

国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划

2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。

集合计划托管人中国建设银行股份有限公司根据本集合计划合同约定，于2021年8月20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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划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2021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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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
§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	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
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54
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	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57

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	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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集合资产管理计划	
基金简称	国君资管君得鑫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	3,916,475,609.07份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国君资管君得鑫2年期混合A	国君资管君得鑫2年期混合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	803,703,562.49份	3,112,772,046.58份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划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，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划根据泛价值投资策略进行个股的甄选，在个股甄选的基础上进行行业、风格的均衡配置。在大类资产比较方面，采取定性与定量相结合的方式，依据宏观风险溢价等模型决定权益资产的比例。
业绩比较基准	$60\% \times \text{沪深300指数收益率} + 30\% \times \text{一年期银行定期存款利率} + 10\% \times \text{恒生指数收益率}$
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划，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	李艳	李申
	联系电话	021-38676631	021-60637102
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	lishen.zh@ccb.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		上海市静安区新闻路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		江伟	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	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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	国君资管君得鑫2年期混合A	国君资管君得鑫2年期混合C
本期已实现收益	334,497,065.88	1,149,430,254.66
本期利润	124,940,176.47	446,175,352.03
加权平均基金份额本期利润	0.1408	0.1439
本期加权平均净值利润率	5.72%	5.80%
本期基金份额净值增长率	5.61%	5.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	国君资管君得鑫2年期混合A	国君资管君得鑫2年期混合C
期末可供分配利润	1,238,656,292.52	4,869,317,216.88
期末可供分配基金份额利润	1.5412	1.5643
期末基金资产净值	2,042,359,855.01	7,982,089,263.46
期末基金份额净值	2.5412	2.5643
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	国君资管君得鑫2年期混合A	国君资管君得鑫2年期混合C
基金份额累计净值增长率	48.52%	48.24%

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

国君资管君得鑫2年期混合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	①-③	②-④
----	--------------	---------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

				④		
过去一个月	-0.31%	0.72%	-1.27%	0.53%	0.96%	0.19%
过去三个月	5.61%	0.76%	2.42%	0.64%	3.19%	0.12%
过去六个月	5.61%	0.98%	1.20%	0.87%	4.41%	0.11%
过去一年	27.52%	1.14%	17.65%	0.87%	9.87%	0.27%
自基金合同 生效起至今	48.52%	1.30%	16.85%	0.94%	31.67%	0.36%

国君资管君得鑫2年期混合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	-0.25%	0.72%	-1.27%	0.53%	1.02%	0.19%
过去三个月	5.78%	0.76%	2.42%	0.64%	3.36%	0.12%
过去六个月	5.95%	0.98%	1.20%	0.87%	4.75%	0.11%
过去一年	28.36%	1.14%	17.65%	0.87%	10.71%	0.27%
自基金合同 生效起至今	48.24%	1.21%	19.73%	0.90%	28.51%	0.31%

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

国君资管君得鑫2年期混合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-2021年06月30日)



国君资管君得鑫2年期混合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-2021年06月30日)



注：2020 年 2 月 6 日，我司发布的《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划 C 类份额开放日常申购、赎回业务公告》中提示：“君得鑫 C 类（代码：952099）份额的首日（即 2020 年 2 月 12 日）集合计划净值同原国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划转换而来的本集合计划 A 类份额净值，之后 C 类份额的净值将按照《管理合同》约定的方法计算。”

§ 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2021年6月30日，本集合计划管理人共管理了7只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：国泰君安君得明混合型集合资产管理计划、国泰君安君得盛债券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、国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划、国泰君安君得惠中债1-3年政策性金融债指数集合资产管理计划、国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划和国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划。

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		
张骏	基金投资部副总经理，本产品的投资经理，国泰君安君得明混合型集合资产管理计划、“君享弘利系列”等产品的投资经理	2020-01-06	-	20年	上海交通大学金融学学士，CFA，2011年10月至2018年3月任国泰君安证券资产管理有限公司投资管理部高级投资经理、副总经理。2012年9月起任国泰君安君得明（原明星价值）投资经理。2012年9月至2018年5月任国泰君安君享富利投资经理。2013年2月至2017年9月任国泰君安君得稳一号投资经理。2013年12月起任国泰君安君享

					弘利投资经理。2014年9月起任国泰君安君得鑫投资经理。2014年11月起任国泰君安君享弘利二号投资经理。2015年3月起任国泰君安君享弘利三号投资经理。2015年3月起任国泰君安君享弘利五号投资经理。2015年11月起任国泰君安君享同利投资经理。2018年4月起任国泰君安君享弘利6号投资经理。
周晨	本产品的投资经理，国泰君安君得明混合型集合资产管理计划、国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划、国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划、国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划的投资经理	2020-01-06	-	10年	北京大学金融学硕士，2010年8月至2018年6月任国泰君安证券资产管理公司研究发展部研究员、高级研究员、资深研究员。2018年8月起任国泰君安君得鑫投资经理。2019年2月起任国泰君安君得明（原明星价值）投资经理。2019年6月起任国泰君安君得诚（原君得稳一号）投资经理。2020年6月起任国泰君安君得盛投资经理。2020年4月21日至2020年6月6日、2020年6月23日起任国泰君安君得惠二号投资经理。

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、相关规定以及集合计划合同、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集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，

本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同、招募说明书约定的行为，无侵害计划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，本集合计划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，未发现本集合计划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

2021年上半年市场风格分化显著，沪深300上涨0.24%，上证指数上涨3.40%，创业板指上涨17.22%。

一季度，权益市场出现剧烈波动，主要原因是在经济复苏与通胀上行的预期下，流动性预期收紧，而美债收益率的快速上行成为权益市场下跌的导火索。结构上来看，19-20年不断推高的核心资产估值溢价在一季度快速回落。二季度，随着经济活动不断上行以及相对充沛的流动性，权益市场出现了一轮明显的估值修复。结构上来看，周期能源、电动车、半导体等行业表现较好，家电、保险等出现较大幅度调整。

上半年，本基金的仓位略有提升，沿着我们既定的投资策略，主要从两个方向进行个股的选择，一是行业内具备竞争优势、商业模式清晰、估值合理的企业；二是阶段性明显低估的企业。并且根据风险收益比不断平衡组合内的标的，使得组合的收益、回撤相对稳健可控。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国君资管君得鑫2年期混合A基金份额净值为2.5412元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.61%，同期业绩比较基准收益率为1.20%；截至报告期末国君资管君得鑫2年期混合C基金份额净值为2.5643元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.95%，同期业绩比较基准收益率为1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情反复冲击下，国内外主要经济体都在不断的进行货币宽松，在可以预见的未来，疫情很可能无法完全消失在我们的生活中。这意味着疫情的冲击很难完全结束，相对宽松的货币环境或将继续陪伴我们。

国内上市公司的景气在海外疫情的不断爆发下持续延续下去。而国内消费升级和产业升级都在不断的进行中，新能源、电动车以及半导体为代表的成长股的爆发正是国内制造业沿着产业复杂程度不断攀升的结果。

市场的风格或许有波动，我们无法判断短期的风格，但是我们知道个股收益率长期来看大致与企业ROE的水平相当，因此我们要做的仍然是挑选出高质量的企业，持续跟踪其竞争优势的变化，以企业长期盈利为主线，保持稳健的投资组合，伴随优秀公司共同成长。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划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

本集合计划本报告期末进行收益分配。

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

本报告期内未出现连续二十个工作日集合计划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集合计划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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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集合资产管理计划

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,259,600,583.07	1,370,494,849.53
结算备付金		5,183,845.29	7,752,445.94
存出保证金		1,067,503.49	643,075.83
交易性金融资产	6.4.7.2	8,824,101,373.72	8,713,690,537.92
其中：股票投资		8,824,101,373.72	8,713,690,537.92
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		14,733,518.67	-
应收利息	6.4.7.3	242,031.46	289,236.79

应收股利		1,711,337.34	-
应收申购款		861,704.39	159,211.77
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		10,107,501,897.43	10,093,029,357.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		24,142,336.17	8,456,902.64
应付赎回款		8,344,429.80	7,808,296.21
应付管理人报酬		6,511,955.31	6,718,125.14
应付托管费		1,723,923.47	1,767,608.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	3,165,466.83	3,420,033.93
应交税费		35,957,260.37	80,513,748.64
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	3,207,407.01	3,169,378.01
负债合计		83,052,778.96	111,854,093.11
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.6	3,916,475,609.07	4,129,919,247.22
未分配利润	6.4.7.7	6,107,973,509.40	5,851,256,017.45
所有者权益合计		10,024,449,118.47	9,981,175,264.67
负债和所有者权益总计		10,107,501,897.43	10,093,029,357.78

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额3,916,475,609.07 份，下属分级基金：国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划A类份额净值2.5412元，份额总额803,703,562.49份。国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划C类份额净值2.5643元，份额总额3,112,772,046.58份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月06日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
一、收入		638,042,353.99	1,235,821,372.71
1. 利息收入		4,666,489.80	3,389,645.38
其中：存款利息收入	6.4.7.8	4,666,489.80	3,389,645.38
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）		1,546,186,965.77	245,200,895.59
其中：股票投资收益	6.4.7.9	1,482,299,771.46	185,548,232.12
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	63,887,194.31	59,652,663.47

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 11	-912, 811, 792. 04	986, 072, 330. 99
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	690. 46	1, 158, 500. 75
减：二、费用		66, 926, 825. 49	55, 664, 642. 35
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	35, 935, 295. 36	29, 304, 645. 09
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	10, 348, 275. 89	7, 541, 575. 04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 13	15, 196, 472. 56	12, 659, 737. 66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 14	5, 446, 781. 68	6, 158, 684. 56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		571, 115, 528. 50	1, 180, 156, 730. 36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		571, 115, 528. 50	1, 180, 156, 730. 36

6.3 所有者权益（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集合资产管理计划

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	4, 129, 919, 247. 22	5, 851, 256, 017. 4	9, 981, 175, 264. 67

(基金净值)		5	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	571, 115, 528. 50	571, 115, 528. 50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-213, 443, 638. 15	-314, 398, 036. 55	-527, 841, 674. 70
其中: 1. 基金申购款	26, 479, 122. 22	39, 541, 619. 85	66, 020, 742. 07
2. 基金赎回款	-239, 922, 760. 37	-353, 939, 656. 40	-593, 862, 416. 77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3, 916, 475, 609. 07	6, 107, 973, 509. 40	10, 024, 449, 118. 47
项 目	上年度可比期间 2020年01月06日(基金合同生效日)至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2, 190, 889, 856. 68	1, 558, 499, 162. 42	3, 749, 389, 019. 10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1, 180, 156, 730. 36	1, 180, 156, 730. 36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2, 241, 522, 543. 17	1, 677, 011, 380. 00	3, 918, 533, 923. 17
其中: 1. 基金申购款	3, 112, 612, 648. 41	2, 294, 224, 653. 92	5, 406, 837, 302. 33
2. 基金赎回	-871, 090, 105. 24	-617, 213, 273. 92	-1, 488, 303, 379. 16

款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,432,412,399.85	4,415,667,272.78	8,848,079,672.63

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：

江伟

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”）由国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划变更而来，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，国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《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》自集合计划管理人公布的生效之日起生效，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。

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本集合计划前，需充分了解本集合计划的产品特性，并承担集合计划投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成

的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于集合计划投资人连续大量赎回集合计划份额产生的流动性风险，管理人在集合计划管理实施过程中产生的集合计划管理风险，本集合计划的特定风险等。

本集合计划可投资于股指期货、国债期货、股票期权。股指期货、国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。投资股票期权所面临的主要风险是股票期权价格波动带来的市场风险；因保证金不足、备兑证券数量不足或持仓超限而导致的强行平仓风险；股票期权具有高杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失；包括对手方风险和连带风险在内的第三方风险；以及各类操作风险。

本集合计划可投资于资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。

本集合计划参与内地与香港股票市场交易互联互通机制（以下简称“港股通机制”）下港股通相关业务，集合计划资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股或选择不将集合计划资产投资于港股，集合计划资产并非必然投资港股。

本集合计划可投资于科创板股票，科创板股票的特有风险包括：科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。此外，科创板企业可

能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

本集合计划为逐笔计提业绩报酬的集合计划，由于管理人可能计提业绩报酬，投资者实际赎回份额净值可能低于每日披露的集合计划份额净值。投资者实际赎回金额，以登记机构确认数据为准。

本集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资者投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》（财政部令第33号发布、财政部令第76号修订）、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会公告（2010）5号的规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本计划2021年6月30日的财务状况以及2021年1-6月的经营成果和所有者权益（计划净值）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

本集合计划本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外，与最近一期年度报告相一致。

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 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

产品管理人运用产品买卖股票税率为1%，为单边征收。

2、增值税

参照财政部、税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》：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。

3、企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

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 2021年06月30日
活期存款	1,259,600,583.07
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	1,259,600,583.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,804,397,417.96	8,824,101,373.72	1,019,703,955.76

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		7,804,397,417.96	8,824,101,373.72	1,019,703,955.76

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	233,885.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	8,145.74
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	242,031.46

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
----	--------------------

交易所市场应付交易费用	3,165,466.83
银行间市场应付交易费用	—
合计	3,165,466.83

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	199,343.16
其他应付	3,008,063.85
合计	3,207,407.01

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 国君资管君得鑫2年期混合A

金额单位：人民币元

项目 (国君资管君得鑫2年期混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,043,626,322.86	1,043,626,322.86
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	-239,922,760.37	-239,922,760.37
本期末	803,703,562.49	803,703,562.49

6.4.7.6.2 国君资管君得鑫2年期混合C

金额单位：人民币元

项目 (国君资管君得鑫2年期混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,086,292,924.36	3,086,292,924.36
本期申购	26,479,122.22	26,479,122.22

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,112,772,046.58	3,112,772,046.58

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 国君资管君得鑫2年期混合A

单位：人民币元

项目 (国君资管君得鑫2年期混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,279,880,486.39	187,775,286.06	1,467,655,772.45
本期利润	334,497,065.88	-209,556,889.41	124,940,176.47
本期基金份额交易产生的变动数	-338,795,695.50	-15,143,960.90	-353,939,656.40
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-338,795,695.50	-15,143,960.90	-353,939,656.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,275,581,856.77	-36,925,564.25	1,238,656,292.52

6.4.7.7.2 国君资管君得鑫2年期混合C

单位：人民币元

项目 (国君资管君得鑫2年期混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,826,407,136.41	557,193,108.59	4,383,600,245.00
本期利润	1,149,430,254.66	-703,254,902.63	446,175,352.03
本期基金份额交易产生的变动数	39,097,712.39	443,907.46	39,541,619.85
其中：基金申购款	39,097,712.39	443,907.46	39,541,619.85
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,014,935,103.46	-145,617,886.58	4,869,317,216.88

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	4,531,180.80
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	119,868.21
其他	15,440.79
合计	4,666,489.80

注：其他包括结算保证金利息收入。

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 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	5,641,084,908.29
减：卖出股票成本总额	4,158,785,136.83
买卖股票差价收入	1,482,299,771.46

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	63,887,194.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	63,887,194.31

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
------	-------------------------------

1. 交易性金融资产	-943,581,550.64
——股票投资	-943,581,550.64
——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	-30,769,758.60
合计	-912,811,792.04

6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	690.46
合计	690.46

6.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	15,196,472.56
银行间市场交易费用	-
合计	15,196,472.56

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
银行费用	13,790.27
帐户维护费	18,600.00
增值税及附加税	5,335,048.25
合计	5,446,781.68

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，本集合计划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，本集合计划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

本报告期内本公司不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。

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	集合计划管理人
国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”）	集合计划管理人的股东、代销机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）	集合计划托管人

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月06日（基金合同生效日）
-------	-------------------------------	---------------------------------

			至2020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	10,765,231,696.45	100.00%	10,368,631,422.35	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年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	7,859,633.83	100.00%	3,165,466.83	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020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	7,187,211.11	100.00%	2,705,704.70	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集合计划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 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年01月06日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	35,935,295.36	29,304,645.09
其中：支付销售机构的客户维护费	11,685,048.25	-

本集合计划A类份额的管理费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的1.2%年费率计提。本集合计划C类份额的管理费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.6%年费率计提。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年01月06日（基金合同生 效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,348,275.89	7,541,575.04

本集合计划A类份额的托管费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.25%年费率计提。本集合计划C类份额的托管费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.2%的年费率计提。

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

本集合计划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

国君资管君得鑫2年期混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年06 月30日	上年度可比期间 2020年01月06日（基金 合同生效日）至2020年0 6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%

国君资管君得鑫2年期混合C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年06 月30日	上年度可比期间 2020年01月06日（基金 合同生效日）至2020年0 6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	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	86,714,649.09
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	86,714,649.09	86,714,649.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.79%	1.96%

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

无。

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月06日（基金合同生效日） 至2020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	1,259,600,583.07	4,531,180.80	1,088,954,946.76	3,225,212.60

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划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

本集合计划本报告期内无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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	可流通日	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
300724	捷佳伟创	2021-04-27	2021-10-27	非公开发行锁定	94.41	106.34	1,080,394	101,999,997.54	114,889,097.96	-

300166	东方国信	2021-06-09	2021-12-09	非公开发行锁定	7.88	11.54	3,172,589	25,000,001.32	36,611,677.06	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打新限售	47.33	251.96	839	39,709.87	211,394.44	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	33.22	87.50	900	29,898.00	78,750.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	951	36,946.35	36,946.35	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	1,233	14,154.84	14,154.84	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	1,326	14,108.64	14,108.64	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	21.31	49.94	258	5,497.98	12,884.52	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	1,132	10,708.72	10,708.72	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	创业板打新限售	28.77	99.85	91	2,618.07	9,086.35	-
6882	威腾	2021	2021	新股	6.42	6.42	1,305	8,37	8,37	-

26	电气	-06-28	-07-07	未上市				8.10	8.10	
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	38.83	199	1,520.36	7,727.17	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	45.29	168	2,659.44	7,608.72	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	13.05	556	2,746.64	7,255.80	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	创业板打新限售	6.87	12.07	579	3,977.73	6,988.53	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	5.31	28.52	243	1,290.33	6,930.36	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打新限售	9.19	40.38	158	1,452.02	6,380.04	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	24.69	31.71	201	4,962.69	6,373.71	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	3.37	10.44	606	2,042.22	6,326.64	-

300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	创业板打新限售	12.76	43.38	139	1,773.64	6,029.82	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	创业板打新限售	8.72	27.11	210	1,831.20	5,693.10	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	57.62	96	1,796.16	5,531.52	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板打新限售	16.53	46.07	113	1,867.89	5,205.91	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	创业板打新限售	12.25	53.71	92	1,127.00	4,941.32	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	创业板打新限售	8.48	22.07	222	1,882.56	4,899.54	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	创业板打新限售	3.40	16.37	290	986.00	4,747.30	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	创业板打新限售	11.72	27.08	172	2,015.84	4,657.76	-
300996	普联软件	2021-05-	2021-12-	创业板打	20.81	42.23	103	2,143.43	4,349.69	-

		26	03	新限售						
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	创业板打新限售	8.53	27.22	153	1,305.09	4,164.66	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	30.57	135	1,996.65	4,126.95	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	4.56	18.88	218	994.08	4,115.84	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.13	103	866.23	4,030.39	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	10.76	22.20	181	1,947.56	4,018.20	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	创业板打新限售	6.79	26.81	147	998.13	3,941.07	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	31.54	124	1,021.76	3,910.96	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板打新限售	8.63	27.42	134	1,157.00	3,674.28	-

301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	32.98	108	1,485.00	3,561.84	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	13.11	24.48	144	1,887.84	3,525.12	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	创业板打新限售	12.10	19.29	182	2,202.20	3,510.78	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	9.79	23.01	151	1,478.29	3,474.51	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	创业板打新限售	13.06	26.51	119	1,554.14	3,154.69	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业板打新限售	5.48	13.03	241	1,320.68	3,140.23	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	13.39	30.10	100	1,339.00	3,010.00	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	创业板打新限售	18.24	28.29	105	1,915.20	2,970.45	-
300978	东箭科技	2021-04-	2021-10-	创业板打	8.42	13.60	217	1,827.14	2,951.20	-

		15	26	新限售						
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	126	1,522.08	2,905.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	4.31	13.11	218	939.58	2,857.98	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	创业板打新限售	7.81	21.94	128	999.68	2,808.32	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	11.54	230	1,044.20	2,654.20	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	33.84	78	1,107.60	2,639.52	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	创业板打新限售	6.02	21.32	100	602.00	2,132.00	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打新限售	5.29	14.44	147	777.63	2,122.68	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打新限售	8.05	24.26	83	668.15	2,013.58	-

301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	创业板打新限售	7.83	17.61	100	783.00	1,761.00	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	23.32	74	1,089.28	1,725.68	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	10.64	10.64	148	1,574.72	1,574.72	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	12.65	119	855.61	1,505.35	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	9.46	9.46	126	1,191.96	1,191.96	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划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2021年6月30日止，本集合计划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2021年6月30日止，本集合计划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

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划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。

本集合计划管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险管理委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门的四级风险管理体系。风险管理部门主要包括风险管理部、法务监察部等专职履行风险管理职责的部门，营运管理部 and 综合管理部等其他部门。监事承担全面风险管理的监督责任。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划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。本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本集合计划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；集合计划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。

本集合计划本报告期末未持有债券投资、同业存单投资、资产支持证券投资，评估应无重大信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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

利率风险是指集合计划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。本集合计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	1,259,600,583.07	-	-	-	-	-	1,259,600,583.07
结算备付金	5,183,845.29	-	-	-	-	-	5,183,845.29
存出保证金	1,067,503.49	-	-	-	-	-	1,067,503.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,824,101,373.72	8,824,101,373.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,733,518.67	14,733,518.67
应收利息	-	-	-	-	-	242,031.46	242,031.46
应收股利	-	-	-	-	-	1,711,337.34	1,711,337.34
应收申购款	-	-	-	-	-	861,704.39	861,704.39
资产总计	1,265,851,931.85	-	-	-	-	8,841,649,965.58	10,107,501,897.43
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	24,142,336.17	24,142,336.17
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,344,429.80	8,344,429.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,511,955.31	6,511,955.31
应付托管费	-	-	-	-	-	1,723,923.47	1,723,923.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,165,466.83	3,165,466.83
应交税费	-	-	-	-	-	35,957,260.37	35,957,260.37
其他负债	-	-	-	-	-	3,207,407.01	3,207,407.01
负债总计	-	-	-	-	-	83,052,778.96	83,052,778.96
利率敏感度缺口	1,265,851,931.85	-	-	-	-	8,758,597,186.62	10,024,449,118.47
上年度末 2020年 12月31	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	1,370,494,849.53	-	-	-	-	-	1,370,494,849.53
结算备付金	7,752,445.94	-	-	-	-	-	7,752,445.94
存出保证金	643,075.83	-	-	-	-	-	643,075.83
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,713,690,537.92	8,713,690,537.92
应收利息	-	-	-	-	-	289,236.79	289,236.79
应收申购款	-	-	-	-	-	159,211.77	159,211.77
资产总计	1,378,890,371.30	-	-	-	-	8,714,138,986.48	10,093,029,357.78
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	8,456,902.64	8,456,902.64
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,808,296.21	7,808,296.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,718,125.14	6,718,125.14
应付托管费	-	-	-	-	-	1,767,608.54	1,767,608.54
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,420,033.93	3,420,033.93
应交税费	-	-	-	-	-	80,513,748.64	80,513,748.64
其他负债	-	-	-	-	-	3,169,378.01	3,169,378.01
负债总计	-	-	-	-	-	111,854,093.11	111,854,093.11
利率敏感度缺口	1,378,890,371.30	-	-	-	-	8,602,284,893.37	9,981,175,264.67

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本集合计划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。本集合计划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。本集合计划的管理人每日对本集合计划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 2021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	-	599,893,409.01	-	599,893,409.01
应收股利	-	1,711,337.34	-	1,711,337.34
应收证券清算款	-	6,164,114.04	-	6,164,114.04
资产合计	-	607,768,860.39	-	607,768,860.39
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	2.75	-	2.75
负债合计	-	2.75	-	2.75
资产负债表外汇风险敞口 净额	-	607,768,857.64	-	607,768,857.64
项目	上年度末 2020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				
交易性金融资产	-	868,981,550.71	-	868,981,550.71
资产合计	-	868,981,550.71	-	868,981,550.71
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	3,857,498.81	-	3,857,498.81
负债合计	-	3,857,498.81	-	3,857,498.81

资产负债表外汇风险敞口		865,124,051.		865,124,051.
净额	-	90	-	90

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 所有港币均相对人民币升值5%	-	43,256,202.60
	2. 所有港币均相对人民币贬值5%	-	-43,256,202.60

6.4.13.4.3 其他价格风险

本集合计划其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指集合计划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。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	8,824,101,373.72	88.03	8,713,690,537.92	87.30
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	8,824,101,373.72	88.03	8,713,690,537.92	87.30

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	44,120,506.87	460,116,861.29
	2. 业绩比较基准下降5%	-44,120,506.87	-460,116,861.29

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（b）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

（c）以公允价值计量的金融工具

（i）各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本集合计划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中属于第一层次的余额为8,672,013,366.09元，属于第二层次的余额为152,088,007.63元，无属于第三层次的余额。

（ii）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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本集合计划本期未持有第三层次的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的承诺事项。

(3) 其他事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的其他重要事项。

(4) 财务报表的批准

本财务报表已于2020年8月26日经本集合计划的集合计划管理人批准。

§ 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	8,824,101,373.72	87.30
	其中：股票	8,824,101,373.72	87.30
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	1,264,784,428.36	12.51

8	其他各项资产	18,616,095.35	0.18
9	合计	10,107,501,897.43	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	44,236,050.59	0.44
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,289,883,687.57	62.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	213,907,608.72	2.13
F	批发和零售业	22,479,924.56	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	114,186,930.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	922,073,167.72	9.20
J	金融业	487,451,687.88	4.86
K	房地产业	90,240,000.00	0.90
L	租赁和商务服务业	15,882,198.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	23,847,591.15	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	19,118.52	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,224,207,964.71	82.04

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	70,474,015.43	0.7
日常消费品	212,639,183.32	2.12
金融	209,181,604.48	2.09
医疗保健	39,128,562.00	0.39
电信服务	68,468,202.05	0.68
地产业	1,841.73	0.00
合计	599,893,409.01	5.98

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	002690	美亚光电	13,457,100	750,367,896.00	7.49
2	600352	浙江龙盛	50,000,000	687,000,000.00	6.85
3	002250	联化科技	16,400,000	457,560,000.00	4.56
4	000860	顺鑫农业	8,753,097	369,205,631.46	3.68
5	300724	捷佳伟创	3,063,794	344,983,331.96	3.44
6	600315	上海家化	5,000,000	300,700,000.00	3.00
7	300369	绿盟科技	18,599,933	296,668,931.35	2.96
8	02318	中国平安	3,160,500	199,995,441.28	2.00
8	601318	中国平安	1,417,500	91,116,900.00	0.91
9	300166	东方国信	23,172,589	283,811,677.06	2.83
10	600519	贵州茅台	128,200	263,668,940.00	2.63
11	600872	中炬高新	5,356,751	225,090,677.02	2.25
12	000799	酒鬼酒	860,347	219,904,693.20	2.19
13	601668	中国建筑	46,000,000	213,900,000.00	2.13
14	601128	常熟银行	32,999,962	204,599,764.40	2.04

15	002851	麦格米特	6,352,371	198,384,546.33	1.98
16	300316	晶盛机电	3,800,000	191,900,000.00	1.91
17	688085	三友医疗	4,306,061	187,873,441.43	1.87
18	603338	浙江鼎力	3,091,358	181,431,801.02	1.81
19	600557	康缘药业	13,899,914	156,235,033.36	1.56
20	002372	伟星新材	7,400,000	152,958,000.00	1.53
21	603308	应流股份	7,199,960	148,679,174.00	1.48
22	02319	蒙牛乳业	3,584,000	140,013,103.10	1.40
23	000568	泸州老窖	556,502	131,301,081.88	1.31
24	300132	青松股份	5,711,937	120,521,870.70	1.20
25	300450	先导智能	2,000,000	120,280,000.00	1.20
26	600004	白云机场	10,213,500	114,186,930.00	1.14
27	300253	卫宁健康	6,384,400	103,874,188.00	1.04
28	603983	丸美股份	1,947,799	101,499,805.89	1.01
29	002624	完美世界	4,012,150	95,930,506.50	0.96
30	002146	荣盛发展	16,000,000	90,240,000.00	0.90
31	603313	梦百合	2,840,696	85,362,914.80	0.85
32	601166	兴业银行	4,131,400	84,900,270.00	0.85
33	600276	恒瑞医药	1,174,200	79,810,374.00	0.80
34	00291	华润啤酒	1,251,363	72,626,080.22	0.72
35	601233	桐昆股份	3,006,821	72,434,317.89	0.72
36	002555	三七互娱	3,006,900	72,225,738.00	0.72
37	002439	启明星辰	2,396,869	69,533,169.69	0.69
38	00700	腾讯控股	140,900	68,468,202.05	0.68
39	300577	开润股份	3,046,504	65,286,580.72	0.65
40	002242	九阳股份	1,954,000	63,485,460.00	0.63
41	002154	报喜鸟	9,847,300	62,727,301.00	0.63
42	603027	千禾味业	2,349,420	61,766,251.80	0.62
43	600036	招商银行	1,020,592	55,305,880.48	0.55
44	601398	工商银行	9,966,900	51,528,873.00	0.51
45	000661	长春高新	130,700	50,580,900.00	0.50

46	00175	吉利汽车	2,337,000	47,544,759.97	0.47
47	603369	今世缘	853,100	46,203,896.00	0.46
48	603203	快克股份	1,600,000	44,944,000.00	0.45
49	603517	绝味食品	503,899	42,473,646.71	0.42
50	603583	捷昌驱动	796,480	40,317,817.60	0.40
51	02196	复星医药	750,000	39,128,562.00	0.39
52	002798	帝欧家居	2,500,000	38,950,000.00	0.39
53	603899	晨光文具	338,300	28,606,648.00	0.29
54	600132	重庆啤酒	137,398	27,197,934.10	0.27
55	600741	华域汽车	1,026,149	26,956,934.23	0.27
56	002641	永高股份	3,800,000	26,220,000.00	0.26
57	300498	温氏股份	1,748,780	25,129,968.60	0.25
58	603018	华设集团	2,999,697	23,847,591.15	0.24
59	02020	安踏体育	150,747	22,929,255.46	0.23
60	603108	润达医疗	2,000,000	22,460,000.00	0.22
61	600584	长电科技	511,800	19,284,624.00	0.19
62	002299	圣农发展	799,913	19,101,922.44	0.19
63	002003	伟星股份	3,000,000	18,720,000.00	0.19
64	300003	乐普医疗	500,000	16,060,000.00	0.16
65	002027	分众传媒	1,687,800	15,882,198.00	0.16
66	300595	欧普康视	146,220	15,141,081.00	0.15
67	600882	妙可蓝多	190,100	13,268,980.00	0.13
68	601100	恒立液压	151,700	13,034,064.00	0.13
69	002014	永新股份	1,399,777	12,108,071.05	0.12
70	00998	中信银行	3,000,000	9,186,163.20	0.09
71	688006	杭可科技	100,000	8,500,000.00	0.08
72	300957	贝泰妮	839	211,394.44	0.00
73	688161	威高骨科	1,729	183,360.45	0.00
74	300979	华利集团	900	78,750.00	0.00
75	300919	中伟股份	342	55,746.00	0.00
76	300920	润阳科技	1,398	47,084.64	0.00

77	688499	利元亨	951	36,946.35	0.00
78	301007	德迈仕	1,465	29,233.94	0.00
79	688517	金冠电气	1,392	19,780.32	0.00
80	300894	火星人	266	18,088.00	0.00
81	688067	爱威科技	565	17,735.35	0.00
82	301020	密封科技	1,474	15,683.36	0.00
83	688239	航宇科技	1,233	14,154.84	0.00
84	300941	创识科技	258	12,884.52	0.00
85	301021	英诺激光	1,258	11,900.68	0.00
86	300953	震裕科技	91	9,086.35	0.00
87	688226	威腾电气	1,305	8,378.10	0.00
88	300925	法本信息	296	7,781.84	0.00
89	301015	百洋医药	199	7,727.17	0.00
90	300982	苏文电能	168	7,608.72	0.00
91	300997	欢乐家	556	7,255.80	0.00
92	300968	格林精密	579	6,988.53	0.00
93	300942	易瑞生物	243	6,930.36	0.00
94	300614	百川畅银	158	6,380.04	0.00
95	300932	三友联众	201	6,373.71	0.00
96	300933	中辰股份	606	6,326.64	0.00
97	300940	南极光	139	6,029.82	0.00
98	301013	利和兴	210	5,693.10	0.00
99	300918	南山智尚	546	5,683.86	0.00
100	301002	崧盛股份	96	5,531.52	0.00
101	300922	天秦装备	152	5,294.16	0.00
102	300955	嘉亨家化	113	5,205.91	0.00
103	300937	药易购	92	4,941.32	0.00
104	300961	深水海纳	222	4,899.54	0.00
105	300962	中金辐照	290	4,747.30	0.00
106	300952	恒辉安防	172	4,657.76	0.00
107	300996	普联软件	103	4,349.69	0.00

108	300958	建工修复	153	4,164.66	0.00
109	300986	志特新材	135	4,126.95	0.00
110	300945	曼卡龙	218	4,115.84	0.00
111	300950	德固特	103	4,030.39	0.00
112	300926	博俊科技	181	4,018.20	0.00
113	300987	川网传媒	147	3,941.07	0.00
114	300966	共同药业	124	3,910.96	0.00
115	300960	通业科技	160	3,741.96	0.00
116	300948	冠中生态	134	3,674.28	0.00
117	301016	雷尔伟	108	3,561.84	0.00
118	300930	屹通新材	144	3,525.12	0.00
119	300993	玉马遮阳	182	3,510.78	0.00
120	300943	春晖智控	151	3,474.51	0.00
121	300991	创益通	119	3,154.69	0.00
122	300975	商络电子	241	3,140.23	0.00
123	300927	江天化学	100	3,010.00	0.00
124	300971	博亚精工	105	2,970.45	0.00
125	300978	东箭科技	217	2,951.20	0.00
126	300931	通用电梯	218	2,857.98	0.00
127	301004	嘉益股份	128	2,808.32	0.00
128	300967	晓鸣股份	230	2,654.20	0.00
129	301011	华立科技	78	2,639.52	0.00
130	300998	宁波方正	100	2,132.00	0.00
131	301012	扬电科技	83	2,013.58	0.00
132	06049	保利物业	42	1,841.73	0.00
133	301010	晶雪节能	100	1,761.00	0.00
134	300995	奇德新材	74	1,725.68	0.00
135	300972	万辰生物	119	1,505.35	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	000860	顺鑫农业	408,753,624.67	4.10
2	300724	捷佳伟创	231,418,618.94	2.32
3	600519	贵州茅台	182,062,812.53	1.82
4	02319	蒙牛乳业	169,969,160.69	1.70
5	603338	浙江鼎力	163,436,699.92	1.64
6	600872	中炬高新	163,056,921.42	1.63
7	000568	泸州老窖	155,191,898.03	1.55
8	000799	酒鬼酒	155,085,204.02	1.55
9	002851	麦格米特	131,153,387.33	1.31
10	002600	领益智造	116,928,540.39	1.17
11	603369	今世缘	114,621,419.60	1.15
12	00700	腾讯控股	107,385,495.65	1.08
13	002146	荣盛发展	106,647,660.86	1.07
14	688085	三友医疗	102,729,873.84	1.03
15	300132	青松股份	97,687,560.60	0.98
16	601166	兴业银行	90,385,361.10	0.91
17	603983	丸美股份	90,038,617.70	0.90
18	600276	恒瑞医药	89,157,228.41	0.89
19	603313	梦百合	89,136,793.90	0.89
20	002555	三七互娱	83,366,033.61	0.84

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	000799	酒鬼酒	700,767,989.68	7.02
2	000568	泸州老窖	464,144,956.53	4.65
3	300450	先导智能	377,092,689.02	3.78

4	00700	腾讯控股	216,721,215.66	2.17
5	600519	贵州茅台	212,097,008.80	2.12
6	00998	中信银行	209,136,405.14	2.10
7	300724	捷佳伟创	198,129,404.51	1.99
8	002600	领益智造	173,330,437.56	1.74
9	00291	华润啤酒	170,548,267.50	1.71
10	603259	药明康德	165,128,781.93	1.65
11	000858	五粮液	142,953,761.35	1.43
12	600315	上海家化	105,780,165.86	1.06
13	002439	启明星辰	96,062,818.80	0.96
14	000651	格力电器	92,460,417.57	0.93
15	688006	杭可科技	77,417,618.29	0.78
16	601668	中国建筑	76,016,406.30	0.76
17	000661	长春高新	73,927,344.00	0.74
18	603369	今世缘	71,205,155.53	0.71
19	002311	海大集团	69,817,014.77	0.70
20	000860	顺鑫农业	67,420,837.30	0.68

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	5,212,777,523.27
卖出股票收入（成交）总额	5,641,084,908.29

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本集合计划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

本集合计划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 本集合计划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 集合计划投资的前十名股票中，没有投资于超出集合计划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	1,067,503.49
2	应收证券清算款	14,733,518.67
3	应收股利	1,711,337.34
4	应收利息	242,031.46
5	应收申购款	861,704.39
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,616,095.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300724	捷佳伟创	114,889,097.96	1.15	非公开发行锁定
2	300166	东方国信	36,611,677.06	0.37	非公开发行锁定

§ 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
国君资管君得鑫2年期混合A	6,431	124,973.34	786,449.63	0.10%	802,917,112.86	99.90%
国君资管君得鑫2年期混合C	51,742	60,159.48	117,820,555.74	3.79%	2,994,951,490.84	96.21%
合计	58,173	67,324.63	118,607,005.37	3.03%	3,797,868,603.70	96.97%

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	国君资管君得鑫2年 期混合A	61,999.47	0.01%
	国君资管君得鑫2年 期混合C	999,113.56	0.03%
	合计	1,061,113.03	0.03%

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	国君资管君得鑫2 年期混合A	0
	国君资管君得鑫2 年期混合C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基 金	国君资管君得鑫2 年期混合A	0~10
	国君资管君得鑫2 年期混合C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	国君资管君得鑫2年期 混合A	国君资管君得鑫2年期 混合C
基金合同生效日(2020年01月06 日)基金份额总额	2,257,431,843.17	1,507,413,612.73
本报告期期初基金份额总额	1,043,626,322.86	3,086,292,924.36
本报告期基金总申购份额	—	26,479,122.22
减：本报告期基金总赎回份额	239,922,760.37	—

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	803, 703, 562. 49	3, 112, 772, 046. 58

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

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、本报告期内本集合计划管理人重大人事变动如下：

2021年5月18日，本集合计划管理人发布了《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》，成飞先生离任本集合计划管理人副总裁职务。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

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集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本集合计划投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划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

本集合计划管理人、集合计划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	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	佣金	占当期佣金总	

	元 数量		交总额的 比例		量的比 例	
国泰君安	2	10,765,231,696.45	100.0 0%	7,859,633.83	100.0 0%	-

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	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划2020年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2021-01-22
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划季度报告提示性公告	中国证券报	2021-01-22
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下集合计划改聘会计师事务所的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-03-12
4	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划2020年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2021-03-30
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划年度报告提示性公告	中国证券报	2021-03-30
6	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划2021年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2021-04-22
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划季度报告提示性公告	中国证券报	2021-04-22
8	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配捷佳伟创（300724）非公开发行A股的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-04-29

9	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分参公大集合单笔最低申购金额的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-05-07
10	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	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-05-18
11	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划C类份额恢复大额申购公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-05-21
12	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下产品开展直销APP费率优惠的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-06-09
13	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配东方国信（300166）非公开发行A股的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-06-11
14	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划C类份额暂停大额申购公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-06-24

§ 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
无。

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、中国证监会关于同意国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划合同变更的函；
- 2、《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划合同》；
- 3、《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；

- 4、《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、集合计划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

备查文件存放于集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人互联网站<http://www.gtjazg.com>。

12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划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
二〇二一年八月三十一日