

国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	16
6.3 净资产(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	63

§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	国泰君安君得鑫2年期混合	
基金主代码	952009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年01月06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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,901,951,257.88份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安君得鑫2年持有混合A	国泰君安君得鑫2年持有混合C
下属分级基金的交易代码	952009	952099
报告期末下属分级基金的份额总额	439,440,004.62份	1,462,511,253.26份

注：国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划于2022年3月21日起正式变更为国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金。

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金利用管理人的研究优势，主要投资于具备持续增长能力的优秀企业，并通过严谨的行业需求和公司前景分析，寻找价格相对于价值有所低估的上市公司，力争实现基金资产的长期稳定增值。</p>
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，辅之以基金管理人自行开发的数量化辅助模型，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。</p> <p>本基金将从分析基金投资者行为特点和需求入手，确定流动性需求，并将其作为资产配置和构建投资组合的一个约束条件，同时配合大额退出的制度安</p>

	排，使投资组合能够满足流动性需要。 2、股票投资策略 3、组合调整策略 4、股指期货、国债期货交易策略 5、债券的投资策略 6、资产支持证券等品种投资策略 7、股票期权的投资策略 8、港股投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中风险/收益的产品。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	021-60637111
传真	021-38871190	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市静安区新闸路669号博华广场22-23层及25层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	谢乐斌	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
----------------	-------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金中期报告备置地点	上海市静安区新闸路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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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)	
	国泰君安君得鑫2 年持有混合A	国泰君安君得鑫2 年持有混合C
本期已实现收益	-224,449,728.00	-1,056,968,943.97
本期利润	-164,527,699.63	-952,554,109.38
加权平均基金份额本期利润	-0.3460	-0.4673
本期加权平均净值利润率	-19.21%	-25.16%
本期基金份额净值增长率	-13.61%	-13.33%
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	389,708,113.70	1,340,340,728.20
期末可供分配基金份额利润	0.8868	0.9165
期末基金资产净值	829,148,118.32	2,802,851,981.46
期末基金份额净值	1.8868	1.9165
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	10.27%	10.79%

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

国泰君安君得鑫2年持有混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.21%	1.24%	5.18%	0.83%	5.03%	0.41%
过去三个月	12.68%	1.63%	3.46%	1.00%	9.22%	0.63%
过去六个月	-13.61%	1.56%	-5.74%	1.04%	-7.87%	0.52%
过去一年	-25.75%	1.31%	-10.36%	0.88%	-15.39%	0.43%
自基金合同生效起至今	10.27%	1.31%	4.74%	0.92%	5.53%	0.39%

国泰君安君得鑫2年持有混合C

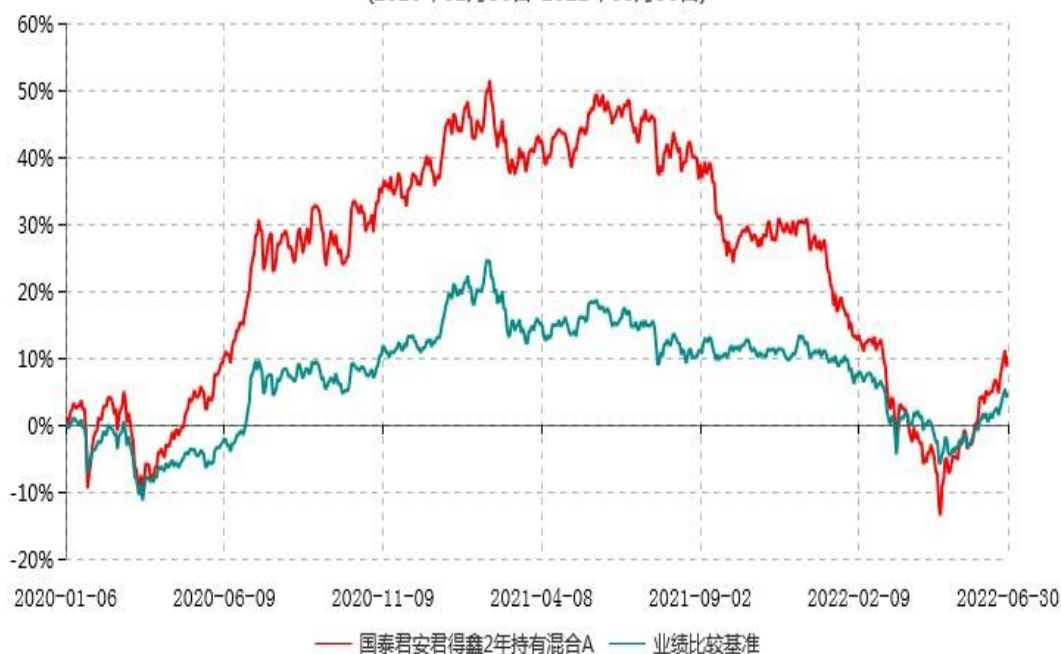
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.27%	1.24%	5.18%	0.83%	5.09%	0.41%
过去三个月	12.86%	1.63%	3.46%	1.00%	9.40%	0.63%
过去六个月	-13.33%	1.56%	-5.74%	1.04%	-7.59%	0.52%
过去一年	-25.26%	1.31%	-10.36%	0.88%	-14.90%	0.43%
自基金合同	10.79%	1.26%	7.32%	0.89%	3.47%	0.37%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

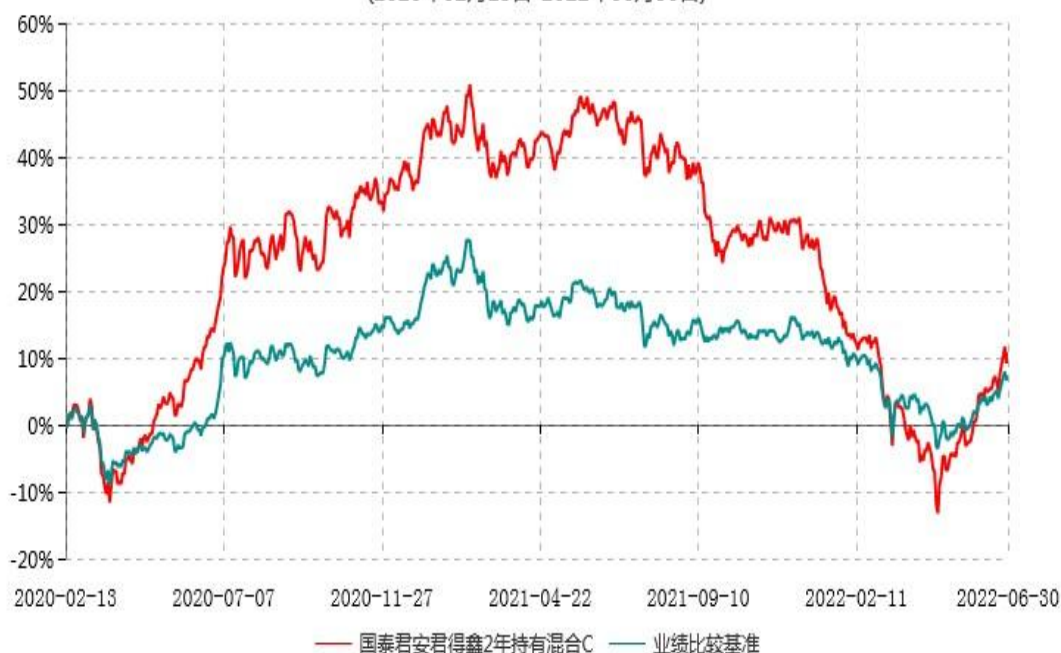
国泰君安君得鑫2年持有混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年01月06日-2022年06月30日)



国泰君安君得鑫2年持有混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年02月13日-2022年06月30日)



注：国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划于 2022 年 3 月 21 日起正式变更为国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金，其业绩比较基准由原来的“60%×沪深 300 指数收益率+30%×一年期银行定期存款利率+10%×恒生指数收益率”变更为“沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×20%”

§ 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		
刘强	本基金基金经理，公募权益投资部基金经理。	2021-08-17	-	10年	刘强，清华大学应用经济学硕士研究生。拥有10年证券从业经验。曾在瑞银证券、汇丰银行、海富通

					基金公司、平安养老保险公司担任股票分析师、研究总监、投资经理职务。2021年8月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司权益投资部。自2021年8月17日至2022年3月20日担任“国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划”投资经理，自2022年3月21日起担任“国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金”基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

4.2 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

上半年市场波动剧烈。A股出现了深V的走势。1季度的下跌延续到4月底，背后主要担忧还是国内疫情、海外通胀、以及中美关系，叠加绝对收益止损盘的止损。5、6月市场出现了强劲的V型反弹，上证指数、沪深300指数底部反弹了18%左右，成长板块领涨，消费医药接力，几乎所有板块都有所反弹。

一季度由于低估值等防御类板块配置比例偏低，因此回撤较大。4月底市场跌至最恐慌时，基于6-12个月维度进行测算、发现很多股票具备较高的吸引力，因此进行了加仓、仓位提高到了接近上限；同时，基于行业比较发现，以新能源、电动车、军工为代表的成长板块景气度依然良好、甚至超预期，但股价已经回调很深、估值处于历史底部区域，因此在行业配置结构上也往成长板块进行了倾斜。考虑到流动性相对宽裕、风险偏好相对较高，因此也在个股层面进行了适度下沉、挖掘二三线的中小市值品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安君得鑫2年持有混合A基金份额净值为1.8868元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.61%，同期业绩比较基准收益率为-5.74%；截至报告期末国泰君安君得鑫2年持有混合C基金份额净值为1.9165元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.33%，同期业绩比较基准收益率为-5.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

5月份以来成长板块率先进行估值修复，但部分消费医药、地产链的股票估值依然处于低位，可以关注后续补涨的机会，但纯粹的估值修复、行业轮动比较难把握。后续我们更多会基于企业的成长性、估值寻找机会，进行更加均衡的配置。

1) 景气度趋势、公司成长性，是未来的核心：投资的核心还是要基于对公司成长性的研究判断、赚取业绩成长的钱。对于景气度依然良好、价值仍被低估的新能源、军工等板块，依然值得继续参与。同时，需要加大对当下基本面较差、但股价反应比较充分的板块研究，比如“后疫情”相关的行业，包括大消费、医药、交运等，对于疫情正常化后的业绩预期、企业价值进行重点研究。

2) 近期宏观的弱复苏预期叠加相对宽裕的流动性，景气度趋势投资演绎到了极致，中小市值占据绝对优势，市场变成了少数人的表演舞台。然而我们还是希望在企业的盈利预期与估值之间寻找平衡，而不是盲目地讲故事、追趋势，现在或许是布局最近“被抛弃资产”的机会。后续会适度进行更加均衡的配置。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金

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	683,169,930.35	578,315,389.11
结算备付金		35,693,281.06	63,954,629.73
存出保证金		4,661,876.87	3,962,438.10
交易性金融资产	6.4.7.2	3,047,633,454.42	7,403,226,901.99
其中：股票投资		3,047,633,454.42	7,403,226,901.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
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		8,693,875.71	53,866,990.44
应收股利		824,044.32	-
应收申购款		36,750.58	10,733.93
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	220,698.38

资产总计		3,780,713,213.31	8,103,557,781.68
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		-	-
应付清算款		89,319,648.91	65.81
应付赎回款		43,146,615.61	925,022.82
应付管理人报酬		2,296,138.11	4,814,557.16
应付托管费		631,637.24	1,437,836.10
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.3	13,319,073.66	29,814,254.98
负债合计		148,713,113.53	36,991,736.87
净资产:			
实收基金	6.4.7.4	1,901,951,257.88	3,654,440,226.73
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.5	1,730,048,841.90	4,412,125,818.08
净资产合计		3,632,000,099.78	8,066,566,044.81
负债和净资产总计		3,780,713,213.31	8,103,557,781.68

注：1、截止本报告期末，本基金份额净值(暂估业绩报酬前)1.9096元，基金份额总额1,901,951,257.88份，其中A类份额净值1.8868元、份额总额439,440,004.62份；C类份额净值1.9165元、份额总额1,462,511,253.26份。

2、本基金资产净值(暂估业绩报酬前)3,632,000,099.78元，暂估业绩报酬16,090,027.28元，基金资产净值(暂估业绩报酬后)3,615,910,072.5元，其中A类份额资产净值(暂估业绩报酬前)829,148,118.32元，暂估业绩报酬15,450,710.56元，A类份额资产净值(暂估业绩报酬后)813,697,407.76元，C类份额资产净值(暂估业绩报酬

前)2,802,851,981.46元,暂估业绩报酬639,316.72元,C类份额资产净值(暂估业绩报酬后)2,802,212,664.74元;暂估业绩报酬为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提业绩报酬前)清算,根据基金委托人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是各基金委托人的暂估业绩报酬的合计,各基金委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

3、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: 国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金

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06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-1,091,419,090.4 5	638,042,353.99
1. 利息收入		4,350,106.40	4,666,489.80
其中: 存款利息收入	6.4.7.6	4,350,106.40	4,666,489.80
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-” 填列)		-1,260,106,059.8 1	1,546,186,965.77
其中: 股票投资收益	6.4.7.7	-1,272,107,313.8	1,482,299,771.46

		3	
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.8	12,001,254.02	63,887,194.31
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）	6.4.7.9	164,336,862.96	-912,811,792.04
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）		-	690.46
减：二、营业总支出		25,662,718.56	66,926,825.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	20,644,067.36	35,935,295.36
2. 托管费	6.4.10.2. 2	4,908,716.94	10,348,275.89
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	5,335,048.25
8. 其他费用	6.4.7.10	109,934.26	15,308,205.99
三、利润总额（亏损总额		-1,117,081,809.0	571,115,528.50

以“-”号填列)		1	
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-1,117,081,809.0 1	571,115,528.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,117,081,809.0 1	571,115,528.50

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金

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)	3,654,440,22 6.73	-	4,412,125,81 8.08	8,066,566,04 4.81
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)	3,654,440,22 6.73	-	4,412,125,81 8.08	8,066,566,04 4.81
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-1,752,488,9 68.85	-	-2,682,076,9 76.18	-4,434,565,9 45.03
(一)、综合收益总 额	-	-	-1,117,081,8 09.01	-1,117,081,8 09.01
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减	-1,752,488,9 68.85	-	-1,564,995,1 67.17	-3,317,484,1 36.02

少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	3,299,293.27	-	2,727,228.92	6,026,522.19
2. 基金赎回款	-1,755,788,262.12	-	-1,567,722,396.09	-3,323,510,658.21
(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)	1,901,951,257.88	-	1,730,048,841.90	3,632,000,099.78
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021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)	4,129,919,247.22	-	5,851,256,017.45	9,981,175,264.67
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)	4,129,919,247.22	-	5,851,256,017.45	9,981,175,264.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-213,443,638.15	-	256,717,491.95	43,273,853.80
(一)、综合收益总额	-	-	571,115,528.50	571,115,528.50
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减	-213,443,638.15	-	-314,398,036.55	-527,841,674.70

少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	26,479,122.2 2	-	39,541,619.8 5	66,020,742.0 7
2. 基金赎回款	-239,922,76 0.37	-	-353,939,65 6.40	-593,862,41 6.77
(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)	3,916,475,60 9.07	-	6,107,973,50 9.40	10,024,449,1 18.47

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

国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)(原名为国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划),由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》(证监会令第17号)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(证监会公告[2008]26号)、《国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划管理合同》及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准于2010年12月28日设立。

根据中国证监会于2018年11月30日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(证监会公告[2018]39号)的规定,并经中国证监会机构部函[2019]2905号文准予合同变更,自2020年1月6日起,国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划正式更名为国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划。《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》自2020年1月6日起生效,原《国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

本集合计划的管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。根据《关于准予国泰君安君得鑫两年持有混合型集合资产管理计划变更注册的批复》(证监许可[2021]3518号)，国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划于2022年3月21日起正式变更为国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金。

根据《国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据投资者参与/申购基金时间分为不同的类别，持有原国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划份额至本集合计划合同生效日、不设置锁定期的分类称为A类份额，A类份额只接受赎回，不接受申购；在本基金合同生效后接受申购/赎回申请、锁定期起始日为该基金份额申购确认日的份额，称为C类份额。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票、股指期货、国债期货、股票期权、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的业绩比较基准为“沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×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》、《国泰君安君得鑫两年持有期混合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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为578,315,389.11元、63,954,629.73元、3,962,438.10元、220,698.38元、53,866,990.44元和10,733.93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、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为578,501,489.41元、63,989,227.81元、3,962,438.10元、0.00元、53,866,990.44元和10,733.93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7,403,226,901.99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7,403,226,901.99元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为65.81元、925,022.82元、4,814,557.16元、1,437,836.10元、26,646,191.13元和3,008,063.85元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管

理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 65.81元、925,022.82元、4,814,557.16元、1,437,836.10元、26,646,191.13元和 3,008,063.85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	683,169,930.35
等于：本金	683,048,711.76
加：应计利息	121,218.59
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	683,169,930.35

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	2,861,100,47 5.55	-	3,047,633,45 4.42	186,532,978.8 7
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,861,100,47 5.55	-	3,047,633,45 4.42	186,532,978.8 7

6.4.7.3 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	10,041,913.87
其中：交易所市场	10,041,913.87
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	269,095.94
其他应付	3,008,063.85
合计	13,319,073.66

6.4.7.4 实收基金

6.4.7.4.1 国泰君安君得鑫2年持有混合A

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安君得鑫2年持有混 合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	532,576,107.72	532,576,107.72
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-93,136,103.10	-93,136,103.10
本期末	439,440,004.62	439,440,004.62

6.4.7.4.2 国泰君安君得鑫2年持有混合C

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安君得鑫2年持有混 合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	3,121,864,119.01	3,121,864,119.01
本期申购	3,299,293.27	3,299,293.27
本期赎回(以“-”号填列)	-1,662,652,159.02	-1,662,652,159.02
本期末	1,462,511,253.26	1,462,511,253.26

6.4.7.5 未分配利润

6.4.7.5.1 国泰君安君得鑫2年持有混合A

单位：人民币元

项目 (国泰君安君得鑫2年 持有混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	786,795,984.99	-156,165,028.65	630,630,956.34
本期利润	-224,449,728.00	59,922,028.37	-164,527,699.63
本期基金份额交易产 生的变动数	-109,478,188.10	33,083,045.09	-76,395,143.01
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-109,478,188.10	33,083,045.09	-76,395,143.01
本期已分配利润	-	-	-

本期末	452,868,068.89	-63,159,955.19	389,708,113.70
-----	----------------	----------------	----------------

6.4.7.5.2 国泰君安君得鑫2年持有混合C

单位：人民币元

项目 (国泰君安君得鑫2年 持有混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,706,659,245.86	-925,164,384.12	3,781,494,861.74
本期利润	-1,056,968,943.97	104,414,834.59	-952,554,109.38
本期基金份额交易产生的变动数	-2,098,146,311.35	609,546,287.19	-1,488,600,024.16
其中：基金申购款	3,865,564.81	-1,138,335.89	2,727,228.92
基金赎回款	-2,102,011,876.16	610,684,623.08	-1,491,327,253.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,551,543,990.54	-211,203,262.34	1,340,340,728.20

6.4.7.6 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	4,008,494.06
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	341,612.34
其他	-
合计	4,350,106.40

6.4.7.7 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	18,289,672,434.57
减：卖出股票成本总额	19,515,216,902.88
减：交易费用	46,562,845.52
买卖股票差价收入	-1,272,107,313.83

6.4.7.8 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	12,001,254.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,001,254.02

6.4.7.9 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	164,336,862.96
——股票投资	164,336,862.96
——债券投资	-
——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	164,336,862.96

6.4.7.10 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
银行费用	838.32
合计	109,934.26

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
中国建设银行股份有限公司	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

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2022年01月01日至2022年06月30日		2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	33,271,942,312.00	100.00%	10,765,231,696.45	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	24,320,753.48	100.00%	10,041,913.87	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

		例		
国泰君安 证券股份 有限公司	7,849,897.24	100.00%	3,165,466.83	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

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202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,644,067.36	35,935,295.36
其中：支付销售机构的客户维护费	8,934,531.46	11,685,048.25

注：1. 本基金本期共发生应支付的固定管理费16,648,779.69元，本基金A类份额的管理费按前一日该类份额对应的基金资产净值的1.2%年费率计提。本基金C类份额的管理费按前一日该类份额对应的基金资产净值的0.6%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值*年费率/当年天数。

2. 本基金本期共发生应支付的业绩报酬3,995,287.67元，其中A类份额已实现的业绩报酬2,928,805.94元、C类份额已实现的业绩报酬1,066,481.73元，不包括暂估业绩报酬。上述金额于业绩报酬计提日提取，按投资者退出申请日或分红日的本基金际收益情况计算确认，从投资人退出基金资金清算款或分红款中以现金支付。业绩报酬计提日为基金份额持有人赎回日、本基金最后运作日或分红日提取。

业绩报酬/附加管理费的计算公式为：

a、退出提取当投资人申请赎回或本基金最后运作日时，管理人根据年化收益率（R）提取业绩报酬。

1) A类份额的业绩报酬计算：E为业绩报酬；当 $R \leq 0\%$ 时， $E=0$ 当 $R > 0\%$ 时，对超过0%的收益部分提取20%的业绩报酬，即 $E=K \times I' \times (R-0\%) \times 20\% \times (D \div 365)$

$R = (H-I) / I' \times 365 / D \times 100\%$

H为业绩报酬计提日的A类基金份额累计净值

I为上一个业绩报酬计提日的A类基金份额累计净值

I' 为上一个业绩报酬计提日的A类基金份额净值

D为上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日（不含）的间隔天数

K为申请赎回或投资人于本基金最后运作日持有的A类份额；

2) C类份额的业绩报酬计提标准为：E为业绩报酬；当 $R \leq 6\%$ 时， $E=0$ 当 $R > 6\%$ 时，对超过6%的收益部分提取20%的业绩报酬，即 $E=K \times C' \times (R-6\%) \times 20\% \times (D \div 365)$

$R=(A-C) / C' \times 365 / D \times 100\%$

A为业绩报酬计提日的C类基金份额累计净值

C为上一个业绩报酬计提日的C类基金份额累计净值

C' 为上一个业绩报酬计提日的C类基金份额净值

D为上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日（不含）的间隔天数

K为申请赎回或投资人于本基金最后运作日持有的C类份额；

b、分红提取当发生分红时，管理人将根据年化收益率（R）对A类份额提取业绩报酬，C类份额不提取业绩报酬。业绩报酬提取方式与退出提取相同。

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	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,908,716.94	10,348,275.89

注：本基金A类份额的托管费按前一日该类份额对应的基金资产净值的0.25%年费率计提。本基金C类份额的托管费按前一日该类份额对应的基金资产净值的0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值*年费率/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

国泰君安君得鑫2年持有混合A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
基金合同生效日（2020年01月06日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

国泰君安君得鑫2年持有混合C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
基金合同生效日（2020年01月06日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	86,714,649.09	86,714,649.09
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	24,250,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	62,464,649.09	86,714,649.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.27%	2.79%

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		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	683,169,930.35	4,008,494.06	1,259,600,583.07	4,531,180.80

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直接购入关联方承销的证券。

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方交易事项。

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

本基金本报告期未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301236	软通动力	2022-03-08	6个月以上	创业板打新限售	72.88	31.38	1,740	84,540.80	54,601.20	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月以上	创业板打新限售	76.56	51.92	835	63,927.60	43,353.20	-
301206	三元生物	2022-01-	6个月以	创业板打	109.30	45.69	875	63,721.9	39,978.7	-

		26	上	新限售				0	5	
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月以上	创业板打新限售	56.88	56.42	476	27,074.88	26,855.92	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6个月以上	创业板打新限售	50.31	70.37	279	14,036.49	19,633.23	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月以上	创业板打新限售	72.69	71.54	228	16,573.32	16,311.12	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月以上	创业板打新限售	55.57	30.03	527	29,285.39	15,825.81	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月以上	创业板打新限售	37.23	25.39	594	22,114.62	15,081.66	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月以上	创业板打新限售	3.80	6.39	2,188	8,314.40	13,981.32	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6个月以上	创业板打新限售	46.80	54.44	185	8,658.00	10,071.40	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月以上	创业板打新限售	64.08	37.52	231	14,802.48	8,667.12	-

301235	华康医疗	2022-01-21	6个月以上	创业板打新限售	39.30	37.93	185	7,270.50	7,017.05	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月以上	创业板打新限售	11.40	20.46	286	3,260.40	5,851.56	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月以上	创业板打新限售	33.98	28.96	128	4,349.44	3,706.88	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月以上	创业板打新限售	63.10	39.85	91	5,742.10	3,626.35	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月以上	创业板打新限售	40.25	30.59	116	4,669.00	3,548.44	-
301158	德石股份	2022-01-07	6个月以上	创业板打新限售	15.64	20.38	166	2,596.24	3,383.08	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月以上	创业板打新限售	22.55	37.70	87	1,961.85	3,279.90	-

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，本基金无因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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因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。

6.4.13.3 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。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，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	683,169,930.35	-	-	-	-	-	683,169,930.35
结算备付金	35,693,281.06	-	-	-	-	-	35,693,281.06
存出保证金	4,661,876.87	-	-	-	-	-	4,661,876.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,047,633,454.42	3,047,633,454.42
应收清算款	-	-	-	-	-	8,693,875.71	8,693,875.71
应收股利	-	-	-	-	-	824,044.32	824,044.32
应收申购款	-	-	-	-	-	36,750.58	36,750.58
资产总计	723,525,088.28	-	-	-	-	3,057,188,125.03	3,780,713,213.31
负债							

国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金 2022 年中期报告

应付清算款	-	-	-	-	-	89,319,648.91	89,319,648.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	43,146,615.61	43,146,615.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,296,138.11	2,296,138.11
应付托管费	-	-	-	-	-	631,637.24	631,637.24
其他负债	-	-	-	-	-	13,319,073.66	13,319,073.66
负债总计	-	-	-	-	-	148,713,113.53	148,713,113.53
利率敏感度缺口	723,525,088.28	-	-	-	-	2,908,475,011.50	3,632,000,099.78
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	578,315,389.11	-	-	-	-	-	578,315,389.11
结算备付金	63,954,629.73	-	-	-	-	-	63,954,629.73
存出保证金	3,962,438.10	-	-	-	-	-	3,962,438.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,403,226,901.99	7,403,226,901.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	53,866,990.44	53,866,990.44
应收利息	-	-	-	-	-	220,698.38	220,698.38
应收申购款	-	-	-	-	-	10,733.93	10,733.93
资产总计	646,232,456.94	-	-	-	-	7,457,325,324.74	8,103,557,781.68
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	65.81	65.81
应付赎回款	-	-	-	-	-	925,022.82	925,022.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,814,557.16	4,814,557.16
应付托管费	-	-	-	-	-	1,437,836.10	1,437,836.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	26,646,191.13	26,646,191.13

其他负债	-	-	-	-	-	3,168,063.85	3,168,063.85
负债总计	-	-	-	-	-	36,991,736.87	36,991,736.87
利率敏感度缺口	646,232,456.94	-	-	-	-	7,420,333,587.87	8,066,566,044.81

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	211,032,120.80	-	211,032,120.80
应收股利	-	824,044.32	-	824,044.32
资产合计	-	211,856,165.12	-	211,856,165.12
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	211,856,165.12	-	211,856,165.12
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元折	港币折合人民	其他币	合计

	合人民币	币	种折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	304,314,015.82	-	304,314,015.82
资产合计	-	304,314,015.82	-	304,314,015.82
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	65.81	-	65.81
负债合计	-	65.81	-	65.81
资产负债表外汇风险敞口净额	-	304,313,950.01	-	304,313,950.01

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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
	1. 所有港币均相对人民币升值5%	10,592,808.26	15,215,700.80
2. 所有港币均相对人民币贬值5%	-10,592,808.26	-15,215,700.80	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的基金、股票、债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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	3,047,633,454.42	83.91	7,403,226,901.99	91.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	3,047,633,454.42	83.91	7,403,226,901.99	91.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	173,715,106.90	402,505,122.27
	业绩比较基准下降5%	-173,715,106.90	-402,505,122.27

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	3,047,338,680.43	7,402,675,904.04
第二层次	-	27,741.24
第三层次	294,773.99	523,256.71
合计	3,047,633,454.42	7,403,226,901.99

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	3,047,633,454.42	80.61
	其中：股票	3,047,633,454.42	80.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	718,863,211.41	19.01
8	其他各项资产	14,216,547.48	0.38
9	合计	3,780,713,213.31	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币211,032,120.80元，占期末净值比例为5.81%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,680.97	0.00
B	采矿业	148,271,512.00	4.08
C	制造业	2,165,655,693.04	59.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,654,329.00	1.48
E	建筑业	72,195,064.81	1.99
F	批发和零售业	79,250.73	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	46,010,918.17	1.27
H	住宿和餐饮业	74,055.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,426,881.30	1.11
J	金融业	273,857,022.57	7.54
K	房地产业	35,873,316.00	0.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	417,122.77	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	69,310.22	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	5,288.02	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,888.90	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,836,601,333.62	78.10

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
非日常生活消费品	93,095,025.58	2.56
日常消费品	114,165,812.54	3.14
金融	4,547.01	0.00
信息技术	2,734,470.03	0.08
电信服务	1,030,469.74	0.03
地产业	1,795.90	0.00
合计	211,032,120.80	5.81

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基绿能	2,415,019	160,912,715.97	4.43
2	00168	青岛啤酒股份	1,636,000	114,165,812.54	3.14
3	002466	天齐锂业	911,228	113,721,254.40	3.13
4	000858	五粮液	546,583	110,371,505.1	3.04

				9	
5	300750	宁德时代	204,308	109,100,472.00	3.00
6	000792	盐湖股份	3,552,100	106,420,916.00	2.93
7	300726	宏达电子	1,648,169	100,818,497.73	2.78
8	000333	美的集团	1,555,807	93,955,184.73	2.59
9	002241	歌尔股份	2,722,890	91,489,104.00	2.52
10	603606	东方电缆	1,078,294	82,597,320.40	2.27
11	002192	融捷股份	484,200	74,421,540.00	2.05
12	000762	西藏矿业	1,320,400	73,849,972.00	2.03
13	000498	山东路桥	7,472,308	72,182,495.28	1.99
14	600760	中航沈飞	1,172,900	70,901,805.00	1.95
15	000776	广发证券	3,696,000	69,115,200.00	1.90
16	300059	东方财富	2,719,740	69,081,396.00	1.90
17	000768	中航西飞	2,217,313	67,162,410.77	1.85
18	002463	沪电股份	4,535,150	66,938,814.00	1.84
19	002142	宁波银行	1,845,464	66,086,065.84	1.82
20	688349	三一重能	1,533,722	62,499,171.50	1.72
21	002056	横店东磁	2,171,260	57,798,941.20	1.59
22	002460	赣锋锂业	387,309	57,592,848.30	1.59
23	02331	李宁	902,500	56,110,512.48	1.54
24	600905	三峡能源	8,530,100	53,654,329.00	1.48
25	300415	伊之密	2,931,100	53,433,953.00	1.47
26	603228	景旺电子	2,214,929	51,674,293.57	1.42
27	600559	老白干酒	1,792,882	51,437,784.58	1.42
28	600184	光电股份	3,444,000	47,664,960.00	1.31
29	002756	永兴材料	302,491	46,042,155.11	1.27
30	603885	吉祥航空	2,557,583	46,010,918.17	1.27
31	603517	绝味食品	753,700	43,578,934.00	1.20

32	002013	中航机电	3,366,000	41,570,100.00	1.14
33	688232	新点软件	1,061,174	39,921,365.88	1.10
34	603986	兆易创新	275,846	39,228,059.66	1.08
35	601233	桐昆股份	2,397,600	38,073,888.00	1.05
36	600933	爱柯迪	2,315,277	37,924,237.26	1.04
37	002384	东山精密	1,644,800	37,715,264.00	1.04
38	601058	赛轮轮胎	3,299,700	37,187,619.00	1.02
39	02333	长城汽车	2,679,500	36,984,513.10	1.02
40	300033	同花顺	381,044	36,637,380.60	1.01
41	600048	保利发展	2,054,600	35,873,316.00	0.99
42	002709	天赐材料	554,590	34,417,855.40	0.95
43	688559	海目星	464,353	33,758,463.10	0.93
44	603297	永新光学	299,832	33,494,232.72	0.92
45	600958	东方证券	3,225,953	32,936,980.13	0.91
46	300014	亿纬锂能	337,115	32,868,712.50	0.90
47	600690	海尔智家	1,029,700	28,275,562.00	0.78
48	600438	通威股份	431,950	25,856,527.00	0.71
49	688348	昱能科技	49,188	24,003,744.00	0.66
50	603338	浙江鼎力	438,800	22,247,160.00	0.61
51	300850	新强联	201,952	17,979,786.56	0.50
52	000625	长安汽车	1,029,300	17,827,476.00	0.49
53	601882	海天精工	484,547	9,986,513.67	0.27
54	688032	禾迈股份	4,390	3,823,690.00	0.11
55	02382	舜宇光学科技	25,000	2,734,470.03	0.08
56	00700	腾讯控股	3,400	1,030,469.74	0.03
57	600660	福耀玻璃	20,900	873,829.00	0.02
58	688270	臻镭科技	2,469	153,102.69	0.00
59	688248	南网科技	5,740	132,708.80	0.00
60	301117	佳缘科技	1,841	102,691.48	0.00
61	688265	南模生物	1,519	97,261.57	0.00

62	688267	中触媒	2,906	97,147.58	0.00
63	688800	瑞可达	700	88,417.00	0.00
64	301196	唯科科技	2,303	87,113.04	0.00
65	301190	善水科技	3,424	81,251.52	0.00
66	301168	通灵股份	1,800	81,144.00	0.00
67	301101	明月镜片	1,532	78,637.56	0.00
68	688259	创耀科技	970	78,152.90	0.00
69	301179	泽宇智能	1,881	76,763.61	0.00
70	301189	奥尼电子	2,280	75,946.80	0.00
71	688173	希荻微	2,245	75,319.75	0.00
72	301073	君亭酒店	1,068	74,055.12	0.00
73	301235	华康医疗	1,842	71,606.91	0.00
74	301100	风光股份	3,040	65,603.20	0.00
75	301108	洁雅股份	1,625	64,301.25	0.00
76	301199	迈赫股份	1,948	62,413.92	0.00
77	301116	益客食品	2,860	59,390.76	0.00
78	301118	恒光股份	1,286	55,336.58	0.00
79	301236	软通动力	1,740	54,601.20	0.00
80	301136	招标股份	2,637	52,608.15	0.00
81	301200	大族数控	835	43,353.20	0.00
82	301188	力诺特玻	2,365	42,097.00	0.00
83	688236	春立医疗	2,109	41,758.20	0.00
84	301193	家联科技	1,530	41,539.50	0.00
85	301133	金钟股份	1,470	40,821.90	0.00
86	301206	三元生物	875	39,978.75	0.00
87	301222	浙江恒威	1,275	39,011.54	0.00
88	301110	青木股份	904	38,829.25	0.00
89	301138	华研精机	1,236	38,007.00	0.00
90	301181	标榜股份	1,155	36,910.73	0.00
91	688175	高凌信息	1,075	36,378.00	0.00
92	301035	润丰股份	441	36,360.45	0.00

93	688115	思林杰	874	35,169.76	0.00
94	688786	悦安新材	771	35,157.60	0.00
95	301185	鸥玛软件	1,892	34,983.08	0.00
96	301158	德石股份	1,660	34,532.98	0.00
97	301130	西点药业	868	34,519.90	0.00
98	688163	赛伦生物	1,363	33,938.70	0.00
99	688283	坤恒顺维	657	31,319.19	0.00
100	301177	迪阿股份	420	31,164.00	0.00
101	301072	中捷精工	948	30,364.44	0.00
102	688722	同益中	1,809	30,282.66	0.00
103	301198	喜悦智行	1,236	27,871.80	0.00
104	301207	华兰疫苗	476	26,855.92	0.00
105	301069	凯盛新材	582	26,836.02	0.00
106	301090	华润材料	2,450	26,729.50	0.00
107	301050	雷电微力	261	26,507.16	0.00
108	301057	汇隆新材	1,068	26,005.80	0.00
109	688227	品高股份	1,203	25,768.26	0.00
110	301087	可孚医疗	577	24,603.28	0.00
111	688210	统联精密	1,117	24,205.39	0.00
112	301182	凯旺科技	987	23,451.12	0.00
113	688255	凯尔达	724	22,371.60	0.00
114	301053	远信工业	948	22,145.28	0.00
115	301049	超越科技	912	21,623.52	0.00
116	301056	森赫股份	2,446	21,182.36	0.00
117	301059	金三江	1,180	19,824.00	0.00
118	301122	采纳股份	279	19,633.23	0.00
119	301091	深城交	700	19,110.00	0.00
120	301083	百胜智能	1,300	18,148.00	0.00
121	301093	华兰股份	500	16,945.00	0.00
122	300854	中兰环保	827	16,440.76	0.00
123	301201	诚达药业	228	16,311.12	0.00

124	301096	百诚医药	204	16,116.00	0.00
125	300834	星辉环材	527	15,825.81	0.00
126	301079	邵阳液压	627	15,549.60	0.00
127	688701	卓锦股份	1,301	15,377.82	0.00
128	301068	大地海洋	626	15,117.90	0.00
129	301123	奕东电子	594	15,081.66	0.00
130	301039	中集车辆	1,373	14,869.59	0.00
131	301215	中汽股份	2,188	13,981.32	0.00
132	688272	富吉瑞	505	13,412.80	0.00
133	300953	震裕科技	91	12,466.09	0.00
134	301089	拓新药业	97	12,185.14	0.00
135	301099	雅创电子	133	11,102.84	0.00
136	301078	孩子王	735	10,775.10	0.00
137	301046	能辉科技	302	10,452.22	0.00
138	301221	光庭信息	159	10,307.97	0.00
139	301166	优宁维	135	7,946.10	0.00
140	300982	苏文电能	168	7,889.28	0.00
141	300997	欢乐家	556	7,428.16	0.00
142	300986	志特新材	189	6,955.20	0.00
143	300994	久祺股份	173	5,676.13	0.00
144	300942	易瑞生物	243	5,613.30	0.00
145	301092	争光股份	178	5,599.88	0.00
146	301180	万祥科技	259	5,426.05	0.00
147	301060	兰卫医学	151	5,288.02	0.00
148	300968	格林精密	579	5,245.74	0.00
149	300940	南极光	222	5,223.66	0.00
150	300996	普联软件	165	4,875.75	0.00
151	301098	金埔园林	193	4,680.25	0.00
152	300918	南山智尚	546	4,668.30	0.00
153	03908	中金公司	318	4,547.01	0.00
154	300962	中金辐照	290	4,379.00	0.00

155	301126	达嘉维康	254	4,351.02	0.00
156	301048	金鹰重工	391	4,304.91	0.00
157	301015	百洋医药	199	4,294.42	0.00
158	300926	博俊科技	181	4,226.35	0.00
159	301028	东亚机械	390	4,219.80	0.00
160	301052	果麦文化	128	4,215.04	0.00
161	300993	玉马遮阳	328	4,191.84	0.00
162	300967	晓鸣股份	230	4,142.30	0.00
163	300614	百川畅银	158	3,975.28	0.00
164	300922	天秦装备	213	3,825.48	0.00
165	301021	英诺激光	126	3,805.20	0.00
166	301013	利和兴	315	3,776.85	0.00
167	300774	倍杰特	185	3,729.60	0.00
168	300966	共同药业	124	3,701.40	0.00
169	301111	粤万年青	134	3,674.28	0.00
170	300943	春晖智控	227	3,566.17	0.00
171	300945	曼卡龙	218	3,505.44	0.00
172	301012	扬电科技	83	3,403.83	0.00
173	301020	密封科技	148	3,330.00	0.00
174	301027	华蓝集团	135	3,277.80	0.00
175	300987	川网传媒	191	3,222.17	0.00
176	301026	浩通科技	87	3,208.56	0.00
177	300975	商络电子	361	3,165.97	0.00
178	300927	江天化学	180	3,114.00	0.00
179	301002	崧盛股份	125	3,108.75	0.00
180	301004	嘉益股份	128	3,028.48	0.00
181	300958	建工修复	153	3,026.34	0.00
182	300998	宁波方正	100	3,025.00	0.00
183	300814	中富电路	165	3,019.50	0.00
184	300961	深水海纳	222	3,010.32	0.00
185	300960	通业科技	160	2,995.20	0.00

186	300952	恒辉安防	172	2,992.80	0.00
187	300937	药易购	92	2,945.84	0.00
188	300978	东箭科技	217	2,831.85	0.00
189	301055	张小泉	156	2,773.68	0.00
190	300955	嘉亨家化	113	2,770.76	0.00
191	300991	创益通	191	2,746.58	0.00
192	301030	仕净科技	116	2,705.12	0.00
193	301040	中环海陆	88	2,686.64	0.00
194	301062	上海艾录	224	2,614.08	0.00
195	300971	博亚精工	105	2,588.25	0.00
196	301011	华立科技	78	2,565.42	0.00
197	301010	晶雪节能	100	2,535.00	0.00
198	300950	德固特	155	2,526.50	0.00
199	301033	迈普医学	55	2,316.05	0.00
200	301081	严牌股份	150	2,262.00	0.00
201	301007	德迈仕	147	2,215.29	0.00
202	300948	冠中生态	134	2,126.58	0.00
203	301063	海锅股份	75	2,089.50	0.00
204	301036	双乐股份	92	2,068.16	0.00
205	301016	雷尔伟	108	2,014.20	0.00
206	301032	新柴股份	214	1,990.20	0.00
207	301041	金百泽	95	1,872.45	0.00
208	06049	保利物业	42	1,795.90	0.00
209	301025	读客文化	127	1,673.86	0.00
210	300995	奇德新材	74	1,583.60	0.00
211	300972	万辰生物	119	1,538.67	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例 (%)
1	603501	韦尔股份	352,050,176.90	4.36
2	002371	北方华创	349,527,590.46	4.33
3	002459	晶澳科技	347,932,420.67	4.31
4	300750	宁德时代	339,781,317.13	4.21
5	601012	隆基绿能	335,266,838.38	4.16
6	002466	天齐锂业	298,880,621.89	3.71
7	000776	广发证券	280,268,593.07	3.47
8	300014	亿纬锂能	254,247,412.19	3.15
9	600048	保利发展	242,701,239.71	3.01
10	000002	万科A	234,786,601.46	2.91
11	002142	宁波银行	233,752,776.07	2.90
12	300059	东方财富	221,210,406.74	2.74
13	000651	格力电器	214,623,049.95	2.66
14	600570	恒生电子	211,831,322.75	2.63
15	603885	吉祥航空	207,760,743.23	2.58
16	300033	同花顺	206,039,643.13	2.55
17	601877	正泰电器	196,153,242.50	2.43
18	300726	宏达电子	188,388,842.27	2.34
19	002756	永兴材料	186,746,211.96	2.32
20	002179	中航光电	182,164,569.87	2.26
21	000568	泸州老窖	181,448,159.12	2.25
22	601800	中国交建	175,814,850.96	2.18
23	600383	金地集团	171,605,942.97	2.13
24	601166	兴业银行	169,314,176.40	2.10
25	000792	盐湖股份	161,801,174.00	2.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	300750	宁德时代	448,548,978.88	5.56
2	300014	亿纬锂能	423,150,268.51	5.25
3	002371	北方华创	361,630,625.13	4.48
4	603501	韦尔股份	346,410,577.14	4.29
5	002459	晶澳科技	343,563,625.34	4.26
6	000776	广发证券	323,781,606.13	4.01
7	601377	兴业证券	305,282,611.52	3.78
8	603816	顾家家居	303,173,474.24	3.76
9	000858	五粮液	290,809,034.95	3.61
10	002271	东方雨虹	279,853,865.68	3.47
11	603606	东方电缆	267,713,235.60	3.32
12	03908	中金公司	256,456,630.33	3.18
13	002291	星期六	250,819,423.79	3.11
14	600803	新奥股份	249,210,848.59	3.09
15	002466	天齐锂业	231,390,388.81	2.87
16	603986	兆易创新	228,368,731.09	2.83
17	002013	中航机电	227,207,688.37	2.82
18	600048	保利发展	219,956,839.79	2.73
19	601012	隆基绿能	219,945,814.16	2.73
20	000661	长春高新	216,870,826.80	2.69
21	300451	创业慧康	213,848,390.85	2.65
22	000799	酒鬼酒	212,834,622.33	2.64
23	000301	东方盛虹	212,590,410.95	2.64
24	000002	万科A	205,087,549.74	2.54
25	600690	海尔智家	204,895,326.19	2.54
26	000792	盐湖股份	202,183,989.42	2.51
27	603589	口子窖	201,413,850.35	2.50
28	300552	万集科技	199,770,727.90	2.48
29	000651	格力电器	196,666,544.16	2.44
30	000568	泸州老窖	195,336,553.02	2.42
31	600570	恒生电子	193,332,450.85	2.40

32	601800	中国交建	190,453,686.05	2.36
33	600438	通威股份	189,187,187.65	2.35
34	600958	东方证券	187,557,814.57	2.33
35	300274	阳光电源	184,875,423.72	2.29
36	601877	正泰电器	183,219,538.31	2.27
37	002179	中航光电	182,342,570.83	2.26
38	688167	炬光科技	181,885,910.17	2.25
39	600038	中直股份	179,472,458.08	2.22
40	002142	宁波银行	177,784,102.35	2.20
41	600703	三安光电	175,605,284.89	2.18
42	002032	苏泊尔	174,202,609.72	2.16
43	600383	金地集团	170,358,956.53	2.11
44	300674	宇信科技	164,545,149.40	2.04
45	300033	同花顺	164,321,300.17	2.04
46	601166	兴业银行	162,966,605.95	2.02

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,995,286,592.35
卖出股票收入（成交）总额	18,289,672,434.57

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

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	4,661,876.87
2	应收清算款	8,693,875.71
3	应收股利	824,044.32
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,750.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,216,547.48

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

本基金本报告期末前十名股票中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
国泰君安君得鑫2年持有混合A	3,764	116,748.14	431,987.91	0.10%	439,008,016.71	99.90%
国泰君安君得鑫2年持有混合C	28,598	51,140.33	66,938,779.31	4.58%	1,395,572,473.95	95.42%
合计	32,362	58,771.13	67,370,767.22	3.54%	1,834,580,490.66	96.46%

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	国泰君安君得鑫2年	0.00	0.00%

持有本基金	持有混合A		
	国泰君安君得鑫2年持有混合C	1,287,387.58	0.09%
	合计	1,287,387.58	0.07%

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

8.3 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	国泰君安君得鑫2年持有混合A	0
	国泰君安君得鑫2年持有混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安君得鑫2年持有混合A	0
	国泰君安君得鑫2年持有混合C	>100
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安君得鑫2年持有混合A	国泰君安君得鑫2年持有混合C
基金合同生效日(2020年01月06日)基金份额总额	2,190,889,856.68	-
本报告期期初基金份额总额	532,576,107.72	3,121,864,119.01
本报告期基金总申购份额	-	3,299,293.27
减：本报告期基金总赎回份额	93,136,103.10	1,662,652,159.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	439, 440, 004. 62	1, 462, 511, 253. 26
-------------	-------------------	----------------------

§ 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、本报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

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	33,271,942,312.00	100.00%	24,320,753.48	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	中国证券报、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	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划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	中国证券报	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更事宜的公告	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	2022-03-12
6	国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
7	国泰君安君得鑫两年持有期	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18

	混合型证券投资基金基金合同		
8	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划(C类份额)产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
9	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划(A类份额)产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
10	国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
11	关于国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划变更注册为国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
12	国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金基金合同和招募说明书提示性公告	中国证券报	2022-03-18
13	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
14	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划2021年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-03-31
15	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	中国证券报	2022-03-31
16	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
17	国泰君安君得鑫两年持有期	证监会指定网站、公司官网	2022-04-22

	混合型证券投资基金2022年 第一季度报告		
18	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	中国证券报	2022-04-22
19	上海国泰君安证券资产管理 有限公司关于旗下部分基金 在华瑞保险开展费率优惠活 动的公告	上海证券报、中国证券报、 证券日报、证监会指定网站、 公司官网	2022-06-22

§ 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、关于准予国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得鑫两年持有期混合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