

国泰君安君得盈债券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28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	9
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	10
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	11
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6 中期财务会计报告(未经审计)	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	21
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
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	49
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	49
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划	
基金简称	国君资管君得盈债券	
基金主代码	952020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年01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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	483,602,468.95份	
基金合同存续期	3年	
下属分级基金的基金简称	国君资管君得盈债券 A	国君资管君得盈债券 C
下属分级基金的交易代码	952020	952320
报告期末下属分级基金的份额总额	343,328,051.13份	140,274,417.82份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划以固定收益品种为主要投资对象，在以资产安全性为优先考虑的前提下，力争获取风险控制下更高的稳健收益。
投资策略	<p>本集合计划将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将集合计划资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。</p> <p>本集合计划将在稳健的资产配置策略基础上，根据股票的运行状况和收益预期，在严格控制风险</p>

的基础上，积极并适时适度地参与权益类资产配置，把握市场时机力争为集合计划资产获取增强型回报。

2、固定收益品种投资策略

本集合计划将采取利率策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。

本集合计划投资的信用债券（不包括可转换债券、可交换债券、可分离交易债券）经国内信用评级机构认定的债项评级或主体评级须在 AA（含 A A）以上，其中投资于评级 AA 的信用债比例不超过集合计划信用债资产的 30%（评级 AA 的同一信用债券不超过集合计划信用债资产的 3%）；投资评级 AA+ 的信用债比例不超过集合计划信用债资产的 50%；投资评级 AAA 的信用债比例不低于集合计划信用债资产的 50%。上述评级为该债券的最新债项评级（不含中债资信），无债项评级或者债项评级为 A-1 的以主体评级为准。

（1）利率策略

通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本集合计划将根据对市场利率变化趋势的预期，制定出组合的目标久期：预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

（2）信用策略

根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状

况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差。

债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息，同时需要考虑企业的经营环境等外部因素，着重分析企业未来的偿债能力，评估其违约风险水平。

（3）债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，主要选择定价合理或价值被低估的企业（公司）债券进行投资。

（4）可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略

可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性。本集合计划将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的上述债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。本集合计划持有的上述债券可以转换为股票。

（5）资产支持证券投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本集合计划将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

3、杠杆投资策略

在利率风险和流动性风险可控情况下，通过回购融资形式来获取息差收益，或更大程度博取价差收益的投资策略。

	<p>4、国债期货投资策略</p> <p>在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合整体风险的目的。</p> <p>5、股票投资策略</p> <p>本集合计划主要侧重于沪深 300 成分股、上证 50 成分股以及部分高分红标的股票，将采用自下而上和自上而下相结合的分析方法进行投资，根据上市公司所处行业的前景、公司本身竞争力和成长性、治理结构和财务健康状况等因素，再结合股票的价值评估，以及对公司经营有实质性影响的事件，精选个股，构建投资组合。首先，选择竞争格局较好的行业。其次，从公司商业模式、创新能力、成本控制、公司治理等多方面评估公司在行业内的竞争力。再次对公司财务状况、盈利质量、成长能力、估值评估等方面进行综合评估，选择盈利能力强、财务健康、成长性好、估值较低或合理的公司。</p> <p>本集合计划将采用定性与定量相结合的方法，对公司股价的驱动要素进行建模，考虑公司财务基本面、发展预期、交易特征等各个层面的因素，综合评估股价的增值潜力。选股要素包括成长性、估值、重大事项、流动性等等。在做好选股的基础上，本集合计划还将根据宏观经济周期、市场流动性变化、市场情绪波动的分析，结合股票组合的净值波动情况，优化股票组合的风格特征，把股票组合对集合计划整体波动率的影响控制在合理范围。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深300指数收益率×10%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本集合计划为债券型集合资产管理计划，预期</p>

	收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划，属于中低风险/收益的产品。	
下属分级基金的风险收益特征	本集合计划为债券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，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划，属于中低风险/收益的产品。	本集合计划为债券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，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划，属于中低风险/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
	联系电话	021-38676631
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	021-60637111
传真	021-38871190	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市静安区新闻路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	《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	上海市静安区新闸路669号博华广场22-23层及25层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月28日(基金合同生效日)-2021年06月30日)	
	国君资管君得盈债券A	国君资管君得盈债券C
本期已实现收益	2,387,176.68	1,446,904.90
本期利润	5,450,516.21	3,335,762.93
加权平均基金份额本期利润	0.0250	0.0178
本期加权平均净值利润率	2.47%	1.76%
本期基金份额净值增长率	1.91%	1.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	7,608,667.58	2,939,176.69
期末可供分配基金份额利润	0.0222	0.0210

期末基金资产净值	350,936,718.71	143,213,594.51
期末基金份额净值	1.0222	1.0210
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.91%	1.84%

注：本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，国君资管君得盈债券C类份额首次确认日为2021年3月9日。

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

国君资管君得盈债券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	0.35%	0.16%	-0.03%	0.09%	0.38%	0.07%
过去三个月	1.75%	0.11%	1.31%	0.10%	0.44%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.91%	0.09%	0.88%	0.13%	1.03%	-0.04%

注：本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日。

国君资管君得盈债券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	0.32%	0.16%	-0.03%	0.09%	0.35%	0.07%
过去三个月	1.65%	0.11%	1.31%	0.10%	0.34%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.84%	0.10%	1.57%	0.11%	0.27%	-0.01%

注：本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，国君资管君得盈债券C类份额首次确认日为2021年3月9日。

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



注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日。



注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，国君资管君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

§ 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		
杜浩然	本产品的投资经理，国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利一号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得惠债券集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利	2021-01-28	-	7年	复旦大学金融硕士。2014年7月至2020年5月任上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部助理投资经理、投资经理，现任基金投资部投资经理。2017年9月起任国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划投资经理。2018年6月起任国泰君安君得利一号

	<p>二号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安现金管家货币集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得金债券分级专项资产管理计划投资经理，国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划投资经理。</p>				<p>货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得惠债券集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利二号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划投资经理。2018年11月起任国泰君安现金管家货币集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得金债券分级专项资产管理计划投资经理。2018年12月起任国泰君安君得稳一号投资经理（于2020年03月25日更名为国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划）。2020年9月28日起任国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划投资经理。2021年1月28日起任国泰君安君得盈（原国泰君安君得惠二号）投资经理。</p>
周晨	<p>本产品的投资经理，国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划、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的投资经理。</p>	2021-01-28	-	10年	<p>北京大学金融学硕士，2010年8月至2018年6月任上海国泰君安证券资产管理有限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</p>

					<p>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。2021年1月28日起任国泰君安君得盈（原国泰君安君得惠二号）投资经理。</p>
杨坤	<p>本产品的投资经理，国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划的投资经理。</p>	2021-04-13	-	8年	<p>浙江大学数学系本科，英国华威大学金融硕士。2010年12月至2012年9月曾任职于工银安盛人寿（原金盛人寿保险）资产管理部，从事投连险账户和分红险账户固定收益投资工作；2012年9月至2014年9月任职于国泰君安证券研究所债券团队；2014年9月至2017年4月任职平安养老固定收益部债券研究主管、投资经理；2017年4月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部资深投资经理、多策略团队负责人。具有10年债券投资研究从业经验。</p>

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。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所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期内，未发现本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

本年度基本面和市场都是一波三折。1季度市场关注点在于海内外的再通胀过程，以2月美债利率上行行为信号，加之国内同比数据高位，市场对于未来政策的收紧预期提升。股票市场体现为年初以来上涨的消费白马开始快速下跌，债券市场也一度跟随海外调整。2季度最大的变化在于经济动能环比1季度有一定下滑。大宗商品上涨之后，在5月之后也受到一定的遏制。市场开始认为年内价格数据将在2-3季度见顶后回落。货币政策层面，重新明确了“中性适度”原则下，流动性依然保持充裕。2季度国内债券市场走势平稳，市场利率稳中向下。美债利率在6月联储议息会议之后震荡向下，基本处于2月利率上行以来的最低位置。随着利率的企稳走低，权益市场开始进入反弹模式，叠加5月美元指数走低，2季度权益市场有不错的收益表现。值得关注的是，进入6月之后，市场预期年内基本面数据逐步见顶，后续价格数据和利率水平将逐步走低，权益市场风格逐步向科技成长类转移。

本报告期内，本集合计划规模增加，我们在初期选择稳扎稳打，逐步提升仓位，目前整体仓位处于适宜水平。对于2021年权益市场，我们依然认为是震荡市，没有趋势性机会，但可以抓住结构性机会。仓位变动必要性低于自下而上的机会把握。2季度在市场反弹的过程中，我们不断优化持仓泛权益资产的结构，降低顺周期品种的比例，加大了未来1年内景气度向上行业的参与力度。尤其关注高端制造业中增速较快且与估值相

对匹配的标的，同时更看重组合构建的均衡性。对于债券市场而言，我们判断短期基本面没有太大的上行风险，维持中性仓位。

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盈债券A集合计划份额净值为1.0222元，本报告期内，该类集合计划份额净值增长率为1.91%，同期业绩比较基准收益率为0.88%；截至报告期末国君资管君得盈债券C集合计划份额净值为1.0210元，本报告期内，该类集合计划份额净值增长率为1.84%，同期业绩比较基准收益率为1.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度宏观基本面数据达到高位之后，后续来自周期复苏的弹性将逐步减弱。当然，我们认为基本面修复的韧性还在，毕竟全球疫情短期还未结束，经济在很多层面并没有恢复到潜在趋势线之上。海外货币政策“正常化”进程可能是一个重要变量，或带来阶段性的冲击。但从2013年的例子来看，美联储加息可能是一个长期过程，不宜短期化。国内来看，预计下一阶段利率环境将维持平稳，但需关注今年“财政后置”带来的逆周期对冲效应。后疫情时代，中国制造业竞争优势逐步加强，叠加新能源、半导体等科技浪潮向上，我们认为2季度以来市场风格变化将在中报后继续维持，权益市场的结构性机会依然值得期待。债券市场而言，长期来看，经济结构调整，宏观波动下滑，未来一段时间利率大概率呈现出一种低位波动的状态。我们预计下半年债市场收益或主要来自于票息机会。

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未进行利润分配，符合相关法规及集合计划合同的规定。

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遵规守信、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：国泰君安君得盈债券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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	24,534,130.72
结算备付金		3,123,366.44
存出保证金		17,348.64
交易性金融资产	6.4.7.2	589,281,260.66
其中：股票投资		73,439,095.00

基金投资		-
债券投资		515,842,165.66
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		120,790.36
应收利息	6.4.7.3	7,979,958.44
应收股利		-
应收申购款		673,615.97
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		625,730,471.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30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		112,698,497.45
应付证券清算款		1,046,784.71
应付赎回款		16,914,212.51
应付管理人报酬		249,882.81
应付托管费		41,647.15
应付销售服务费		238,954.80
应付交易费用	6.4.7.4	96,789.57
应交税费		193,733.13
应付利息		24,858.38
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	6.4.7.5	74,797.50
负债合计		131,580,158.01
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.6	483,602,468.95
未分配利润	6.4.7.7	10,547,844.27
所有者权益合计		494,150,313.22
负债和所有者权益总计		625,730,471.23

注：（1）本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，实际报告期间为2021年1月28日至2021年6月30日。

（2）报告截止日2021年6月30日，集合计划份额总额483,602,468.95份。其中下属国君资管君得盈债券A集合计划份额净值为1.0222元，份额总额为343,328,051.13份；国君资管君得盈债券C集合计划份额净值为1.0210元，份额总额为140,274,417.82份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月28日（基金合同 生效日）至2021年06月30 日
一、收入		10,739,426.82
1. 利息收入		4,997,299.41
其中：存款利息收入	6.4.7.8	81,657.67
债券利息收入		4,867,629.48
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		48,012.26
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		504,032.21
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-324,043.69
基金投资收益		-

债券投资收益	7.4.7.3	538,530.78
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	289,545.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	4,952,197.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	285,897.64
减：二、费用		1,953,147.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	906,727.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	151,121.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	238,954.80
4. 交易费用	6.4.7.14	116,736.35
5. 利息支出		420,038.49
其中：卖出回购金融资产支出		420,038.49
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.15	119,568.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,786,279.14
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,786,279.14

注：本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，因此无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年01月28日（基金合同生效日）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 (基金净值)	52,495,722.43	162,094.62	52,657,817.05
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	8,786,279.14	8,786,279.14
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)	431,106,746.52	1,599,470.51	432,706,217.03
其中: 1. 基金申购款	777,223,908.93	4,683,542.30	781,907,451.23
2. 基金赎回款	-346,117,162.41	-3,084,071.79	-349,201,234.20
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)	483,602,468.95	10,547,844.27	494,150,313.22

注: 本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日, 因此无上年度可比期间数据。

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:

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

国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)由国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划变更而来, 国泰君安君得惠二号债券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)、《国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划集合资产管理合同》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，国泰君安君得惠二号债券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，自2021年1月28日起，《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式，本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过三年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。本集合计划的管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

本集合计划的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深300指数收益率×10%

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

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、完整地反映了本集合计划于2021年6月30日的财务状况以及2021年1月28日（集合计划合同变更生效日）至2021年6月30日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

6.4.5 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

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

1. 增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《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，通知自2018年1月1日起施行。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。

2. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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	24,534,130.72
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	24,534,130.72

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	72,602,766.59	73,439,095.00	836,328.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券 交易所市场	128,399,835.75	131,435,665.66	3,035,829.91

	银行间市场	383,302,823.33	384,406,500.00	1,103,676.67
	合计	511,702,659.08	515,842,165.66	4,139,506.58
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	584,305,425.67	589,281,260.66	4,975,834.99

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	2,945.22
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	1,413.30
应收债券利息	7,975,599.92
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	7,979,958.44

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	87,552.37
银行间市场应付交易费用	9,237.20
合计	96,789.57

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	905.89
预提费用	73,891.61
合计	74,797.50

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 国君资管君得盈债券A

金额单位：人民币元

项目 (国君资管君得盈债券A)	本期 2021年01月28日(基金合同生效日)至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	52,495,722.43	52,495,722.43
本期申购	429,710,280.57	429,710,280.57
本期赎回(以“-”号填列)	-138,877,951.87	-138,877,951.87
本期末	343,328,051.13	343,328,051.13

6.4.7.6.2 国君资管君得盈债券C

金额单位：人民币元

项目 (国君资管君得盈债券C)	本期 2021年03月09日(C类份额首次确认日)至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	347,513,628.36	347,513,628.36
本期赎回(以“-”号填列)	-207,239,210.54	-207,239,210.54
本期末	140,274,417.82	140,274,417.82

注：本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，国君资管君得盈债券C类份额首次确认日为2021年3月9日。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 国君资管君得盈债券A

单位：人民币元

项目 (国君资管君得盈债券 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	1,037,460.24	-875,365.62	162,094.62
本期利润	2,387,176.68	3,063,339.53	5,450,516.21
本期基金份额交易产生的变动数	6,618,081.56	-4,622,024.81	1,996,056.75
其中：基金申购款	9,964,240.93	-6,933,733.40	3,030,507.53
基金赎回款	-3,346,159.37	2,311,708.59	-1,034,450.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,042,718.48	-2,434,050.90	7,608,667.58

6.4.7.7.2 国君资管君得盈债券C

单位：人民币元

项目 (国君资管君得盈债券 C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,446,904.90	1,888,858.03	3,335,762.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,488,026.60	-2,884,612.84	-396,586.24
其中：基金申购款	7,624,873.54	-5,971,838.77	1,653,034.77
基金赎回款	-5,136,846.94	3,087,225.93	-2,049,621.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,934,931.50	-995,754.81	2,939,176.69

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	75,894.95
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	5,762.72
其他	-
合计	81,657.67

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28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出股票成交总额	17,091,601.67
减：卖出股票成本总额	17,415,645.36
买卖股票差价收入	-324,043.69

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	538,530.78
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	538,530.78

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	130,586,953.65
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	128,802,991.41
减：应收利息总额	1,245,431.46
买卖债券差价收入	538,530.78

6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	289,545.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	289,545.12

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	5,100,414.66
——股票投资	836,328.41
——债券投资	4,264,086.25
——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	148,217.10
合计	4,952,197.56

6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
基金赎回费收入	285,897.64
合计	285,897.64

6.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
交易所市场交易费用	110,086.35
银行间市场交易费用	6,650.00
合计	116,736.35

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
审计费用	8,437.66

信息披露费	54,674.62
汇划手续费	9,839.35
帐户维护费	15,810.09
差价收入增值税抵减	13,977.64
增值税金及附加税	16,829.54
合计	119,568.90

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28日（基金合同生效日）至2021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	107,110,013.62	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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国泰君安证券	151,240,147.76	100.00%

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 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021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	1,315,000,000.00	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 2021年01月28日（基金合同生效日）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	101,603.45	100.00%	87,552.37	100.00%

证券				
----	--	--	--	--

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28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	906,727.83
其中：支付销售机构的客户维护费	432,916.94

注：支付集合计划管理人国泰君安资管的管理人报酬按前一日集合计划资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日集合计划资产净值*0.60%/365

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	151,121.31

注：支付集合计划托管人建设银行的托管费按前一日集合计划资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日集合计划资产净值*0.10%/365

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 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国君资管君得盈债券A	国君资管君得盈债券C	合计
国泰君安证券	0.00	208,474.57	208,474.57

合计	0.00	208,474.57	208,474.57
----	------	------------	------------

注：本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，国君资管君得盈债券C类份额首次确认日为2021年3月9日，无上年度同期可比数据。

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

本集合计划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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内本集合计划的管理人未运用固有资金投资本集合计划。

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

本集合计划本报告期末无除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

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 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	24,534,130.72	75,894.95

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未进行利润分配。

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

本集合计划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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101766006	17车都建投MTN001	2021-07-02	102.46	24,000	2,459,040.00
101800247	18诸暨国资MTN001	2021-07-07	101.16	54,000	5,462,640.00
101800605	18芜湖建设MTN001	2021-07-02	103.91	100,000	10,391,000.00
101800883	18江岸国资MTN001	2021-07-05	104.34	105,000	10,955,700.00
102000353	20长电(疫情防控债)MTN001	2021-07-07	99.69	115,000	11,464,350.00
200202	20国开02	2021-07-06	98.39	150,000	14,758,500.00
210201	21国开01	2021-07-07	100.06	100,000	10,006,000.00
合计				648,000	65,497,230.00

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，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币50,999,390.00元。该类交易要求本集合计划在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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，营运管理部和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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	30,019,000.00
合计	30,019,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本期末，未评级的短期债券是政策性金融债和短期融资债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日
AAA	252,195,659.60
AAA以下	203,912,506.06
未评级	29,715,000.00
合计	485,823,165.66

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本期末，未评级的长期债券均是政策性金融债。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的集合计划管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全集合计划流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的集合计划管理人采用监控集合计划组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的集合计划管理人在集合计划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带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过集合计划资产净值的15%。

本集合计划本报告期末无重大流动性风险。

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 2021 年06	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
--------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

月30日							
资产							
银行存款	24,534,130.72	-	-	-	-	-	24,534,130.72
结算备付金	3,123,366.44	-	-	-	-	-	3,123,366.44
存出保证金	17,348.64	-	-	-	-	-	17,348.64
交易性金融资产	-	4,030,000.00	92,280,523.22	399,073,382.00	20,458,260.44	73,439,095.00	589,281,260.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	120,790.36	120,790.36
应收利息	-	-	-	-	-	7,979.958.44	7,979.958.44
应收申购款	-	-	-	-	-	673,615.97	673,615.97
资产总计	27,674,845.80	4,030,000.00	92,280,523.22	399,073,382.00	20,458,260.44	82,213,459.77	625,730,471.23
负债							
卖出回购金融资产款	112,698,497.45	-	-	-	-	-	112,698,497.45
应付	-	-	-	-	-	1,046,78	1,046,78

证券清算款						4.71	4.71
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,914,212.51	16,914,212.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	249,882.81	249,882.81
应付托管费	-	-	-	-	-	41,647.15	41,647.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	238,954.80	238,954.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	96,789.57	96,789.57
应交税费	-	-	-	-	-	193,733.13	193,733.13
应付利息	-	-	-	-	-	24,858.38	24,858.38
其他负债	-	-	-	-	-	74,797.50	74,797.50
负债总计	112,698,497.45	-	-	-	-	18,881,660.56	131,580,158.01
利率敏感度缺口	-85,023,651.65	4,030,000.00	92,280,523.22	399,073,382.00	20,458,260.44	63,331,799.21	494,150,313.22

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；利率变动范围合理。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021年06月30日
	基准点利率增加0.25%	-1,703,562.19
	基准点利率减少0.25%	1,714,718.23

6.4.13.4.2 外汇风险

本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	73,439,095.00	14.86
交易性金融资产—基金投	-	-

资		
交易性金融资产—债券投资	515,842,165.66	104.39
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	589,281,260.66	119.25

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除权益投资公允价值发生变动，其他影响集合计划资产公允价值的风险变量保持不变。	
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
	权益投资公允价值增加5%	3,671,954.75
	权益投资公允价值减少5%	-3,671,954.75

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118,555,110.66元，属于第二层次的余额为470,726,150.00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2021年8月27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	73,439,095.00	11.74
	其中：股票	73,439,095.00	11.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	515,842,165.66	82.44
	其中：债券	515,842,165.66	82.44
	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	27,657,497.16	4.42
8	其他各项资产	8,791,713.41	1.41
9	合计	625,730,471.23	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	787,476.00	0.16
B	采矿业	1,464,000.00	0.30
C	制造业	48,137,357.40	9.74
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	2,800,730.60	0.57
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	7,983,311.00	1.62
J	金融业	12,151,418.00	2.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	114,802.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	73,439,095.00	14.86

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	601398	工商银行	1,020,900	5,278,053.00	1.07
2	603583	捷昌驱动	54,860	2,777,013.20	0.56
3	300253	卫宁健康	157,400	2,560,898.00	0.52
4	002439	启明星辰	80,800	2,344,008.00	0.47
5	601233	桐昆股份	91,600	2,206,644.00	0.45
6	603027	千禾味业	80,960	2,128,438.40	0.43
7	600887	伊利股份	54,900	2,021,967.00	0.41
8	002048	宁波华翔	100,000	1,950,000.00	0.39
9	002415	海康威视	30,000	1,935,000.00	0.39
10	603501	韦尔股份	6,000	1,932,000.00	0.39
11	601318	中国平安	29,500	1,896,260.00	0.38
12	002600	领益智造	200,000	1,838,000.00	0.37
13	000887	中鼎股份	150,000	1,812,000.00	0.37
14	002597	金禾实业	51,900	1,800,930.00	0.36
15	002643	万润股份	100,000	1,778,000.00	0.36
16	603108	润达医疗	153,300	1,721,559.00	0.35
17	002444	巨星科技	50,000	1,704,000.00	0.34
18	300207	欣旺达	51,960	1,691,817.60	0.34
19	300059	东方财富	50,000	1,639,500.00	0.33
20	002475	立讯精密	35,000	1,610,000.00	0.33
21	600036	招商银行	29,000	1,571,510.00	0.32
22	300724	捷佳伟创	13,000	1,508,130.00	0.31
23	601088	中国神华	75,000	1,464,000.00	0.30
24	300271	华宇软件	75,000	1,443,750.00	0.29
25	000860	顺鑫农业	33,900	1,429,902.00	0.29

26	603308	应流股份	67,200	1,387,680.00	0.28
27	000932	华菱钢铁	201,207	1,327,966.20	0.27
28	300146	汤臣倍健	40,000	1,316,000.00	0.27
29	603338	浙江鼎力	21,400	1,255,966.00	0.25
30	601128	常熟银行	200,000	1,240,000.00	0.25
31	300132	青松股份	57,900	1,221,690.00	0.25
32	600196	复星医药	15,000	1,081,950.00	0.22
33	603939	益丰药房	19,240	1,079,171.60	0.22
34	600741	华域汽车	35,300	927,331.00	0.19
35	002555	三七互娱	36,300	871,926.00	0.18
36	600584	长电科技	22,200	836,496.00	0.17
37	600276	恒瑞医药	12,000	815,640.00	0.17
38	300498	温氏股份	54,800	787,476.00	0.16
39	000651	格力电器	15,000	781,500.00	0.16
40	603313	梦百合	25,600	769,280.00	0.16
41	002624	完美世界	31,900	762,729.00	0.15
42	000661	长春高新	1,900	735,300.00	0.15
43	603369	今世缘	12,900	698,664.00	0.14
44	603180	金牌厨柜	13,900	662,891.00	0.13
45	600872	中炬高新	15,700	659,714.00	0.13
46	600519	贵州茅台	300	617,010.00	0.12
47	002242	九阳股份	18,100	588,069.00	0.12
48	300577	开润股份	25,800	552,894.00	0.11
49	002142	宁波银行	13,500	526,095.00	0.11
50	002154	报喜鸟	81,700	520,429.00	0.11
51	600132	重庆啤酒	2,500	494,875.00	0.10
52	603983	丸美股份	6,000	312,660.00	0.06
53	603517	绝味食品	3,000	252,870.00	0.05
54	603899	晨光文具	1,500	126,840.00	0.03
55	002027	分众传媒	12,200	114,802.00	0.02

56	600882	妙可蓝多	1,000	69,800.00	0.01
----	--------	------	-------	-----------	------

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	5,350,481.00	1.08
2	600276	恒瑞医药	2,833,079.00	0.57
3	300253	卫宁健康	2,704,423.66	0.55
4	603583	捷昌驱动	2,545,665.40	0.52
5	002439	启明星辰	2,528,187.00	0.51
6	601318	中国平安	2,312,448.00	0.47
7	601233	桐昆股份	2,239,519.00	0.45
8	002597	金禾实业	2,217,558.00	0.45
9	600887	伊利股份	2,162,312.00	0.44
10	603027	千禾味业	2,111,422.20	0.43
11	603108	润达医疗	2,080,630.00	0.42
12	603338	浙江鼎力	1,922,586.45	0.39
13	300724	捷佳伟创	1,891,647.00	0.38
14	002415	海康威视	1,789,757.00	0.36
15	002444	巨星科技	1,782,900.00	0.36
16	000887	中鼎股份	1,730,570.00	0.35
17	603501	韦尔股份	1,716,791.00	0.35
18	002048	宁波华翔	1,695,305.00	0.34
19	002600	领益智造	1,677,649.00	0.34
20	002643	万润股份	1,660,647.00	0.34

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例 (%)
1	600276	恒瑞医药	1,878,370.80	0.38
2	300476	胜宏科技	1,463,633.00	0.30
3	002318	久立特材	1,251,075.00	0.25
4	002078	太阳纸业	1,077,684.00	0.22
5	601166	兴业银行	911,212.00	0.18
6	300413	芒果超媒	901,499.00	0.18
7	603369	今世缘	828,937.00	0.17
8	600004	白云机场	822,177.00	0.17
9	300724	捷佳伟创	657,973.00	0.13
10	600132	重庆啤酒	655,255.00	0.13
11	601225	陕西煤业	577,600.00	0.12
12	002597	金禾实业	555,194.00	0.11
13	600690	海尔智家	530,788.00	0.11
14	601899	紫金矿业	494,700.00	0.10
15	002851	麦格米特	486,855.00	0.10
16	000661	长春高新	473,678.00	0.10
17	603108	润达医疗	419,334.00	0.08
18	603338	浙江鼎力	371,486.00	0.08
19	000651	格力电器	304,668.00	0.06
20	688085	三友医疗	261,898.40	0.05

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	90,018,411.95
卖出股票收入（成交）总额	17,091,601.67

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,727,000.00	10.06
	其中：政策性金融债	49,727,000.00	10.06
4	企业债券	112,591,650.00	22.78
5	企业短期融资券	10,007,000.00	2.03
6	中期票据	298,400,500.00	60.39
7	可转债(可交换债)	45,116,015.66	9.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	515,842,165.66	104.39

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	102000621	20中油股MTN001	300,000	29,649,000.00	6.00
2	101800883	18江岸国资MTN001	200,000	20,868,000.00	4.22
3	143580	18穗发01	200,000	20,180,000.00	4.08
4	101900834	19南电MTN005	200,000	20,138,000.00	4.08
5	101901410	19光明MTN001	200,000	20,078,000.00	4.06

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

本报告期内，本集合计划未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内，本集合计划未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、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	17,348.64
2	应收证券清算款	120,790.36
3	应收股利	-
4	应收利息	7,979,958.44
5	应收申购款	673,615.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,791,713.41

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产
----	------	------	------	-------

				产净 值比 例 (%)
1	113044	大秦转债	5,144,500.00	1.04
2	132018	G三峡EB1	4,612,608.00	0.93
3	113024	核建转债	3,072,600.00	0.62
4	128046	利尔转债	2,087,244.02	0.42
5	128097	奥佳转债	2,079,709.60	0.42
6	113025	明泰转债	1,873,900.00	0.38
7	113602	景20转债	1,780,500.00	0.36
8	128032	双环转债	1,722,380.00	0.35
9	113611	福20转债	1,720,600.00	0.35
10	128113	比音转债	1,719,190.00	0.35
11	113012	骆驼转债	1,629,420.00	0.33
12	113037	紫银转债	1,546,950.00	0.31
13	128101	联创转债	1,345,883.00	0.27
14	128119	龙大转债	1,200,390.00	0.24
15	123083	朗新转债	981,550.51	0.20
16	128083	新北转债	929,925.00	0.19
17	127024	盈峰转债	911,285.99	0.18
18	113615	金诚转债	877,200.00	0.18
19	128078	太极转债	829,584.00	0.17
20	127012	招路转债	813,207.60	0.16
21	113021	中信转债	801,572.00	0.16
22	113011	光大转债	739,072.00	0.15
23	127022	恒逸转债	687,506.40	0.14
24	113534	鼎胜转债	401,460.00	0.08

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 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
国君资管君得盈债券A	804	427,024.94	194,063,223.89	56.52%	149,264,827.24	43.48%
国君资管君得盈债券C	927	151,320.84	13,424,546.21	9.57%	126,849,871.61	90.43%
合计	1,731	279,377.51	207,487,770.10	42.90%	276,114,698.85	57.10%

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	国君资管君得盈债券A	197,319.74	0.06%
	国君资管君得盈债券C	20,917.70	0.01%
	合计	218,237.44	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国君资管君得盈债券A	0~10
	国君资管君得盈债券C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国君资管君得盈债券A	0~10
	国君资管君得盈债券C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国君资管君得盈债券A	国君资管君得盈债券C
基金合同生效日(2021年01月28日)基金份额总额	52,495,722.43	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	429,710,280.57	347,513,628.36
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	138,877,951.87	207,239,210.54
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	343,328,051.13	140,274,417.82

§ 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。

本集合计划基金经理变动详见“基金管理人及基金经理情况”章节。

2、本报告期内本集合计划托管人的专门集合计划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

本报告期内，本集合计划投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划提供审计服务。本报告期内本集合计划未改聘会计师事务所。

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	107,110,013.62	100.00%	101,603.45	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	占当期债券成交总额的比例	成交金额
国泰君安	151,240,147.76	100.00%	1,315,000,000.00	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	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2021-01-25
2	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同	证监会指定网站、公司官网	2021-01-25
3	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划托管协议	证监会指定网站、公司官网	2021-01-25
4	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划(A类份额)产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2021-01-25
5	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划(C类份额)产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2021-01-25
6	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同及招募说明书提示性公告	证券时报	2021-01-25
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2021-01-28
8	国泰君安君得盈债券型集合	证券时报、证监会指定网站、	2021-03-03

	资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	公司官网	
9	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	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2021-03-12
10	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2021-04-15
11	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划（A类份额）产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2021-04-16
12	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2021-04-16
13	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）（2021年第2号）	证监会指定网站、公司官网	2021-04-16
14	国泰君安君得盈债券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
15	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	证券时报	2021-04-22
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2021-05-18
17	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	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2021-06-09

§ 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

自2021年1月28日起,《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划合同(现为国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划)变更的回函;
- 2、《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》;
- 3、《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划托管协议》;
- 4、《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划招募说明书》;
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、集合计划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