

国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

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

基金管理人的董事会、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2022年3月18日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2021年05月25日(合同生效日)起至2021年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 | 6 |
| 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 | 15 |
| 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 | 16 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 17 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 17 |
| 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 | 17 |
| §5 托管人报告 | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 18 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 18 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 18 |
| §6 审计报告 | 18 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 18 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 18 |
| §7 年度财务报表 | 21 |
| 7.1 资产负债表 | 21 |
| 7.2 利润表 | 23 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 24 |
| 7.4 报表附注 | 25 |
| §8 投资组合报告 | 48 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 48 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 48 |
| 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 | 48 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 49 |
| 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 | 49 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 50 |

| | |
|---|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 50 |
| 8.12 投资组合报告附注..... | 50 |
| §9 基金份额持有人信息..... | 51 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 51 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 52 |
| §11 重大事件揭示..... | 53 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 53 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 53 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 54 |
| 11.8 其他重大事件..... | 54 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 58 |
| §13 备查文件目录..... | 58 |
| 13.1 备查文件目录..... | 58 |
| 13.2 存放地点..... | 58 |
| 13.3 查阅方式..... | 58 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------------|----------------|
| 基金名称 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金 | |
| 基金简称 | 国泰君安中债1-3年政金债 | |
| 基金主代码 | 952003 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021年05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 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 49,736,823.91份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰君安中债1-3年政金债A | 国泰君安中债1-3年政金债C |
| 下属分级基金的交易代码 | 952003 | 952303 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 49,736,814.30份 | 9.61份 |

注：国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金由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变更而来，变更生效日期为2021年12月07日。

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取获得与标的相似总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | <p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市</p> |

| | |
|--------|--|
| | 或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。 |
| 业绩比较基准 | 中债1-3年政策性金融债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-----------------------------|-------------------|
| 名称 | | 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李艳 | 李申 |
| | 联系电话 | 021-38676631 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | zgxxpl@gtjas.com | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 95521 | 021-60637111 |
| 传真 | | 021-38871190 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区南苏州路381号409A10室 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | | 上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 江伟 | 田国立 |

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 | 《中国证券报》 |
| 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 | 上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层 |

| | |
|---|--|
| 点 | |
|---|--|

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05月25日（基金合同生效日）- 2021年12月31日 | |
|--------------------------|-------------------------------------|----------------|
| | 国泰君安中债1-3年政金债A | 国泰君安中债1-3年政金债C |
| 本期已实现收益 | 754,417.54 | - |
| 本期利润 | 840,486.21 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0163 | - |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.58% | - |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.62% | 0.05% |

| | | |
|-------------------------------------|------------------|---------|
| 3.1.2 期末数 数据和指 标 | 2021年末 | |
| 期末可供分配利润 | 1, 281, 939. 18 | 0. 25 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0. 0258 | 0. 0260 |
| 期末基金资产净值 | 51, 804, 065. 68 | 10. 00 |
| 期末基金份额净值 | 1. 0416 | 1. 0406 |
| 3.1.3 累计期 末指标 | 2021年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 1. 62% | 0. 05% |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

4、本基金合同在当期生效，本报告期不足一年。

5、修订后的《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合同》生效日为2021年12月07日，本报告中的财务指标、图表、净值表现、投资组合报告等内容，不受

该合同生效日变更影响，仍保持历史数据的延续性，以2021年05月25日（初始生效日）为起始日进行编制。

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

国泰君安中债1-3年政金债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 | 0.72% | 0.02% | 0.88% | 0.02% | -0.16% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.38% | 0.02% | 1.77% | 0.02% | -0.39% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.62% | 0.02% | 2.08% | 0.02% | -0.46% | 0.00% |

国泰君安中债1-3年政金债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 | 0.05% | 0.02% | 0.12% | 0.02% | -0.07% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.05% | 0.02% | 0.12% | 0.02% | -0.07% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.05% | 0.02% | 0.12% | 0.02% | -0.07% | 0.00% |

注：为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2021 年 05 月 25 日（初始生效日）为起始日进行编制。

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

国泰君安中债1-3年政金债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05月25日-2021年12月31日)



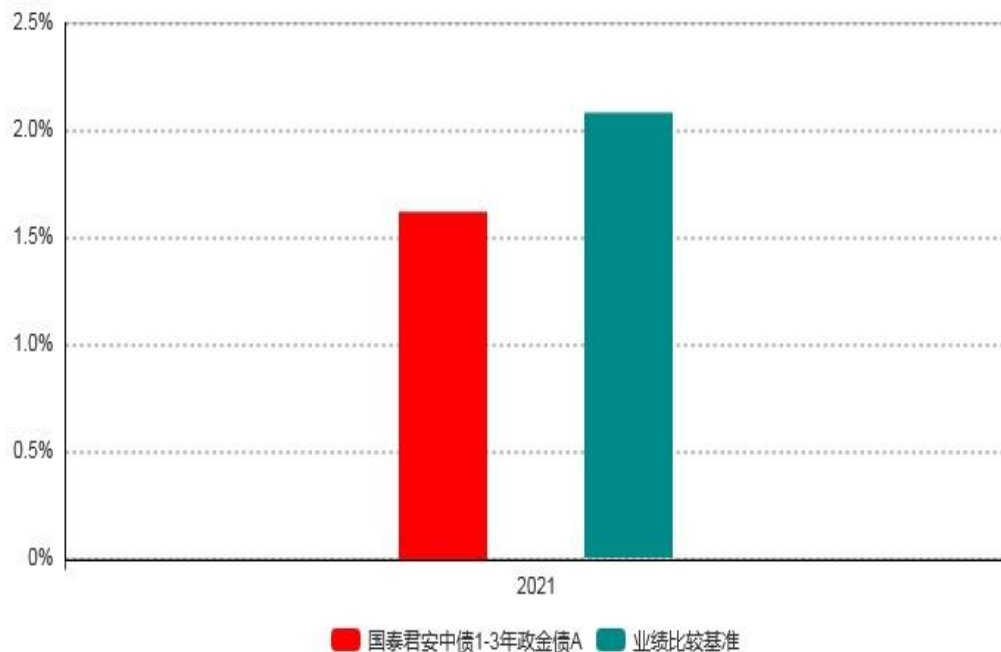
国泰君安中债1-3年政金债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月28日-2021年12月31日)



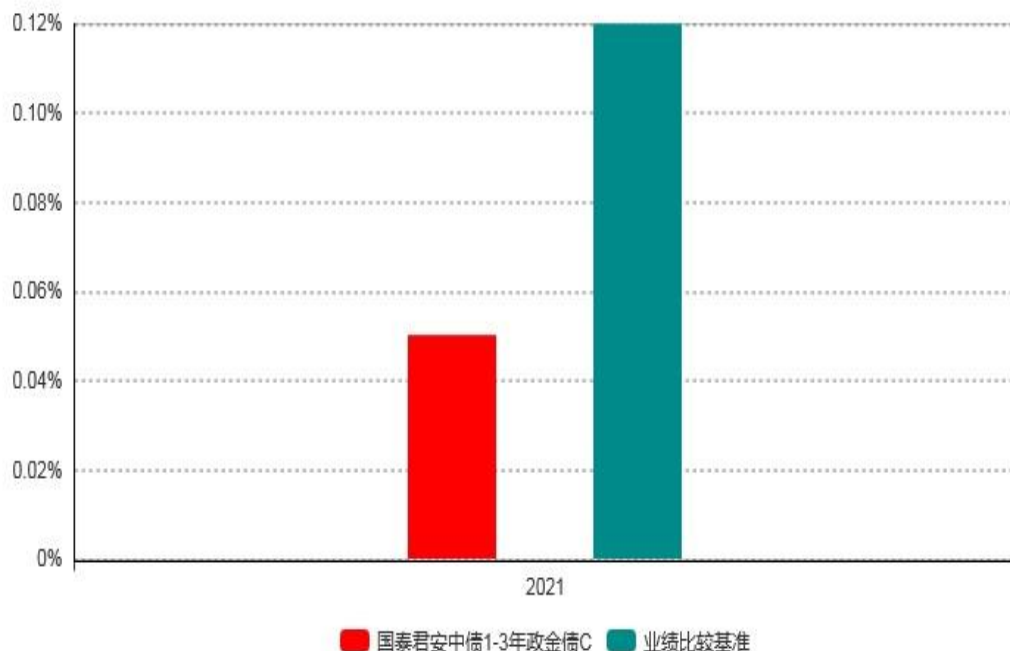
注：国泰君安君得惠中债 1-3 年政策性金融债指数集合资产管理计划合同生效日为 2021 年 05 月 25 日，“国泰君安君得惠中债 1-3 年政策性金融债指数集合资产管理计划”于 2021 年 12 月 7 日变更注册为“国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金”。“国泰君安中债 1-3 年政金债 C（代码：952303）”份额的首日（即 2021 年 12 月 28 日）

同国泰君安中债 1-3 年政金债 A 类份额净值，之后 C 类份额的净值将按照《管理合同》约定的方法计算。截至本报告期末基金合同生效不满一年。

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 5 月 25 日，2021 年按实际存续期计算。



注：国泰君安中债 1-3 年政金债 C 类份额 2021 年 12 月 28 日开始运作，首日份额净值同国泰君安中债 1-3 年政金债 A 类份额净值，之后 C 类份额的净值将按照《基金合同》约定的方法计算，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

本基金过去三年无利润分配事项。

§ 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 | 本产品的基金经理，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30天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理，国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划投资经理 | 2020-09-28 | - | 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 |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|----|---|
| | | | | | <p>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。</p> |
| 朱莹 | <p>本基金基金经理，现任上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部基金经理，历任固定收益部研究员、投资经理助理。</p> | 2021-12-30 | - | 3年 | <p>上海财经大学经济学学士、国际商务硕士、北卡罗莱纳大学夏洛特分校数理金融硕士、FRM。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部基金经理，历任固定收益部研究员、投资经理助理；东证期货衍生品研究院高级金融工程分析师。主要从</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 事债券投资研究。自2021年12月30日起担任“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。 |
|--|--|--|--|--|--|

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、相关规定以及基金合同、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基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金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

本基金管理人根据《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，未发现本基金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

报告期内本产品严格按照投资目标和投资范围，主要投资于所跟踪指数的成分券。并根据债券与标的指数的偏离情况，对投资组合进行调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中债1-3年政金债A基金份额净值为1.0416元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.62%，同期业绩比较基准收益率为2.08%；截至报告期末国泰君安中债1-3年政金债C基金份额净值为1.0406元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.05%，同期业绩比较基准收益率为0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国经济目前处于复苏前期，对于经济增速具有领先性的社融增速指标在2021年底已经基本出现本轮底部。2021年四季度中国人民银行货币政策执行报告继续强调宽信用，提到“培育激发实体信贷需求，引导有力扩大信贷投放”。随着近期各地陆续出台各种经济刺激政策，我们对于未来经济企稳回升的信心增强。

但经济的回暖仍然面临多重考验。国内方面，近期疫情又有所反复，疫情对于服务业和消费的干扰尚未完全消退，内需依然偏弱。在财政和基建的发力下，短期工业生产得到一定支撑，但地产销售目前还未看到明显的改善，实体融资需求的回暖存疑。国外方面，地缘政治局势起伏，风险资产波动剧烈上升，大宗商品和农产品暴涨，也在一定程度上增加了我国的通胀压力。此外美联储几乎确定会在2022年内加息，但是加息次数存在分歧，这也进一步增加了市场波动的可能性。

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，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，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，保障基金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

本基金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

本基金本报告期内未进行过利润分配。

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22922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 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | (一)我们审计的内容 我们审计了国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(以下简称“国泰君安中债1-3年政金债”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年5月25日(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(基金净值)变动表以及财务 |

| | |
|------------------------|---|
| | <p>报表附注。(二)我们的意见 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中债1-3年政金债2021年12月31日的财务状况以及2021年5月25日(合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</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中债1-3年政金债,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>国泰君安中债1-3年政金债的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)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,基金管理人管理层负责评估国泰君安中债1-3年政金债的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国泰君安中债1-3年政金债、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责</p> |

| | |
|------------------------|--|
| | <p>监督国泰君安中债1-3年政金债的财务报告过程。</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）评价基金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）对基金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中债1-3年政金债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可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安中债1-3年政金债不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结</p> |

| | |
|-----------|---|
| | 构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金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：国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金

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 | 5,860,212.15 |
| 结算备付金 | | - |
| 存出保证金 | | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 45,148,000.00 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 45,148,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 904,360.78 |

| | | |
|-----------------|------------|----------------------------|
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 51,912,572.93 |
| 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 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 6,597.94 |
| 应付托管费 | | 2,199.31 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 400.00 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 99,300.00 |
| 负债合计 | | 108,497.25 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 49,736,823.91 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 2,067,251.77 |
| 所有者权益合计 | | 51,804,075.68 |
| 负债和所有者权益总计 | | 51,912,572.93 |

注：1、截止本报告期末，基金份额总额49,736,823.91份，其中国泰君安中债1-3年政金债A基金份额净值1.0416元，国泰君安中债1-3年政金债A类基金份额49,736,814.30

份；国泰君安中债1-3年政金债C类基金份额净值1.0406元，国泰君安中债1-3年政金债C基金份额9.61份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2021年5月25日(合同生效日)至2021年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金

本报告期：2021年05月25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05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|------------------------|------------|--|
| 一、收入 | | 1,002,631.29 |
| 1. 利息收入 | | 717,442.62 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 35,133.03 |
| 债券利息收入 | | 682,309.59 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 199,120.00 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 199,120.00 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.3 | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 86,068.67 |
| 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. 18 | - |
| 减：二、费用 | | 162, 145. 08 |
| 1. 管理人报酬 | 7. 4. 10. 2. 1 | 48, 394. 00 |
| 2. 托管费 | 7. 4. 10. 2. 2 | 16, 131. 32 |
| 3. 销售服务费 | 7. 4. 10. 2. 3 | - |
| 4. 交易费用 | 7. 4. 7. 19 | 400. 00 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 税金及附加 | | - |
| 7. 其他费用 | 7. 4. 7. 20 | 97, 219. 76 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 840, 486. 21 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 840, 486. 21 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金

本报告期：2021年05月25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05月25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, 801, 784. 22 | 1, 332, 411. 92 | 54, 134, 196. 14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 840, 486. 21 | 840, 486. 21 |
| 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) | -3, 064, 960. 31 | -105, 646. 36 | -3, 170, 606. 67 |

| | | | |
|--|---------------|--------------|---------------|
| 列) | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 19.19 | 0.77 | 19.96 |
| 2. 基金赎回款 | -3,064,979.50 | -105,647.13 | -3,170,626.63 |
| 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） | 49,736,823.91 | 2,067,251.77 | 51,804,075.68 |

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

国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(原名为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,以下简称本基金)系经中国证券监督管理委员会于2009年5月6日以证监机构字[2009]373号《关于核准国泰君安证券股份有限公司设立国泰君安君得惠债券集合资产管理计划的批复》予以核准设立。计划类型为限定性集合资产管理计划。计划推广期间募集资金规模上限为60亿份,计划存续期间募集资金规模上限为60亿份。首次设立推广不包括认购资金利息共募集人民币3,473,987,444.45元,业经万隆亚洲会计师事务所(特殊普通合伙)万亚会沪验字(2009)第1357号验资报告予以验证。经本基金管理人公告,本基金于2009年9月24日成立,设立日的计划份额总额为3,475,308,498.04份。本基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司,托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

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,并经中国证监会机构部函[2021]951号文准予合同变更,自2021年5月25日起,国泰君安君得惠债券集合资产管理计划正式更名为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。《国泰君安君得惠中债 1-3 年政策性金融债指数集合资产管理计划资产管理合同》自2021年5月25日起生效，原《国泰君安君得惠债券集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

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》等规定及中国证监会《关于准予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变更注册的批复》(证监许可[2021]2906号)，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于2021年12月7日起正式变更为国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(原国泰君安君得惠债券集合资产管理计划)。本基金根据申购费、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别，称为 A 类份额；在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别，称为 C 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的政策性金融债、债券回购、银行存款。本基金不参与股票等资产的投资，同时本基金不投资于除政策性金融债以外的债券资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于待偿期为1-3年的标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债 1-3 年政策性金融债指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金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〉》、中国证券投资基金业协会(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》、《国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(原国泰君安君得惠债券集

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。

本财务报表以本基金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

本基金2021年5月25日(合同生效日)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、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021年5月25日(合同生效日)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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历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5月25日(合同生效日)至2021年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金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基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金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。

本基金目前以交易目的持有的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。

本基金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。本基金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。本基金持有的其他金融负债包括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基金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，且本基金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，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

本基金持有的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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金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

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

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

本基金同一类的每一基金份额享有同等分配权。本基金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

本基金以内部组织结构、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。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金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) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别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，本基金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》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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。本基金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。本基金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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金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) 本基金的城市维护建设税、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 | 5,860,212.15 | |
| 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 | 5,860,212.15 | |

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 | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | |
| | 银行间市场 | 44,885,525.00 | 45,148,000.00 | 262,475.00 |
| | 合计 | 44,885,525.00 | 45,148,000.00 | 262,475.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | |
| 合计 | 44,885,525.00 | 45,148,000.00 | 262,475.00 | |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 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 | 1,108.73 |
| 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 | - |
| 应收债券利息 | 903,252.05 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 904,360.78 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 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 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 400.00 |
| 合计 | 400.00 |

7.4.7.8 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 | - |
| 预提费用 | 99,300.00 |
| 合计 | 99,300.00 |

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 国泰君安中债1-3年政金债A

金额单位：人民币元

| 项目 (国泰君安中债1-3年政金债 A) | 本期 2021年05月25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 | 52,801,784.22 | 52,801,784.22 |
| 本期申购 | 9.58 | 9.58 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -3,064,979.50 | -3,064,979.50 |
| 本期末 | 49,736,814.30 | 49,736,814.30 |

7.4.7.9.2 国泰君安中债1-3年政金债C

金额单位：人民币元

| 项目 (国泰君安中债1-3年政金债 C) | 本期 2021年05月25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 | 9.61 | 9.61 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 9.61 | 9.61 |

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 国泰君安中债1-3年政金债A

单位：人民币元

| 项目 (国泰君安中债1-3年 政金债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 | 581,578.90 | 750,833.02 | 1,332,411.92 |
| 本期利润 | 754,417.54 | 86,068.67 | 840,486.21 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -54,057.26 | -51,589.49 | -105,646.75 |
| 其中：基金申购款 | 0.24 | 0.14 | 0.38 |
| 基金赎回款 | -54,057.50 | -51,589.63 | -105,647.13 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,281,939.18 | 785,312.20 | 2,067,251.38 |

7.4.7.10.2 国泰君安中债1-3年政金债C

单位：人民币元

| 项目 (国泰君安中债1-3年 政金债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 | - | - | - |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 0.25 | 0.14 | 0.39 |
| 其中：基金申购款 | 0.25 | 0.14 | 0.39 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 0.25 | 0.14 | 0.39 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入 | 35,133.02 |
| 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 | 0.01 |
| 其他 | - |
| 合计 | 35,133.03 |

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年05月25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 | 199,120.00 |
| 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 | 199,120.00 |

7.4.7.13.2 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05月25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 | 20,175,265.48 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 19,904,540.00 |
| 减：应收利息总额 | 71,605.48 |
| 买卖债券差价收入 | 199,120.00 |

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|----------------------------------|
| | 2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产 | 80,120.00 |
| ——股票投资 | - |

| | |
|------------------------|-----------|
| ——债券投资 | 80,120.00 |
| ——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 | -5,948.67 |
| 合计 | 86,068.67 |

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | - |
| 银行间市场交易费用 | 400.00 |
| 合计 | 400.00 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年05月25日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-------|--|
| 审计费用 | 24,219.04 |
| 信息披露费 | 50,000.00 |
| 汇划手续费 | 619.52 |

| | |
|-------|-----------|
| 帐户维护费 | 22,381.20 |
| 合计 | 97,219.76 |

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于2022年1月29日宣告2022年度第1次分红，向截至2022年2月7日止在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，国泰君安中债1-3年政金债A类基金份额按每10份基金份额派发红利0.2420元，国泰君安中债1-3年政金债C类基金份额按每10份基金份额派发红利0.2350元。除以上情况外，截至本财务报告批准报出日，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 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 | 基金管理人 |
| 国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”） | 基金管理人的股东、代销机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”） | 基金托管人 |

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

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05月25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 | 48,394.00 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 23,985.29 |

注：支付基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年05月25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 | 16,131.32 |

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

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05月25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 | | |
| | 国泰君安中债1-3年政金债A | 国泰君安中债1-3年政金债C | 合计 |
| 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

注：本基金国泰君安中债1-3年政金债A基金份额不收取销售服务费，国泰君安中债1-3年政金债C基金份额的销售服务费年费率为0.20%。

国泰君安中债1-3年政金债C的销售服务费按前一日国泰君安中债1-3年政金债C资产净值的0.20%年费率计提。

计算公式为：国泰君安中债1-3年政金债C基金日销售服务费=国泰君安中债1-3年政金债C基金份额前一日资产净值×0.20%/当年天数

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

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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05月25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 | 5,860,212.15 | 35,133.02 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

本基金本报告期内无利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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

本基金本报告期末无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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无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。

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同责任，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。

本基金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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金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。

本基金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。

本基金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

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年12月31日 |
|--------|--------------------|
| AAA | - |
| AAA以下 | - |
| 未评级 | 45,148,000.00 |
| 合计 | 45,148,000.00 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。本基金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，本基金的基金管理人每日对本基金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。本基金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。

于2021年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即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

本基金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》等法规的要求对本基金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基金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期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。

本基金所持证券均在银行间市场交易，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，本基金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。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的10%；本基金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%。

本基金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。

同时，本基金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基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

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。

本基金的基金管理人定期对本基金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。本基金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 | 5,860,212.15 | - | - | - | - | - | 5,860,212.15 |
| 交易性金融资产 | - | - | 5,016,000.00 | 40,132,000.00 | - | - | 45,148,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 904,360.78 | 904,360.78 |
| 资产总计 | 5,860,212.15 | - | 5,016,000.00 | 40,132,000.00 | - | 904,360.78 | 51,912,572.93 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 6,597.94 | 6,597.94 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 2,199.31 | 2,199.31 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 400.00 | 400.00 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 99,300.00 | 99,300.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 108,497.25 | 108,497.25 |
| 利率敏感度缺 | 5,860,212.15 | - | 5,016,000.00 | 40,132,000.00 | - | 795,863.53 | 51,804,075.68 |

| | | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|--|
| 口 | | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|--|

注：表中所示为本基金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 |
| | 基准利率点利率增加0.1% | -67,234.39 |
| | 基准利率点利率减少0.1% | 67,279.54 |

注：本基金合同自2021年05月25日起生效，无上年度末数据。

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。本基金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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于2021年12月31日，本基金未持有交易性权益类投资，因此无其他价格风险敞口。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021年12月31日本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，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基金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中属于第二层次的余额为45,148,000.00元，无属于第一或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金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，本基金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，本基金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—金融工具确认和计量》、《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，本基金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。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自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基金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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 45,148,000.00 | 86.97 |
| | 其中：债券 | 45,148,000.00 | 86.97 |
| | 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 | 5,860,212.15 | 11.29 |
| 8 | 其他各项资产 | 904,360.78 | 1.74 |
| 9 | 合计 | 51,912,572.93 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期未进行股票买入交易。

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

本基金本报告期未进行股票卖出交易。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未进行股票买卖交易。

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 | 45,148,000.00 | 87.15 |
| | 其中：政策性金融债 | 45,148,000.00 | 87.15 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 45,148,000.00 | 87.15 |

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 | 210402 | 21农发02 | 200,000 | 20,262,000.00 | 39.11 |
| 2 | 200202 | 20国开02 | 200,000 | 19,870,000.00 | 38.36 |
| 3 | 190207 | 19国开07 | 50,000 | 5,016,000.00 | 9.68 |

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
本基金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
本基金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
本基金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
本基金本报告期内未进行股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

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 本基金本报告期末未持有股票。

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 904,360.78 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 904,360.78 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资，不存在流通受限情况。

§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 中债1 -3年 政金 债A | 290 | 171,506.26 | 22,743,154.12 | 45.7 3% | 26,993,660.18 | 54.27% |
| 国泰 君安 中债1 -3年 政金 债C | 1 | 9.61 | 0.00 | 0.00% | 9.61 | 100.0 0% |
| 合计 | 291 | 170,916.92 | 22,743,154.12 | 45.7 3% | 26,993,669.79 | 54.27% |

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

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 | 国泰君安中债1-3年 政金债A | 0.00 | 0.00% |
| | 国泰君安中债1-3年 政金债C | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 0.00 | 0.00% |

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

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 | 国泰君安中债1-3 年政金债A | 0 |
| | 国泰君安中债1-3 年政金债C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基 金 | 国泰君安中债1-3 年政金债A | 0 |
| | 国泰君安中债1-3 年政金债C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 国泰君安中债1-3年政 金债A | 国泰君安中债1-3年政 金债C |
|---------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日(2021年05月25) | 52,801,784.22 | - |

| | | |
|-------------------------|---------------|------|
| 日)基金份额总额 | | |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 9.58 | 9.61 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 3,064,979.50 | - |
| 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 | 49,736,814.30 | 9.61 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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,本基金管理人发布了《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》,成飞先生离任本基金计划管理人副总裁职务。

本基金基金经理变动详见“4.1 基金管理人及基金经理情况”章节。

2、本报告期内,本基金托管人的专门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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币24,219.04元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | - | - | - | - | - |

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

本报告期内，本基金无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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 | 国泰君安君得惠中债1-3年政策性金融债指数集合资产管理计划招募说明书 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-05-25 |
| 2 | 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资产管理合同 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-05-25 |
| 3 | 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托管协议 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-05-25 |
| 4 | 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(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 | 2021-05-25 |
| 5 | 国泰君安君得惠中债1-3年政策性金融债指数集合资产 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-05-25 |

| | | | |
|----|--|--------------------|------------|
| | 管理计划(C类份额)基金产品资料概要更新 | | |
| 6 | 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资产管理合同及招募说明书提示性公告 | 中国证券报 | 2021-05-25 |
| 7 | 关于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资产管理合同等法律文件生效的公告 | 中国证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2021-05-25 |
| 8 | 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招募说明书、资产管理合同、托管协议更正公告 | 证监会指定网站 | 2021-06-01 |
| 9 | 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暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2021-08-25 |
| 10 | 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开放日常赎回业务的公告 | 中国证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2021-08-25 |
| 11 | 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2021年第三季度报告 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-10-27 |
| 12 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划季度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2021-10-27 |
| 13 | 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 | 中国证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2021-11-17 |

| | | | |
|----|---|--------------------|------------|
| | 北京证券交易所股票的公告 | | |
| 14 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金招募说明书 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-03 |
| 15 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-03 |
| 16 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-03 |
| 17 | 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合同 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-03 |
| 18 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金托管协议 | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-03 |
| 19 | 关于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变更注册为国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金的公告 | 中国证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-03 |
| 20 | 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合同及招募说明书提示性公告 | 中国证券报 | 2021-12-03 |
| 21 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金恢复申购、转换转入、定期定额投资的公告 | 中国证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-16 |
| 22 | 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变更公告 | 中国证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-30 |

| | | | |
|----|---|--------------|------------|
| 23 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第1号） | 证监会指定网站、公司官网 | 2021-12-30 |
| 24 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(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 | 2021-12-30 |
| 25 | 国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(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 | 2021-12-30 |

§ 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 | 一年 | 22,743,154.12 | 0.00 | 0.00 | 22,743,154.12 | 45.73% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 例 | 本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致： <ol style="list-style-type: none"> 基金在短期内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金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

《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资产管理合同》自2021年5月25日起生效，原《国泰君安君得惠债券集合资产管理计划管理合同》同日起失效。《国泰君安君得惠中债1-3年政策性金融债指数集合资产管理计划》于2021年12月7日起正式变更为《国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金》，原《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》同日起失效。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准变更的批复；
- 2、《国泰君安中债1-3年政策性金融债指数基金基金合同》；
- 3、《国泰君安中债1-3年政策性金融债指数基金托管协议》；
- 4、《国泰君安中债1-3年政策性金融债指数基金说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站<http://www.gtjazg.com>。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金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