.16% | 0.01% | 0.09% | 0.01% | 0.07% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.06% | 0.02% | 0.86% | 0.02% | 0.20% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.99% | 0.02% | 1.55% | 0.02% | 0.44% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.17% | 0.02% | 2.49% | 0.02% | 0.68% | 0.00% |

国泰君安30天滚动持有中短债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 | 0.14% | 0.01% | 0.09% | 0.01% | 0.05% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.00% | 0.02% | 0.86% | 0.02% | 0.14% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.88% | 0.02% | 1.55% | 0.02% | 0.33% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.00% | 0.02% | 2.49% | 0.02% | 0.51% | 0.00% |

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

国泰君安30天滚动持有中短债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
(2021年09月01日-2022年06月30日)



国泰君安30天滚动持有中短债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
(2021年09月01日-2022年06月30日)



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 09 月 01 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

2、本基金建仓期自 2021 年 09 月 01 日至 2022 年 03 月 01 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 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

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于2010年10月18日，经中国证监会证监许可【2010】631号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金20亿元，注册地上海。

截至2022年6月30日，本基金管理人共管理了17只公开募集证券投资基金：国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安君得盛债券型证券投资基金、国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证500指数增强型证券投资基金、国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安创新医药混合型发起式证券投资基金、国泰君安信息行业混合型发起式证券投资基金、国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安君得盈债券型证券投资基金、国泰君安君得诚混合型证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君添利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 | | |
| 杜浩然 | 本基金基金经理，国泰君安现金管家货币市场基金基金经理，国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君得利短债债券型证券投资基金 | 2021-09-01 | - | 7年 | 杜浩然，复旦大学金融硕士，7年证券从业经历。现任本公司固定收益投资部基金经理，主要负责固定收益类产品的投资研究工作。自2017年9月5日至2022年3月2日担任“国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划”投资经理，自2 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | <p>基金经理，国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金基金经理</p> | | | <p>018年6月21日至2022年3月8日担任“国泰君安君得利一号货币增强集合资产管理计划”，自2018年6月21日起至2021年11月30日担任“国泰君安君得利二号货币增强集合资产管理计划”投资经理，自2018年11月6日起至2021年12月2日担任“国泰君安现金管家货币集合资产管理计划”投资经理，自2020年3月25日起至2021年8月17日担任“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”投资经理，自2020年9月28日起至2021年12月6日担任“国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划”投资经理，自2021年1月28日起至2022年1月16日担任“国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划”投资经理，自2021年5月25日至2021年12月6日担任“国泰君安君得惠中债1-3年政策性金融债指数集合资产管理计划”投资经理，自2021年9月1日起担任“国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金”基金经理，自2021年12月3日起担任“国泰君安现金管家货币市场基金”基金经理，自2021年</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>12月7日起至2022年3月9日担任“国泰君安君得盛债券型证券投资基金”基金经理，自2021年12月7日起担任“国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金”基金经理，自2022年1月17日起至2022年3月9日担任“国泰君安君得盈债券型证券投资基金”基金经理，自2022年3月3日起担任“国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金”基金经理，自2022年3月9日起担任“国泰君安君得利短债债券型证券投资基金”基金经理，自2022年6月17日起担任“国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金”基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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
无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵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

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

上半年，国内经济受到多地疫情短期扰动影响存在一定压力。货币政策持续维持宽松，财政发力靠前。债券在宽货币基调和宽信用担忧中呈现震荡走势，曲线陡峭化。信用债在低资金成本下呈现资产荒，表现好于利率债。上半年地产需求端政策显著放松、专项债提前集中发行，经济一季度呈现弱复苏，二季度受到疫情多地爆发影响，下行压力加大。PMI从2月份50.2下滑到4月份的低点47.4，6月份重回50.2。货币政策方面，4月降准25BP，1月和5月份分别降低LPR 10BP和15BP，资金价格相对稳定、显著低于OMO政策利率，R007、DR007的2季度中枢分别为1.8519%、1.7248%，机构杠杆套息力度较大，带动信用利差大幅压缩。上半年，同业存单利率震荡下行，1年期AAA级CD利率全年从2.60%下行到2.3%附近，3年期国债收益率下行0.9bp、10年国债上行4.5bp，3年AAA中短期票据收益率上行4BP、AA+、AA中短期票据收益率下行1bp、38bp，中低等级信用利差压缩。

操作方面，报告期内基金以剩余期限中短期限信用债为主要配置资产，保持适度久期和杠杆，适当参与利率债和存单的交易性机会，在关注收益的同时兼顾回撤控制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安30天滚动持有中短债A基金份额净值为1.0317元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.99%，同期业绩比较基准收益率为1.55%；截至报告期末国泰君安30天滚动持有中短债C基金份额净值为1.0300元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.88%，同期业绩比较基准收益率为1.55%。

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，稳增长政策持续发力下经济将缓步复苏，不过在疫情持续扰动、地产下行压力拖累下复苏斜率或较为平缓，货币政策仍将持续保驾护航，流动性保持合理充裕，资金中枢缓慢向政策利率回归。政治局会议强调“保持经济运行在合理区间，力争实现最好结果”、“财政货币政策要有效弥补社会需求不足。用好地方政府专项债券资金，支持地方政府用足用好专项债务限额”，在稳增长政策持续发力下，经济基本面将持续修复，但短期在疫情时有扰动、地产行业仍面临下行压力的拖累下，经济修复斜率或较为平缓，货币政策将维持流动性合理充裕，易松难紧，但也需提防随着经济增长逐渐回归潜在增速，资金中枢也将缓慢回归政策利率带来的调整风险。

基于上述判断，本基金将继续保持稳收益、控回撤的投资风格。根据账户流动性情况灵活调整仓位和杠杆水平，配置上在久期适度、灵活性高的品种间择优挑选，适当参与交易性机会增厚组合收益，发挥中短债基金久期中枢较短、调整灵活、攻守兼备的特点，兼顾收益与回撤。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。

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

本报告期内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。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 14,196,503.20 | 23,512,366.48 |
| 结算备付金 | | 1,994,810.18 | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,780,202,822.27 | 365,011,400.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,780,202,822.27 | 365,011,400.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.3 | 21,006,197.86 | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 44,964,781.14 | 231,774.42 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.4 | - | 8,560,143.98 |
| 资产总计 | | 1,862,365,114.65 | 397,315,684.88 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 370,176,701.67 | 78,849,440.57 |
| 应付清算款 | | 70,420,169.73 | - |
| 应付赎回款 | | 31,071,033.35 | 22,839,993.02 |
| 应付管理人报酬 | | 208,827.37 | 56,122.03 |
| 应付托管费 | | 52,206.85 | 14,030.49 |
| 应付销售服务费 | | 185,781.06 | 30,341.24 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 168,833.99 | 48,827.29 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.5 | 214,767.49 | 104,954.38 |

| | | | |
|-------------|---------|------------------|----------------|
| 负债合计 | | 472,498,321.51 | 101,943,709.02 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.6 | 1,349,116,132.39 | 292,067,525.06 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.7 | 40,750,660.75 | 3,304,450.80 |
| 净资产合计 | | 1,389,866,793.14 | 295,371,975.86 |
| 负债和净资产总计 | | 1,862,365,114.65 | 397,315,684.88 |

注：1、截止本报告期末，基金份额总额1,349,116,132.39份，其中国泰君安30天滚动持有中短债A类份额净值1.0317元，国泰君安30天滚动持有中短债A类份额137,280,291.66份；国泰君安30天滚动持有中短债C类份额净值1.0300元，国泰君安30天滚动持有中短债C类份额1,211,835,840.73份。

2、比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年01月01日至2022年0 6月30日 |
|----------------|---------|-----------------------------------|
| 一、营业总收入 | | 11,778,649.50 |
| 1. 利息收入 | | 90,358.73 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.8 | 31,338.42 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 59,020.31 |
| 其他利息收入 | | - |

| | | |
|----------------------------|------------|---------------------|
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 12,257,734.69 |
| 其中：股票投资收益 | | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.9 | 12,265,950.71 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.10 | -8,216.02 |
| 股利收益 | | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - |
| 其他投资收益 | | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.11 | -569,443.92 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | | - |
| 减：二、营业总支出 | | 2,391,147.27 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 581,131.07 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 145,282.71 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 439,929.52 |
| 4. 投资顾问费 | | - |
| 5. 利息支出 | | 1,063,000.68 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,063,000.68 |
| 6. 信用减值损失 | | - |
| 7. 税金及附加 | | 49,946.25 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.12 | 111,857.04 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 9,387,502.23 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 9,387,502.23 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 9,387,502.23 |

注：本基金合同生效日为2021年09月01日，无上年度可比期间。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | |
|---|-------------------------------|------------|--------------------|----------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收 益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 (基金净值) | 292,067,525. 06 | - | 3,304,450.80 | 295,371,975. 86 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 (基金净值) | 292,067,525. 06 | - | 3,304,450.80 | 295,371,975. 86 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列) | 1,057,048,60 7.33 | - | 37,446,209.9 5 | 1,094,494,81 7.28 |
| (一)、综合收益总 额 | - | - | 9,387,502.23 | 9,387,502.23 |
| (二)、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) | 1,057,048,60 7.33 | - | 28,058,707.7 2 | 1,085,107,31 5.05 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,816,641,15 4.82 | - | 48,195,123.2 2 | 1,864,836,27 8.04 |
| 2. 基金赎回 款 | -759,592,54 7.49 | - | -20,136,415. 50 | -779,728,96 2.99 |
| (三)、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） | | | | |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 1,349,116,132.39 | - | 40,750,660.75 | 1,389,866,793.14 |

注：本基金合同生效日为2021年09月01日，无上年度可比期间。

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：

谢乐斌

陶耿

茹建江

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

国泰君安30天滚动持有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[2021]2395号《关于准予国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金注册的批复》注册,由上海国泰君安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《国泰君安30天滚动持有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基金,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587,618,098.15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(2021)第0872号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》于2021年9月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为587,710,615.66份基金份额,其中认购资金利息折合92,517.51份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司,基金托管人为上海银行股份有限公司。本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费,将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费,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;投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于流动性良好的金融工具,包括债券(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期

融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不参与股票等资产的投资，不参与可转换债券（可分离交易可转债中的纯债部分除外）、可交换债券的投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短期债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，持有现金或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：中债综合财富（1-3年）指数收益率*80%+一年期定期存款基准利率（税后）*20%。

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》、《国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

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于2022年6月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的其他会计政策与最新一期年度报告不一致，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2022年1月1日至2022年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的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、其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收

入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、各类基金份额之间由于是否收取销售服务费的不同将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；通过红利再投资所得基金份额的持有期起始日与该份额持有期起始日相同；

4、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在不违反法律法规的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表,根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

于2022年1月1日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息和应收申购款,金额分别为23,512,366.48元、8,560,143.98元和231,774.42元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为23,514,305.45元、0.00元和231,774.42元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为365,011,400.00元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为373,569,605.01元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息,金额分别为78,849,440.57元、22,839,993.02元、56,122.03元、14,030.49元、30,341.24元、34,648.49元和5,305.89元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息,金额分别为78,854,746.46元、22,839,993.02元、56,122.03元、14,030.49元、30,341.24元、34,648.49元和0.00元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 基金运营过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人。基金管理人运营基金资产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股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 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 2022年06月30日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|

| | |
|--------------|---------------|
| 活期存款 | 14,182,773.44 |
| 等于：本金 | 14,179,664.47 |
| 加：应计利息 | 3,108.97 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | 13,729.76 |
| 等于：本金 | 13,728.46 |
| 加：应计利息 | 1.30 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 14,196,503.20 |

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | | | |
|---------------|--------------------|--------------|---------------|--------------|-------------|
| | 成本 | 应计利息 | 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 | 4,986,455.07 | 26,630.14 | 5,029,630.14 | 16,544.93 |
| | 银行间市场 | 1,754,078.58 | 21,841,542.13 | 1,775,173.19 | -746,930.85 |
| | 合计 | 1,759,065.03 | 21,868,172.27 | 1,780,202.82 | -730,385.92 |

| | | | | | |
|--------|--|----------------------|---------------|----------------------|-------------|
| | | 5.92 | | 2.27 | |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 1,759,065.03 5.92 | 21,868,172.27 | 1,780,202.82 2.27 | -730,385.92 |

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 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 2022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 | 21,006,197.86 | - |
| 合计 | 21,006,197.86 | - |

6.4.7.4 其他资产

无

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付交易费用 | 63,604.03 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 63,604.03 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 151,163.46 |
| 合计 | 214,767.49 |

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 国泰君安30天滚动持有中短债A

金额单位：人民币元

| 项目 (国泰君安30天滚动持有中短 债A) | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|-----------------------------|-------------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 137,696,848.88 | 137,696,848.88 |
| 本期申购 | 39,065,880.86 | 39,065,880.86 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -39,482,438.08 | -39,482,438.08 |
| 本期末 | 137,280,291.66 | 137,280,291.66 |

6.4.7.6.2 国泰君安30天滚动持有中短债C

金额单位：人民币元

| 项目 (国泰君安30天滚动持有中短 债C) | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|-----------------------------|-------------------------------|------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 154,370,676.18 | 154,370,676.18 |
| 本期申购 | 1,777,575,273.96 | 1,777,575,273.96 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -720,110,109.41 | -720,110,109.41 |
| 本期末 | 1,211,835,840.73 | 1,211,835,840.73 |

注：申购含红利再投(如有)、转换入份额(如有)，赎回含转换出份额(如有)。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 国泰君安30天滚动持有中短债A

单位：人民币元

| 项目 (国泰君安30天滚动持 有中短债A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------------------|--------------|------------|--------------|
| 本期期初 | 1,600,042.88 | 133.89 | 1,600,176.77 |
| 本期利润 | 2,529,630.77 | 233,682.88 | 2,763,313.65 |
| 本期基金份额交易产 | -32,801.97 | 19,784.82 | -13,017.15 |

| | | | |
|----------|--------------|------------|--------------|
| 生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 745,222.25 | 67,206.81 | 812,429.06 |
| 基金赎回款 | -778,024.22 | -47,421.99 | -825,446.21 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 4,096,871.68 | 253,601.59 | 4,350,473.27 |

6.4.7.7.2 国泰君安30天滚动持有中短债C

单位：人民币元

| 项目 (国泰君安30天滚动持有中短债C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期期初 | 1,703,564.56 | 709.47 | 1,704,274.03 |
| 本期利润 | 7,427,315.38 | -803,126.80 | 6,624,188.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 25,034,603.04 | 3,037,121.83 | 28,071,724.87 |
| 其中：基金申购款 | 43,021,085.77 | 4,361,608.39 | 47,382,694.16 |
| 基金赎回款 | -17,986,482.73 | -1,324,486.56 | -19,310,969.29 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 34,165,482.98 | 2,234,704.50 | 36,400,187.48 |

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 活期存款利息收入 | 28,251.07 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 61.15 |
| 结算备付金利息收入 | 3,026.20 |
| 其他 | - |
| 合计 | 31,338.42 |

6.4.7.9 债券投资收益

6.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 15,582,732.69 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -3,316,781.98 |
| 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 | 12,265,950.71 |

6.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 2,191,950,280.79 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,173,713,139.82 |
| 减：应计利息总额 | 21,508,486.15 |
| 减：交易费用 | 45,436.80 |
| 买卖债券差价收入 | -3,316,781.98 |

6.4.7.10 衍生工具收益

6.4.7.10.1 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 |
|------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 期货投资 | -8,216.02 |

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -569,443.92 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -569,443.92 |
| ——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 | -569,443.92 |

6.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 审计费用 | - |
| 信息披露费 | - |
| 汇划手续费 | 7,093.58 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 审计费用 | 17,356.09 |
| 帐户维护费 | 27,900.00 |
| 合计 | 111,857.04 |

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明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

本报告期内与本基金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 |
|----------------------------|---------------|
| 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | 基金管理人 |
| 国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”） | 基金管理人的股东、代销机构 |
| 上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”） | 基金托管人 |

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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 581,131.07 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 264,959.57 |

注：支付基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 145,282.71 |

注：支付基金托管人上海银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

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 | | |
|------------------|-------------------------|-----------------|------------|
| | 2022年01月01日至2022年06月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国泰君安30天滚动持有中短债A | 国泰君安30天滚动持有中短债C | 合计 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 0.00 | 146,238.68 | 146,238.68 |
| 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | 0.00 | 1,275.06 | 1,275.06 |
| 合计 | - | 147,513.74 | 147,513.74 |

注：本基金国泰君安30天滚动持有中短债A基金份额不收取销售服务费，国泰君安30天滚动持有中短债C基金份额的销售服务费年费率为0.20%。

国泰君安30天滚动持有中短债C的销售服务费按前一日国泰君安30天滚动持有中短债C资产净值的0.20%年费率计提。

计算公式为：国泰君安30天滚动持有中短债C基金日销售服务费=国泰君安30天滚动持有中短债C基金份额前一日资产净值×0.20%/当年天数。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况，本基金合同生效日为2021年9月1日，无上年度同期对比数据。。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|------------|-------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海银行股份有限公司 | 14,182,773.44 | 28,251.07 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2022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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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2022年6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370,176,701.67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 |
|-----------|--------------|------------|--------|---------|---------------|
| 012180021 | 21涪陵新城SCP005 | 2022-07-01 | 102.59 | 350,000 | 35,907,410.96 |
| 012280605 | 22苏交通SCP002 | 2022-07-01 | 100.80 | 300,000 | 30,239,021.92 |
| 012281577 | 22厦路桥SCP005 | 2022-07-01 | 100.52 | 200,000 | 20,104,109.59 |
| 042280197 | 22黄石众邦CP001 | 2022-07-01 | 100.92 | 63,000 | 6,357,960.00 |
| 042280287 | 22港兴港投CP001 | 2022-07-01 | 100.03 | 150,000 | 15,003,961.64 |
| 101800408 | 18成都开投MTN002 | 2022-07-01 | 104.03 | 450,000 | 46,813,233.70 |
| 101900920 | 19沪杭甬MTN002 | 2022-07-01 | 103.56 | 200,000 | 20,712,061.37 |
| 101901200 | 19咸宁高新MTN001 | 2022-07-01 | 105.15 | 400,000 | 42,061,150.68 |
| 101901393 | 19未来科技MTN002 | 2022-07-01 | 103.33 | 300,000 | 30,998,069.59 |
| 102000525 | 20随州城建MTN001 | 2022-07-01 | 102.26 | 300,000 | 30,676,911.78 |
| 102200152 | 22港兴港投MTN | 2022-07-01 | 100.45 | 300,000 | 30,134,465.75 |

| | | | | | |
|-----------|-------------------|------------|--------|-----------|----------------|
| | 006 | | | | |
| 112203043 | 22农业银行CDO 43 | 2022-07-01 | 98.07 | 330,000 | 32,361,725.75 |
| 112299016 | 22厦门国际银 行CD082 | 2022-07-01 | 97.99 | 300,000 | 29,398,491.78 |
| 200303 | 20进出03 | 2022-07-01 | 100.62 | 100,000 | 10,061,534.25 |
| 210211 | 21国开11 | 2022-07-01 | 101.96 | 200,000 | 20,392,087.67 |
| 210302 | 21进出02 | 2022-07-01 | 101.69 | 138,000 | 14,032,993.15 |
| 220201 | 22国开01 | 2022-07-01 | 101.06 | 78,000 | 7,882,500.49 |
| 合计 | | | | 4,159,000 | 423,137,690.07 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

| | 2022年06月30日 | 2021年12月31日 |
|-------|----------------|----------------|
| A-1 | 30,878,672.88 | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 479,838,767.12 | 120,264,000.00 |
| 合计 | 510,717,440.00 | 120,264,000.00 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.2 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 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 205,704,143.51 | - |
| 合计 | 205,704,143.51 | - |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.3 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 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 403,793,864.38 | 64,695,000.00 |
| AAA以下 | 548,250,145.62 | 180,052,400.00 |
| 未评级 | 111,737,228.76 | - |
| 合计 | 1,063,781,238.76 | 244,747,400.00 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022 年 06 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------------|----------------|----------------|------------------|----------------|-------|--------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 14,196,503.20 | - | - | - | - | - | 14,196,503.20 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | 1,994,810.18 | 1,994,810.18 |
| 交易性金融资产 | 189,890,995.89 | 181,852,582.69 | 1,109,360,405.47 | 299,098,838.22 | - | - | 1,780,202,822.27 |
| 买入返售金融资产 | 21,006,197.86 | - | - | - | - | - | 21,006,197.86 |

国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金 2022 年中期报告

| | | | | | | | |
|--------------------------------|-----------------|----------------|------------------|----------------|-------|----------------|------------------|
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 44,964,781.14 | 44,964,781.14 |
| 资产总计 | 225,093,696.95 | 181,852,582.69 | 1,109,360,405.47 | 299,098,838.22 | - | 46,959,591.32 | 1,862,365,114.65 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 370,176,701.67 | - | - | - | - | - | 370,176,701.67 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 70,420,169.73 | 70,420,169.73 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 31,071,033.35 | 31,071,033.35 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 208,827.37 | 208,827.37 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 52,206.85 | 52,206.85 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 185,781.06 | 185,781.06 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 168,833.99 | 168,833.99 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 214,767.49 | 214,767.49 |
| 负债总计 | 370,176,701.67 | - | - | - | - | 102,321,619.84 | 472,498,321.51 |
| 利率敏感度缺口 | -145,083,004.72 | 181,852,582.69 | 1,109,360,405.47 | 299,098,838.22 | - | -55,362,028.52 | 1,389,866,793.14 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 23,512,366.48 | - | - | - | - | - | 23,512,366.48 |
| 交易性金融资产 | 25,825,400.00 | 104,932,000.00 | 181,760,000.00 | 52,494,000.00 | - | - | 365,011,400.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 8,560,143.98 | 8,560,143.98 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 231,774.42 | 231,774.42 |
| 资产总计 | 49,337,766.48 | 104,932,000.00 | 181,760,000.00 | 52,494,000.00 | - | 8,791,918.40 | 397,315,684.88 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 78,849,440.57 | - | - | - | - | - | 78,849,440.57 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 22,839,993.02 | 22,839,993.02 |
| 应付管 | - | - | - | - | - | 56,122.03 | 56,122.03 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|----------------|----------------|---------------|---|----------------|----------------|
| 理人报酬 | | | | | | | |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 14,030.49 | 14,030.49 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 30,341.24 | 30,341.24 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 34,648.49 | 34,648.49 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 48,827.29 | 48,827.29 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 5,305.89 | 5,305.89 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 65,000.00 | 65,000.00 |
| 负债总计 | 78,849,440.57 | - | - | - | - | 23,094,268.45 | 101,943,709.02 |
| 利率敏感度缺口 | -29,511,674.09 | 104,932,000.00 | 181,760,000.00 | 52,494,000.00 | - | -14,302,350.05 | 295,371,975.86 |

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 | 影响生息资产公允价值其他变量不变，仅利率发生变动；利率变动范围合理。 | | |
| 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 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| | 基准利率点利率增加0.1% | -1,161,196.23 | -155,582.93 |
| | 基准利率点利率减少0.1% | 1,162,954.57 | 155,947.94 |

上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年06月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 1,780,202,822.27 | 128.08 | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,780,202,822.27 | 128.08 | - | - |

无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022年06月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 1,780,202,822.27 | 365,011,400.00 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 1,780,202,822.27 | 365,011,400.00 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期未发生公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金本报告期内无不以公允价值计量的金融工具。

6.4.15 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 | 1,780,202,822.27 | 95.59 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：债券 | 1,780,202,822.27 | 95.59 |
| | 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 | 21,006,197.86 | 1.13 |
| | 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 | 16,191,313.38 | 0.87 |
| 8 | 其他各项资产 | 44,964,781.14 | 2.41 |
| 9 | 合计 | 1,862,365,114.65 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末进行股票买入交易。

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

本基金本报告期末进行股票卖出交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末进行股票买卖交易。

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 | 117,011,582.19 | 8.42 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| | 其中：政策性金融债 | 76,024,184.93 | 5.47 |
| 4 | 企业债券 | 333,432,195.75 | 23.99 |
| 5 | 企业短期融资券 | 460,008,042.74 | 33.10 |
| 6 | 中期票据 | 664,046,858.08 | 47.78 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | 205,704,143.51 | 14.80 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,780,202,822.27 | 128.08 |

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 | 112203043 | 22农业银行CD 043 | 1,000,000 | 98,065,835.6 2 | 7.06 |
| 2 | 112211073 | 22平安银行CD 073 | 800,000 | 78,239,816.1 1 | 5.63 |
| 3 | 102001106 | 20泰州滨江MT N001 | 700,000 | 70,812,863.0 1 | 5.09 |
| 4 | 012281056 | 22苏交通SCP0 05 | 700,000 | 70,417,391.7 8 | 5.07 |
| 5 | 012281486 | 22厦国贸控SC P005 | 500,000 | 50,328,013.7 0 | 3.62 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金持有的前十名证券发行主体中国农业银行、平安银行、交通银行，在报告编制日前一年曾被央行及中国银保监会处以罚款的行政处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 本基金本报告期末未持有股票投资，没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

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 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 44,964,781.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 44,964,781.14 |

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投资，不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-----------------|-----------|------------|---------------|--------|------------------|---------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 国泰君安30天滚动持有中短债A | 664 | 206,747.43 | 50,010,250.00 | 36.43% | 87,270,041.66 | 63.57% |
| 国泰君安30天滚动持有中短债C | 64,467 | 18,797.77 | 0.00 | 0.00% | 1,211,835,840.73 | 100.00% |
| 合计 | 65,131 | 20,713.89 | 50,010,250.00 | 3.71% | 1,299,105,882.39 | 96.29% |

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（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 | 国泰君安30天滚动持有中短债A | 396,650.57 | 0.29% |
| | 国泰君安30天滚动持 | 234,904.54 | 0.02% |

| | | | |
|--|-------|------------|-------|
| | 有中短债C | | |
| | 合计 | 631,555.11 | 0.05% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 国泰君安30天滚动持有中短债A | 0 |
| | 国泰君安30天滚动持有中短债C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 国泰君安30天滚动持有中短债A | 0 |
| | 国泰君安30天滚动持有中短债C | 0 |
| | 合计 | 0 |

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 国泰君安30天滚动持有中短债A | 国泰君安30天滚动持有中短债C |
|----------------------------|-----------------|------------------|
| 基金合同生效日(2021年09月01日)基金份额总额 | 245,238,129.37 | 342,472,486.29 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 137,696,848.88 | 154,370,676.18 |
| 本报告期基金总申购份额 | 39,065,880.86 | 1,777,575,273.96 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 39,482,438.08 | 720,110,109.41 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 137,280,291.66 | 1,211,835,840.73 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2022年1月17日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，谢乐斌同志担任公司董事长，江伟同志不再担任公司董事长。

2022年3月12日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告》，谢乐斌同志担任公司董事和董事长，江伟同志不再担任公司董事和董事长职务。陶耿同志担任公司董事和副董事长；王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇同志担任公司董事，蒋忆明、喻健同志不再兼任公司董事职务。经过上述变更，公司现任董事会成员为谢乐斌、陶耿、王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇。

2022年3月30日，本基金管理人发布了《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告》，董博阳同志担任公司监事，傅南平同志不再担任公司监事职务；王红莲同志担任公司职工监事。

2022年4月8日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，吕巍同志担任公司合规总监、督察长，叶明同志不再担任公司合规总监。

2、本报告期内，本基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

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

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

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 | |
| 国泰君安 | 2 | - | - | 30.55 | 100.00% | - |

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|------|---------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国泰君安 | 15,275,058.90 | 100.00% | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|------------------------------------|------------|
| 1 | 关于调整旗下基金对账单服务规则的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-01-19 |
| 2 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-01-19 |
| 3 | 国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金2021年第四季度报告 | 证监会指定网站、公司官网 | 2022-01-24 |
| 4 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金和集合计划季度报告提示性公告 | 证券日报 | 2022-01-24 |
| 5 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监 | 2022-03-12 |

| | | | |
|----|--|------------------------------------|------------|
| | 更事宜的公告 | 会指定网站、公司官网 | |
| 6 | 关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-03-30 |
| 7 | 国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金2021年年度报告 | 证监会指定网站、公司官网 | 2022-03-31 |
| 8 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金和集合计划年度报告提示性公告 | 证券日报 | 2022-03-31 |
| 9 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-04-08 |
| 10 | 国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金2022年第一季度报告 | 证监会指定网站、公司官网 | 2022-04-22 |
| 11 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金季度报告提示性公告 | 证券日报 | 2022-04-22 |
| 12 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在深圳新华信通开展费率优惠活动的公告 | 证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-05-20 |

§ 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、中国证监会准予国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金募集注册的文件；

- 2、《国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站<http://www.gtjazg.com>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰君安证券资产管理有限公司
二〇二二年八月三十一日