

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

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:交通银行股份有限公司

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。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2021年08月27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，投资者在做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2021年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 中期财务会计报告(未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
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 本报告期投资基金情况	50
7.13 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.....	58
§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.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	59
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.9 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
11.1 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	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划	
基金简称	国君资管君得益三个月(FOF)	
基金主代码	952013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年11月16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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,479,249,589.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国君资管君得益三个月(FOF)A	国君资管君得益三个月(FOF)C
下属分级基金的交易代码	952013	952313
报告期末下属分级基金的份额总额	2,951,661,978.89份	1,527,587,611.03份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本集合计划采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，精选基金品种，构建有超额收益能力的基金组合。同时通过有效地风险管理，降低业绩的波动性，获得稳定而持续的投资收益。 2、基金投资策略 (1) 开放式基金投资策略 本集合计划以权益类基金为重点投资方向，在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选

择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。

1) 在基金公司维度，主要考虑的因素有：基金公司的股东背景、公司治理、核心管理团队的综合素质和稳定性、基金经理与投研团队的综合素质和稳定性、公司管理的资产规模和盈利能力、管理层的管理风格、投资决策程序的科学性和执行度、公司风险控制制度健全性和执行力度、公司基金的类型和收益情况、公司基金交叉持股情况、基金公司产品创新能力及客户服务水平等。评价方式主要来自于实地调研、公司刊物和公开信息。

2) 基金经理维度，对基金经理的从业经验、业绩表现、风险控制、业绩归因、风格特征等多个层面全方位地进行分析，定量和定性相结合，并通过持续跟踪保持更新。该体系从多种维度对基金经理的风格特征加以剖析，包括但不限于：组合构建思路、选股偏好、擅长投资领域、投资集中度、换手率情况等。

3) 基金产品维度，重点考量首先根据基金的历史业绩情况，挑选出业绩持续优秀的基金，根据基金的风险收益特征，构建合适的基金投资组合。通过风险收益综合评价方法挖掘持续稳定的基金品种，主要包括选股能力、择时能力、风险控制能力等指标。

(2) 场内ETF等基金投资策略

场内ETF等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及ETF所跟踪指数的综合评价挑选适合的ETF投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。

3、股票的投资策略

通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，以证监会行业分类标准为基础，挑选出增长前景持续向好的行业或周期景气复苏或上升的行业。通过定性和定量分析精选个股。定量分析使用的指标包括成长

	指标、价值指标和盈利指标，针对不同行业采取相应的估值方法；定性分析对精选公司进行“波特五力模型”分析，结合行业估值模型进行数量化的辅助投资决策。 4、债券的投资策略 本集合计划将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等投资策略，发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，评估债券投资价值，选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合，并根据市场变化情况对组合进行优化。 5、资产支持证券等品种投资策略 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，并辅助数量化定价模型，评估其内在价值。
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%
风险收益特征	本集合计划为混合型基金中基金集合资产管理计划，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李艳	陆志俊
	联系电话	021-38676631	95559
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95521	95559

传真	021-38871190	021-62701216
注册地址	上海市黄浦区南苏州路381号 409A10室	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	江伟	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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)	
	国君资管君得益三个月(FOF)A	国君资管君得益三个月(FOF)C
本期已实现收益	-6,126,850.83	-7,920,075.04
本期利润	90,110,536.87	44,996,086.09

加权平均基金份额本期利润	0.0308	0.0270
本期加权平均净值利润率	2.07%	1.82%
本期基金份额净值增长率	5.82%	2.01%
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	1,672,301,249.42	806,462,043.79
期末可供分配基金份额利润	0.5666	0.5279
期末基金资产净值	4,623,963,228.31	2,388,608,023.25
期末基金份额净值	1.5666	1.5636
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	12.03%	2.01%

注：1. 所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3. 本集合计划于2020年11月16日参公生效，C类份额于2021年1月12日首次申购确认，因此本集合计划A类份额当期的相关数据和指标按本报告期（即2021年1月1日至2021年6月30日）计算；C类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即2021年1月12日至2021年6月30日）计算。

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

国君资管君得益三个月(FOF)A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差	①-③	②-④
----	--------------	---------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

				④		
过去一个月	2.71%	0.81%	1.75%	0.78%	0.96%	0.03%
过去三个月	9.46%	0.76%	10.23%	0.83%	-0.77%	-0.07%
过去六个月	5.82%	0.98%	6.95%	1.14%	-1.13%	-0.16%
自基金合同 生效起至今	12.03%	0.92%	14.63%	1.07%	-2.60%	-0.15%

注：（1）本集合计划于 2020 年 11 月 16 日参公生效，A 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2020 年 11 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日）计算。

（2）业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%

国君资管君得益三个月(FOF)C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.67%	0.80%	1.75%	0.78%	0.92%	0.02%
过去三个月	9.34%	0.76%	10.23%	0.83%	-0.89%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	2.01%	0.98%	3.56%	1.14%	-1.55%	-0.16%

注：（1）本集合计划于 2020 年 11 月 16 日参公生效，C 类份额于 2021 年 1 月 12 日首次申购确认，C 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2021 年 1 月 12 日至 2021 年 6 月 30 日）计算。

（2）业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%

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

国君资管君得益三个月(FOF)A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：（1）本集合计划于 2020 年 11 月 16 日参公生效，截至本报告期末，集合计划参公生效未满一年。A 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2020 年 11 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日）计算。

（2）业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%

国君资管君得益三个月(FOF)C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：（1）本集合计划于 2020 年 11 月 16 日参公生效，截至本报告期末，集合计划参公生效未满一年。C 类份额于 2021 年 1 月 12 日首次申购确认，C 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2021 年 1 月 12 日至 2021 年 6 月 30 日）计算。

（2）业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至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		
李少君	投资研究院院长、组合投资部总经理，本集合计划的投资经理	2020-12-07	-	10 年	中国人民大学博士，CFA、FRM。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司投资研究院院长、组合投资部总经理，负责研究及组合投资业务。曾供职于中国工商银行总行；民生证券研究院，历任研究业务部总经理、首席策略分析师；国泰君安证券研究所，历任副所长、全球首席策略分析师、总量团队负责人。
高琛	本集合计划的投资经理	2020-11-16	-	11 年	华东理工大学工商管理硕士。曾任上海证券基金评价分析师、金融实验室负责人，国泰君安资产管理业务委员会执行办董事。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司组合投资部投资经理，主要负责公募基金评价及FOF 投资研究工作。

注：1. 本集合计划投资经理的任职日期为本集合计划合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议做出决定的公告（生效）日期。

2. 证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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

回顾经济，2021年上半年，全球宏观的几个重要特征包括：1）全球疫情向好，但不均衡与反复的特征严重：发达国家普遍改善明显，而印度、巴西、阿根廷等新兴市场国家仍经受冲击，此外变种病毒等带来的反复的风险仍在；2）经济不均衡复苏态势延续：发达市场强于新兴市场，制造业强于消费服务业；3）供需错配问题严重：以美国为首的发达国家通过政策刺激拉升需求，而（除中国外）各国生产修复相对偏慢，尤其新兴市场国家疫苗接种滞后、政策能力有限而约束了供给；4）二季度开始，美国以及国内流动性都相较一季度宽松，好于之前预期。美国对通胀的容忍度较高，而国内在通胀压力加大的情况下，银行间市场的流动性状况、R007等资金利率价格始终好于预期。

回顾配置，总体上，上半年我们对大类资产持以商品（原油>基本金属）>股（发达>新兴）>贵金属>债（中国>海外）的观点。在年初确定的“稳扎稳打”的思路下，在资产配置Alpha中，我们经历了两个阶段，从一季度的权益配置比例显著低于基准，到二季度权益配置比例显著高于基准。在风格和行业的Alpha中，君得益低配消费和医药，

超配科技和新能源，并偏向中盘和均衡。基金Alpha中，我们将基金的收益分解成Beta和Alpha，筛选有效甄别基金业绩持续性的指标，提高基金优选的胜率。

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益三个月(FOF)A基金份额净值为1.5666元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.82%，同期业绩比较基准收益率为6.95%；截至报告期末国君资管君得益三个月(FOF)C基金份额净值为1.5636元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.01%，同期业绩比较基准收益率为3.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，虽有调整和波折，但上半年的市场表现整体超过了去年底投资者的预期。越是热闹的市场越需要警醒，我们认为支撑权益走强的主要原因是海外宽松的实际情况没有因为强劲的复苏逆转，以及国内经济在出口和地产投资的支撑下，仍相对有韧性，而这些因素接下来可能发生变化。

具体来看，

其一，美元流动性持续宽松格局变数犹存。下半年考虑到补贴的退出，以及当前已经出现的较高职位空缺率，美国就业市场有加速改善的可能性，进而推升美债实际利率上行；

其二，美国通胀是否是暂时的，存在不确定性。尽管商品消费供需错配的因素在下半年会有所缓解，但服务业、房租以及薪资增长的压力可能会成为推升美国通胀超预期的因素。

其三，中国出口部门是否能够维持高水平的韧性是不确定的。出口有效缓解了国内的滞胀压力，对中国经济的重要性高于以往，但随着发达市场疫情改善，其居民消费存在由耐用消费品向服务消费转变的可能，加之海外自身的生产供应能力不断修复，从量与份额的层面均有可能对中国出口形成负面压力。

针对这些不确定性，我们计划秉承稳扎稳打的操作策略，利用总量优势，密切跟踪、小心求证，进一步提升资产配置Alpha。

在行业/风格Alpha上，我们认为三大转折的演绎大体维持，但中间会有波动，决定行业/风格Alpha的根本原因是分子端的业绩比较优势和盈利周期变化趋势，而分母端的贴现率变化是催化剂，从这两个维度，我们可以看到：

首先，消费转向周期为代表的其他景气行业的趋势仍将继续：1）消费数据持续低预期，上市公司的盈利增速相比周期、科技较慢。2021年6月社会消费品零售总额的2年复合增长率仅4.9%，仍显著低于疫情前的增速。2021年第一季度消费板块扣非净利润2年复合增长率为16.5%，同期周期及科技板块增速分别为22.9%与32.4%。2）消费确定性溢价的来源，较低的无风险利率下半年面临上行的可能性。消费板块是外资重点配置方

向，受到全球利率环境影响。2007年7月-2021年6月的数据显示，美债收益率上行期间消费板块收益率低于周期、科技板块。

其次，龙头溢价仍将缩窄，中小盘股的超额收益大概率好于大盘股：1) 中小盘股的盈利修复斜率具有优势。根据2021年7月末的Wind一致预测，中证500指数成分股2021年净利润预期增速为51.6%，沪深300指数成分股增速为21.2%。2) 过去两年支撑龙头估值溢价的无风险利率存在上行压力。美债收益率上行期间申万小盘指数表现优于申万大盘指数。

第三，防范成长转向价值的切换风险。成长转价值在一季度得到了较好体现，但二季度又出现反复。我们判断成长转向价值主要是基于安全边际与估值角度。截止上半年末，国证价值指数的股息率为4.0%，为近10年90%分位水平，国证成长指数相对价值指数的市盈率溢价达到近10年98%分位，价值风格估值优势明显。此外，利率上行期间，价值股通常也表现较好。2007年7月以来，在美债收益率上行期间国证成长指数相对国证价值指数存在明显超额收益。

具体的基金操作上，计划整体均衡，行业以及风格上根据以上三大转折的判断适当偏离。在大量的历史回测中我们发现，过频繁或幅度过大的行业偏离以及风格偏离会显著的降低投资组合未来业绩的持续性，提高组合的风险暴露，而选股Alpha强的基金有着显著更高的业绩持续性。因此，我们依然坚持均衡的行业和风格配置，优选选股Alpha能力强的基金经理，提高基金组合整体的投资表现。

我们仍将锲而不舍地，依托三重alpha的价值观，在2021年动荡加大的市场中，为投资者获取超额收益。

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、全球研究院负责人、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

根据本集合计划合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本集合计划本报告期内未进行利润分配。符合合同规定。

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，集合计划托管人在国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，上海国泰君安证券资产管理有限公司在国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本集合计划未进行收益分配，符合集合计划合同的规定。

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

本报告期，由上海国泰君安证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)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	266,880,775.21	5,565,902.47
结算备付金		1,056,556.42	—
存出保证金		25,052.00	—
交易性金融资产	6.4.7.2	6,926,787,702.73	38,960,386.48

其中：股票投资		-	-
基金投资		6,727,359,636.03	38,960,386.48
债券投资		199,428,066.70	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		58,816,290.93	-
应收利息	6.4.7.5	3,355,080.75	1,235.53
应收股利		186,484.29	12,465.60
应收申购款		729,179.98	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,257,837,122.31	44,539,990.08
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		234,335,646.13	-
应付管理人报酬		4,699,471.49	29,006.16
应付托管费		1,199,275.33	7,976.70
应付销售服务费		4,157,499.18	-
应付交易费用	6.4.7.7	175,859.43	10,623.92
应交税费		-	91,830.10
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	698,119.19	70,000.00
负债合计		245,265,870.75	209,436.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,479,249,589.92	29,941,966.04
未分配利润	6.4.7.10	2,533,321,661.64	14,388,587.16
所有者权益合计		7,012,571,251.56	44,330,553.20
负债和所有者权益总计		7,257,837,122.31	44,539,990.08

注：截至本报告期末2021年06月30日，基金份额净值1.5656元，基金份额总额4,479,249,589.92份。

6.2 利润表

会计主体：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

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0 6月30日
一、收入		174,087,875.59
1. 利息收入		2,946,281.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,492,382.51
债券利息收入		453,899.28
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）		19,351,621.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益	6.4.7.13	-11,322,367.20
债券投资收益	7.4.7.6	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	30,673,988.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	149,153,548.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	2,636,423.62
减：二、费用		38,981,252.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,572,048.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,621,080.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,653,878.88
4. 交易费用	6.4.7.20	1,038,567.71
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	6.4.7.21	95,677.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		135,106,622.96
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		135,106,622.96

注：本集合计划于2020-11-16日参公生效，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：国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)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	29,941,966.04	14,388,587.16	44,330,553.20

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	135,106,622.96	135,106,622.96
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)	4,449,307,623.88	2,383,826,451.52	6,833,134,075.40
其中：1. 基金申购款	5,162,130,663.22	2,736,745,347.47	7,898,876,010.69
2. 基金赎回款	-712,823,039.34	-352,918,895.95	-1,065,741,935.29
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)	4,479,249,589.92	2,533,321,661.64	7,012,571,251.56

注：本集合计划于2020-11-16日参公生效，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

国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划由国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划变更而来。

国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于2011年3月30日经中国证监会证监许可〔2011〕466号文核准设立，自2011年4月25日起开始募集并于2011年5月31日结束募集，于2011年6月7日成立。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，国泰君安君得益二号优选基金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2020年11月16日起，《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划管理合同》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，托管人为交通银行股份有限公司。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括QDII基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许集合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：投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（权益类资产比例不低于60%）合计占集合计划资产的比例为60%-95%，投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于15%；本集合计划应当保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划采用业绩比较基准：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%。

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、完整地反映了本基金于2021年6月30日的财务状况以及自2021年1月1日起至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本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。

6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2021年1月1日至2021年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。本集合计划采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《集合计划合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；通过红利再投资所得集合计划份额的最短持有期起始日与该份额最短持有期起始日相同；

3、集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.5 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	266,880,775.21
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	266,880,775.21

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		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	199,571,048.60	199,428,066.70	-142,981.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	199,571,048.60	199,428,066.70	-142,981.90
资产支持证券		-	-	-
基金		6,575,392,328.78	6,727,359,636.03	151,967,307.25
其他		-	-	-
合计		6,774,963,377.38	6,926,787,702.73	151,824,325.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 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	31,349.81
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	486.80
应收债券利息	3,323,244.14
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	3,355,080.75

6.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 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	175,859.43
银行间市场应付交易费用	—
合计	175,859.43

6.4.7.8 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	588,776.03
预提费用	109,343.16
合计	698,119.19

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 国君资管君得益三个月(FOF)A

金额单位：人民币元

项目 (国君资管君得益三个月(FOF)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	29,941,966.04	29,941,966.04
本期申购	3,248,125,733.30	3,248,125,733.30
本期赎回(以“-”号填列)	-326,405,720.45	-326,405,720.45
本期末	2,951,661,978.89	2,951,661,978.89

6.4.7.9.2 国君资管君得益三个月(FOF)C

金额单位：人民币元

项目 (国君资管君得益三个月(FOF)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	-	-
本期申购	1,914,004,929.92	1,914,004,929.92
本期赎回(以“-”号填列)	-386,417,318.89	-386,417,318.89
本期末	1,527,587,611.03	1,527,587,611.03

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 国君资管君得益三个月(FOF)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
----	-------	-------	---------

(国君资管君得益三个月 (FOF) A)			
上年度末	19,172,442.70	-4,783,855.54	14,388,587.16
本期利润	-6,126,850.83	96,237,387.70	90,110,536.87
本期基金份额交易产生的变动数	1,869,674,150.10	-301,872,024.71	1,567,802,125.39
其中：基金申购款	2,078,584,910.73	-348,792,982.96	1,729,791,927.77
基金赎回款	-208,910,760.63	46,920,958.25	-161,989,802.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,882,719,741.97	-210,418,492.55	1,672,301,249.42

6.4.7.10.2 国君资管君得益三个月 (FOF) C

单位：人民币元

项目 (国君资管君得益三个月 (FOF) C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-7,920,075.04	52,916,161.13	44,996,086.09
本期基金份额交易产生的变动数	814,382,118.83	1,642,207.30	816,024,326.13
其中：基金申购款	1,019,468,015.20	-12,514,595.50	1,006,953,419.70
基金赎回款	-205,085,896.37	14,156,802.80	-190,929,093.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	806,462,043.79	54,558,368.43	861,020,412.22

6.4.7.11 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	2,490,950.66
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	1,431.85
其他	-
合计	2,492,382.51

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	1,050,183,197.63
减：卖出/赎回基金成本总额	1,061,505,564.83
基金投资收益	-11,322,367.20

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本集合计划本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本集合计划本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.17 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	-
基金投资产生的股利收益	30,673,988.55
合计	30,673,988.55

6.4.7.18 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	149,117,095.12
——股票投资	-
——债券投资	-142,981.90
——资产支持证券投资	-
——基金投资	149,260,077.02
——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	-36,453.71
合计	149,153,548.83

6.4.7.19 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	2,636,423.62
合计	2,636,423.62

6.4.7.20 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	30,568.49
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	1,007,999.22
其中：申购费	116,410.00
赎回费	740,720.72
交易费	150,868.50
合计	1,038,567.71

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年01月01日至2021年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	531,308.37
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	35,849,369.97
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	6,032,532.37

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.21 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	13,334.15
其他费用	3,000.00
合计	95,677.31

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，本集合计划无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本集合计划无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、代销机构
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
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	集合计划托管人、代销机构

注：以上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

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

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	176,708.59	100.00%	175,859.43	100.00%

注：（1）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。

（2）本集合计划参公生效日为2020年11月16日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,572,048.11
其中：支付销售机构的客户维护费	3,895,615.30

注：（1）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0.80%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*0.80%/365。

（2）本集合计划参公生效日为2020年11月16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
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,621,080.62

注：（1）支付集合计划托管人交通银行的托管费按前一日集合计划资产净值0.22%的费率计提，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*0.22%/365。

（2）本集合计划参公生效日为2020年11月16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 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国君资管君得益三个月 (FOF) A	国君资管君得益三个月 (FOF) C	合计
国泰君安 证券	0.00	4,324,367.44	4,324,367.44
上海国泰 君安证券 资产管理 有限公司	0.00	15,713.86	15,713.86
交通银行 股份有限 公司	0.00	52,408.70	52,408.70
合计	0.00	4,392,490.00	4,392,490.00

注：本集合计划参公生效日为2020年11月16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。

本集合计划参公生效日为2020年11月16日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国君资管君得益三个月 (FOF)A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金合同生效日（2020年11月16日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	161,783,547.52
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	161,783,547.52
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.48%

国君资管君得益三个月 (FOF)C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金合同生效日（2020年11月16日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

注：本集合计划参公生效日为2020年11月16日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本集合计划除管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本集合计划。

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	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	266,880,775.21	2,490,950.66

注：本集合计划参公生效日为2020年11月16日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本集合计划未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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

项目	本期费用 2021年01月01日至2021年06月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	14,000.00
当期交易基金产生的赎回费（元）	0.00
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	0.00
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,494,219.35
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	415,703.30

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

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

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

本集合计划无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本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06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06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、法律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

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同责任，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

6.4.13.2.1 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	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	149,704,818.70	-
合计	149,704,818.70	-

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	49,723,248.00	-
合计	49,723,248.00	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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，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及上年度末均无重大流动性风险。

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	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
-----	-------	-------	--------	------	------	-----	----

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 2021 年中期报告

2021年 06月30 日							
资产							
银行存款	266,880,775.21	-	-	-	-	-	266,880,775.21
结算备付金	1,056,556.42	-	-	-	-	-	1,056,556.42
存出保证金	25,052.00	-	-	-	-	-	25,052.00
交易性金融资产	99,713,248.00	-	99,714,818.70	-	-	6,727,359,636.03	6,926,787,702.73
应收证券清算款	-	-	-	-	-	58,816,290.93	58,816,290.93
应收利息	-	-	-	-	-	3,355,080.75	3,355,080.75
应收股利	-	-	-	-	-	186,484.29	186,484.29
应收申购款	-	-	-	-	-	729,179.98	729,179.98
资产总计	367,675,631.63	-	99,714,818.70	-	-	6,790,446,671.98	7,257,837,122.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	234,335,646.13	234,335,646.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,699,471.49	4,699,471.49
应付托管费	-	-	-	-	-	1,199,275.33	1,199,275.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,157,499.18	4,157,499.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	175,859.43	175,859.43
其他负债	-	-	-	-	-	698,119.19	698,119.19
负债总计	-	-	-	-	-	245,265,870.75	245,265,870.75
利率敏感度缺口	367,675,631.63	-	99,714,818.70	-	-	6,545,180,801.23	7,012,571,251.56
上年度末 2020年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	5,565,902.47	-	-	-	-	-	5,565,902.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	38,960,386.48	38,960,386.48
应收利息	-	-	-	-	-	1,235.53	1,235.53
应收股利	-	-	-	-	-	12,465.60	12,465.60
资产总计	5,565,902.47	-	-	-	-	38,974,087.61	44,539,990.08
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	29,006.16	29,006.16
应付托管费	-	-	-	-	-	7,976.70	7,976.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,623.92	10,623.92
应交税费	-	-	-	-	-	91,830.10	91,830.10
其他负债	-	-	-	-	-	70,000.00	70,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	209,436.88	209,436.88
利率敏感度缺口	5,565,902.47	-	-	-	-	38,764,650.73	44,330,553.20

注：表中所示为本集合计划资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本期末持有包含利率风险的交易性金融资产全部为国债，且金额不重大，因此本集合计划的利率风险较低。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

本集合计划不持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此不存在相应的外汇风险。

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，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大的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	—	—	—	—
交易性金融资产—基金投资	6,727,359,636.03	95.93	38,960,386.48	87.89
交易性金融资产—债券投资	199,428,066.70	2.84	—	—
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	6,926,787,702.73	98.78	38,960,386.48	87.89

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06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6,727,359,636.03元，属于第二层次的余额为199,428,066.70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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	6,727,359,636.03	92.69
3	固定收益投资	199,428,066.70	2.75
	其中：债券	199,428,066.70	2.75
	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	267,937,331.63	3.69
8	其他各项资产	63,112,087.95	0.87
9	合计	7,257,837,122.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有境内股票资产。

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

本集合计划本报告期末未持有股票资产。

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

本集合计划本报告期内未进行股票投资。

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

本集合计划本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期内未进行股票投资。

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	199,428,066.70	2.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	199,428,066.70	2.84

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	019645	20国债15	500,630	50,218,195.30	0.72
2	019640	20国债10	499,900	49,990,000.00	0.71
3	010107	21国债(7)	496,240	49,723,248.00	0.71
4	019649	21国债01	494,620	49,496,623.40	0.71

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投资。

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投资。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本集合计划为基金中基金，通过定量和定性相结合的方法，从基金公司、基金经理、基金产品三个方向，筛选出各类资产类别中优秀的基金经理和基金品种进行投资，力求基金资产的长期稳健增值。本集合计划主要投资于公开募集证券投资基金，且资产比例不低于基金资产的80%，其中股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为60%-95%。报告期内，本集合计划投资运作符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	001054	工银新金融股票A	契约型 开放式	68,072,89 9.84	220,760,4 14.18	3.15	否
2	001605	国富沪港深成长精选股票	契约型 开放式	58,111,66 9.01	164,804,6 93.31	2.35	否
3	000136	民生加银策略精选混合A	契约型 开放式	32,032,94 5.42	163,880,5 48.77	2.34	否
4	004450	嘉实前沿科技	契约型	62,629,27	149,677,7	2.13	否

		沪港深股票	开放式	9.93	16.10		
5	161606	融通行业景气混合A	契约型 开放式	48,148,13 4.81	141,892,5 53.29	2.02	否
6	001990	中欧数据挖掘混合A	契约型 开放式	63,455,82 3.17	141,614,3 60.57	2.02	否
7	001186	富国文体健康股票A	契约型 开放式	56,068,62 2.54	141,292,9 28.80	2.01	否
8	002980	华夏创新前沿股票	契约型 开放式	47,744,73 0.60	138,220,9 95.09	1.97	否
9	100020	富国天益价值混合A	契约型 开放式	45,883,81 9.92	136,036,3 49.30	1.94	否
10	000595	嘉实泰和混合	契约型 开放式	27,180,19 9.33	134,840,9 68.88	1.92	否
11	004231	中欧行业成长混合(LOF)C	契约型 开放式	52,359,84 3.71	134,198,2 79.43	1.91	否
12	001736	圆信永丰优加生活股票	契约型 开放式	40,345,64 9.58	132,495,1 13.22	1.89	否
13	001705	泓德战略转型股票	契约型 开放式	58,071,94 0.74	132,485,3 25.60	1.89	否
14	002593	富国美丽中国混合A	契约型 开放式	43,749,05 2.08	131,553,3 99.60	1.88	否
15	519002	华安安信消费混合	契约型 开放式	32,145,85 7.17	131,251,5 34.83	1.87	是
16	519133	海富通改革驱动混合	契约型 开放式	47,341,84 5.30	130,237,4 16.42	1.86	否
17	163409	兴全绿色	契约型 开放式	56,348,57 0.88	127,854,9 07.33	1.82	否
18	001126	上投摩根卓越制造股票	契约型 开放式	68,692,98 3.86	126,978,9 80.67	1.81	否
19	002624	广发优企精选混合A	契约型 开放式	47,813,10 0.30	123,988,9 31.70	1.77	否
20	450003	国富潜力组合	契约型	64,631,58	122,218,3	1.74	否

		混合A	开放式	4.23	25.78		
21	000020	景顺长城品质 投资混合	契约型 开放式	27,882,91 2.71	122,015,6 26.02	1.74	否
22	202007	南方隆元产业 主题混合	契约型 开放式	108,243,5 70.86	120,583,3 37.94	1.72	否
23	001694	华安沪港深外 延增长灵活配 置混合	契约型 开放式	28,040,54 0.63	118,106,7 57.13	1.68	是
24	100060	富国高新技术 产业混合	契约型 开放式	23,412,63 6.19	114,838,9 80.51	1.64	否
25	002692	富国创新科技 混合A	契约型 开放式	42,145,41 3.89	110,968,8 74.77	1.58	否
26	000305	中银中高等级 债券A	契约型 开放式	96,744,90 7.32	102,549,6 01.76	1.46	否
27	005754	平安短债债券A	契约型 开放式	92,429,05 9.99	101,413,1 64.62	1.45	否
28	003293	易方达科瑞灵 活配置混合	契约型 开放式	49,330,68 1.93	101,266,0 23.87	1.44	否
29	002562	泓德泓益量化 混合	契约型 开放式	50,521,79 1.42	101,043,5 82.84	1.44	否
30	510050	50ETF	契约型 开放式	27,932,20 0.00	98,181,68 3.00	1.40	否
31	002851	南方品质优选 灵活配置混合	契约型 开放式	39,842,36 2.45	97,534,10 3.28	1.39	否
32	519672	银河蓝筹精选 混合	契约型 开放式	17,220,71 5.21	95,781,61 8.00	1.37	否
33	001975	景顺长城环保 优势股票	契约型 开放式	24,427,17 5.57	93,067,53 8.92	1.33	否
34	001410	信达澳银新能 源产业股票	契约型 开放式	20,381,91 0.83	91,657,45 3.00	1.31	否
35	001616	嘉实环保低碳 股票	契约型 开放式	23,377,84 9.21	91,407,39 0.41	1.30	否

36	040020	华安升级主题混合	契约型 开放式	31,305,39 8.78	89,220,38 6.52	1.27	是
37	320022	诺安研究精选股票	契约型 开放式	34,349,07 6.86	88,861,06 1.84	1.27	否
38	003984	嘉实新能源新材料股票A	契约型 开放式	27,030,34 1.93	88,202,70 8.75	1.26	否
39	110013	易方达科翔混合	契约型 开放式	15,859,80 6.71	86,182,18 9.66	1.23	否
40	519003	海富通收益增长混合	契约型 开放式	34,616,61 6.18	85,503,04 1.96	1.22	否
41	550002	中信保诚精萃成长混合	契约型 开放式	90,533,67 2.68	85,101,65 2.32	1.21	否
42	002669	华商万众创新混合	契约型 开放式	32,153,93 8.91	83,085,77 8.14	1.18	否
43	000263	工银信息产业混合A	契约型 开放式	17,323,30 0.13	82,840,02 1.22	1.18	否
44	001538	上投摩根科技前沿混合	契约型 开放式	25,726,45 9.99	81,519,43 3.77	1.16	否
45	008851	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合	契约型 开放式	75,785,33 5.35	81,022,10 2.02	1.16	否
46	040035	华安逆向策略混合	契约型 开放式	11,878,09 9.48	80,177,17 1.49	1.14	是
47	004958	圆信永丰优享生活混合	契约型 开放式	34,559,78 9.18	78,982,94 2.19	1.13	否
48	206002	鹏华精选成长混合	契约型 开放式	27,008,25 3.48	78,783,07 5.40	1.12	否
49	161610	融通领先	契约型 开放式	35,873,99 1.03	76,016,98 6.99	1.08	否
50	519193	万家消费成长股票	契约型 开放式	28,502,86 8.14	73,719,81 8.16	1.05	否

51	002808	泓德优势领航混合	契约型 开放式	26,727,99 3.59	61,297,98 0.50	0.87	否
52	004449	上银慧增利货币	契约型 开放式	61,009,54 4.36	61,009,54 4.36	0.87	否
53	161623	融通汇财宝货币B	契约型 开放式	60,969,95 0.99	60,969,95 0.99	0.87	否
54	004614	鹏扬利泽债券A	契约型 开放式	56,231,49 0.16	60,679,40 1.03	0.87	否
55	002563	泓德泓汇混合	契约型 开放式	20,536,34 9.95	60,557,58 8.73	0.86	否
56	001043	工银美丽城镇股票A	契约型 开放式	18,698,20 4.94	54,542,66 3.81	0.78	否
57	750001	安信灵活配置混合	契约型 开放式	18,549,78 8.89	53,163,69 4.96	0.76	否
58	001955	中欧养老混合A	契约型 开放式	19,134,71 1.06	51,108,81 3.24	0.73	否
59	000762	汇添富绝对收益定开混合A	契约型 开放式	34,867,49 6.51	50,348,66 4.96	0.72	否
60	121002	国投瑞银景气行业混合	契约型 开放式	22,649,15 0.62	50,224,49 1.50	0.72	否
61	519062	海富通阿尔法对冲混合A	契约型 开放式	42,770,74 4.23	50,170,08 2.98	0.72	否
62	000936	博时产业新动力混合A	契约型 开放式	15,757,64 2.61	47,698,38 4.18	0.68	否
63	519710	交银策略回报混合	契约型 开放式	18,430,35 4.98	41,007,53 9.83	0.58	是
64	166301	华商新趋势优选混合	契约型 开放式	5,961,99 1.35	40,642,89 5.03	0.58	否
65	004686	华夏研究精选股票	契约型 开放式	20,273,18 8.04	40,236,19 6.30	0.57	否
66	001236	博时丝路主题股票A	契约型 开放式	17,698,67 2.57	39,344,14 9.12	0.56	否

67	000390	华商优势行业混合	契约型 开放式	32,797,22 5.66	39,159,88 7.44	0.56	否
68	519091	新华泛资源优势混合	契约型 开放式	4,983,05 7.04	32,717,75 5.91	0.47	否
69	310339	申万菱信收益宝货币B	契约型 开放式	30,133,59 8.41	30,133,59 8.41	0.43	否
70	000663	国投瑞银美丽中国混合	契约型 开放式	13,291,53 7.44	30,012,29 1.54	0.43	否
71	004434	博时逆向投资混合A	契约型 开放式	14,684,51 7.11	29,319,10 6.86	0.42	否
72	519688	交银精选混合	契约型 开放式	18,736,52 4.83	23,564,92 7.28	0.34	否
73	000073	上投摩根成长动力混合	契约型 开放式	6,771,97 6.16	22,120,66 0.13	0.32	否
74	002955	融通新趋势灵活配置混合	契约型 开放式	9,012,61 8.30	20,215,30 2.85	0.29	否
75	001287	安信优势增长混合A	契约型 开放式	6,755,50 6.01	19,163,34 3.90	0.27	否
76	001938	中欧时代先锋股票A	契约型 开放式	5,254,61 1.38	10,723,08 5.44	0.15	否
77	166006	中欧成长	契约型 开放式	2,613,84 1.62	6,894,00 7.27	0.10	否
78	163411	兴全精选混合	契约型 开放式	1,664,34 6.25	6,614,77 7.74	0.09	否
79	003095	中欧医疗健康混合A	契约型 开放式	1,260,78 1.84	5,312,93 4.67	0.08	否
80	163417	兴全合宜	契约型 开放式	912,400.0 0	1,870,42 0.00	0.03	否
81	515800	800ETF	契约型 开放式	459,900.0 0	617,645.7 0	0.01	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,052.00
2	应收证券清算款	58,816,290.93
3	应收股利	186,484.29
4	应收利息	3,355,080.75
5	应收申购款	729,179.98
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	63,112,087.95

7.13.4 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处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
国君 资管 君得 益三 个月 (FOF) A	37,188	79,371.36	219,286,343.20	7.43%	2,732,375,635.69	92.57%
国君 资管 君得 益三 个月 (FOF) C	22,085	69,168.56	42,961,129.51	2.81%	1,484,626,481.52	97.19%
合计	59,273	75,569.81	262,247,472.71	5.85%	4,217,002,117.21	94.15%

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	国君资管君得益三个月(FOF)A	966,939.68	0.03%
	国君资管君得益三个月(FOF)C	4,332,307.95	0.28%
	合计	5,299,247.63	0.12%

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	国君资管君得益三个月 (FOF) A	0~10
	国君资管君得益三个月 (FOF) C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国君资管君得益三个月 (FOF) A	0~10
	国君资管君得益三个月 (FOF) C	>100
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国君资管君得益三个月 (FOF) A	国君资管君得益三个月 (FOF) C
基金合同生效日(2020年11月16日)基金份额总额	29,941,966.04	—
本报告期期初基金份额总额	29,941,966.04	—
本报告期基金总申购份额	3,248,125,733.30	1,914,004,929.92
减：本报告期基金总赎回份额	326,405,720.45	386,417,318.89
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,951,661,978.89	1,527,587,611.03

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本集合计划没有召开基金份额持有人大会。

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：

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及集合计划管理人、基金资产、集合计划托管人的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本集合计划投资策略无改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本集合计划本报告期所持有的基金未发生具有重大影响的事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	-	-	176,708.59	100.00%	-

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
国泰君安	202,440,39 3.46	100.0 0%	-	-	-	-	100,579,00 2.30	100.0 0%

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-01-07
2	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2021年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2021-04-22
3	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	上海证券报	2021-04-22
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2021-05-18
5	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	上海证券报、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 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、中国证监会核准集合计划募集的无异议函；
- 2、《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《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。

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