

# 国泰君安君得盈债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

上海国泰君安证券资产管理有限公司的董事会、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。

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8月19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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 中期财务会计报告(未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产(基金净值)变动表	21
6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	61
§9 开放式基金份额变动 .....	61
§10 重大事件揭示 .....	61
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
§12 备查文件目录 .....	66
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 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证券投资基金	
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	261,273,054.07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	159,284,745.77份	101,988,308.30份

注：国泰君安君得盈债券型集合资产计划于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	<p>本基金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。</p>
投资策略	<p>本基金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>本基金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”的方法将基金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>本基金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，</p>

	<p>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基金资产获取增强型回报。</p> <p>2、固定收益品种投资策略</p> <p>本基金将采取利率策略、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>本基金投资策略还包括：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	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

### 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	吕巍
	联系电话	021-38676022
	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	上海市静安区新闸路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	谢乐斌	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
----------------	------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金中期报告备置地点	上海市静安区新闸路669号博华广场22-23层及25层

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30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	-6,484,444.86	-2,954,189.39
本期利润	-12,399,523.73	-3,714,948.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0444	-0.0308
本期加权平均净值利润率	-4.29%	-2.99%
本期基金份额净值增长率	-2.00%	-2.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	7,007,013.01	3,944,081.55
期末可供分配基金份额利润	0.0440	0.0387
期末基金资产净值	167,038,718.21	106,400,248.20
期末基金份额净值	1.0487	1.0433
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	

基金份额累计净值增长率	4.56%	4.06%
-------------	-------	-------

注：1. 所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。

### 3.2 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
过去一个月	1.86%	0.26%	0.96%	0.10%	0.90%	0.16%
过去三个月	2.51%	0.34%	1.48%	0.14%	1.03%	0.20%
过去六个月	-2.00%	0.35%	0.57%	0.15%	-2.57%	0.20%
过去一年	2.59%	0.29%	2.24%	0.13%	0.35%	0.16%
自基金合同生效起至今	4.56%	0.25%	3.14%	0.13%	1.42%	0.12%

##### 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
过去一个月	1.84%	0.26%	0.96%	0.10%	0.88%	0.16%
过去三个月	2.41%	0.34%	1.48%	0.14%	0.93%	0.20%
过去六个月	-2.19%	0.35%	0.57%	0.15%	-2.76%	0.20%
过去一年	2.18%	0.29%	2.24%	0.13%	-0.06%	0.16%
自基金合同生效起至今	4.06%	0.26%	3.84%	0.13%	0.22%	0.13%

#### 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-2022年06月30日)



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-2022年06月30日)



注：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。

#### § 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2022年6月30日，本基金管理人共管理了17只公开募集证券投资基金：国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安现金管家货币市场基金、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、国泰君安中证500指数增强型证券投资基金、国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安创新医药混合型发起式证券投资基金、国泰君安信息行业混合型发起式证券投资基金、国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安君得盈债券型证券投资基金、国泰君安君得诚混合型证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金。

### 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		
杨坤	本基金基金经理，国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金经理。	2021-04-13	-	9年	英国华威大学金融硕士，约克大学金融数学硕士。11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”投资经理，自2021年4月13日至2022年1月16日担任”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”基金经理，自2022年1月17日起担任”国泰君安君得盈债券型证券投资基金”基金经理。
周晨	本基金基金经理（已于2022年3月9日离任）	2021-01-28	2022-03-09	11年	周晨，北京大学光华管理学院金融学硕士，拥有11年从业经验，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、公募权益投资部基金经理。自2019年8月30日至2022年3月13日担任”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日至2022年1月16日担任“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日至2022年3月9日担任“国泰君安君得盛债券型证券投资基金”基金经理，自2022年1月17日至2022年3月9日担任“国泰君安君得盈债券型证券投资基金”基金经理，自2022年3月14日至2022年3月22日担任“国泰君安君得明混合型证券投资基金”基金经理。
杜浩然	本基金基金经理（已于2022年3月9日离任）	2021-01-28	2022-03-09	7年	杜浩然，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日至2022年3月2日担任“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日至2022年3月8日担任“国泰君安君得利一号货币增强集合资产管理计划”，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

				<p>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日起至2022年1月16日担任“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日起至2022年3月9日担任“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7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，自2022年1月17日起至2022年3月9日担任“国泰君安君</p>
--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

				<p>得盈债券型证券投资基金”基金经理，自2022年3月3日起担任“国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金”基金经理，自2022年3月9日起担任“国泰君安君得利短债债券型证券投资基金”基金经理，自2022年6月17日起担任“国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金”基金经理。</p>
--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期内，未发现本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

2022年上半年市场先抑后扬，基本面预期在悲观中开始逐步修复。1季度市场主要受海外加息预期压制，跨年行情没有发生，反而是成长股估值体系的下修。俄乌战争超预期爆发，一方面是对风险偏好的压制，更重要的是打乱了大宗商品供需天平，进一步加大了海外通胀压力。进入2季度，伴随着上海的全面封控，市场集中下调年内的基本面预期。极端情绪在4月下旬达到了极致。转机出现在4月下旬的政治局会议，政府强调了疫情管控和经济发展具有协同性，打消了市场的疑虑。同时，防疫的优化从推动重点企业复工，以及物流条件恢复开始。从5月中旬开始，上海疫情逐步受到控制。政府在2季度加大稳增长力度，进入6月之后各项高频数据开始修复。海外来看，随着6月美国加息的深入，市场开始前瞻美国在未来一年的衰退可能，这导致美债利率曲线变平。更重要的是，美元指数走强开始打压大宗商品。回顾上半年，国内经历了从衰退走向复苏的过程，而海外则还在滞胀的环境中。但随着利率上行，海外价格数据已经有拐头下行的态势，海外衰退预期在积累。我们认为市场在3季度将继续出现衰退和复苏交织的行情，但在4季度悲观预期有望得到修复。

本报告期内，权益仓位没有大的变动。基于市场从衰退逐步走向复苏，而海外加息开始压制大宗商品的基本判断，我们降低了上游资源品以及部分消费品的配置，加大了新能源、医药等成长板块的配置。此外，基于政策方向和毛利率改善的判断，我们亦加大了对于汽车、家电等制造业的配置，同时保留了一定仓位的地产和基建链条标的。对于债券市场而言，上半年表现较好，尤其是信用债。但是从未来1-2个季度来看，基本面复苏趋势较为明显，债券机会不大，我们降低了组合的仓位和久期。

##### 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基金份额净值为1.0487元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.00%，同期业绩比较基准收益率为0.57%；截至报告期末国泰君安君得盈债券C基金份额净值为1.0433元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.19%，同期业绩比较基准收益率为0.57%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期来看，市场在经历5-6月上涨之后，可能市场波动会加大，尤其是前期获利较多的新能源板块有止盈的压力。但是反过来考虑，在4月底市场最为悲观的时候，这些板块的逆势上行，背后来自于投资者对于其未来1-2个季度基本面高景气的预期。因此，我们认为判断这些板块行情结束的根源在于其3季度基本面能否被证伪，至少从目前来说还看不到这一迹象。更重要的是，从5月开始，基本面逐季复苏的态势相对比较明朗。从2020年-2021年周期经验来看，经济3季度相对2季度反弹的概率较大，而在基本实现今年经济目标之前，流动性也将宽裕。总体而言，我们认为随着基本面复苏进行，以基建、地产、制造业、大金融等传统板块在下半年也将迎来机会，新能源不是市场的唯一选择。海外来看，当前加息预期逐步见顶，预计海外流动性压力最大时点可能度过。海外步入衰退后对于大宗商品将产生压制，而在中国稳增长周期中，需求以内主导的中下游行业可能同时获得收入和毛利率上行的双击。总之，在经历1季度市场泥沙俱下、2季度否极泰来之后，预计下半年市场将迎来风险资产表现窗口。对于债券市场而言，基本面恢复到潜在水平之前，货币环境不会有大的变化，但随着时钟从衰退到复苏的演进，也需要未雨绸缪。

#### 4.6 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、风险管理部负责人及市场部门负责人组成。具体参会的投资部门负责人依据待决议事项对应的资管产品确定。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关事项。

## § 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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得盈债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,630,576.05	9,662,312.60
结算备付金		3,574,745.95	2,512,854.11
存出保证金		36,827.45	24,230.59
交易性金融资产	6.4.7.2	312,018,499.19	508,503,671.15
其中：股票投资		49,876,629.56	76,825,701.36
基金投资		-	-
债券投资		262,141,869.63	431,677,969.79
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,698,160.53	158,107.63
应收股利		-	-
应收申购款		20,740.00	533,318.53
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	9,068,136.39
资产总计		328,979,549.17	530,462,631.00
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		52,502,796.81	78,348,750.97
应付清算款		1,640,251.83	25,446.26
应付赎回款		848,366.60	4,087,460.39
应付管理人报酬		138,086.42	203,875.60
应付托管费		23,014.35	33,979.28
应付销售服务费		35,901.05	80,994.49
应付投资顾问费		-	-
应交税费		20,758.75	368,166.40
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.3	331,406.95	240,839.75
负债合计		55,540,582.76	83,389,513.14
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.4	261,273,054.07	418,165,012.95
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.5	12,165,912.34	28,908,104.91
净资产合计		273,438,966.41	447,073,117.86
负债和净资产总计		328,979,549.17	530,462,631.00

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额总额261,273,054.07份。其中：国泰君安君得盈债券A份额净值1.0487元，份额总额159,284,745.77份；国泰君安君得盈债券C份额净值1.0433元，份额总额101,988,308.30份。

2、比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰君安君得盈债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月28日（基金 合同生效日）至2021 年06月30日
一、营业总收入		-13,439,406.09	10,739,426.82
1. 利息收入		60,173.42	4,997,299.41
其中：存款利息收入	6.4.7.6	60,173.42	81,657.67
债券利息收入		-	4,867,629.48
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		-	48,012.26
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,914,271.29	504,032.21
其中：股票投资收益	6.4.7.7	-14,954,751.02	-324,043.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.8	7,570,854.56	538,530.78
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.9	469,625.17	289,545.12
以摊余成本计量的			
金融资产终止确认		-	-
产生的收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.10	-6,675,837.79	4,952,197.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	90,529.57	285,897.64
<b>减：二、营业总支出</b>		2,675,065.95	1,953,147.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,234,530.34	906,727.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	205,755.02	151,121.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	247,357.68	238,954.80
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		865,345.90	420,038.49
其中：卖出回购金融资产支出		865,345.90	420,038.49
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		22,540.43	-
8. 其他费用	6.4.7.12	99,536.58	236,305.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,114,472.04	8,786,279.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,114,472.04	8,786,279.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-16,114,472.04	8,786,279.14

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得盈债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	418,165,012.95	-	28,908,104.91	447,073,117.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	418,165,012. 95	-	28,908,104.9 1	447,073,117. 86
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-156,891,95 8.88	-	-16,742,192. 57	-173,634,15 1.45
(一)、综合收益总 额	-	-	-16,114,472. 04	-16,114,472. 04
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	-156,891,95 8.88	-	-627,720.53	-157,519,67 9.41
其中: 1. 基金申购款	107,115,774. 36	-	5,675,569.54	112,791,343. 90
2. 基金赎回 款	-264,007,73 3.24	-	-6,303,290.0 7	-270,311,02 3.31
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	261,273,054. 07	-	12,165,912.3 4	273,438,966. 41
项 目	上年度可比期间 2021年01月28日(基金合同生效日)至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	52,495,722.4 3	-	162,094.62	52,657,817.0 5
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	52,495,722.4 3	-	162,094.62	52,657,817.0 5
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	431,106,746. 52	-	10,385,749.6 5	441,492,496. 17
(一)、综合收益总 额	-	-	8,786,279.14	8,786,279.14
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	431,106,746. 52	-	1,599,470.51	432,706,217. 03
其中: 1. 基金申购款	777,223,908. 93	-	4,683,542.30	781,907,451. 23
2. 基金赎回 款	-346,117,16 2.41	-	-3,084,071.7 9	-349,201,23 4.20
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	483,602,468. 95	-	10,547,844.2 7	494,150,313. 22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

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

## 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

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），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。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票）、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基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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%；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。本基金投资于可转换债券、可交换债券、可分离交易债券的比例不超过基金资产的20%。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：中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深300指数收益率×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明



本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2022年1月1日起至2022年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

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

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的、股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中

包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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或资产支持证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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下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；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况

下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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也可按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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按直线法近似计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

1、于2022年1月1日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款, 金额分别为9,662,312.60元、

2,512,854.11元、24,230.59元、9,068,136.39元、158,107.63元和533,318.53元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款, 金额分别为9,665,677.29元、2,514,097.88元、24,242.58元、0.00元、158,107.63元和533,318.53元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为508,503,671.15元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为517,567,187.09元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为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、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款, 金额分别为78,348,750.97元、25,446.26元、4,087,460.39元、203,875.60元、33,979.28元、80,994.49元、85,500.31元、3,242.35元和2,797.09元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款, 金额分别为78,351,993.32元、25,446.26元、4,087,460.39元、203,875.60元、33,979.28元、80,994.49元、85,500.31元、0.00元和2,797.09元。

2、于2021年12月31日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结

算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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〉》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际



买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	11,630,576.05
等于：本金	11,629,694.70
加：应计利息	881.35
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	11,630,576.05

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	48,843,337.66	-	49,876,629.56	1,033,291.90	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	644,617.46	81,029,223.76	710,809.28	
	银行间市场	178,740,379.92	2,349,145.87	181,112,645.87	23,120.08
	合计	258,414,176.94	2,993,763.33	262,141,869.63	733,929.36
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	307,257,514.60	2,993,763.33	312,018,499.19	1,767,221.26	

#### 6.4.7.3 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	377.98

应付交易费用	104,865.51
其中：交易所市场	99,756.91
银行间市场	5,108.60
应付利息	-
预提费用	226,163.46
合计	331,406.95

#### 6.4.7.4 实收基金

##### 6.4.7.4.1 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	298,694,748.66	298,694,748.66
本期申购	77,181,964.79	77,181,964.79
本期赎回(以“-”号填列)	-216,591,967.68	-216,591,967.68
本期末	159,284,745.77	159,284,745.77

##### 6.4.7.4.2 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	119,470,264.29	119,470,264.29
本期申购	29,933,809.57	29,933,809.57
本期赎回(以“-”号填列)	-47,415,765.56	-47,415,765.56
本期末	101,988,308.30	101,988,308.30

注：申购含红利再投、转换入份额、赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.5 未分配利润

##### 6.4.7.5.1 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
本期期初	20,105,099.95	833,750.26	20,938,850.21
本期利润	-6,484,444.86	-5,915,078.87	-12,399,523.73
本期基金份额交易产生的变动数	-6,613,642.08	5,828,288.04	-785,354.04
其中：基金申购款	5,257,969.72	-1,244,495.91	4,013,473.81
基金赎回款	-11,871,611.80	7,072,783.95	-4,798,827.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,007,013.01	746,959.43	7,753,972.44

#### 6.4.7.5.2 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
本期期初	7,640,911.91	328,342.79	7,969,254.70
本期利润	-2,954,189.39	-760,758.92	-3,714,948.31
本期基金份额交易产生的变动数	-742,640.97	900,274.48	157,633.51
其中：基金申购款	1,886,125.55	-224,029.82	1,662,095.73
基金赎回款	-2,628,766.52	1,124,304.30	-1,504,462.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,944,081.55	467,858.35	4,411,939.90

#### 6.4.7.6 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	35,308.43
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	24,864.99
其他	-
合计	60,173.42

#### 6.4.7.7 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	121,407,082.28
减：卖出股票成本总额	136,050,705.02
减：交易费用	311,128.28
买卖股票差价收入	-14,954,751.02

#### 6.4.7.8 债券投资收益

##### 6.4.7.8.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	7,183,031.52
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	387,823.04
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	7,570,854.56

##### 6.4.7.8.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	332,245,140.34

付) 成交总额	
减: 卖出债券 (、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	327,404,357.58
减: 应计利息总额	4,442,363.44
减: 交易费用	10,596.28
买卖债券差价收入	387,823.04

#### 6.4.7.9 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	469,625.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	469,625.17

#### 6.4.7.10 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-6,960,549.54
——股票投资	-1,717,841.10
——债券投资	-5,242,708.44
——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	-6,675,837.79
----	---------------

#### 6.4.7.11 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	90,529.57
合计	90,529.57

#### 6.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	4,193.12
帐户维护费	18,480.00
合计	99,536.58

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰君安证券资产管理有限公司	基金管理人、销售机构

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、代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月28日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
国泰君安 证券	232,226,556.60	100.00%	107,110,013.62	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月28日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
国泰君安	123,674,015.27	100.00%	151,240,147.76	100.00%



证券				
----	--	--	--	--

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月28日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
国泰君安 证券	3,374,000,000.00	100.00%	1,315,000,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国泰君安 证券	229,431.33	100.00%	99,756.91	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国泰君安 证券	101,603.45	100.00%	87,552.37	100.00%

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年01月28日（基金合同 生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,234,530.34	906,727.83
其中：支付销售机构的客户维护费	572,063.20	432,916.94

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年01月28日（基金合同生 效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	205,755.02	151,121.31

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
--------------	-------------------------------

各关联方名称	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
上海国泰君安证券资产管理有限公司	0.00	9,215.97	9,215.97
国泰君安证券	0.00	216,618.18	216,618.18
建设银行	0.00	1,245.08	1,245.08
合计	0.00	227,079.23	227,079.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月28日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安君得盈债券A	国泰君安君得盈债券C	合计
国泰君安证券	0.00	208,474.57	208,474.57
合计	0.00	208,474.57	208,474.57

注：本基金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类份额的基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月28日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	11,630,576.05	35,308.43	24,534,130.72	75,894.95

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金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9,501,356.85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	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	-----	-------	--------

			值单价		
101800823	18广州地铁MTN 004	2022-07-07	103.61	100,000	10,361,438.36
合计				100,000	10,361,438.36

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，基金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43,001,439.96元，于2022年7月1日、2022年7月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	17,190,795.89	30,013,000.00
合计	17,190,795.89	30,013,000.00

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	122,570,795.44	185,928,344.00
AAA以下	92,005,974.19	125,033,625.79
未评级	30,374,304.11	90,703,000.00
合计	244,951,073.74	401,664,969.79

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行

的可流通股未超过该上市公司可流通股票的30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,630,576.05	-	-	-	-	-	11,630,576.05
结算备付金	3,574,745.95	-	-	-	-	-	3,574,745.95
存出保证金	36,827.45	-	-	-	-	-	36,827.45
交易性金融资产	11,212,635.92	10,499,819.73	149,152,720.22	85,590,452.99	5,686,240.77	49,876,629.56	312,018,499.19
应收清算款	-	-	-	-	-	1,698,160.53	1,698,160.53
应收申购款	-	-	-	-	-	20,740.00	20,740.00
资产总计	26,454,785.37	10,499,819.73	149,152,720.22	85,590,452.99	5,686,240.77	51,595,530.09	328,979,549.17
负债							
卖出回购金融资产款	52,502,796.81	-	-	-	-	-	52,502,796.81
应付清算款	-	-	-	-	-	1,640,251.83	1,640,251.83
应付赎回款	-	-	-	-	-	848,366.60	848,366.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	138,086.42	138,086.42
应付托管费	-	-	-	-	-	23,014.35	23,014.35
应付销售服务	-	-	-	-	-	35,901.05	35,901.05

费							
应交税费	-	-	-	-	-	20,758.75	20,758.75
其他负债	-	-	-	-	-	331,406.95	331,406.95
负债总计	52,502,796.81	-	-	-	-	3,037,785.95	55,540,582.76
利率敏感度缺口	-26,048,011.44	10,499,819.73	149,152,720.22	85,590,452.99	5,686,240.77	48,557,744.14	273,438,966.41
上年度末 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
应收申购款	-	-	-	-	-	533,318.53	533,318.53
其他资产	-	-	-	-	-	9,068,136.39	9,068,136.39
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
应交税费	-	-	-	-	-	368,166.40	368,166.40



其他负债	-	-	-	-	-	240,839.75	240,839.75
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：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	基准利率点利率增加0.1%	-204,933.49	-823,025.70
	基准利率点利率减少0.1%	205,192.63	823,457.37

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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基金、股票、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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	49,876,629.56	18.24	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	49,876,629.56	18.24	76,825,701.36	17.18

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2022年6月30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18.24%（2021年12月31日：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基金资产净值无重大影响（2021年12月31日：同）。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2022年06月30日	2021年12月31日
第一层次	72,819,602.09	109,028,171.15
第二层次	239,198,897.10	399,475,500.00
第三层次	-	-
合计	312,018,499.19	508,503,671.15

#### 6.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	49,876,629.56	15.16
	其中：股票	49,876,629.56	15.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	262,141,869.63	79.68
	其中：债券	262,141,869.63	79.68
	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	15,205,322.00	4.62
8	其他各项资产	1,755,727.98	0.53
9	合计	328,979,549.17	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	666,000.00	0.24
C	制造业	42,173,639.56	15.42
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	587,160.00	0.21
J	金融业	2,344,300.00	0.86
K	房地产业	1,309,500.00	0.48
L	租赁和商务服务业	931,720.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	1,864,310.00	0.68
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	49,876,629.56	18.24
--	----	---------------	-------

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600048	保利发展	75,000	1,309,500.00	0.48
2	300059	东方财富	50,000	1,270,000.00	0.46
3	000333	美的集团	20,000	1,207,800.00	0.44
4	600887	伊利股份	30,000	1,168,500.00	0.43
5	002142	宁波银行	30,000	1,074,300.00	0.39
6	002507	涪陵榨菜	30,000	1,035,600.00	0.38
7	002271	东方雨虹	20,000	1,029,400.00	0.38
8	603338	浙江鼎力	20,000	1,014,000.00	0.37
9	300450	先导智能	16,000	1,010,880.00	0.37
10	000858	五粮液	5,000	1,009,650.00	0.37
11	000568	泸州老窖	4,000	986,160.00	0.36
12	601677	明泰铝业	40,000	952,000.00	0.35
13	300760	迈瑞医疗	3,000	939,600.00	0.34
14	603259	药明康德	9,000	935,910.00	0.34
15	600600	青岛啤酒	9,000	935,280.00	0.34
16	000661	长春高新	4,000	933,680.00	0.34
17	601888	中国中免	4,000	931,720.00	0.34
18	002709	天赐材料	15,000	930,900.00	0.34
19	300012	华测检测	40,000	928,400.00	0.34
20	002756	永兴材料	6,000	913,260.00	0.33
21	002705	新宝股份	40,000	879,600.00	0.32
22	002597	金禾实业	20,000	866,600.00	0.32
23	601799	星宇股份	5,000	855,000.00	0.31
24	002241	歌尔股份	25,000	840,000.00	0.31

25	600690	海尔智家	30,000	823,800.00	0.30
26	600519	贵州茅台	400	818,000.00	0.30
27	000733	振华科技	6,000	815,820.00	0.30
28	603816	顾家家居	14,300	809,809.00	0.30
29	002557	洽洽食品	14,000	797,020.00	0.29
30	300502	新易盛	30,000	786,000.00	0.29
31	002572	索菲亚	28,000	770,000.00	0.28
32	603916	苏博特	30,000	764,700.00	0.28
33	002812	恩捷股份	3,000	751,350.00	0.27
34	002013	中航机电	60,000	741,000.00	0.27
35	603612	索通发展	20,000	737,000.00	0.27
36	688733	壹石通	10,000	733,900.00	0.27
37	600989	宝丰能源	50,000	732,500.00	0.27
38	300979	华利集团	10,000	730,800.00	0.27
39	000887	中鼎股份	40,000	729,600.00	0.27
40	002372	伟星新材	30,000	721,200.00	0.26
41	603986	兆易创新	5,000	711,050.00	0.26
42	002179	中航光电	11,200	709,184.00	0.26
43	600522	中天科技	30,000	693,000.00	0.25
44	600660	福耀玻璃	16,000	668,960.00	0.24
45	601088	中国神华	20,000	666,000.00	0.24
46	601012	隆基绿能	9,800	652,974.00	0.24
47	002472	双环传动	19,934	634,698.56	0.23
48	601966	玲珑轮胎	25,000	634,250.00	0.23
49	600285	羚锐制药	50,000	626,500.00	0.23
50	300274	阳光电源	6,000	589,500.00	0.22
51	300496	中科创达	4,500	587,160.00	0.21
52	002245	蔚蓝锂芯	25,000	580,250.00	0.21
53	002371	北方华创	2,000	554,240.00	0.20
54	002960	青鸟消防	20,000	547,800.00	0.20
55	603236	移远通信	3,900	521,274.00	0.19

56	600460	士兰微	10,000	520,000.00	0.19
57	300409	道氏技术	20,000	519,600.00	0.19
58	603501	韦尔股份	3,000	519,090.00	0.19
59	002531	天顺风能	30,000	494,700.00	0.18
60	002384	东山精密	20,000	458,600.00	0.17
61	002690	美亚光电	20,000	433,600.00	0.16
62	603055	台华新材	30,000	376,800.00	0.14
63	300861	美畅股份	4,000	370,760.00	0.14
64	300750	宁德时代	600	320,400.00	0.12
65	002003	伟星股份	28,000	266,000.00	0.10

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600522	中天科技	3,477,187.00	0.78
2	002472	双环传动	2,753,022.20	0.62
3	002271	东方雨虹	2,724,946.00	0.61
4	601800	中国交建	2,594,086.00	0.58
5	000739	普洛药业	2,532,232.00	0.57
6	600036	招商银行	2,374,924.00	0.53
7	000002	万科A	2,271,630.00	0.51
8	601677	明泰铝业	2,192,206.00	0.49
9	002463	沪电股份	2,144,779.00	0.48
10	000651	格力电器	2,102,690.00	0.47
11	603916	苏博特	1,976,857.60	0.44
12	600600	青岛啤酒	1,946,183.00	0.44
13	603899	晨光股份	1,850,469.00	0.41
14	601888	中国中免	1,809,842.00	0.40
15	603517	绝味食品	1,805,713.00	0.40

16	601233	桐昆股份	1,790,849.00	0.40
17	000887	中鼎股份	1,695,154.00	0.38
18	000932	华菱钢铁	1,695,000.00	0.38
19	300674	宇信科技	1,686,516.00	0.38
20	688005	容百科技	1,642,812.38	0.37

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	4,186,253.00	0.94
2	002271	东方雨虹	3,042,721.00	0.68
3	002472	双环传动	3,039,271.88	0.68
4	600522	中天科技	2,901,761.00	0.65
5	000887	中鼎股份	2,648,730.00	0.59
6	601800	中国交建	2,625,107.00	0.59
7	688005	容百科技	2,597,458.60	0.58
8	601318	中国平安	2,382,998.00	0.53
9	600486	扬农化工	2,322,800.00	0.52
10	000739	普洛药业	2,119,750.00	0.47
11	000002	万科A	2,064,010.00	0.46
12	002463	沪电股份	2,040,091.00	0.46
13	300207	欣旺达	2,035,223.14	0.46
14	002048	宁波华翔	1,964,561.27	0.44
15	601233	桐昆股份	1,762,298.00	0.39
16	603899	晨光股份	1,713,582.00	0.38
17	000932	华菱钢铁	1,695,000.00	0.38
18	000651	格力电器	1,659,675.00	0.37
19	002832	比音勒芬	1,643,998.55	0.37
20	603517	绝味食品	1,551,245.00	0.35

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额



单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	110,819,474.32
卖出股票收入（成交）总额	121,407,082.28

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	17,190,795.89	6.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,247,013.70	7.40
	其中：政策性金融债	20,247,013.70	7.40
4	企业债券	57,525,663.95	21.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	144,235,423.56	52.75
7	可转债(可交换债)	22,942,972.53	8.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	262,141,869.63	95.87

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	210207	21国开07	200,000	20,247,013.70	7.40
2	019666	22国债01	170,000	17,190,795.89	6.29
3	101800757	18泰州城建MTN001	100,000	10,801,712.33	3.95
4	101766006	17车都建投MTN001	100,000	10,499,819.73	3.84
5	101900007	19中航集MTN0	100,000	10,379,589.0	3.80

		01		4	
--	--	----	--	---	--

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金持有的前十名证券发行主体国家开发银行，2022年3月因系统数据质量及数据报送违规，被中国银保监会处以罚款的行政处罚。

本基金持有的前十名证券发行主体广州地铁集团有限公司，在报告编制日前一年曾被当地行政机关处以罚款的行政处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,827.45
2	应收清算款	1,698,160.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,740.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,755,727.98

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	3,350,086.03	1.23
2	113044	大秦转债	2,617,441.97	0.96
3	110079	杭银转债	2,004,486.58	0.73
4	127016	鲁泰转债	1,982,528.69	0.73
5	110053	苏银转债	1,889,707.19	0.69
6	113046	金田转债	1,693,195.27	0.62
7	113024	核建转债	1,197,701.64	0.44
8	127005	长证转债	1,157,349.18	0.42
9	128035	大族转债	902,547.95	0.33
10	127027	靖远转债	886,805.75	0.32
11	110081	闻泰转债	862,260.58	0.32
12	132018	G三峡EB1	699,779.79	0.26
13	128136	立讯转债	685,462.06	0.25
14	127012	招路转债	342,678.29	0.13
15	127038	国微转债	334,786.82	0.12

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安君得盈债券A	1,106	144,018.76	34,679,897.55	21.77%	124,604,848.22	78.23%
国泰君安君得盈债券C	1,344	75,884.16	27,387,473.33	26.85%	74,600,834.97	73.15%
合计	2,450	106,642.06	62,067,370.88	23.76%	199,205,683.19	76.24%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安君得盈债券A	119,842.32	0.08%
	国泰君安君得盈债券C	34,644.19	0.03%

	合计	154,486.51	0.06%
--	----	------------	-------

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 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	-
本报告期期初基金份额总额	298,694,748.66	119,470,264.29
本报告期基金总申购份额	77,181,964.79	29,933,809.57
减：本报告期基金总赎回份额	216,591,967.68	47,415,765.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	159,284,745.77	101,988,308.30

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2022年1月17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》，谢乐斌同志担任公司董事长，江伟同志不再担任公司董事长。

2022年3月12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董事会成员变更事宜的公告》，谢乐斌同志担任公司董事和董事长，江伟同志不再担任公司董事和董事长职务。陶耿同志担任公司董事和副董事长；王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇同志担任公司董事，蒋忆明、喻健同志不再兼任公司董事职务。经过上述变更，公司现任董事会成员为谢乐斌、陶耿、王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇。

2022年3月30日，本基金管理人发布了《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告》，董博阳同志担任公司监事，傅南平同志不再担任公司监事职务；王红莲同志担任公司职工监事。

2022年4月8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》，吕巍同志担任公司合规总监、督察长，叶明同志不再担任公司合规总监。

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基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	232,226,556.60	100.00%	229,431.33	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	123,674,015.27	100.00%	3,374,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2022-01-14
2	国泰君安君得盈债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2022-01-14
3	国泰君安君得盈债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2022-01-14
4	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2022-01-14
5	国泰君安君得盈债券型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2022-01-14
6	关于国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划变更注册	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2022-01-14

	为国泰君安君得盈债券型证券投资基金的公告		
7	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2022-01-14
8	关于调整旗下基金对账单服务规则的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-01-19
9	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-01-19
10	国泰君安君得盈债券型证券投资基金2021年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-01-24
11	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金和集合计划季度报告提示性公告	证券时报	2022-01-24
12	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额（更新）	证监会指定网站、公司官网	2022-03-09
13	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额（更新）	证监会指定网站、公司官网	2022-03-09
14	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年第1号）	证监会指定网站、公司官网	2022-03-09
15	国泰君安君得盈债券型证券投资基金2022年经理变更公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-09
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-12



17	关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-30
18	国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划2021年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-03-31
19	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金和集合计划年度报告提示性公告	证券时报	2022-03-31
20	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-04-08
21	国泰君安君得盈债券型证券投资基金2022年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-04-22
22	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金季度报告提示性公告	证券时报	2022-04-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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
个人	1	20220101-20220414	106,573,828.20	0.00	106,573,828.20	0.00	0.00%
产品特有风险							
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"> <li>(1) 基金在短时间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；</li> <li>(2) 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；</li> <li>(3) 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；</li> </ol>							

- (4) 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;
- (5) 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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、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;
- 2、《国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《国泰君安君得盈债券型证券投资基金托管协议》;
- 4、《国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书》;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 7、法律意见书;
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于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网站<http://www.gtjazg.com>。

### 12.3 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

二〇二二年八月三十一日