

国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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:江苏银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

上海国泰君安证券资产管理有限公司的董事会、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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
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	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 本报告期投资基金情况	53
7.13 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59

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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	61
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.9 其他重大事件.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）	
基金主代码	014566	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年12月28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	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,995,212,891.58份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	014566	014567
报告期末下属分级基金的份额总额	1,956,861,353.44份	38,351,538.14份

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的前提下，通过稳定的资产配置和精细化优选基金，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，精选基金品种，构建有超额收益能力的基金组合。同时通过有效地风险管理，降低业绩的波动性，获得稳定而持续的投资收益。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>（1）开放式基金投资策略</p> <p>在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产</p>

	<p>品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。</p> <p>1) 在基金公司维度，主要考虑的因素有：基金公司的股东背景、公司治理、核心管理团队的综合素质和稳定性、基金经理与投研团队的综合素质和稳定性、公司管理的资产规模和盈利能力、管理层的管理风格、投资决策程序的科学性和执行度、公司风险控制制度健全性和执行力度、公司基金的类型和收益情况、公司基金交叉持股情况、基金公司产品创新能力及客户服务水平等。评价方式主要来自于实地调研、公司刊物和公开信息。</p> <p>2) 基金经理维度，对基金经理的从业经验、业绩表现、风险控制、业绩归因、风格特征等多个层面全方位地进行分析，定量和定性相结合，并通过持续跟踪保持更新。该体系从多种维度对基金经理的风格特征加以剖析，包括但不限于：组合构建思路、选股偏好、擅长投资领域、投资集中度、换手率情况等。</p> <p>3) 基金产品维度，重点考量首先根据基金的历史业绩情况，挑选出业绩持续优秀的基金，根据基金的风险收益特征，构建合适的基金投资组合。通过风险收益综合评价方法挖掘持续稳定的基金品种，主要包括选股能力、择时能力、风险控制能力等指标。</p> <p>(2) 场内ETF等基金投资策略</p> <p>场内ETF等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及ETF所跟踪指数的综合评价挑选适合的ETF投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。</p> <p>其他投资策略还包括股票的投资策略、债券的投资策略、资产支持证券的投资策略、存托凭证的投资策略、可转换债券、可交换债券的投资策略等投资策略。</p>
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期

	风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。
--	--

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	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	周宏
	联系电话	021-38676022	025-58588217
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	zhouhong1@jsbchina.cn
客户服务电话		95521	95319
传真		021-38871190	025-58588155
注册地址		上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	南京市中华路26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	南京市中华路26号
邮政编码		200120	210001
法定代表人		谢乐斌	夏平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	上海市静安区新闻路669号博华广场

有限公司	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)	
	国泰君安善融稳健 一年持有混合（FO F）A	国泰君安善融稳健 一年持有混合（FO F）C
本期已实现收益	6,337,216.69	48,929.56
本期利润	-1,621,893.79	-107,170.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0008	-0.0028
本期加权平均净值利润率	-0.08%	-0.28%
本期基金份额净值增长率	-0.08%	-0.28%
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	-610,747.60	-89,201.58
期末可供分配基金份额利润	-0.0003	-0.0023
期末基金资产净值	1,956,250,605.84	38,262,336.56
期末基金份额净值	0.9997	0.9977
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	-0.03%	-0.23%

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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

国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）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	1.40%	0.18%	1.87%	0.21%	-0.47%	-0.03%
过去三个月	1.69%	0.20%	2.16%	0.28%	-0.47%	-0.08%
过去六个月	-0.08%	0.19%	-0.29%	0.29%	0.21%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	-0.03%	0.18%	-0.05%	0.29%	0.02%	-0.11%

国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）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	1.37%	0.18%	1.87%	0.21%	-0.50%	-0.03%
过去三个月	1.59%	0.20%	2.16%	0.28%	-0.57%	-0.08%
过去六个月	-0.28%	0.19%	-0.29%	0.29%	0.01%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	-0.23%	0.19%	-0.05%	0.29%	-0.18%	-0.10%

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

国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）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12月28日-2022年06月30日)



注：本基金于 2021 年 12 月 28 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）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12月28日-2022年06月30日)



注：本基金于 2021 年 12 月 28 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

§ 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		
李少君	本基金基金经理，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)的基金经理，本公司基金投资部总经理。	2021-12-28	-	11年	李少君，中国人民大学博士研究生，2009年7月至2010年12月任职于中国工商银行总行研究所分析师，2010年12月至2016年12月民生证券研究院，历任研究业务部总经理，首席策略分析师，2016年12月至2020年9月历任国泰君安证券股份有限公司研究所副

					<p>所长、全球首席策略分析师、总量团队负责人，2020年9月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现担任基金投资部总经理。自2020年12月7日起至2022年3月20日止，担任“国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金（FOF）集合资产管理计划”的投资经理。自2021年12月28日起担任“国泰君安善融稳健一年持有期混合型证券投资基金（FOF）”基金经理。自2022年3月21日起担任“国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金（FOF）”的基金经理。</p>
高琛	<p>本基金基金经理，国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金（FOF）的基金经理。</p>	2021-12-28	-	12年	<p>高琛，华东理工大学工商管理硕士，10年以上证券从业经历。曾任上海证券基金评价分析师、金融实验室负责人，国泰君安资产管理业务委员会执行办董事。2019年4月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现担任基金投资部基金经理。自2020年11月16日起至2022年3月20日止，担任“国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金（FOF）集合资产管理计划”的投资经理。自2021年12月28日起担任“国泰君安善融稳健一年持</p>

					有期混合型证券投资基金中基金（FOF）”基金经理。自2022年3月21日起担任“国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）”的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.3 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

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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

市场回顾：

回顾市场，从全球范围来看，受海外高通胀的影响，上半年全球主要指数均呈现不同程度下跌。上半年A股市场表现主要分为两个阶段：1-4月下跌阶段，外部因素主要来自于美联储加息预期以及地缘政治冲突升级对全球金融市场造成冲击，内部因素为国内疫情反复，对经济造成严重冲击，加剧了资金对市场的担忧；进入5月后，随着疫情逐步得到控制，政策端也逐步发力，市场信心逐步恢复，A股随之回暖。

债券市场方面，2022年10年国债以2.8%的水平开场，到六月末依然是2.8%，整体而言长端利率维持震荡格局。3月份以来全国新一轮疫情冲击对经济造成较为显著的影响，但参考2020年的走势，市场并未过多参与长端利率交易。但对于信用债来说，DR001伴随着政策的宽松从2.0%的水平快速回落至1.3%的低位，引发信用债出现了一轮波澜壮阔的牛市，以2年AA（2）城投收益率曲线来看，从3月份到5月底下行接近50bp，其中部分个券收益率下行幅度超过100bp。

操作回顾：

上半年善融FOF在一季度经历建仓期，二季度处于正常运作期，股票市场上半年在俄乌战争影响及国内疫情影响下阶段性的悲观恐慌抛售期，给了产品较好的建仓布局机会。后续市场反弹，截止季末产品净值已基本修复。

在权益类基金方面，A股市场的回调给产品带来较好的补仓权益资产的机会，善融FOF在二季度底部区域进行的加仓，具体品种上以均衡成长和泛消费属性基金为主。在权益基金的筛选上，我们整体偏好选股能力强，行业配置均衡的基金，基金组合整体偏向均衡成长；在行业层面，相对侧重选股能力相对擅长的新能源科技类基金经理，以及泛消费领域中长期超额收益较为稳定的基金经理。在反弹阶段，组合内权益基金的整体表现要显著的好于宽基指数和偏股基金的平均水平。

债券类基金方面，二季度基本保持原有配置状态，未做较大调整。在具体债券类基金选择上，仍以纯债型基金为主，以高等级信用债及利率债基为主，对于二级债基及可转债的参与程度相对较小。虽然未来流动性总体上预期依然保持适度宽松，但随着经济的修复以及宽信用政策的发力，利率的下行空间有限，债券市场整体难有较大行情。当前债券市场相对有利的一面是短期资金面仍将保持充裕，但进一步宽松空间非常有限。当前经济面临下行压力，央行通过降准、上缴利润等方式为市场提供了充裕的流动性，但同期信贷需求疲弱，流动性淤积在银行间市场。此外由于政府面临维持国内物价稳定和维持人民币汇率稳定两个目标面临挑战，因此央行对于进一步开展货币政策的总量宽松较为谨慎。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A基金份额净值为0.9997元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.08%，同期业绩比较基准收益率为-0.29%；

截至报告期末国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C基金份额净值为0.9977元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.28%，同期业绩比较基准收益率为-0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们处在哪个位置？

从历史几轮熊牛转换来看，重要条件不外乎有两个：一个是盈利，一个是风险偏好。犹记得四月我们曾经提出，市场“风险偏好”系统性快速下行，市场已经跌出了2018年的感觉，现在看来，四月下旬的“最后一跌”，颇有2018年四季度“最后一跌”的味道。如果风险偏好已经在4月底走完了2018年的极低点了，那么从盈利预期来看，过去一个月的盈利预期几乎没有提供增量，这也许与刚刚经历年报季不久有关。我们不妨把视角上移，从盈利预期转向盈利周期。从我们监控的重点标的来看，与2022年盈利周期位置相似的是2016-2017年，同样经历了上年的盈利增速见底回升。

从宏观政策来看，2016年我们也看到了当年1月份的天量社融，甚至也看到了首付比例的松动。受宏观政策驱动，工业增加值和上市公司盈利也陆续在2016年中见底。

从市场结构来看，伴随着流动性的大幅释放，银行、有色、非银、煤炭、家电等行业也分别领涨了2016年的单月行情，并开启了茅指数引领的核心资产周期。

总体而言，随着全球货币政策的总体收紧，通胀交易正在逐渐离开舞台中央，前期PPI上行交易有转向CPI上行交易的苗头。具体来看，美国在逐渐从胀（经济过热）转向滞（衰退），我们在从滞（经济下行风险）转向胀（复苏）。

结构上看，无论是增速仍然可圈可点的新能源，还是经济复苏阶段往往不会缺席的大消费，其估值和盈利的匹配性、盈利的持续性（或盈利周期开启的驱动）都存在这样或者那样的瑕疵。

所以，总量数据的上行仍缺乏微观数据的夯实和印证；结构领先的行业在领涨逻辑上也多少存在着不那么顺的地方。这也是市场近期围绕新能源令人振奋的微观数据扎堆上行的的重要原因。

未来全球经济增长驱动的价格走势和货币政策差异将更加明朗，股债等大类资产之间的性价比也将更加清晰。权益市场将逐渐经历中报的检验。相信市场还会有反复，甚至不排除二次探底的风险，但如果盈利周期和政策周期的演绎没有太大的风险，大家此刻大概率会在结构上花更多的经历。我们认为，上半年经历了急跌和急涨，市场有望在下半年重新开启分子端主导的结构性行情。从历史上来看，分子行情中体现的能力，其持续性会显著强于分母端行情。综上，我们对下半年的权益市场投资相较上半年信心更足，股债资产的贡献方向也将更加趋于一致，对下半年的期望也可以更高。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会对公司依法管理的资管产品的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定资管产品估值业务的操作流程和风险控制，确保资管产品估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值委员会由营运管理部分管领导、协管领导（若有）、投资部门负责人、投资研究院负责人、营运管理部负责人、法务监察部负责人、风险管理部门负责人及市场部门负责人组成。具体参会的投资部门负责人依据待决议事项对应的资管产品确定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的约定进行收益分配。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人一江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人一江苏银行股份有限公司未发现上海国泰君安证券资产管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

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

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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	193,648,419.95	580,540,482.98
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,802,094,274.98	1,414,976,923.66
其中：股票投资		807,075.00	-
基金投资		1,801,287,199.98	1,414,976,923.66
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		34,822.03	93,356.03
应收申购款		590.48	-

递延所得税资产		-	-
其他资产		-	688,658.36
资产总计		1,995,778,107.44	1,996,299,421.03
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		976,278.44	98,401.07
应付托管费		211,527.00	21,320.24
应付销售服务费		12,485.27	1,259.91
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	6.4.7.5	64,874.33	813.00
负债合计		1,265,165.04	121,794.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	1,995,212,891.58	1,995,147,518.10
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	-699,949.18	1,030,108.71
净资产合计		1,994,512,942.40	1,996,177,626.81
负债和净资产总计		1,995,778,107.44	1,996,299,421.03

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额1,995,212,891.58份，其中A类份额1,956,861,353.44份，A类单位净值0.9997元，B类份额38,351,538.14份，B类单位净值0.9977元。本基金合同生效日为2021年12月28日。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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		5,548,663.13
1. 利息收入		715,059.10
其中：存款利息收入	6.4.7.8	715,059.10
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）		12,948,814.96
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-164.43
基金投资收益	6.4.7.10	-988,197.23
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	6.4.7.11	13,937,176.62
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）	6.4.7.12	-8,115,210.93
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		7,277,727.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,867,020.81

2. 托管费	6.4.10.2.2	1,271,187.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	75,057.83
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		-
8. 其他费用	6.4.7.14	64,461.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,729,064.68
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,729,064.68
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,729,064.68

注：本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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）	1,995,147,518.10	-	1,030,108.71	1,996,177,626.81
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）	1,995,147,518.10	-	1,030,108.71	1,996,177,626.81

三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	65,373.48	-	-1,730,057.89	-1,664,684.41
（一）、综合收益总额	-	-	-1,729,064.68	-1,729,064.68
（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）	65,373.48	-	-993.21	64,380.27
其中：1. 基金申购款	65,373.48	-	-993.21	64,380.27
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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）	1,995,212,891.58	-	-699,949.18	1,994,512,942.40

注：本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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

国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称：“本基金”）经中国证券监督管理委员会2021年12月6日证监许可【2021】3842号文注册募集。基金合同于2021年12月28日正式生效，首次设立募集规模为1,995,147,518.10份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定期。本基金的基金管理人和注册登记机构为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板以及其他依法上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债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、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

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。

本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的80%。投资于权益类资产（股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金）合计占基金资产的比例为0-30%，战略配置目标中枢为20%。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产60%的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票资产占基金资产比例均不低于60%的混合型基金。本基金投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于15%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为中债新综合指数（财富）收益率*80%+沪深300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》、《国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至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

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的、股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。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)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益，股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下

由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）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；

（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

（3）每一基金份额享有同等分配权；

（4）在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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入账。

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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

（4）对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，采用如下方法估值：

（a）对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

（b）对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

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，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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、应收股利、应收利息，金额分别为580,540,482.98元、93,356.03元、688,658.36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、应收股利、其他资产-应收利息、应收申购款，金额分别为580,622,106.22元、93,356.03元、0.00元和607,035.12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1,414,976,923.66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1,414,976,923.66元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为98,401.07元、21,320.24元、1,259.91元和813.00元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为98,401.07元、21,320.24元、1,259.91元和813.00元。

(b) 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>》

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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

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) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税

(5) 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	108,343,174.99
等于：本金	108,319,675.24
加：应计利息	23,499.75
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	85,305,244.96
等于：本金	85,296,952.40
加：应计利息	8,292.56
减：坏账准备	-
合计	193,648,419.95

注：其他存款为券商保证金。

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	822,144.57	-	807,075.00	-15,069.57
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	1,808,420,178.91	-	1,801,287,199.98	-7,132,978.93
其他	-	-	-	-
合计	1,809,242,323.48	-	1,802,094,274.98	-7,148,048.50

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期内未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期内未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,874.33
合计	64,874.33

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安善融稳健一年持有 混合（FOF）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	1,956,828,851.85	1,956,828,851.85
本期申购	32,501.59	32,501.59

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,956,861,353.44	1,956,861,353.44

6.4.7.6.2 国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）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	38,318,666.25	38,318,666.25
本期申购	32,871.89	32,871.89
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	38,351,538.14	38,351,538.14

注：申购含红利再投、转换入份额、赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A

单位：人民币元

项目 (国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	62,973.06	948,587.46	1,011,560.52
本期利润	6,337,216.69	-7,959,110.48	-1,621,893.79
本期基金份额交易产生的变动数	74.24	-488.57	-414.33
其中：基金申购款	74.24	-488.57	-414.33
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,400,263.99	-7,011,011.59	-610,747.60

6.4.7.7.2 国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(国泰君安善融稳健一年持有混合 (FOF) C)			
本期期初	-26.78	18,574.97	18,548.19
本期利润	48,929.56	-156,100.45	-107,170.89
本期基金份额交易产生的变动数	28.74	-607.62	-578.88
其中：基金申购款	28.74	-607.62	-578.88
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,931.52	-138,133.10	-89,201.58

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	621,165.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	93,893.92
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	715,059.10

6.4.7.9 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	-
减：卖出股票成本总额	-
减：交易费用	164.43
买卖股票差价收入	-164.43

6.4.7.10 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	895,195,408.95
减：卖出/赎回基金成本总额	896,115,674.60
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	67,931.58
基金投资收益	-988,197.23

6.4.7.11 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	15,333.07
基金投资产生的股利收益	13,921,843.55
合计	13,937,176.62

6.4.7.12 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	-8,115,210.93
——股票投资	-15,069.57
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-8,100,141.36
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允	-

价值变动产生的预估增值税	
合计	-8, 115, 210. 93

6.4.7.13 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	22, 576. 86
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	4, 335, 200. 79
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1, 068, 755. 50

6.4.7.14 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	27, 273. 08
信息披露费	36, 788. 25
帐户维护费	400. 00
合计	64, 461. 33

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本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
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构
上海国泰君安证券资产管理有限公司	基金管理人
江苏银行股份有限公司	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

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	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	822,144.57	100.00%

注：本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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。本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 基金交易

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	
	成交金额	占当期基金成交 总额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	62,211,175.30	100.00%

注：本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 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	6,935.00	100.00%	-	-

注：本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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	5,867,020.81
其中：支付销售机构的客户维护费	2,859,976.96

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年实际天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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	1,271,187.84

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.13\% \div \text{当年实际天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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		
	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C	合计
国泰君安证券股份有限公司	0.00	607.49	607.49
江苏银行股份有限公司	0.00	62,204.22	62,204.22
上海国泰君安证券资产管理有限公司	0.00	10.55	10.55
合计	0.00	62,822.26	62,822.26

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.40%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年实际天数}$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金资产净值

本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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

国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金合同生效日（2021年12月28日）持有的基金份额	50,002,250.05
报告期初持有的基金份额	50,002,250.05
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	50,002,250.05
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.56%

国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金合同生效日（2021年12月28日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

本基金合同生效日为2021年12月28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
江苏银行股份有限公司	108,343,174.99	621,165.18

注：本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

报告期末，本基金持有管理人关联方华安基金管理有限公司所管理的基金合计104,659,500.94元，占本基金资产净值的比例为5.25%。

6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2022年01月01日至2022年06月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	4,000.00
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	199,629.06
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	44,067.92

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。
 本基金合同生效日为2021年12月28日，无上年度同期对比数据。

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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	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
--------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日							
资产							
银行存款	193,648,419.95	-	-	-	-	-	193,648,419.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,802,094,274.98	1,802,094,274.98
应收股利	-	-	-	-	-	34,822.03	34,822.03
应收申购款	-	-	-	-	-	590.48	590.48
资产总计	193,648,419.95	-	-	-	-	1,802,129,687.49	1,995,778,107.44
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	976,278.44	976,278.44
应付托管费	-	-	-	-	-	211,527.00	211,527.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,485.27	12,485.27
其他负债	-	-	-	-	-	64,874.33	64,874.33
负债总计	-	-	-	-	-	1,265,165.04	1,265,165.04
利率敏感度缺口	193,648,419.95	-	-	-	-	1,800,864,522.45	1,994,512,942.40
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	580,540,482.98	-	-	-	-	-	580,540,482.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,414,976,923.66	1,414,976,923.66
应收利息	-	-	-	-	-	688,658.36	688,658.36
应收股利	-	-	-	-	-	93,356.03	93,356.03
资产总计	580,540,482.98	-	-	-	-	1,415,758,938.05	1,996,299,421.03
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	98,401.07	98,401.07
应付托管费	-	-	-	-	-	21,320.24	21,320.24

应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,259.91	1,259.91
其他负债	-	-	-	-	-	813.00	813.00
负债总计	-	-	-	-	-	121,794.22	121,794.22
利率敏感度缺口	580,540,482.98	-	-	-	-	1,415,637,143.83	1,996,177,626.81

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

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

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	807,075.00	0.04	-	-
交易性金融资产—基金投资	1,801,287,199.98	90.31	1,414,976,923.66	70.88
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	1,802,094,274.98	90.35	1,414,976,923.66	70.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
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%	90,098,692.97	70,748,846.18
	业绩比较基准下降5%	-90,098,692.97	-70,748,846.18

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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	1,802,094,274.98	1,414,976,923.66
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,802,094,274.98	1,414,976,923.66

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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

（1）承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

（2）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。

（3）财务报表的批准

本财务报表已经本基金的基金管理人批准。

§ 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	807,075.00	0.04
	其中：股票	807,075.00	0.04

2	基金投资	1,801,287,199.98	90.25
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	193,648,419.95	9.70
8	其他各项资产	35,412.51	0.00
9	合计	1,995,778,107.44	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	601,146.00	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	91,540.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	114,389.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	807,075.00	0.04

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	600519	贵州茅台	100	204,500.00	0.01
2	603259	药明康德	1,100	114,389.00	0.01
3	000799	酒鬼酒	500	92,905.00	0.00
4	601166	兴业银行	4,600	91,540.00	0.00
5	300274	阳光电源	900	88,425.00	0.00
6	000651	格力电器	2,500	84,300.00	0.00
7	600585	海螺水泥	2,200	77,616.00	0.00
8	300750	宁德时代	100	53,400.00	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	600519	贵州茅台	191,299.00	0.01
2	300274	阳光电源	99,468.00	0.00
3	601166	兴业银行	98,900.00	0.00
4	000651	格力电器	97,400.00	0.00
5	600585	海螺水泥	96,757.00	0.00
6	603259	药明康德	94,380.00	0.00
7	000799	酒鬼酒	90,193.57	0.00

8	300750	宁德时代	53,747.00	0.00
---	--------	------	-----------	------

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

无

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	822,144.57
卖出股票收入（成交）总额	-

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。场内ETF 等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及ETF 所跟踪指数的综合评价挑选适合的ETF 投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的80%。报告期内，本集合计划投资运作符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	530021	建信纯债债券A	契约型 开放式	79,975,38 2.87	121,722,5 32.73	6.10	否
2	003258	博时富祥纯债债券A	契约型 开放式	78,722,06 8.52	81,556,06 2.99	4.09	否
3	004200	博时富瑞纯债债券A	契约型 开放式	77,482,52 2.54	81,348,90 0.41	4.08	否
4	003847	华安鼎丰债券	契约型 开放式	72,680,11 2.66	80,805,74 9.26	4.05	是

5	001299	兴业添利债券	契约型 开放式	79,143,25 2.86	80,757,77 5.22	4.05	否
6	100066	富国纯债债券发起A	契约型 开放式	73,305,25 4.45	80,496,49 9.91	4.04	否
7	160622	鹏华丰利债券(L OF)	契约型 开放式	78,237,82 1.19	79,254,91 2.87	3.97	否
8	003327	万家鑫璟纯债债券A	契约型 开放式	63,024,53 9.33	75,824,82 3.27	3.80	否
9	519188	万家信用恒利债券A	契约型 开放式	59,967,92 8.15	75,637,54 7.78	3.79	否
10	004441	富荣富兴纯债	契约型 开放式	49,996,33 0.32	61,245,50 4.64	3.07	否
11	675100	西部利得得尊债券A	契约型 开放式	40,821,97 8.05	45,577,73 8.49	2.29	否
12	002673	诺德货币B	契约型 开放式	40,924,39 5.69	40,924,39 5.69	2.05	否
13	004920	富国泓利纯债债券型发起式A	契约型 开放式	38,751,59 8.78	40,859,68 5.75	2.05	否
14	310339	申万菱信收益宝货币B	契约型 开放式	40,847,40 3.24	40,847,40 3.24	2.05	否
15	000329	鹏华丰饶定期开放债券	契约型 开放式	33,500,00 0.00	40,702,50 0.00	2.04	否
16	675111	西部利得汇享债券A	契约型 开放式	34,198,87 1.41	40,563,28 1.38	2.03	否
17	004705	南方祥元债券A	契约型 开放式	36,139,32 0.56	40,280,88 6.70	2.02	否
18	206018	鹏华产业债债券	契约型 开放式	35,745,30 8.31	40,213,47 1.85	2.02	否
19	003280	鹏华丰恒债券	契约型 开放式	36,129,52 7.59	40,009,83 8.85	2.01	否
20	000204	国富日日收益货币B	契约型 开放式	35,314,63 0.93	35,314,63 0.93	1.77	否
21	003264	新华活期添利货	契约型	30,531,30	30,531,30	1.53	否

		币B	开放式	3.60	3.60		
22	003267	新华壹诺宝货币 B	契约型 开放式	30,476,58 4.67	30,476,58 4.67	1.53	否
23	001871	前海开源货币B	契约型 开放式	29,695,18 7.99	29,695,18 7.99	1.49	否
24	003293	易方达科瑞灵活 配置混合	契约型 开放式	11,448,25 7.21	23,828,40 2.56	1.19	否
25	006533	易方达科融混合	契约型 开放式	6,702,31 9.38	21,302,65 1.92	1.07	否
26	519710	交银策略回报混 合	契约型 开放式	10,171,97 2.65	20,374,46 1.22	1.02	否
27	380005	中银纯债债券A	契约型 开放式	18,884,79 6.98	20,087,75 8.55	1.01	否
28	000183	嘉实丰益策略定 期债券	契约型 开放式	19,539,81 4.36	19,848,54 3.43	1.00	否
29	006973	太平睿盈混合A	契约型 开放式	17,772,14 9.65	19,281,00 5.16	0.97	否
30	519003	海富通收益增长 混合	契约型 开放式	7,655,11 5.20	19,160,75 3.35	0.96	否
31	519126	浦银安盛新经济 结构混合A	契约型 开放式	5,619,62 5.83	18,476,20 5.80	0.93	否
32	004958	圆信永丰优享生 活混合	契约型 开放式	8,388,52 4.11	18,460,62 5.01	0.93	否
33	166019	中欧价值智选混 合A	契约型 开放式	3,579,75 1.91	17,378,62 1.60	0.87	否
34	001955	中欧养老混合A	契约型 开放式	6,143,06 5.28	17,317,30 1.02	0.87	否
35	006773	国寿安保尊荣中 短债债券A	契约型 开放式	13,353,32 1.50	15,014,47 4.69	0.75	否
36	164902	交银信用添利债 券(LOF)	契约型 开放式	11,985,77 5.93	15,002,59 5.73	0.75	否
37	519002	华安安信消费混 合A	契约型 开放式	3,064,01 0.72	14,774,65 9.69	0.74	是

38	006609	申万菱信安泰瑞利中短债债券A	契约型 开放式	13,545,23 4.64	14,016,60 8.81	0.70	否
39	501064	国泰价值优选灵活配置混合(L0F)	契约型 开放式	3,301,85 2.52	10,941,34 8.70	0.55	否
40	001710	安信新趋势混合A	契约型 开放式	8,825,24 2.72	10,246,10 6.80	0.51	否
41	540003	汇丰晋信动态策略混合A	契约型 开放式	2,081,26 0.54	10,160,08 9.58	0.51	否
42	010208	平安日增利货币B	契约型 开放式	10,048,95 9.99	10,048,95 9.99	0.50	否
43	485107	工银添利债券A	契约型 开放式	7,460,38 4.96	10,011,09 0.58	0.50	否
44	004442	中欧康裕混合A	契约型 开放式	7,881,91 7.07	10,009,24 6.49	0.50	否
45	519752	交银新回报灵活配置混合A	契约型 开放式	6,471,84 4.66	10,005,47 1.84	0.50	否
46	420009	天弘安康颐养混合A	契约型 开放式	4,798,90 5.74	9,874,22 8.45	0.50	否
47	519738	交银周期回报灵活配置混合A	契约型 开放式	7,621,18 9.02	9,785,60 6.70	0.49	否
48	004100	鹏华安益增强混合	契约型 开放式	7,050,98 3.71	9,617,54 1.78	0.48	否
49	320018	诺安新动力灵活配置混合A	契约型 开放式	2,380,71 4.29	9,606,18 2.16	0.48	否
50	000054	鹏华双债增利债券	契约型 开放式	6,914,93 7.76	9,510,11 3.90	0.48	否
51	550002	中信保诚精萃成长混合A	契约型 开放式	9,313,52 4.59	9,267,88 8.32	0.46	否
52	519909	华安安顺灵活配置混合	契约型 开放式	2,352,70 5.88	9,079,09 1.99	0.46	是
53	320003	诺安先锋混合A	契约型 开放式	3,341,24 1.73	8,748,03 9.10	0.44	否

54	008657	景顺长城科技创新混合A	契约型 开放式	6,041,32 6.81	8,713,40 5.66	0.44	否
55	001224	中邮新思路灵活配置混合	契约型 开放式	2,715,64 3.67	8,676,48 1.53	0.44	否
56	110013	易方达科翔混合	契约型 开放式	1,665,66 7.17	8,419,94 7.54	0.42	否
57	001236	博时丝路主题股票A	契约型 开放式	2,644,97 3.54	5,676,11 3.22	0.28	否
58	720001	财通价值动量混合	契约型 开放式	1,104,64 0.98	5,399,48 5.11	0.27	否
59	570008	诺德周期策略混合	契约型 开放式	1,294,40 7.04	5,015,82 7.28	0.25	否
60	003751	万家瑞隆混合A	契约型 开放式	2,155,48 4.65	4,990,80 9.16	0.25	否
61	003634	嘉实农业产业股票A	契约型 开放式	2,352,13 8.52	4,907,97 2.24	0.25	否
62	515790	光伏ETF	契约型 开放式	2,893,30 0.00	4,895,46 3.60	0.25	否
63	510300	300ETF	契约型 开放式	926,600.0 0	4,177,11 2.80	0.21	否
64	510580	易方达中证500ETF	契约型 开放式	5,347,10 0.00	4,058,44 8.90	0.20	否
65	510050	50ETF	契约型 开放式	154,200.0 0	473,239.8 0	0.02	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	34,822.03
4	应收利息	-
5	应收申购款	590.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,412.51

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
国泰君安善融	15,157	129,106.11	50,002,250.05	2.56%	1,906,859,103.39	97.44%

稳健一年持有混合（FOF）A						
国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C	1,253	30,607.77	0.00	0.00%	38,351,538.14	100.00%
合计	16,410	121,585.19	50,002,250.05	2.51%	1,945,210,641.53	97.49%

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	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A	175,974.72	0.01%
	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C	16,573.12	0.04%
	合计	192,547.84	0.01%

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	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A	10~50
	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A	10~50
	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）A	国泰君安善融稳健一年持有混合（FOF）C
基金合同生效日(2021年12月28日)基金份额总额	1,956,828,851.85	38,318,666.25
本报告期期初基金份额总额	1,956,828,851.85	38,318,666.25
本报告期基金总申购份额	32,501.59	32,871.89
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,956,861,353.44	38,351,538.14

§ 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，托管人的专门基金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

本报告期内，本基金投资策略未发生变更。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期所持有的基金未发生具有重大影响的事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	822,144.57	100.00%	6,935.00	100.00%	-

10.8.2 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	-	-	-	-	-	-	62,211,175.30	100.00%

10.9 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	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
4	国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购和定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-23
5	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

	告	会指定网站、公司官网	
6	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
7	国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）2022年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-04-22
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季度报告提示性公告	证券时报	2022-04-22

§ 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、中国证监会准予国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件；
- 2、《国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、《国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）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