

# 国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2023 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月18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2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>7</b>
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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

<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产(基金净值)变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告 .....</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
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 .....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	43

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>48</b>
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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安价值精选混合发起	
基金主代码	016382	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 08 月 09 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	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	15,169,881.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安价值精选混合发起 A	国泰君安价值精选混合发起 C
下属分级基金的交易代码	016382	016383
报告期末下属分级基金的份额总额	10,101,075.32 份	5,068,806.13 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过宏观驱动、行业景气、估值比较三个维度，积极把握行业和个股机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将自上而下驱动与自下而上验证相结合，在分析和判断宏观经济发展趋势、经济周期和市场环境变化趋势的基础上，前瞻性的挖掘投资机会，精选个股。本基金的投资策略还包括资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	姜敏
	联系电话	021-38676022	4006800000
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		95521	95558
传真		021-38871190	010-85230024
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		陶耿	朱鹤新

## 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有限公司	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

## § 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（2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日）	
	国泰君安价值精选混合发起 A	国泰君安价值精选混合发起 C
本期已实现收益	-108,729.01	-62,778.69
本期利润	-503,499.71	-258,297.40

加权平均基金份额本期利润	-0.0500	-0.0514
本期加权平均净值利润率	-4.94%	-5.10%
本期基金份额净值增长率	-4.94%	-5.12%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-454,560.73	-245,315.28
期末可供分配基金份额利润	-0.0450	-0.0484
期末基金资产净值	9,646,514.59	4,823,490.85
期末基金份额净值	0.9550	0.9516
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-4.50%	-4.84%

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（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 国泰君安价值精选混合发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.82%	0.61%	1.17%	0.72%	-0.35%	-0.11%
过去三个月	-5.78%	0.72%	-4.07%	0.67%	-1.71%	0.05%
过去六个月	-4.94%	0.74%	-0.76%	0.68%	-4.18%	0.06%
自基金合同生效起至今	-4.50%	0.69%	-5.39%	0.82%	0.89%	-0.13%

#### 国泰君安价值精选混合发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.78%	0.61%	1.17%	0.72%	-0.39%	-0.11%
过去三个月	-5.88%	0.72%	-4.07%	0.67%	-1.81%	0.05%
过去六个月	-5.12%	0.74%	-0.76%	0.68%	-4.36%	0.06%
自基金合同生效起至今	-4.84%	0.69%	-5.39%	0.82%	0.55%	-0.13%

### 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

国泰君安价值精选混合发起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  
(2022年08月09日-2023年06月30日)



注：1、本基金于 2022 年 8 月 9 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

国泰君安价值精选混合发起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  
(2022年08月09日-2023年06月30日)



注：1、本基金于 2022 年 8 月 9 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、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、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 39 只公开募集证券投资基金。

#### 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	国泰君安品质生活混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金基金经理。现任公募权益投资部总经理助理。	2022-08-09	-	11 年	刘强，清华大学应用经济学硕士研究生。拥有 11 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任公募权益投资部总经理助理。
张昂	国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金基金经理，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。现任公募权益投资部基金经理。	2022-08-30	-	14 年	张昂，香港城市大学经济学硕士研究生，曾在国泰君安证券、川财证券、富国基金担任首席研究员、消费组组长、首席策略分析师职务。2017 年 3 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任投资研究院资深研究员、策略研究岗，2022

					年 4 月至今任公司公募权益投资部基金经理职务。
--	--	--	--	--	--------------------------

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、证券从业的含义遵从行业协会《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，因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 5 次。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

本基金在 2023 年上半年本着确定性+价值优选的角度，整个配置思路偏强周期，虽然中间也阶段性的参与了 AI 主题的投资，但始终认为即使是一轮确定的产业周期，短期的涨幅也过快过高，需要警惕风险，因此持有的时间并不长，净值整体表现并不突出。下半年来看，行业配置方面，仍将以复苏为主线，将重点关注新技术+顺周期带来的先进制造和国产替代等行业机会，实现组合的优化配置。我们将通过深度研究，结合基本面和估值，将仓位逐步集中到细分行业和最有进攻性个股上。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安价值精选混合发起 A 基金份额净值为 0.9550 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.94%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%；截至报告期末国泰君安价值精选混合发起 C 基金份额净值为 0.9516 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.12%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2023 年上半年，资本市场曙光初现，市场情绪和信心得到修复，A 股市场整体呈现震荡上升，上证指数累计上涨 3.7%。上半年中国经济温和复苏，海外经济存在韧性，A 股市场走出 2022 年三条线索压制后经历了强复苏与弱现实的再平衡，随后市场从复苏预期走向主题博弈的短期行情。中特估和 AI 智能主题主导短期交易走向极致化，市场风险偏好迅速上行。市值因子方面，中小盘占优；市场风格方面，稳定和成长风格领涨，金融和消费风格较弱。

展望 2023 年下半年，当前如火如荼的主题交易仍无法掩盖弱势的市场盈利预期，但我们很可能站在 A 股新一轮盈利周期底部：PPI、PMI 和 M1 三大领先指标已趋于见底回升，企业家预期明显改善；叠加本轮库存周期下行见底进入补库阶段，新一轮资本开支周期已突破底部区间，这无一不对应着企业盈利增速或已见底，2023 年第三季度有望开启新一轮盈利上升周期。同时，估值维度如出一辙得指向指数正处在中长期盈利支撑区间，拐点之日可待。目前或是 A 股分子端的黎明前夜，不同于 2023 年上半年市场情绪的踽踽独行，2023 年下半年有望迎来市场情绪和企业盈利共振的双升力。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配

#### 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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

## § 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在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

本托管人认为，上海国泰君安证券资产管理有限公司在国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金的投资运作、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，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，上海国泰君安证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年中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 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,299,295.75	2,061,295.24
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	11,244,784.54	11,572,751.09

其中：股票投资		11,244,784.54	11,572,751.09
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	6.4.7.3	-	1,506,580.53
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		300.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.4	-	-
资产总计		14,544,380.29	15,140,626.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			

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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,768.06	19,160.87
应付托管费		2,961.33	3,193.50
应付销售服务费		1,577.19	1,702.06
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	52,068.27	25,000.00
负债合计		74,374.85	49,056.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	15,169,881.45	15,030,235.38
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	-699,876.01	61,335.05
净资产合计		14,470,005.44	15,091,570.43
负债和净资产总计		14,544,380.29	15,140,626.86

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 15,169,881.45 份。其中国泰君安价值精选混合发起 A 基金份额净值 0.9550 元，基金份额总额 10,101,075.32 份；国泰君安价值精选混合发起 C 基金份额净值 0.9516 元，基金份额总额 5,068,806.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-567,061.69
1. 利息收入		7,731.71
其中：存款利息收入	6.4.7.8	5,197.53
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		2,534.18
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,398.70
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-88,076.37
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	6.4.7.10	103,475.07
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	-590,289.41

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 12	97. 31
<b>减：二、营业总支出</b>		194, 735. 42
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	113, 550. 36
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	18, 925. 05
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	10, 056. 74
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. 13	52, 203. 27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-761, 797. 11
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-761, 797. 11
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-761, 797. 11

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 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）	15, 030, 235. 38	-	61, 335. 05	15, 091, 570. 43
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）	15,030,235.38	-	61,335.05	15,091,570.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	139,646.07	-	-761,211.06	-621,564.99
（一）、综合收益总额	-	-	-761,797.11	-761,797.11
（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）	139,646.07	-	586.05	140,232.12
其中：1. 基金申购款	161,346.28	-	238.06	161,584.34
2. 基金赎回款	-21,700.21	-	347.99	-21,352.22
（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）	15,169,881.45	-	-699,876.01	14,470,005.44

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

国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2022】1539号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费,将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为15,019,988.14份,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证。《国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2022年8月9日正式生效。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定,本基金的投资范围包括内地依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他依法发行、上市)的股票、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票(以下简

称“港股通股票”）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

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，本基金可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通股票不超过股票资产的 40%）；每个交易日日终，扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

#### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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》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

本基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2023 年 06 月 30 日
活期存款	365,763.26
等于：本金	365,732.82
加：应计利息	30.44
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	2,933,532.49
等于：本金	2,933,257.06
加：应计利息	275.43
减：坏账准备	-
合计	3,299,295.75

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	12,040,095.44	-	11,244,784.54	-795,310.90
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	12,040,095.44	-	11,244,784.54	-795,310.90

### 6.4.7.3 买入返售金融资产

#### 6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

#### 6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	39,671.58
预提审计费	12,396.69
合计	52,068.27

### 6.4.7.6 实收基金

#### 国泰君安价值精选混合发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,020,133.79	10,020,133.79
本期申购	90,108.30	90,108.30
本期赎回（以“-”号填列）	-9,166.77	-9,166.77
本期末	10,101,075.32	10,101,075.32

#### 国泰君安价值精选混合发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,010,101.59	5,010,101.59
本期申购	71,237.98	71,237.98
本期赎回 (以“-”号填列)	-12,533.44	-12,533.44
本期末	5,068,806.13	5,068,806.13

注：申购含红利再投、份额转换入、份额升降级等原因导致的份额调增，赎回含份额转换出、份额升降级等原因导致的份额调减。

#### 6.4.7.7 未分配利润

##### 国泰君安价值精选混合发起 A

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
上年度末	183,005.61	-136,824.36	46,181.25
本期利润	-108,729.01	-394,770.70	-503,499.71
本期基金份额交易产生的变动数	3,465.64	-707.91	2,757.73
其中：基金申购款	3,768.49	-919.21	2,849.28
基金赎回款	-302.85	211.30	-91.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,742.24	-532,302.97	-454,560.73

##### 国泰君安价值精选混合发起 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
上年度末	83,528.72	-68,374.92	15,153.80
本期利润	-62,778.69	-195,518.71	-258,297.40
本期基金份额交易产生的变动数	302.42	-2,474.10	-2,171.68
其中：基金申购款	468.71	-3,079.93	-2,611.22
基金赎回款	-166.29	605.83	439.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,052.45	-266,367.73	-245,315.28

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	564.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,633.32

结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5,197.53

#### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	35,926,440.09
减：卖出股票成本总额	35,919,157.63
减：交易费用	95,358.83
买卖股票差价收入	-88,076.37

#### 6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	103,475.07
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	103,475.07

#### 6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-590,289.41
——股票投资	-590,289.41
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-590,289.41

#### 6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	97.31
合计	97.31

#### 6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	135
合计	52,203.27

#### 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
上海国泰君安证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰君安资管”)	基金管理人
中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)	基金托管人
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

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	72,107,920.58	100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	2,349,000.00	100.00%

###### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	52,137.33	100.00%	0.00	0.00%

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。

##### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	113,550.36
其中：支付销售机构的客户维护费	0

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：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年实际天数}$$

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 2022 年 8 月 9 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	18,925.05

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年实际天数}$$

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 2022 年 8 月 9 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安价值精选混合发起 A	国泰君安价值精选混合发起 C	合计
上海国泰君安证券资产管理有限公司	-	10,036.50	10,036.50
合计	-	10,036.50	10,036.50

注：本基金国泰君安价值精选混合发起 A 基金份额不收取销售服务费，国泰君安价值精选混合发起 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

国泰君安价值精选混合发起 C 的销售服务费按前一日国泰君安价值精选混合发起 C 资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算公式为：国泰君安价值精选混合发起 C 基金日销售服务费 = 国泰君安价值精选混合发起 C 基金份额前一日资产净值 × 0.40% / 当年天数。

本基金合同生效日为 2022 年 8 月 9 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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 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自有资金投资本基金的情况

##### 国泰君安价值精选混合发起 A

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 09 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	10,009,000.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	99.09%

##### 国泰君安价值精选混合发起 C

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 09 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	5,010,000.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	98.84%

#### 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

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期内及上年度末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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	365,763.26	564.21
国泰君安证券股份有限公司	2,933,532.49	4,633.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券保管，按协议约定利率计息。

#### 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

本基金本报告期无须做说明的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

无

#### 6.4.12 期末（2023 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/增发证券而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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

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、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中信银行股份有限公司,其他银行存款为国泰君安证券券商保证金,与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 6 月 30 日,本基金未持有信用类债券(2022 年 12 月 31 日:本基金未持有信用类债券)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的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

可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,299,295.75	-	-	-	3,299,295.75
交易性金融资产	-	-	-	11,244,784.54	11,244,784.54

应收申购款	-	-	-	300.00	300.00
资产总计	3,299,295.75	-	-	11,245,084.54	14,544,380.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,768.06	17,768.06
应付托管费	-	-	-	2,961.33	2,961.33
应付销售服务费	-	-	-	1,577.19	1,577.19
其他负债	-	-	-	52,068.27	52,068.27
负债总计	-	-	-	74,374.85	74,374.85
利率敏感度缺口	3,299,295.75	-	-	11,170,709.69	14,470,005.44
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,061,295.24	-	-	-	2,061,295.24
交易性金融资产	-	-	-	11,572,751.09	11,572,751.09
买入返售金融资产	1,506,580.53	-	-	-	1,506,580.53
资产总计	3,567,875.77	-	-	11,572,751.09	15,140,626.86
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	19,160.87	19,160.87
应付托管费	-	-	-	3,193.50	3,193.50
应付销售服务费	-	-	-	1,702.06	1,702.06
其他负债	-	-	-	25,000.00	25,000.00
负债总计	-	-	-	49,056.43	49,056.43
利率敏感度缺口	3,567,875.77	-	-	11,523,694.66	15,091,570.43

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2022 年 12 月 31 日: 0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2022 年 12 月 31 日: 同)

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的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 2023 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	-	211,336.26	-	211,336.26
资产合计	-	211,336.26	-	211,336.26
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	-	211,336.26	-	211,336.26
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金的所有资产及负债以人民币计价。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口		
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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

港币相对人民币贬值 1%	-2,113.36	-
港币相对人民币升值 1%	2,113.36	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	11,244,784.54	77.71	11,572,751.09	76.68
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	11,244,784.54	77.71	11,572,751.09	76.68

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	11,244,784.54	11,572,751.09
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	11,244,784.54	11,572,751.09

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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	11,244,784.54	77.31
	其中：股票	11,244,784.54	77.31
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	3,299,295.75	22.68
8	其他各项资产	300.00	0.00
9	合计	14,544,380.29	100.00

## 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	878,509.00	6.07
B	采矿业	1,108,618.00	7.66
C	制造业	5,779,542.52	39.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	220,382.00	1.52
F	批发和零售业	133,102.00	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	674,858.00	4.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,420.00	0.42
J	金融业	1,478,292.00	10.22
K	房地产业	138,798.00	0.96
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	559,926.76	3.87
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	11,033,448.28	76.25

### 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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	211,336.26	1.46

合计	211,336.26	1.46
----	------------	------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	占基金资产净值比例 (%)
1	601988	中国银行	130,000	508,300.00	3.51
1	03988	中国银行	73,000	211,336.26	1.46
2	601816	京沪高铁	128,300	674,858.00	4.66
3	688308	欧科亿	15,914	636,560.00	4.40
4	601882	海天精工	15,800	526,140.00	3.64
5	601088	中国神华	14,400	442,800.00	3.06
6	300498	温氏股份	21,600	396,360.00	2.74
7	688059	华锐精密	4,504	377,210.00	2.61
8	688046	药康生物	19,442	376,980.38	2.61
9	000923	河钢资源	27,500	371,250.00	2.57
10	600309	万华化学	4,000	351,360.00	2.43
11	601717	郑煤机	26,500	329,925.00	2.28
12	601398	工商银行	59,000	284,380.00	1.97
13	002182	云海金属	12,400	272,676.00	1.88
14	300842	帝科股份	2,700	246,888.00	1.71
15	601628	中国人寿	6,900	241,224.00	1.67
16	603477	巨星农牧	6,900	230,115.00	1.59
17	603901	永创智能	15,200	221,312.00	1.53
18	601800	中国交建	20,200	220,382.00	1.52
19	300750	宁德时代	900	205,911.00	1.42
20	688981	中芯国际	3,987	201,423.24	1.39
21	688265	南模生物	4,889	182,946.38	1.26
22	600256	广汇能源	26,500	181,790.00	1.26
23	601336	新华保险	4,800	176,496.00	1.22
24	600166	福田汽车	46,300	157,420.00	1.09
25	300011	鼎汉技术	20,200	148,672.00	1.03
26	002850	科达利	1,100	145,475.00	1.01
27	688558	国盛智科	4,028	144,041.28	1.00
28	600085	同仁堂	2,500	143,900.00	0.99
29	601288	农业银行	40,400	142,612.00	0.99
30	600975	新五丰	14,900	142,444.00	0.98
31	600141	兴发集团	6,400	142,208.00	0.98
32	600118	中国卫星	5,000	141,050.00	0.97
33	300733	西菱动力	9,200	138,828.00	0.96

34	000002	万科 A	9,900	138,798.00	0.96
35	600685	中船防务	4,600	137,770.00	0.95
36	688037	芯源微	796	136,076.20	0.94
37	600153	建发股份	12,200	133,102.00	0.92
38	002466	天齐锂业	1,900	132,829.00	0.92
39	601318	中国平安	2,700	125,280.00	0.87
40	002840	华统股份	8,000	125,120.00	0.86
41	601225	陕西煤业	6,200	112,778.00	0.78
42	300558	贝达药业	2,300	110,469.00	0.76
43	002714	牧原股份	2,600	109,590.00	0.76
44	300408	三环集团	3,700	108,595.00	0.75
45	603236	移远通信	1,680	96,952.80	0.67
46	603986	兆易创新	900	95,625.00	0.66
47	300260	新莱应材	2,340	92,476.80	0.64
48	603690	至纯科技	2,280	79,435.20	0.55
49	603516	淳中科技	3,200	70,560.00	0.49
50	002045	国光电器	3,900	62,634.00	0.43
51	301269	华大九天	500	61,420.00	0.42

## 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	601628	中国人寿	1,008,650.00	6.68
2	601398	工商银行	757,492.00	5.02
3	688558	国盛智科	702,111.94	4.65
4	601233	桐昆股份	695,810.00	4.61
5	600256	广汇能源	683,368.00	4.53
6	601601	中国太保	601,258.00	3.98
7	603259	药明康德	600,391.00	3.98
8	601668	中国建筑	555,446.00	3.68
9	002714	牧原股份	533,833.00	3.54
10	002643	万润股份	531,042.00	3.52
11	601988	中国银行	515,870.00	3.42
12	601882	海天精工	505,435.00	3.35
13	600036	招商银行	471,363.00	3.12
14	600276	恒瑞医药	468,523.00	3.10
15	603477	巨星农牧	459,160.00	3.04
16	601186	中国铁建	451,065.00	2.99
17	601728	中国电信	436,249.00	2.89

18	603019	中科曙光	430,604.00	2.85
19	601088	中国神华	424,992.00	2.82
20	600941	中国移动	412,906.00	2.74
21	002129	TCL 中环	392,312.00	2.60
22	688308	欧科亿	389,608.68	2.58
23	688046	药康生物	387,516.63	2.57
24	300558	贝达药业	385,679.00	2.56
25	300408	三环集团	383,932.00	2.54
26	600309	万华化学	380,751.00	2.52
27	601717	郑煤机	376,475.00	2.49
28	300604	长川科技	372,529.00	2.47
29	603986	兆易创新	362,866.00	2.40
30	688059	华锐精密	361,396.50	2.39
31	600975	新五丰	359,883.00	2.38
32	000923	河钢资源	356,432.00	2.36
33	300842	帝科股份	356,378.00	2.36
34	300750	宁德时代	344,625.00	2.28
35	600732	爱旭股份	316,667.00	2.10
36	601939	建设银行	314,515.00	2.08
37	300316	晶盛机电	311,065.00	2.06
38	603806	福斯特	310,134.00	2.06
39	002182	云海金属	309,686.00	2.05
40	002840	华统股份	308,837.00	2.05
41	601658	邮储银行	307,632.00	2.04
42	605589	圣泉集团	306,724.00	2.03
43	688777	中控技术	305,856.00	2.03
44	600938	中国海油	304,425.00	2.02
45	002555	三七互娱	304,403.00	2.02
46	688265	南模生物	304,210.83	2.02

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 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

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	601668	中国建筑	1,053,821.00	6.98
2	601186	中国铁建	1,001,260.00	6.63
3	002714	牧原股份	791,733.00	5.25
4	601628	中国人寿	727,127.00	4.82
5	002643	万润股份	715,723.00	4.74
6	601233	桐昆股份	676,072.00	4.48

7	605589	圣泉集团	610,105.00	4.04
8	300124	汇川技术	596,048.00	3.95
9	603105	芯能科技	595,120.00	3.94
10	601882	海天精工	591,598.00	3.92
11	688558	国盛智科	579,619.73	3.84
12	601601	中国太保	565,153.00	3.74
13	603259	药明康德	563,119.00	3.73
14	601398	工商银行	553,411.00	3.67
15	601988	中国银行	540,585.00	3.58
16	688059	华锐精密	482,327.26	3.20
17	600276	恒瑞医药	481,347.00	3.19
18	688777	中控技术	461,289.95	3.06
19	600036	招商银行	460,173.00	3.05
20	601728	中国电信	437,865.00	2.90
21	603019	中科曙光	432,414.00	2.87
22	688033	天宜上佳	429,346.38	2.84
23	002129	TCL 中环	424,864.00	2.82
24	002585	双星新材	424,070.00	2.81
25	300416	苏试试验	418,350.00	2.77
26	600941	中国移动	402,298.00	2.67
27	600256	广汇能源	388,340.00	2.57
28	688265	南模生物	378,897.94	2.51
29	300604	长川科技	374,072.00	2.48
30	688017	绿的谐波	334,661.82	2.22
31	601939	建设银行	326,646.00	2.16
32	002555	三七互娱	326,462.00	2.16
33	603477	巨星农牧	317,373.00	2.10
34	688046	药康生物	311,404.59	2.06
35	600938	中国海油	311,282.00	2.06
36	601689	拓普集团	308,456.00	2.04
37	603416	信捷电气	308,277.00	2.04
38	601009	南京银行	307,400.00	2.04
39	002624	完美世界	305,347.00	2.02
40	600563	法拉电子	303,984.00	2.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 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	36,181,480.49
卖出股票收入（成交）总额	35,926,440.09

注：买入股票成本（成交）总额和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以

成交数量) 填列, 不考虑相关费用。

## 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

本基金可投资股指期货。若本基金投资股指期货, 将根据风险管理的原则, 以套期保值为主要目的, 综合考虑流动性、基差水平、与股票组合相关度等因素, 以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

## 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

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货, 将根据风险管理的原则, 以套期保值为主要目的, 综合考虑流动性、基差水平、与债券组合相关度等因素, 以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体中国银行股份有限公司，2023 年 2 月因贷款违规，被中国银行保险监督管理委员会处以罚款的处罚。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	300.00

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末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	户均持有的	持有人结构
------	------	-------	-------

	数（户）	基金份额	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
国泰君安价值精选混合发起 A	13	777,005.79	10,009,000.00	99.09%	92,075.32	0.91%
国泰君安价值精选混合发起 C	19	266,779.27	5,010,000.00	98.84%	58,806.13	1.16%
合计	32	474,058.80	15,019,000.00	99.01%	150,881.45	0.99%

## 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	国泰君安价值精选混合发起 A	77,752.43	0.7697%
	国泰君安价值精选混合发起 C	197.76	0.0039%
	合计	77,950.19	0.5138%

## 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	国泰君安价值精选混合发起 A	-
	国泰君安价值精选混合发起 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安价值精选混合发起 A	0~10
	国泰君安价值精选混合发起 C	-
	合计	0~10

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	15,019,000.00	99.01%	15,019,000.00	99.01%	自基金合同生效日起不少于 3 年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	77,645.10	0.51%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	305.09	0.00%	-	-	-
合计	15,096,950.19	99.52%	15,019,000.00	99.01%	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安价值精选混合发起 A	国泰君安价值精选混合发起 C
基金合同生效日（2022 年 08 月 09 日）基金份额总额	10,009,988.14	5,010,000.00
本报告期期初基金份额总额	10,020,133.79	5,010,101.59
本报告期基金总申购份额	90,108.30	71,237.98
减：本报告期基金总赎回份额	9,166.77	12,533.44
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,101,075.32	5,068,806.13

## § 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：

本基金管理人于 2023 年 04 月 08 日发布公告，上海国泰君安证券资产管理有限公司法定代表人变更为陶耿先生，相关工商变更手续已于 2023 年 04 月 06 日在上海市场监督管理局办理完毕。

2、本报告期内本基金托管人重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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	
国泰君安证券股份有限公司	2	72,107,920.58	100.00%	52,137.33	100.00%	-

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	2,349,000.00	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	国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金 2022 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-01-20
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-01-20
3	国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-03-31
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告	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	2023-04-08
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与直销 APP 费率优惠活动的公告	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	2023-04-17
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-04-22
8	国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23

度报告		
-----	--	--

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230630	15,019,000.00	-	-	15,019,000.00	99.01%

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延缓赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本报告截止日至报告批准送出日之间，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等法律文件的相关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 24 日起，调低本基金的管理费率和托管费率并相应修订法律文件。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金注册的批复；

- 2、《国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照；
- 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  
二〇二三年八月三十一日