

国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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:2022 年 03 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2022年3月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年1月28日起至12月31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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§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	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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
8.7 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
8.8 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
8.9 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
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
8.12 投资组合报告附注.....	59
§9 基金份额持有人信息.....	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
9.3 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.....	61
§10 开放式基金份额变动.....	62
§11 重大事件揭示.....	62
11.1 基金份额持有人大会决议.....	62
11.2 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.....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
11.4 基金投资策略的改变.....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
11.8 其他重大事件.....	63
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
12.1 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.....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§13 备查文件目录.....	67
13.1 备查文件目录.....	67
13.2 存放地点.....	67
13.3 查阅方式.....	67

§ 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	国泰君安君得盈债券	
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	418,165,012.95份	
基金合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。	
下属分级基金的基金简称	国泰君安君得盈债券 A	国泰君安君得盈债券 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	298,694,748.66份	119,470,264.29份

注：国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划于2022年1月17日起正式变更为国泰君安君得盈债券型证券投资基金。

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。</p> <p>2、固定收益品种投资策略</p> <p>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。</p> <p>本集合计划投资策略还包括：杠杆投资策略、国债期货投资策略、股票投资策略。</p>
业绩比较基准	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%
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。

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

注：上海国泰君安证券资产管理有限公司法定代表人已于2022年1月27日变更为谢乐斌。

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2021年01月28日（基金合同生效日）- 2021年12月31日	
	国泰君安君得盈债券A	国泰君安君得盈债券C
本期已实现收益	11,526,090.18	5,753,673.98
本期利润	17,281,122.63	8,566,280.25
加权平均基金份额本	0.0750	0.0592

期利润		
本期加 权平均 净值利 润率	7.28%	5.77%
本期基 金份额 净值增 长率	6.69%	6.39%
3.1.2 期末数 据和指 标	2021年末	
期末可 供分配 利润	20,105,099.95	7,640,911.91
期末可 供分配 基金份 额利润	0.0673	0.0640
期末基 金资产 净值	319,633,598.87	127,439,518.99
期末基 金份额 净值	1.0701	1.0667
3.1.3 累计期 末指标	2021年末	
基金份 额累计 净值增 长率	6.69%	6.39%

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

2. 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。

3. 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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安君得盈债券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
过去三个月	3.04%	0.17%	1.10%	0.08%	1.94%	0.09%
过去六个月	4.69%	0.22%	1.66%	0.11%	3.03%	0.11%
自基金合同生效起至今	6.69%	0.17%	2.56%	0.12%	4.13%	0.05%

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日。

国泰君安君得盈债券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
过去三个月	2.93%	0.17%	1.10%	0.08%	1.83%	0.09%
过去六个月	4.48%	0.22%	1.66%	0.11%	2.82%	0.11%
自基金合同生效起至今	6.39%	0.18%	3.26%	0.11%	3.13%	0.07%

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，国泰君安君得盈债券 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

国泰君安君得盈债券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
(2021年01月28日-2021年12月31日)



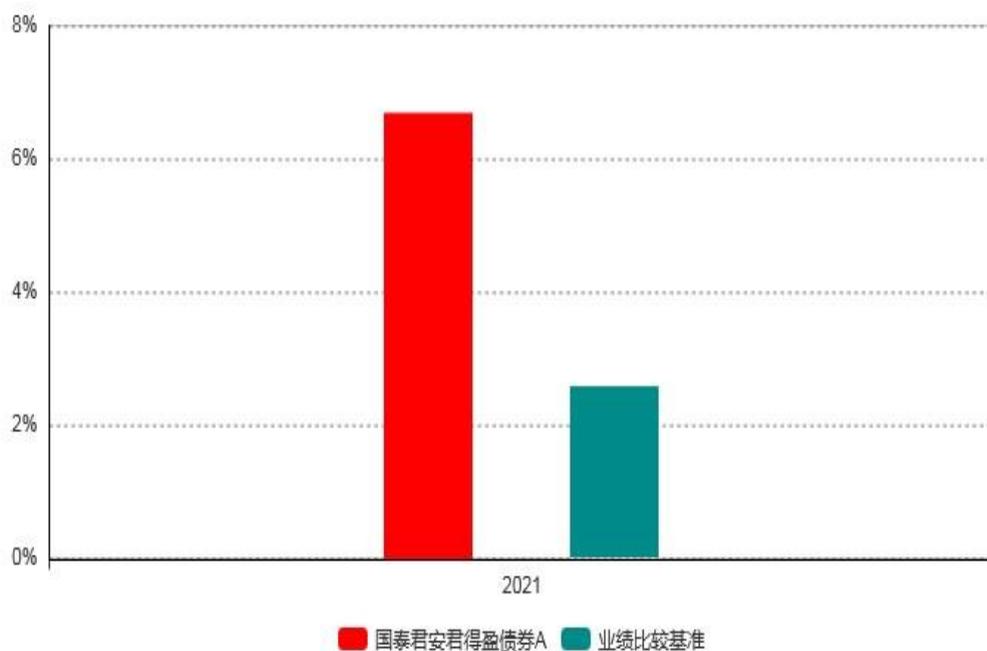
注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，截至本报告期末本集合计划合同生效不满一年。

国泰君安君得盈债券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
(2021年03月09日-2021年12月31日)

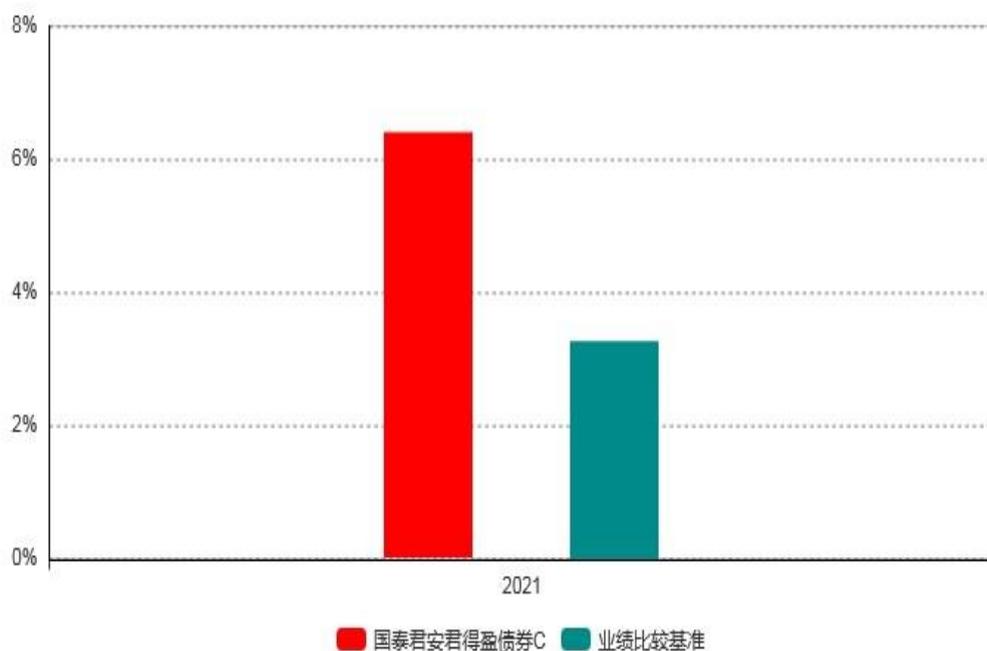


注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，国泰君安君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日，截至本报告期末本集合计划合同生效不满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日, 2021 年按实际存续期计算。



注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，国泰君安君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日，2021 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本集合计划未进行利润分配。

§ 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12月31日，本基金管理人共管理了9只公开募集证券投资基金、5只参照公开募集证券投资基金管理的集合计划：国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安创新医药混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得盛债券型证券投资基金、国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安信息行业混合型发起式证券投资基金、国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证500指数增强型证券投资基金、国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、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，国泰君安君得利一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	2021-01-28	-	7年	复旦大学金融硕士，7年证券从业经历。现任本公司固定收益投资部基金经理，主要负责固定收益类

	<p>币市场基金基金经理，国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金经理，国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理，国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理</p>			<p>产品的投资研究工作。自2017年9月5日起担任“国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划”投资经理，自2018年6月21日起担任“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，自2018年6月21日起至2021年11月30日担任“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，自2018年11月6日起至2021年12月2日担任“国泰君安现金管家货币集合资产管理计划”投资经理，自2020年3月25日起至2021年8月17日担任“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”投资经理，自2020年9月28日起至2021年12月6日担任“国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划”投资经理，自2021年1月28日起担任“国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划”投资经理，自2021年5月25日至2021年12月6日担任“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”投资经理，自2021年9月1日起担任“国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金”基金经理，自2021年12月3</p>
--	--	--	--	--

					日起担任“国泰君安现金管家货币市场基金”基金经理,自2021年12月7日起担任“国泰君安君得盛债券型证券投资基金”、“国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金”基金经理。
周晨	本产品的投资经理, 国泰君安君得盛债券型证券投资基金的基金经理、国泰君安君得明混合型集合资产管理计划的投资经理	2021-01-28	-	10年	北京大学光华管理学院金融学硕士, 拥有10年从业经验, 现任本公司公募权益投资部基金经理。历任本公司研究发展部研究员、高级研究员、资深研究员、本公司权益与衍生品部高级投资经理。自2019年8月30日起担任“国泰君安君得明混合型集合资产管理计划”投资经理, 自2020年1月6日至2021年8月17日担任“国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划”投资经理, 自2020年3月25日至2021年8月17日担任“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”投资经理, 自2020年6月18日至2021年12月6日担任“国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划”投资经理, 自2021年1月28日起担任“国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划”投资经理, 自2021年12月7日起担任“国泰君安君得盛

					债券型证券投资基金”基金经理。
杨坤	本产品的投资经理，国泰君安君得盛债券型证券投资基金的基金经理，国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理	2021-04-13	-	8年	英国华威大学金融硕士，约克大学金融数学硕士。10年债券从业经验。现任本公司基金经理、“固收+”投资组主管。曾就职于工银安盛人寿资产管理部、国泰君安证券研究所债券团队、平安养老固定收益部债券研究团队。自2021年4月13日至2021年12月6日担任“国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划”，自2021年4月13日起担任“国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划”投资经理，自2021年12月7日起担任“国泰君安君得盛债券型证券投资基金”基金经理，自2021年12月16日起担任“国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金”的基金经理。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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年市场整体是从滞胀到衰退的过程。其中上半年构成全年基本面的顶部位置，3季度大宗商品受供给因素进一步向上，但基本面数据已经较为疲软，4季度基本面更是明显回落。货币政策层面，2季度边际转向，4季度货币政策明显宽松。此外，在偏弱的基本面格局下，4季度市场稳增长和跨周期对冲的预期加强。债券市场来看，从滞胀到衰退通常对应了市场走牛，本轮债券牛市受制于利率绝对水平偏低的原因，全年来看幅度不大。值得关注的是，由于地产政策调整，2021年信用债市场分化巨大，高低评级债券利差拉大。股票市场层面，全年呈现出明显的结构市特点，周期股为代表的上游品种走强，消费为代表的下游品种持续调整。而具备产业周期逻辑的新能源、半导体等高端制造板块全年走强。总体来看，尽管全年走势波折，但是自上而下复盘来说2021年市场走势还是有迹可循。顺着上述的逻辑出发，4季度一些稳增长相关的标的表现较好。市

场在考虑海外货币收紧的环境下对于成长股获利兑现的问题，这是针对2021年消费股的学习效应。这一情况在12月中旬之后达到了极致状态，并延续到了2022年年初。

本报告期内，产品规模得到了稳健增长，在完成建仓之后，各类资产根据实际情况有序轮动，但是幅度都不大。结构上来看，我们在上半年相对看好周期品种，但3季度从周期品种到消费品种转移，4季度小幅加仓了部分基建、地产链条相关的稳增长标的。对于光伏、半导体、锂电等成长赛道全年持续关注，因此组合的构建更为均衡化。对于债券市场而言，我们在下半年开始小幅减仓，但依然维持中性仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安君得盈债券A集合计划份额净值为1.0701元，本报告期内，该类集合计划份额净值增长率为6.69%，同期业绩比较基准收益率为2.56%；截至报告期末国泰君安君得盈债券C集合计划份额净值为1.0667元，本报告期内，该类集合份额净值增长率为6.39%，同期业绩比较基准收益率为3.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2022年，我们认为基本面前低后高，货币政策在基本面见底之前会维持相对宽松，财政政策也可以期待。在类似的宏观情境中，都不会有太大的风险。当前需要关注的问题在于，上半年政策面和基本面究竟谁更主导，包括疫情这一外生因素的影响程度。但总体而言，这些不影响我们大的判断，投资的主要精力还是需要放到寻找结构性机会。我们同时认为2022年需要关注“变和不变”。首先，变化的是，由于宏观象限的不同，2021年和2022年在国内、国外情景都可能镜像对称。国内传统行业、中下游行业都会迎来景气度的回升，这将从指数层面对于市场形成支撑。海外货币收紧的冲击对于市场的影响或相对可控。其次，不变的是，自主可控、制造业升级，全球新能源浪潮等都还将继续，产业链存在继续延拓的机会。不过，对于大市值股票而言，需要更关注盈利和估值的匹配程度，波动受短期因素放大。这些行业进一步挖掘的难度在加大。总之，对于权益市场我们不悲观，对于中长期市场的收益水平依然保有期待。战术上，由于机会广泛存在，但是其中各有制约，我们配置结构上可能更趋向于分散，倾向于全局机会的把握，而不需要集中于某一领域的超额收益深挖。对于债券市场而言，我们认为上半年风险不大，但绝对收益率较低，且经历一年上涨之后预期差不足，大概率还是维持震荡的走势。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本集合计划管理人从维护集合计划份额持有人利益、保障集合计划合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 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、风险管理部门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。

4.8 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未进行利润分配，符合相关法规及集合计划合同的规定。

4.9 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基金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基金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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第22915号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划全体集合计划份额持有人
审计意见	我们审计了国泰君安君得盈债券型集合资产管

	<p>理计划(以下简称“国泰君安君得盈债券”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年1月28日(集合计划合同生效日)至2021年12月31日止期间的利润表和所有者权益(集合计划净值)变动表以及财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了国泰君安君得盈债券2021年12月31日的财务状况以及2021年1月28日(集合计划合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和集合计划净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国泰君安君得盈债券,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>无</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>国泰君安君得盈债券的集合计划管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“集合计划管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,集合计划管理人管理层负责评估国泰君安君得盈债券的持续经</p>

	<p>营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非集合计划管理人管理层计划清算国泰君安君得盈债券、终止运营或别无其他现实的选择。集合计划管理人治理层负责监督国泰君安君得盈债券的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价集合计划管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对集合计划管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国泰君安君得盈债券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日</p>

	可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安君得盈债券不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与集合计划管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	陈轶杰
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2022-03-30	

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	9,662,312.60
结算备付金		2,512,854.11
存出保证金		24,230.59
交易性金融资产	7.4.7.2	508,503,671.15
其中：股票投资		76,825,701.36
基金投资		-
债券投资		431,677,969.79
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		158,107.63
应收利息	7.4.7.3	9,068,136.39
应收股利		-
应收申购款		533,318.53
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		530,462,631.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		78,348,750.97
应付证券清算款		25,446.26
应付赎回款		4,087,460.39
应付管理人报酬		203,875.60
应付托管费		33,979.28
应付销售服务费		80,994.49
应付交易费用	7.4.7.4	85,500.31
应交税费		368,166.40
应付利息		3,242.35
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.5	152,097.09
负债合计		83,389,513.14
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.6	418,165,012.95
未分配利润	7.4.7.7	28,908,104.91
所有者权益合计		447,073,117.86

负债和所有者权益总计		530,462,631.00
------------	--	----------------

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12月31日。

（2）报告截止日2021年12月31日，集合计划份额总额418,165,012.95份。其中下属国泰君安君得盈债券A集合计划份额净值为1.0701元，份额总额为298,694,748.66份；国泰君安君得盈债券C集合计划份额净值为1.0667元，份额总额为119,470,264.29份。

7.2 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12月31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12月31日
一、收入		30,852,691.57
1. 利息收入		11,400,673.43
其中：存款利息收入	7.4.7.8	167,923.27
债券利息收入		11,184,737.90
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）		10,287,971.06
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-191,914.29
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.10	9,391,472.54
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	7.4.7.11	1,088,412.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	8,567,638.72

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 13	596, 408. 36
减：二、费用		5, 005, 288. 69
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	2, 033, 120. 89
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	338, 853. 52
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	487, 927. 51
4. 交易费用	7. 4. 7. 14	363, 116. 40
5. 利息支出		1, 313, 748. 62
其中：卖出回购金融资产支出		1, 313, 748. 62
6. 税金及附加		61, 357. 88
7. 其他费用	7. 4. 7. 15	407, 163. 87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25, 847, 402. 88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25, 847, 402. 88

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。

7.3 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12月31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12月31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）	-	25, 847, 402. 88	25, 847, 402. 88
三、本期基金份额交易产生的基金	365, 669, 290. 52	2, 898, 607. 41	368, 567, 897. 93

净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	1, 092, 372, 248. 01	19, 375, 954. 89	1, 111, 748, 202. 90
2. 基金赎回款	-726, 702, 957. 49	-16, 477, 347. 48	-743, 180, 304. 97
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）	418, 165, 012. 95	28, 908, 104. 91	447, 073, 117. 86

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7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

谢乐斌

陶耿

茹建江

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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%

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划2021年1月28日（集合计划合同变更生效日）至2021年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划2021年12月31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12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2021年1月28日(集合计划合同变更生效日)至2021年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为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资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止

的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本集合计划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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本集合计划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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资和债券投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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，基金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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权。本集合计划收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配

利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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）本集合计划的基金管理人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）本集合计划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单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和可交换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和可交换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计

划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本集合计划于2021年1月1日起执行。本集合计划在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本集合计划财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
活期存款	9,662,312.60
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	9,662,312.60

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	74,074,568.36	76,825,701.36	2,751,133.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	86,569,445.33	91,075,469.79	4,506,024.46
	银行间市场	339,131,886.66	340,602,500.00	1,470,613.34
	合计	425,701,331.99	431,677,969.79	5,976,637.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		499,775,900.35	508,503,671.15	8,727,770.80

7.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	3,364.69
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	1,243.77
应收债券利息	9,063,515.94
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	11.99
合计	9,068,136.39

7.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	80,220.21
银行间市场应付交易费用	5,280.10
合计	85,500.31

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,797.09
预提费用	149,300.00
合计	152,097.09

7.4.7.6 实收基金

7.4.7.6.1 国泰君安君得盈债券A

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安君得盈债券A)	本期 2021年01月28日(基金合同生效日)至2021年12月31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	641,556,814.31	641,556,814.31
本期赎回(以“-”号填列)	-395,357,788.08	-395,357,788.08
本期末	298,694,748.66	298,694,748.66

7.4.7.6.2 国泰君安君得盈债券C

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安君得盈债券C)	本期 2021年01月28日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	450,815,433.70	450,815,433.70
本期赎回(以“-”号填列)	-331,345,169.41	-331,345,169.41
本期末	119,470,264.29	119,470,264.29

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类份额首次确认为2021年3月9日。

7.4.7.7 未分配利润

7.4.7.7.1 国泰君安君得盈债券A

单位：人民币元

项目 (国泰君安君得盈债券 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	11,526,090.18	5,755,032.45	17,281,122.63
本期基金份额交易产生的变动数	7,541,549.53	-4,045,916.57	3,495,632.96
其中：基金申购款	21,345,426.15	-8,237,803.51	13,107,622.64
基金赎回款	-13,803,876.62	4,191,886.94	-9,611,989.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,105,099.95	833,750.26	20,938,850.21

7.4.7.7.2 国泰君安君得盈债券C

单位：人民币元

项目 (国泰君安君得盈债券 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	5,753,673.98	2,812,606.27	8,566,280.25
本期基金份额交易产生的变动数	1,887,237.93	-2,484,263.48	-597,025.55
其中：基金申购款	12,733,623.48	-6,465,291.23	6,268,332.25
基金赎回款	-10,846,385.55	3,981,027.75	-6,865,357.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,640,911.91	328,342.79	7,969,254.70

7.4.7.8 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12月31日
活期存款利息收入	136,779.28
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	31,143.99
其他	-
合计	167,923.27

7.4.7.9 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12月31日
卖出股票成交总额	107,833,400.04
减：卖出股票成本总额	108,025,314.33
买卖股票差价收入	-191,914.29

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 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12月31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	9,391,472.54
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	9,391,472.54

7.4.7.10.2 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12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	431,203,508.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	415,660,656.64
减：应收利息总额	6,151,379.62
买卖债券差价收入	9,391,472.54

7.4.7.11 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12月31日
股票投资产生的股利收益	1,088,412.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,088,412.81

7.4.7.12 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12月31日
1. 交易性金融资产	8,852,350.47
——股票投资	2,751,133.00
——债券投资	6,101,217.47

——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	284,711.75
合计	8,567,638.72

7.4.7.13 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12月31日
基金赎回费收入	596,408.36
合计	596,408.36

7.4.7.14 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12月31日
交易所市场交易费用	351,016.40
银行间市场交易费用	12,100.00
合计	363,116.40

7.4.7.15 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12月31日
----	--

	日
审计费用	18,520.67
信息披露费	120,000.00
汇划手续费	16,480.03
帐户维护费	34,410.09
差价收入增值税抵减	217,753.08
合计	407,163.87

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、中国证监会《关于准予国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划变更注册的批复》(证监许可[2021]4085号)以及《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变更注册为国泰君安君得盈债券型证券投资基金的公告》，国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划于2022年1月17日起正式变更为国泰君安君得盈债券型证券投资基金。

7.4.9 关联方关系

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。

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	289,933,282.73	100.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券	252,416,829.77	100.00%

7.4.10.1.4 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12月31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	4,724,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

		例		
国泰君安 证券	292,294.86	100.00%	80,220.21	100.00%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,033,120.89
其中：支付销售机构的客户维护费	963,151.08

注：支付集合计划管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司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

7.4.10.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	338,853.52

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

7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安君得盈债券A	国泰君安君得盈债券C	合计
上海国泰	0.00	14,949.14	14,949.14

君安证券 资产管理 有限公司			
国泰君安 证券	0.00	461,526.65	461,526.65
建设银行	0.00	6,735.27	6,735.27
合计	0.00	483,211.06	483,211.06

注：1、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。

2、本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.4%，销售服务费按前一日C类份额的集合计划资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div 365$$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设 银行股份 有限公司	9,662,312.60	136,779.28

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 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未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本集合计划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为人民币39,349,340.97元，是以如下债券作为质押：

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
101900834	19南电MTN005	2022-01-04	100.46	20,000	2,009,200.00
101900834	19南电MTN005	2022-01-05	100.46	25,000	2,511,500.00
101900926	19中电投MTN013	2022-01-06	100.47	100,000	10,047,000.00
102000353	20长电(疫情防控债)MTN001	2022-01-04	100.19	140,000	14,026,600.00
102000353	20长电(疫情防控债)MTN001	2022-01-05	100.19	60,000	6,011,400.00
102100810	21电网MTN001	2022-01-06	100.58	70,000	7,040,600.00
合计				415,000	41,646,300.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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38,999,410.00元，于2022年1月4日到期。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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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公司风险管理部、投资风险管理部、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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管人中国建设银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 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12月31日
--------	--------------------

A-1	-
A-1以下	-
未评级	30,013,000.00
合计	30,013,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

7.4.13.2.2 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12月31日
AAA	185,928,344.00
AAA以下	125,033,625.79
未评级	90,703,000.00
合计	401,664,969.79

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的基金管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2021年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有78,348,750.97元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本集合计划所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本集合计划投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本集合计划与由本集合计划的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本集合计划与由本集合计划的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本集合计划与由本集合计划的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年12月31日，本集合计划持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本集合计划的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年12月31日，本集合计划组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本集合计划的基金管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本集合计划主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	9,662,312.60	-	-	-	-	-	9,662,312.60
结算备付金	2,512,854.11	-	-	-	-	-	2,512,854.11
存出保证金	24,230.59	-	-	-	-	-	24,230.59
交易性金融资产	80,498,000.00	-	-	342,109,500.79	9,070,469.00	76,825,701.36	508,503,671.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	158,107.63	158,107.63
应收利息	-	-	-	-	-	9,068,136.39	9,068,136.39
应收申购款	-	-	-	-	-	533,318.53	533,318.53
资产总计	92,697,397.30	-	-	342,109,500.79	9,070,469.00	86,585,263.91	530,462,631.00
负债							
卖出回购金融资产款	78,348,750.97	-	-	-	-	-	78,348,750.97
应付证券清算款	-	-	-	-	-	25,446.26	25,446.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,087,460.39	4,087,460.39

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	203,875.60	203,875.60
应付托管费	-	-	-	-	-	33,979.28	33,979.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	80,994.49	80,994.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	85,500.31	85,500.31
应交税费	-	-	-	-	-	368,166.40	368,166.40
应付利息	-	-	-	-	-	3,242.35	3,242.35
其他负债	-	-	-	-	-	152,097.09	152,097.09
负债总计	78,348,750.97	-	-	-	-	5,040,762.17	83,389,513.14
利率敏感度缺口	14,348,646.33	-	-	342,109,500.79	9,070,469.00	81,544,501.74	447,073,117.86

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日
	基准点利率增加0.1%	-823,025.70
	基准点利率减少0.1%	823,457.37

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	76,825,701.36	17.18
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	76,825,701.36	17.18

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021年12月31日本集合计划持有的交易性权益类投资公允价值占集合计划资产净值的比例为17.18%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

7.4.14 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) 持续的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12月31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109,028,171.15元，属于第二层次的余额为399,475,500.00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

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本集合计划不会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将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本集合计划已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本集合计划业务的性质，新金融工具准则预期不会对本集合计划的财务状况和经营成果产生重大影响。

本集合计划将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	76,825,701.36	14.48
	其中：股票	76,825,701.36	14.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	431,677,969.79	81.38
	其中：债券	431,677,969.79	81.38
	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	12,175,166.71	2.30
8	其他各项资产	9,783,793.14	1.84
9	合计	530,462,631.00	100.00

8.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	61,926,074.86	13.85
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	625,646.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,312,656.50	1.19
J	金融业	5,427,552.00	1.21
K	房地产业	2,181,960.00	0.49
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,351,812.00	0.30
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	76,825,701.36	17.18

8.3 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	600690	海尔智家	70,000	2,092,300.00	0.47
2	600887	伊利股份	50,000	2,073,000.00	0.46
3	600036	招商银行	41,000	1,997,110.00	0.45
4	603816	顾家家居	25,000	1,929,000.00	0.43
5	601318	中国平安	38,200	1,925,662.00	0.43
6	600519	贵州茅台	900	1,845,000.00	0.41
7	000887	中鼎股份	80,000	1,744,800.00	0.39
8	000733	振华科技	14,000	1,739,920.00	0.39
9	002048	宁波华翔	80,000	1,730,400.00	0.39
10	002271	东方雨虹	30,000	1,580,400.00	0.35
11	600989	宝丰能源	90,000	1,562,400.00	0.35
12	601311	骆驼股份	101,419	1,554,753.27	0.35
13	603501	韦尔股份	5,000	1,553,850.00	0.35

14	600570	恒生电子	25,000	1,553,750.00	0.35
15	601012	隆基股份	18,000	1,551,600.00	0.35
16	300760	迈瑞医疗	4,000	1,523,200.00	0.34
17	000799	酒鬼酒	7,000	1,487,500.00	0.33
18	688518	联赢激光	30,000	1,478,100.00	0.33
19	002028	思源电气	30,000	1,476,300.00	0.33
20	002013	中航机电	80,000	1,454,400.00	0.33
21	002003	伟星股份	110,000	1,410,200.00	0.32
22	603986	兆易创新	7,920	1,392,732.00	0.31
23	002241	歌尔股份	25,000	1,352,500.00	0.30
24	603259	药明康德	11,400	1,351,812.00	0.30
25	002831	裕同科技	40,000	1,347,600.00	0.30
26	000858	五粮液	6,000	1,335,960.00	0.30
27	002415	海康威视	25,300	1,323,696.00	0.30
28	600486	扬农化工	10,000	1,312,000.00	0.29
29	002734	利民股份	100,000	1,310,000.00	0.29
30	002597	金禾实业	24,900	1,278,615.00	0.29
31	600048	保利地产	80,000	1,250,400.00	0.28
32	002557	洽洽食品	20,000	1,227,200.00	0.27
33	300036	超图软件	40,000	1,202,000.00	0.27
34	002236	大华股份	50,000	1,174,000.00	0.26
35	300253	卫宁健康	69,000	1,156,440.00	0.26
36	688005	容百科技	10,000	1,155,800.00	0.26
37	000568	泸州老窖	4,500	1,142,415.00	0.26
38	600703	三安光电	30,000	1,126,800.00	0.25
39	002960	青鸟消防	22,958	1,114,610.90	0.25
40	000921	海信家电	69,947	1,059,697.05	0.24
41	300207	欣旺达	25,060	1,056,529.60	0.24
42	603806	福斯特	8,000	1,044,400.00	0.23
43	688232	新点软件	23,630	1,026,723.50	0.23
44	600276	恒瑞医药	20,000	1,014,200.00	0.23

45	601377	兴业证券	100,000	988,000.00	0.22
46	002690	美亚光电	25,000	936,500.00	0.21
47	600641	万业企业	28,000	931,560.00	0.21
48	300750	宁德时代	1,500	882,000.00	0.20
49	300274	阳光电源	6,000	874,800.00	0.20
50	000860	顺鑫农业	20,600	786,508.00	0.18
51	603583	捷昌驱动	15,280	758,346.40	0.17
52	600399	抚顺特钢	30,000	743,100.00	0.17
53	002472	双环传动	25,448	701,855.84	0.16
54	603313	梦百合	39,080	676,474.80	0.15
55	600009	上海机场	13,400	625,646.00	0.14
56	600872	中炬高新	15,700	596,129.00	0.13
57	000301	东方盛虹	30,000	580,200.00	0.13
58	002142	宁波银行	13,500	516,780.00	0.12
59	300737	科顺股份	30,000	487,500.00	0.11
60	002832	比音勒芬	18,500	470,825.00	0.11
61	300132	青松股份	40,000	451,600.00	0.10
62	600315	上海家化	10,000	404,100.00	0.09
63	002439	启明星辰	13,100	373,743.00	0.08
64	600809	山西汾酒	1,000	315,780.00	0.07
65	603877	太平鸟	11,300	315,044.00	0.07
66	300577	开润股份	10,000	228,600.00	0.05
67	300896	爱美客	300	160,833.00	0.04

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	1.20
2	600276	恒瑞医药	3,831,777.00	0.86

3	002415	海康威视	3,661,379.00	0.82
4	601318	中国平安	3,332,347.00	0.75
5	300253	卫宁健康	2,857,223.66	0.64
6	300724	捷佳伟创	2,759,163.00	0.62
7	600887	伊利股份	2,652,422.00	0.59
8	603806	福斯特	2,648,605.00	0.59
9	603583	捷昌驱动	2,545,665.40	0.57
10	002439	启明星辰	2,528,187.00	0.57
11	600690	海尔智家	2,511,845.00	0.56
12	300059	东方财富	2,508,314.00	0.56
13	603501	韦尔股份	2,399,377.00	0.54
14	601688	华泰证券	2,398,334.00	0.54
15	002048	宁波华翔	2,374,936.00	0.53
16	002597	金禾实业	2,364,420.00	0.53
17	002472	双环传动	2,315,871.52	0.52
18	600036	招商银行	2,310,738.52	0.52
19	601233	桐昆股份	2,239,519.00	0.50
20	603027	千禾味业	2,231,706.20	0.50

8.4.2 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	601398	工商银行	4,916,761.00	1.10
2	300724	捷佳伟创	3,445,242.00	0.77
3	300059	东方财富	2,645,703.00	0.59
4	601233	桐昆股份	2,477,462.00	0.55
5	600276	恒瑞医药	2,456,357.40	0.55
6	002439	启明星辰	2,135,197.40	0.48
7	603108	润达医疗	2,117,971.00	0.47
8	002643	万润股份	2,116,660.40	0.47

9	601688	华泰证券	2,108,650.00	0.47
10	002415	海康威视	2,056,237.00	0.46
11	603583	捷昌驱动	2,014,164.40	0.45
12	603855	华荣股份	1,995,458.00	0.45
13	603806	福斯特	1,892,369.70	0.42
14	603027	千禾味业	1,890,396.40	0.42
15	002472	双环传动	1,829,692.00	0.41
16	300476	胜宏科技	1,818,763.00	0.41
17	002206	海利得	1,810,975.00	0.41
18	603338	浙江鼎力	1,798,081.00	0.40
19	002597	金禾实业	1,760,652.00	0.39
20	603369	今世缘	1,722,281.00	0.39

8.4.3 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	182,099,882.69
卖出股票收入（成交）总额	107,833,400.04

8.5 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	100,635,000.00	22.51
	其中：政策性金融债	100,635,000.00	22.51
4	企业债券	81,260,000.00	18.18
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	217,580,500.00	48.67
7	可转债(可交换债)	32,202,469.79	7.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	431,677,969.79	96.56
----	----	----------------	-------

8.6 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	210218	21国开18	300,000	30,138,000.00	6.74
2	210203	21国开03	200,000	20,422,000.00	4.57
3	101900066	19招商局MTN001	200,000	20,392,000.00	4.56
4	210208	21国开08	200,000	20,062,000.00	4.49
5	102000353	20长电(疫情防控债)MTN001	200,000	20,038,000.00	4.48

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金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。

8.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

8.12.3 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	24,230.59
2	应收证券清算款	158,107.63
3	应收股利	-
4	应收利息	9,068,136.39
5	应收申购款	533,318.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,783,793.14

8.12.4 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	占基金资产净值比例(%)
1	113044	大秦转债	2,736,000.00	0.61
2	110079	杭银转债	2,490,200.00	0.56
3	123111	东财转3	2,185,989.00	0.49
4	128083	新北转债	1,762,515.00	0.39
5	132014	18中化EB	1,699,900.00	0.38

6	132018	G三峡EB1	1,678,800.00	0.38
7	113024	核建转债	1,564,200.00	0.35
8	113026	核能转债	1,447,400.00	0.32
9	113615	金诚转债	1,359,820.00	0.30
10	113025	明泰转债	1,343,160.00	0.30
11	113622	杭叉转债	1,313,950.00	0.29
12	113046	金田转债	1,198,000.00	0.27
13	110076	华海转债	1,177,700.00	0.26
14	128113	比音转债	1,121,010.00	0.25
15	128078	太极转债	1,105,077.60	0.25
16	123083	朗新转债	1,031,872.00	0.23
17	128136	立讯转债	1,008,798.19	0.23
18	128140	润建转债	980,754.00	0.22
19	110074	精达转债	939,720.00	0.21
20	110048	福能转债	757,560.00	0.17
21	123022	长信转债	749,124.00	0.17
22	123101	拓斯转债	689,136.00	0.15
23	128119	龙大转债	668,590.00	0.15
24	123107	温氏转债	404,844.00	0.09

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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

国泰君安君得盈债券A	823	362,934.08	93,424,888.59	31.28%	205,269,860.07	68.72%
国泰君安君得盈债券C	1,285	92,972.97	9,430,758.46	7.89%	110,039,505.83	92.11%
合计	2,108	198,370.50	102,855,647.05	24.60%	315,309,365.90	75.40%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安君得盈债券A	121,962.80	0.04%
	国泰君安君得盈债券C	75,463.45	0.06%
	合计	197,426.25	0.05%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安君得盈债券A	0~10
	国泰君安君得盈债券C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安君得盈债券A	0~10
	国泰君安君得盈债券C	0

	券C	
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安君得盈债券A	国泰君安君得盈债券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	641,556,814.31	450,815,433.70
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	395,357,788.08	331,345,169.41
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	298,694,748.66	119,470,264.29

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、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。

本集合计划投资经理变动详见“4.1 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	289,933,282.73	100.00%	292,294.86	100.00%	-

11.7.2 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	252,416,829.77	100.00%	4,724,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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	证监会指定网站、公司官网	2021-01-25

	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	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资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2021-03-03
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)基金产品资料概要更新	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	证监会指定网站、公司官网	2021-04-16

	资产管理计划招募说明书 (更新) (2021年第2号)		
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
18	国泰君安君得盈债券型集合 资产管理计划2021年第二季 度报告	证监会指定网站、公司官网	2021-07-21
19	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	2021-07-21
20	上海国泰君安证券资产管理 有限公司关于调整第三方线 上代销平台费率优惠的公告	证券时报、证监会指定网站、 公司官网	2021-07-26
21	国泰君安君得盈债券型集合 资产管理计划2021年中期报 告	证监会指定网站、公司官网	2021-08-31
22	上海国泰君安证券资产管理 有限公司旗下部分集合计划 中期报告提示性公告	证券时报	2021-08-31
23	国泰君安君得盈债券型集合 资产管理计划2021年第三季 度报告	证监会指定网站、公司官网	2021-10-27
24	上海国泰君安证券资产管理	证券时报	2021-10-27

	有限公司旗下部分集合计划季度报告提示性公告		
25	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2021-11-17
26	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划(C类份额)基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2021-12-24
27	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划(A类份额)基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2021-12-24
28	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3号)	证监会指定网站、公司官网	2021-12-24

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021年1-3月	49,504,950.50	-	49,504,950.50	-	-
个人	1	2021年12月	-	106,573,828.21	-	106,573,828.21	25.49%

产品特有风险

本集合计划如果出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过集合计划份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

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

(2) 集合计划管理人被迫抛售证券以应付集合计划赎回的现金需要，则可能使集合计划资产净值受到不利影响，影响集合计划的投资运作和收益水平；

(3) 因集合计划净值精度计算问题，或因赎回费收入归集合计划资产，导致集合计划净值出现较大波动；

(4) 集合计划资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现集合计划合同约定的投资目的及投资策略;
(5) 大额赎回导致集合计划资产规模过小, 不能满足存续的条件, 集合计划将根据集合计划合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

12.2 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。国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划于2022年1月17日起正式变更为国泰君安君得盈债券型证券投资基金。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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>。

13.3 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
二〇二二年三月三十一日