

国泰君安君得诚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:招商银行股份有限公司

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。

集合计划托管人招商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2021年08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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
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	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60

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	60
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划
基金简称	国君资管君得诚混合
基金主代码	952035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年03月25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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	448,745,844.34份
基金合同存续期	不定期

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，并通过宏观、市场和价值分析，捕捉价值型公司（价值公司）的投资机会。通过科学合理的资产配置和股票组合，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。 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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李艳	张燕
	联系电话	021-38676631	0755-83199084
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95521	95555
传真		021-38871190	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		江伟	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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)
本期已实现收益	72,597,853.20
本期利润	-9,486,335.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0169
本期加权平均净值利润率	-1.17%
本期基金份额净值增长率	-1.41%
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	310,907,137.87
期末可供分配基金份额利润	0.6928
期末基金资产净值	657,101,845.27
期末基金份额净值	1.4643
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	46.43%

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.16%	0.77%	-1.25%	0.53%	1.09%	0.24%
过去三个月	5.35%	0.88%	2.68%	0.64%	2.67%	0.24%
过去六个月	-1.41%	1.10%	1.62%	0.87%	-3.03%	0.23%
过去一年	11.98%	1.19%	18.09%	0.87%	-6.11%	0.32%
自基金合同生效起至今	46.43%	1.19%	29.44%	0.84%	16.99%	0.35%

注：业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 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		
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，国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划（原国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划）的投资经理	2020-03-25	-	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。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。
杜浩然	本产品的投资经理，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，国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划（原国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划）的投资经理	2020-03-25	-	7 年	复旦大学金融硕士。2014 年 7 月至 2020 年 5 月任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。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。
--	--	--	--	--	----------------

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。从行业板块配置角度，我们以消费升级和制造升级为主要选择方向，并且仍然保持了消费的较高的配置比例。因此，相比上半年市场相对极致的风格，使得我们的基金净值暂时表现相对落后。

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诚混合基金份额净值为1.4643元，本报告期内，基金份额净值增长率为-1.41%，同期业绩比较基准收益率为1.62%。

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、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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：国泰君安君得诚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	80,603,694.51	223,550,977.58
结算备付金		829,914.16	2,806,004.17

存出保证金		242,214.75	379,004.59
交易性金融资产	6.4.7.2	581,600,092.89	1,044,806,985.80
其中：股票投资		581,600,092.89	1,044,806,985.80
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,286,137.19	2,182,253.13
应收利息	6.4.7.5	8,457.46	23,041.31
应收股利		-	-
应收申购款		5,709.51	11,472,744.31
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		667,576,220.47	1,285,221,010.89
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		1,205,785.47	9.18
应付赎回款		7,768,080.41	19,785,102.12
应付管理人报酬		663,211.36	1,275,628.61
应付托管费		138,169.02	265,755.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	379,312.69	757,994.03

应交税费		125,510.63	2,575,154.13
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	194,305.62	212,768.32
负债合计		10,474,375.20	24,872,412.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	346,194,707.40	654,681,468.38
未分配利润	6.4.7.9	310,907,137.87	605,667,130.13
所有者权益合计		657,101,845.27	1,260,348,598.51
负债和所有者权益总计		667,576,220.47	1,285,221,010.89

注：截至本报告期末2021年06月30日，基金份额净值1.4643元，基金份额总额448,745,844.34份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安君得诚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03月25日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
一、收入		1,448,546.46	63,757,321.30
1. 利息收入		244,557.96	108,955.54
其中：存款利息收入	6.4.7.10	209,112.75	42,502.33
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		35,445.21	66,453.21

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		81,469,209.83	14,588,829.28
其中：股票投资收益	6.4.7.11	77,528,961.20	13,649,340.98
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.6	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,940,248.63	939,488.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-82,084,188.25	47,862,947.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,818,966.92	1,196,588.93
减：二、费用		10,934,881.51	2,020,285.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	4,864,632.40	665,380.19
2. 托管费	6.4.10.2. 2	1,013,465.11	138,620.90
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,430,612.98	721,456.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		2,529,100.06	-
7. 其他费用	6.4.7.20	97,070.96	494,828.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,486,335.05	61,737,035.93

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,486,335.05	61,737,035.93

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得诚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（基金净值）	654,681,468.38	605,667,130.13	1,260,348,598.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,486,335.05	-9,486,335.05
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）	-308,486,760.98	-285,273,657.21	-593,760,418.19
其中：1. 基金申购款	58,145,958.99	55,417,209.65	113,563,168.64
2. 基金赎回款	-366,632,719.97	-340,690,866.86	-707,323,586.83
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）	346,194,707.40	310,907,137.87	657,101,845.27
项 目	上年度可比期间 2020年03月25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)	26,453,424.38	7,836,479.09	34,289,903.47
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	61,737,035.93	61,737,035.93
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)	308,144,728.17	163,007,479.52	471,152,207.69
其中：1. 基金申购款	421,947,091.25	224,535,203.46	646,482,294.71
2. 基金赎回 款	-113,802,363.08	-61,527,723.94	-175,330,087.02
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)	334,598,152.55	232,580,994.54	567,179,147.09

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

国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划由国泰君安君得稳一号集合资产管理计划变更而来。

国泰君安君得稳一号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，自2013年2月19日起开始募集，于2013年2月21日结束募集工作，并于2013年2月27日成立。2013年5月31日，国泰君安君得稳一号集合资产管理计划取得《关于上海国泰君安证券资产管

理有限公司发起设立国泰君安君得稳一号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕941号）。

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，国泰君安君得稳一号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，《国泰君安君得诚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《国泰君安君得稳一号集合资产管理计划资产管理合同》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，托管人为招商银行股份有限公司。

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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、金融债、可转换债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可交换债券、可分离交易债券的纯债部分、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）。

集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产比例为50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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。

本集合计划的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×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

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

经营分部是指本集合计划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。

本集合计划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	80,603,694.51
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	80,603,694.51

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		651,227,088.61	581,600,092.89	-69,626,995.72
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		651,227,088.61	581,600,092.89	-69,626,995.72

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	7,680.50
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	776.11
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	0.85
合计	8,457.46

6.4.7.6 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	379,312.69
银行间市场应付交易费用	—
合计	379,312.69

6.4.7.7 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	24,962.46
预提费用	169,343.16
合计	194,305.62

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	848,615,378.67	654,681,468.38
本期申购	75,370,660.02	58,145,958.99
本期赎回（以“-”号填列）	-475,240,194.35	-366,632,719.97
本期末	448,745,844.34	346,194,707.40

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	561,323,125.23	44,344,004.90	605,667,130.13
本期利润	72,597,853.20	-82,084,188.25	-9,486,335.05
本期基金份额交易产生的变动数	-287,068,495.79	1,794,838.58	-285,273,657.21
其中：基金申购款	52,504,377.69	2,912,831.96	55,417,209.65
基金赎回款	-339,572,873.48	-1,117,993.38	-340,690,866.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	346,852,482.64	-35,945,344.77	310,907,137.87

6.4.7.10 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	183,525.64
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	23,872.89
其他	1,714.22
合计	209,112.75

6.4.7.11 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	1,011,336,328.23
减：卖出股票成本总额	933,807,367.03
买卖股票差价收入	77,528,961.20

6.4.7.12 基金投资收益

本集合计划本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 衍生工具收益

本集合计划本报告期末无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	3,940,248.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,940,248.63

6.4.7.17 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	-82,504,262.18
——股票投资	-82,504,262.18
——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	-420,073.93

合计	-82,084,188.25
----	----------------

6.4.7.18 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	1,818,966.92
合计	1,818,966.92

6.4.7.19 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	2,430,612.98
银行间市场交易费用	-
合计	2,430,612.98

6.4.7.20 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	8,427.80
帐户维护费	9,000.00
其他费用	300.00
合计	97,070.96

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
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	集合计划托管人

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03月25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	1,564,441,064.53	100.00%	620,205,359.40	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

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年03月25日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
国泰君安 证券	50,000,000.00	100.00%	1,057,900,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 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	1,132,573.05	100.00%	379,312.69	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年03月25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	721,456.02	100.00%	451,042.11	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03月25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	4,864,632.40	665,380.19
其中：支付销售机构的客户维护费	941,105.18	-

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1.20%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*1.20%/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01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年03月25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	1,013,465.11	138,620.90

注：支付集合计划托管人招商银行的托管费按前一日集合计划资产净值0.25%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*0.25%/365。

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内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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03月25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03月25日）持有的基金份额	6,676,326.56	6,676,326.56
报告期初持有的基金份额	42,628,172.01	6,645,809.39
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	57,517.17
报告期末持有的基金份额	42,628,172.01	6,618,809.39
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.50%	1.53%

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03月25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
招商银行股份有限公司	80,603,694.51	183,525.64	36,321,217.89	28,495.23

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

本报告期内未发生利润分配。

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	76,263	7,199,989.83	8,109,807.42	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打新限售	47.33	251.96	576	27,262.08	145,128.96	-
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	-
301006	迈拓股份	2021-05-31	2021-12-07	创业板打新限售	14.42	24.89	2,021	29,142.82	50,302.69	-
688499	利元亨	2021-06-	2021-07-	新股未上	38.85	38.85	951	36,946.3	36,946.3	-

		23	01	市				5	5	
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	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	1,305	8,378.10	8,378.10	-
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	-

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	-
3009	药易	2021	2021	创业	12.2	53.7	92	1,12	4,94	-

37	购	-01- 20	-07- 27	板打 新限 售	5	1		7.00	1.32	
3009 61	深水 海纳	2021 -03- 23	2021 -09- 30	创业 板打 新限 售	8.48	22.0 7	222	1,88 2.56	4,89 9.54	-
3009 62	中金 辐照	2021 -03- 29	2021 -10- 11	创业 板打 新限 售	3.40	16.3 7	290	986. 00	4,74 7.30	-
3009 52	恒辉 安防	2021 -03- 03	2021 -09- 13	创业 板打 新限 售	11.7 2	27.0 8	172	2,01 5.84	4,65 7.76	-
3009 96	普联 软件	2021 -05- 26	2021 -12- 03	创业 板打 新限 售	20.8 1	42.2 3	103	2,14 3.43	4,34 9.69	-
3009 58	建工 修复	2021 -03- 18	2021 -09- 29	创业 板打 新限 售	8.53	27.2 2	153	1,30 5.09	4,16 4.66	-
3009 86	志特 新材	2021 -04- 21	2021 -11- 01	创业 板打 新限 售	14.7 9	30.5 7	135	1,99 6.65	4,12 6.95	-
3009 45	曼卡 龙	2021 -02- 03	2021 -08- 10	创业 板打 新限 售	4.56	18.8 8	218	994. 08	4,11 5.84	-
3009 50	德固 特	2021 -02- -	2021 -09- -	创业 板打	8.41	39.1 3	103	866. 23	4,03 0.39	-

		24	03	新限售						
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	-

				售						
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	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	8.42	13.60	217	1,827.14	2,951.20	-
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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

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

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

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，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 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	80,603,694.51	-	-	-	-	-	80,603,694.51
结算备付金	829,914.16	-	-	-	-	-	829,914.16
存出保证金	242,214.75	-	-	-	-	-	242,214.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	581,600,092.89	581,600,092.89
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,286,137.19	4,286,137.19
应收利息	-	-	-	-	-	8,457.46	8,457.46
应收申购款	-	-	-	-	-	5,709.51	5,709.51
资产总计	81,675,823.42	-	-	-	-	585,900,397.05	667,576,220.47
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,205,785.47	1,205,785.47

国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划 2021 年中期报告

应付赎回款	-	-	-	-	-	7,768,080.41	7,768,080.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	663,211.36	663,211.36
应付托管费	-	-	-	-	-	138,169.02	138,169.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	379,312.69	379,312.69
应交税费	-	-	-	-	-	125,510.63	125,510.63
其他负债	-	-	-	-	-	194,305.62	194,305.62
负债总计	-	-	-	-	-	10,474,375.20	10,474,375.20
利率敏感度缺口	81,675,823.42	-	-	-	-	575,426,021.85	657,101,845.27
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	223,550,977.58	-	-	-	-	-	223,550,977.58
结算备付金	2,806,004.17	-	-	-	-	-	2,806,004.17
存出保证金	379,004.59	-	-	-	-	-	379,004.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,044,806,985.80	1,044,806,985.80
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,182,253.13	2,182,253.13
应收利息	-	-	-	-	-	23,041.31	23,041.31
应收申购款	-	-	-	-	-	11,472,744.31	11,472,744.31
资产总计	226,735,986.34	-	-	-	-	1,058,485,024.55	1,285,221,010.89
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9.18	9.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,785,102.12	19,785,102.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,275,628.61	1,275,628.61

应付托管费	-	-	-	-	-	265,755.99	265,755.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	757,994.03	757,994.03
应交税费	-	-	-	-	-	2,575,154.13	2,575,154.13
其他负债	-	-	-	-	-	212,768.32	212,768.32
负债总计	-	-	-	-	-	24,872,412.38	24,872,412.38
利率敏感度缺口	226,735,986.34	-	-	-	-	1,033,612,612.17	1,260,348,598.51

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	-	79,451,437.05	-	79,451,437.05
资产合计	-	79,451,437.05	-	79,451,437.05
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	17.60	-	17.60

负债合计	-	17.60	-	17.60
资产负债表外汇风险敞口净额	-	79,451,419.45	-	79,451,419.45
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	-	142,931,476.30	-	142,931,476.30
应收证券清算款	-	1,728,148.01	-	1,728,148.01
资产合计	-	144,659,624.31	-	144,659,624.31
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	9.18	-	9.18
负债合计	-	9.18	-	9.18
资产负债表外汇风险敞口净额	-	144,659,615.13	-	144,659,615.13

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本集合计划得单一外币汇率变化1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取得风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	港币相对人民币贬值1%	-794,514.19	-1,446,596.15
	港币相对人民币升值1%	794,514.19	1,446,596.15

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	581,600,092.89	88.51	1,044,806,985.80	82.90
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	581,600,092.89	88.51	1,044,806,985.80	82.90

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存不变。	
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
	权益投资公允价值增加 5%	-	52,240,349.29
	权益投资公允价值减少 5%	-	-52,240,349.29

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573019127.8元，属于第二层次的余额为8580965.13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

本集合计划本期末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	581,600,092.89	87.12
	其中：股票	581,600,092.89	87.12
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	81,433,608.67	12.20
8	其他各项资产	4,542,518.91	0.68
9	合计	667,576,220.47	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	5,349,799.55	0.81

B	采矿业	-	-
C	制造业	354,226,487.74	53.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,608.72	0.00
F	批发和零售业	19,924.56	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	22,812,790.00	3.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,911,487.34	13.68
J	金融业	26,349,578.00	4.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,370,662.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	100,317.93	0.02
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	502,148,655.84	76.42

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	16,072,447.96	2.45
日常消费品	49,772,816.93	7.57
电信服务	13,606,172.16	2.07
合计	79,451,437.05	12.09

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	002690	美亚光电	881,239	49,137,886.64	7.48
2	02319	蒙牛乳业	832,043	32,504,721.64	4.95
3	002624	完美世界	1,218,300	29,129,553.00	4.43
4	300253	卫宁健康	1,704,970	27,739,861.90	4.22
5	600872	中炬高新	589,174	24,757,091.48	3.77
6	603983	丸美股份	451,000	23,501,610.00	3.58
7	600004	白云机场	2,040,500	22,812,790.00	3.47
8	000860	顺鑫农业	517,800	21,840,804.00	3.32
9	300724	捷佳伟创	187,763	21,044,922.42	3.20
10	300132	青松股份	939,500	19,823,450.00	3.02
11	601233	桐昆股份	814,400	19,618,896.00	2.99
12	002439	启明星辰	664,132	19,266,469.32	2.93
13	00291	华润啤酒	297,533	17,268,095.29	2.63
14	601166	兴业银行	817,400	16,797,570.00	2.56
15	000799	酒鬼酒	62,879	16,071,872.40	2.45
16	002242	九阳股份	447,300	14,532,777.00	2.21
17	688085	三友医疗	328,813	14,346,111.19	2.18
18	002555	三七互娱	572,300	13,746,646.00	2.09
19	00700	腾讯控股	28,000	13,606,172.16	2.07
20	300577	开润股份	609,430	13,060,084.90	1.99
21	603027	千禾味业	482,688	12,689,867.52	1.93
22	603313	梦百合	420,847	12,646,452.35	1.92
23	002154	报喜鸟	1,947,500	12,405,575.00	1.89
24	603338	浙江鼎力	199,700	11,720,393.00	1.78

25	002851	麦格米特	339,597	10,605,614.31	1.61
26	00175	吉利汽车	488,000	9,928,045.73	1.51
27	603583	捷昌驱动	189,500	9,592,490.00	1.46
28	601318	中国平安	148,600	9,552,008.00	1.45
29	603369	今世缘	164,400	8,903,904.00	1.36
30	603517	绝味食品	99,300	8,369,997.00	1.27
31	600741	华域汽车	258,300	6,785,541.00	1.03
32	02020	安踏体育	40,396	6,144,402.23	0.94
33	600132	重庆啤酒	27,100	5,364,445.00	0.82
34	300498	温氏股份	372,000	5,345,640.00	0.81
35	603899	晨光文具	59,000	4,989,040.00	0.76
36	000661	长春高新	12,500	4,837,500.00	0.74
37	600584	长电科技	109,000	4,107,120.00	0.63
38	002027	分众传媒	358,200	3,370,662.00	0.51
39	600882	妙可蓝多	29,300	2,045,140.00	0.31
40	600519	贵州茅台	300	617,010.00	0.09
41	688161	威高骨科	1,729	183,360.45	0.03
42	300957	贝泰妮	576	145,128.96	0.02
43	300912	凯龙高科	2,073	81,199.41	0.01
44	300979	华利集团	900	78,750.00	0.01
45	300919	中伟股份	342	55,746.00	0.01
46	301006	迈拓股份	2,021	50,302.69	0.01
47	688499	利元亨	951	36,946.35	0.01
48	301007	德迈仕	1,465	29,233.94	0.00
49	300894	火星人	266	18,088.00	0.00
50	688067	爱威科技	565	17,735.35	0.00
51	301020	密封科技	1,474	15,683.36	0.00
52	688239	航宇科技	1,233	14,154.84	0.00
53	300941	创识科技	258	12,884.52	0.00
54	301021	英诺激光	1,258	11,900.68	0.00

55	300911	亿田智能	168	11,639.04	0.00
56	300953	震裕科技	91	9,086.35	0.00
57	688226	威腾电气	1,305	8,378.10	0.00
58	300925	法本信息	296	7,781.84	0.00
59	301015	百洋医药	199	7,727.17	0.00
60	300982	苏文电能	168	7,608.72	0.00
61	300997	欢乐家	556	7,255.80	0.00
62	300942	易瑞生物	243	6,930.36	0.00
63	300614	百川畅银	158	6,380.04	0.00
64	300932	三友联众	201	6,373.71	0.00
65	300933	中辰股份	606	6,326.64	0.00
66	300940	南极光	139	6,029.82	0.00
67	301013	利和兴	210	5,693.10	0.00
68	300918	南山智尚	546	5,683.86	0.00
69	301002	崧盛股份	96	5,531.52	0.00
70	300922	天秦装备	152	5,294.16	0.00
71	300955	嘉亨家化	113	5,205.91	0.00
72	300937	药易购	92	4,941.32	0.00
73	300961	深水海纳	222	4,899.54	0.00
74	300962	中金辐照	290	4,747.30	0.00
75	300952	恒辉安防	172	4,657.76	0.00
76	300996	普联软件	103	4,349.69	0.00
77	300958	建工修复	153	4,164.66	0.00
78	300986	志特新材	135	4,126.95	0.00
79	300945	曼卡龙	218	4,115.84	0.00
80	300950	德固特	103	4,030.39	0.00
81	300926	博俊科技	181	4,018.20	0.00
82	300987	川网传媒	147	3,941.07	0.00
83	300966	共同药业	124	3,910.96	0.00
84	300948	冠中生态	134	3,674.28	0.00

85	301016	雷尔伟	108	3,561.84	0.00
86	300930	屹通新材	144	3,525.12	0.00
87	300993	玉马遮阳	182	3,510.78	0.00
88	300943	春晖智控	151	3,474.51	0.00
89	300975	商络电子	241	3,140.23	0.00
90	300927	江天化学	100	3,010.00	0.00
91	300971	博亚精工	105	2,970.45	0.00
92	300978	东箭科技	217	2,951.20	0.00
93	300931	通用电梯	218	2,857.98	0.00
94	301004	嘉益股份	128	2,808.32	0.00
95	300967	晓鸣股份	230	2,654.20	0.00
96	301011	华立科技	78	2,639.52	0.00
97	300998	宁波方正	100	2,132.00	0.00
98	301012	扬电科技	83	2,013.58	0.00
99	301010	晶雪节能	100	1,761.00	0.00
100	300995	奇德新材	74	1,725.68	0.00
101	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	02319	蒙牛乳业	35,363,489.36	2.81
2	000860	顺鑫农业	27,780,520.91	2.20
3	00700	腾讯控股	26,513,681.72	2.10
4	603369	今世缘	25,776,266.00	2.05
5	000651	格力电器	24,682,167.28	1.96
6	601233	桐昆股份	22,992,586.70	1.82
7	02020	安踏体育	22,139,005.72	1.76
8	601166	兴业银行	18,343,973.00	1.46

9	00291	华润啤酒	16,971,285.86	1.35
10	000799	酒鬼酒	15,004,926.00	1.19
11	002242	九阳股份	14,875,711.00	1.18
12	002311	海大集团	14,743,764.14	1.17
13	603027	千禾味业	14,607,081.40	1.16
14	601398	工商银行	14,052,205.00	1.11
15	600276	恒瑞医药	12,839,493.00	1.02
16	600132	重庆啤酒	12,834,809.00	1.02
17	603338	浙江鼎力	12,552,906.90	1.00
18	02318	中国平安	11,738,566.55	0.93
19	002156	通富微电	11,381,808.53	0.90
20	300724	捷佳伟创	10,714,237.83	0.85

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	00291	华润啤酒	93,954,599.64	7.45
2	000799	酒鬼酒	85,201,049.50	6.76
3	603259	药明康德	80,215,761.42	6.36
4	000568	泸州老窖	63,975,436.53	5.08
5	002142	宁波银行	56,954,091.38	4.52
6	600519	贵州茅台	49,091,100.00	3.90
7	00700	腾讯控股	41,290,274.93	3.28
8	002690	美亚光电	40,239,653.40	3.19
9	000651	格力电器	24,617,411.11	1.95
10	603043	广州酒家	22,341,367.00	1.77
11	600004	白云机场	21,018,308.81	1.67
12	06049	保利物业	19,626,399.42	1.56
13	300724	捷佳伟创	18,886,415.80	1.50

14	000661	长春高新	18,570,281.00	1.47
15	02020	安踏体育	18,244,780.22	1.45
16	002311	海大集团	18,103,043.61	1.44
17	603369	今世缘	17,551,740.76	1.39
18	002127	南极电商	16,296,731.40	1.29
19	300166	东方国信	15,631,333.10	1.24
20	002851	麦格米特	15,538,958.28	1.23

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	553,104,736.30
卖出股票收入（成交）总额	1,011,336,328.23

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

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投资。

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投资。

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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	242,214.75
2	应收证券清算款	4,286,137.19
3	应收股利	—
4	应收利息	8,457.46
5	应收申购款	5,709.51
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,542,518.91

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	8,109,807.42	1.23	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

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
6,596	68,033.03	67,485,268.26	15.04%	381,260,576.08	84.96%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,496,856.49	0.56%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020年03月25日) 基金份额总额	34,289,903.47
本报告期期初基金份额总额	848,615,378.67

本报告期基金总申购份额	75,370,660.02
减：本报告期基金总赎回份额	475,240,194.35
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	448,745,844.34

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无

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，基金托管人无重大人事变动。

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

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	1,552,225,315.35	100.00%	1,132,573.05	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：本报告期租用证券公司交易单元无变化。

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	国泰君安君得诚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	证券日报	2021-01-22
3	国泰君安君得诚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
4	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	证券日报	2021-03-30
5	国泰君安君得诚混合型集合	证监会指定网站、公司官网	2021-04-22

	资产管理计划2021年第一季度报告		
6	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	证券日报	2021-04-22
7	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	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2021-04-29
8	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	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2021-05-07
9	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	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2021-05-18
10	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	证券日报、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
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稳一号集合资产管理计划合同变更的函
- 2、《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划托管协议》；

- 4、《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- 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

投资者可于本集合计划管理人办公时间预约查阅，或登录集合计划管理人网站www.gtjazg.com查阅，还可拨打本公司客服电话（95521）查询相关信息。

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