

国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

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:交通银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08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，投资者在做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2022年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	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	10
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产(基金净值)变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 本报告期投资基金情况	52
7.13 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	59
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.9 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)	
基金简称	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)	
基金主代码	952013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年11月16日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,475,035,502.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C
下属分级基金的交易代码	952013	952313
报告期末下属分级基金的份额总额	1,088,607,934.41份	386,427,568.14份

注：国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划于2022年3月21日起正式变更为国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)。

2.2 基金产品说明

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

	<p>力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。</p> <p>(2) 场内ETF等基金投资策略</p> <p>场内ETF等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及ETF所跟踪指数的综合评价挑选适合的ETF投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。</p> <p>其他投资策略还包括股票的投资策略、债券的投资策略和资产支持证券等品种投资策略等。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中债综合(全价)指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

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	交通银行股份有限公司
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	95559
传真	021-38871190	021-62701216
注册地址	上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码	200120	200336

法定代表人	谢乐斌	任德奇
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金中期报告备置地点	上海市静安区新闸路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)	
	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C
本期已实现收益	-54,722,474.48	-19,867,528.58
本期利润	-264,196,439.44	-86,352,102.48
加权平均基金份额本期利润	-0.2224	-0.2139
本期加权平均净值利润率	-16.18%	-15.65%
本期基金份额净值增长率	-12.42%	-12.60%
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	439,563,764.23	152,849,293.04
期末可供分配基金份额利润	0.4038	0.3955
期末基金资产净值	1,528,171,698.64	539,276,861.18
期末基金份额净值	1.4038	1.3955
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	0.39%	-8.96%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.06%	1.02%	7.09%	0.80%	0.97%	0.22%
过去三个月	4.90%	1.39%	4.82%	1.07%	0.08%	0.32%
过去六个月	-12.42%	1.36%	-9.28%	1.13%	-3.14%	0.23%
过去一年	-10.39%	1.18%	-11.80%	1.00%	1.41%	0.18%
自基金合同生效起至今	0.39%	1.09%	1.11%	1.03%	-0.72%	0.06%

注：业绩比较基准为：沪深300指数收益率*75%+中债综合(全价)指数收益率*25%

国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.02%	1.02%	7.09%	0.80%	0.93%	0.22%

过去三个月	4.80%	1.39%	4.82%	1.07%	-0.02%	0.32%
过去六个月	-12.60%	1.36%	-9.28%	1.13%	-3.32%	0.23%
过去一年	-10.75%	1.18%	-11.80%	1.00%	1.05%	0.18%
自基金合同生效起至今	-8.96%	1.12%	-8.66%	1.05%	-0.30%	0.07%

注：业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中债综合(全价)指数收益率*25%

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

国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金于 2020 年 11 月 16 日参公生效，A 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2020 年 11 月 16 日至 2022 年 6 月 30 日）计算。

国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年01月12日-2022年06月30日)



注：本基金于2020年11月16日参公生效，C类份额于2021年1月12日首次申购确认，C类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即2021年1月12日至2022年6月30日）计算。

§ 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		
李少君	本基金基金经理，国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理，本公司基金投资部总经理。	2020-12-07	-	11年	李少君，中国人民大学博士研究生，2009年7月至2010年12月任职于中国工商银行总行研究所分析师，2010年12月至2016年12月民生证券研究院，历任研究业务部总经理，首席策略分析师，2016年12月至2020年9月历任国泰君安证券股份有限公司研究所副所长、全球首席策略分析师、总量团队负责人，2020年9月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现担任基金投资部总经理。自2020年12月7日起至2022年3月20日止，担任“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”的投资经理。自2021年12月28日起担任“国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)”基金经理。自2022年3月21日起担

					任“国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金(FOF)”的基金经理。
高琛	本基金基金经理，国泰君安善融稳健一年持有期混合型证券投资基金(FOF)基金经理。	2020-11-16	-	12年	高琛，华东理工大学工商管理硕士，10年以上证券从业经历。曾任上海证券基金评价分析师、金融实验室负责人，国泰君安资产管理业务委员会执行办董事。2019年4月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现担任基金投资部基金经理。自2020年11月16日起至2022年3月20日止，担任“国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金(FOF)集合资产管理计划”的投资经理。自2021年12月28日起担任“国泰君安善融稳健一年持有期混合型证券投资基金(FOF)”基金经理。自2022年3月21日起担任“国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金(FOF)”的基金经理。

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、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、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

回顾市场，从全球范围来看，受海外高通胀的影响，上半年全球主要指数均呈现不同程度下跌。上半年A股市场表现主要分为两个阶段：1-4月下跌阶段，外部因素主要来自于美联储加息预期以及地缘政治冲突升级对全球金融市场造成冲击，内部因素为国内疫情反复，对经济造成严重冲击，加剧了资金对市场的担忧；进入5月后，随着疫情逐步得到控制，政策端也逐步发力，市场信心逐步恢复，A股随之回暖。

在资产配置层面，股指快速下跌的后期，给了较好的中长期的布局空间，市场进入平缓期后，对于公募基金赚取超额收益是较好的时间阶段，因此在仓位上保持乐观偏上的态度。市场实际走势与普遍预期不同的地方在于，此轮反弹的力度和速度均好于预期，在4月26日以来的反弹过程中上证综指观测期间几乎没有出现大幅度的连续回调，市场的逼空节奏也很有可能打乱参与者的原本投资布局。在君得益资产配置节奏上，中短期内权益资产较难进入全面乐观状态，因此加入了部分债券基金配置，增强类现金类资产收益。

在风格/行业配置层面，组合以成长均衡为主线，二季度市场反弹中成长板块涨幅明显好于价值板块，组合相对受益。在行业配置上，相对重配的行业仍以新能源、科技

为主，新能源板块成长确定性较强，对组合的贡献相对较大。在调整中，对泛消费行业增加配置比例，主要看好疫情复苏后消费场景的修复所带来的业绩提升机会。

在基金配置上，对重仓基金进行的比例调整，减持了部分持仓比例较高的基金产品，保持适度均衡分散。在经历了市场又一次大幅调整后，我们重新审视组合内的基金，调低的部分低于预期的基金品种，并小幅扩大了基金投资的数量，对不同擅长领域的优秀管理人保持更全面的跟踪布局。此外，四月底以来的反弹，强者恒强得到了淋漓尽致的发挥，分母端的力量体现的超乎寻常充分。这也使得我们布局的部分逆向策略产品在反弹过程中表现的不尽如人意。我们也一并进行了审视，并结合各子基金的情况，进行了优化。

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益三个月持有混合(FOF)A基金份额净值为1.4038元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.42%，同期业绩比较基准收益率为-9.28%；截至报告期末国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C基金份额净值为1.3955元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.60%，同期业绩比较基准收益率为-9.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们处在哪个位置？

从历史几轮熊牛转换来看，重要条件不外乎有两个：一个是盈利，一个是风险偏好。犹记得四月我们曾经提出，市场“风险偏好”系统性快速下行，市场已经跌出了2018年的感觉，现在看来，四月下旬的“最后一跌”，颇有2018年四季度“最后一跌”的味道。如果风险偏好已经在4月底走完了2018年的极低点了，那么从盈利预期来看，过去一个月的盈利预期几乎没有提供增量，这也许与刚刚经历年报季不久有关。我们不妨把视角上移，从盈利预期转向盈利周期。从我们监控的重点标的来看，与2022年盈利周期位置相似的是2016-2017年，同样经历了上年的盈利增速见底回升。

从宏观政策来看，2016年我们也看到了当年1月份的天量社融，甚至也看到了首付比例的松动。受宏观政策驱动，工业增加值和上市公司盈利也陆续在2016年中见底。

从市场结构来看，伴随着流动性的大幅释放，银行、有色、非银、煤炭、家电等行业也分别领涨了2016年的单月行情，并开启了茅指数引领的核心资产周期。

总体而言，随着全球货币政策的总体收紧，通胀交易正在逐渐离开舞台中央，前期PPI上行交易有转向CPI上行交易的苗头。具体来看，美国在逐渐从胀（经济过热）转向滞（衰退），我们在从滞（经济下行风险）转向胀（复苏）。

结构上看，无论是增速仍然可圈可点的新能源，还是经济复苏阶段往往不会缺席的大消费，其估值和盈利的匹配性、盈利的持续性（或盈利周期开启的驱动）都存在这样或者那样的瑕疵。

所以，总量数据的上行仍缺乏微观数据的夯实和印证；结构领先的行业在领涨逻辑上也多少存在着不那么顺的地方。这也是市场近期围绕新能源令人振奋的微观数据扎堆上行的重要原因。

未来市场将逐渐经历中报的检验。相信市场还会有反复，甚至不排除二次探底的风险，但如果盈利周期和政策周期的演绎没有太大的风险，大家此刻大概率会在结构上花更多的经历。我们认为，上半年经历了急跌和急涨，市场有望在下半年重新开启分子端主导的结构性行情。从历史上来看，分子行情中体现的能力，其持续性会显著强于分母端行情。综上，我们对下半年的市场和投资相较上半年信心更足，期望也更高。

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、全球研究院负责人、营运管理部负责人、法务监察部负责人、风险管理部负责人及市场部门负责人组成。具体参会的投资部门负责人依据待决议事项对应的资管产品确定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日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，基金托管人在国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金(FOF)的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，上海国泰君安证券资产管理有限公司在国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金(FOF)投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得益三个月持有期混合型证券投资基金(FOF)

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	239,848,271.77	154,680,140.78
结算备付金		-	-
存出保证金		-	107,932.95
交易性金融资产	6.4.7.2	1,781,860,541.21	2,608,579,648.88
其中：股票投资		-	-
基金投资		1,781,860,541.21	2,608,579,648.88
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

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	6.4.7.6	-	-
应收清算款		59,374,055.32	-
应收股利		-	-
应收申购款		334,762.77	943,296.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.7	-	27,357.59
资产总计		2,081,417,631.07	2,764,338,376.75
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,999,582.18	-
应付赎回款		6,917,506.42	23,774,621.55
应付管理人报酬		1,328,499.07	1,967,715.63
应付托管费		334,261.38	502,673.70
应付销售服务费		171,953.34	243,029.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	217,268.86	248,680.25
负债合计		13,969,071.25	26,736,720.83
净资产：			

实收基金	6.4.7.9	1,475,035,502.55	1,709,571,725.82
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.10	592,413,057.27	1,028,029,930.10
净资产合计		2,067,448,559.82	2,737,601,655.92
负债和净资产总计		2,081,417,631.07	2,764,338,376.75

注：截至本报告期末2022年06月30日，基金份额净值1.4016元，基金份额总额1,475,035,502.55份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-338,451,257.11	174,087,875.59
1. 利息收入		801,341.70	2,946,281.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	801,341.70	2,492,382.51
债券利息收入		-	453,899.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-63,570,859.48	19,351,621.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-70,701,873.44	-11,322,367.20
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.15	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-

衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	7,131,013.96	30,673,988.55
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）	6.4.7.19	-275,958,538.86	149,153,548.83
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.20	276,799.53	2,636,423.62
减：二、营业总支出		12,097,284.81	38,981,252.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	8,705,698.49	26,572,048.11
2. 托管费	6.4.10.2. 2	2,199,300.06	6,621,080.62
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	1,098,058.70	4,653,878.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	94,227.56	1,134,245.02
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-350,548,541.92	135,106,622.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-350,548,541.92	135,106,622.96
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		-350,548,541.92	135,106,622.96

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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)	1,709,571,72 5.82	-	1,028,029,93 0.10	2,737,601,65 5.92
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)	1,709,571,72 5.82	-	1,028,029,93 0.10	2,737,601,65 5.92
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-234,536,22 3.27	-	-435,616,87 2.83	-670,153,09 6.10
(一)、综合收益总额	-	-	-350,548,54 1.92	-350,548,54 1.92
(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)	-234,536,22 3.27	-	-85,068,330. 91	-319,604,55 4.18
其中：1. 基金申购款	30,516,366.6 9	-	13,619,230.1 9	44,135,596.8 8
2. 基金赎回款	-265,052,58 9.96	-	-98,687,561. 10	-363,740,15 1.06
(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）	1,475,035,50 2.55	-	592,413,057. 27	2,067,448,55 9.82
项 目	上年度可比期间 2021年01月01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）	29,941,966.0 4	-	14,388,587.1 6	44,330,553.2 0
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）	29,941,966.0 4	-	14,388,587.1 6	44,330,553.2 0
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,449,307,62 3.88	-	2,518,933,07 4.48	6,968,240,69 8.36
（一）、综合收益总额	-	-	135,106,622. 96	135,106,622. 96
（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）	4,449,307,62 3.88	-	2,383,826,45 1.52	6,833,134,07 5.40
其中：1. 基金申购款	5,162,130,66 3.22	-	2,736,745,34 7.47	7,898,876,01 0.69
2. 基金赎回款	-712,823,03 9.34	-	-352,918,89 5.95	-1,065,741,9 35.29

(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)	4,479,249,589.92	-	2,533,321,661.64	7,012,571,251.56

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

国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)由国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划由国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于2011年3月30日经中国证监会证监许可〔2011〕466号文核准设立，自2011年4月25日起开始募集并于2011年5月31日结束募集，于2011年6月7日成立。根据《基金法》、《运作办法》、《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》等法律法规的规定，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更为国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)，即本基金，并相应修改《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》等法律文件。2021年11月5日，本基金经中国证监会《关于准予国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更注册的批复》(证监许可[2021]3519号文)注册。《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》自基金管理人2022年3月21日公告后生效，原《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括QDII基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许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。

本基金采用业绩比较基准：沪深300指数收益率*75%+中债综合（全价）指数收益率*25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本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1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2022年1月1日至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

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的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、其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收

入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，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) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、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相应类别的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；通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该份额最短持有期起始日相同；

3、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；

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

根据《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》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准

则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润【或其他综合收益】。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

2021年12月31日，本基金根据原金融工具准则计量的减值准备金额为人民币0.00元。首次执行日（2022年1月1日），本基金根据新金融工具准则预期信用损失模型重新计量的减值准备金额为人民币0.00元。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

本基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	239,848,271.77
等于：本金	239,788,177.21
加：应计利息	60,094.56
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	239,848,271.77

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	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	1,712,136,537.15	-	1,781,860,541.21	69,724,004.06
其他	-	-	-	-
合计	1,712,136,537.15	-	1,781,860,541.21	69,724,004.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他权益工具投资

6.4.7.6.1 其他权益工具投资情况

本基金本期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7 其他资产

本基金本期末无其他资产。

6.4.7.8 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	12,916.31
应付交易费用	49.99
其中：交易所市场	49.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	204,302.56
合计	217,268.86

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安君得益三个月持有 混合(FOF)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	1,281,177,315.74	1,281,177,315.74
本期申购	25,409,029.30	25,409,029.30
本期赎回(以“-”号填列)	-217,978,410.63	-217,978,410.63
本期末	1,088,607,934.41	1,088,607,934.41

6.4.7.9.2 国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安君得益三个月持有 混合(FOF)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	428,394,410.08	428,394,410.08
本期申购	5,107,337.39	5,107,337.39
本期赎回(以“-”号填列)	-47,074,179.33	-47,074,179.33
本期末	386,427,568.14	386,427,568.14

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A

单位：人民币元

项目 (国泰君安君得益三个 月持有混合(FOF)A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	796,607,852.08	-24,183,837.55	772,424,014.53
本期利润	-54,722,474.48	-209,473,964.96	-264,196,439.44
本期基金份额交易产生的变动数	-116,916,106.43	48,252,295.57	-68,663,810.86
其中：基金申购款	15,801,946.67	-4,383,412.16	11,418,534.51
基金赎回款	-132,718,053.10	52,635,707.73	-80,082,345.37
本期已分配利润	-	-	-

本期末	624,969,271.17	-185,405,506.94	439,563,764.23
-----	----------------	-----------------	----------------

6.4.7.10.2 国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C

单位：人民币元

项目 (国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	217,905,896.98	37,700,018.59	255,605,915.57
本期利润	-19,867,528.58	-66,484,573.90	-86,352,102.48
本期基金份额交易产生的变动数	-20,855,370.46	4,450,850.41	-16,404,520.05
其中：基金申购款	2,559,009.02	-358,313.34	2,200,695.68
基金赎回款	-23,414,379.48	4,809,163.75	-18,605,215.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	177,182,997.94	-24,333,704.90	152,849,293.04

6.4.7.11 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	801,180.06
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	161.64
其他	-
合计	801,341.70

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	682,081,671.26
减：卖出/赎回基金成本总额	750,876,964.97
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	1,906,579.73
基金投资收益	-70,701,873.44

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

6.4.7.15.1 资产支持证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
资产支持证券投资收益——利息收入	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期未进行贵金属投资。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期未进行衍生工具投资。

6.4.7.18 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	-
基金投资产生的股利收益	7,131,013.96
合计	7,131,013.96

6.4.7.19 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	-275,958,538.86
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-275,958,538.86
——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	-
合计	-275,958,538.86

6.4.7.20 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	276,799.53

合计	276,799.53
----	------------

6.4.7.21 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	13,868,272.11
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	2,295,020.50

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期末有资产发生信用减值损失。

6.4.7.23 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
银行费用	925.00
账户维护费	9,000.00
合计	94,227.56

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
交通银行股份有限公司	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

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01日至2021年06月30日

	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安证券	4,999,382.20	100.00%	100,579,002.30	100.00%

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	49.99	100.00%	49.99	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	176,708.59	100.00%	175,859.43	100.00%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年01月01日至2022年06月30日	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,705,698.49	26,572,048.11
其中：支付销售机构的客户维护费	3,986,394.02	3,895,615.30

注：支付基金管理人国泰君安资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值*0.80%/365。

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01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,199,300.06	6,621,080.62

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值*0.22%/365。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C	合计
国泰君安证券	0.00	979,238.96	979,238.96
上海国泰君安证券资产管理有限公司	0.00	7,119.44	7,119.44
交通银行股份有限公司	0.00	28,271.32	28,271.32

公司			
合计	0.00	1,014,629.72	1,014,629.72
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01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C	合计
国泰君安证券	0.00	4,324,367.44	4,324,367.44
上海国泰君安证券资产管理有限公司	0.00	15,713.86	15,713.86
交通银行股份有限公司	0.00	52,408.70	52,408.70
合计	0.00	4,392,490.00	4,392,490.00

注：本基金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0.40%，销售服务费按前一日C类份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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

国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A

份额单位：份

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01日至 2021年06月30日
基金合同生效日（2020年11月16日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	161,783,547.52	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	161,783,547.52
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	107,450,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	54,333,547.52	161,783,547.52
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.99%	5.48%

国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C

份额单位：份

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

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01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
交通银行股份有限公司	239,848,271.77	801,180.06	266,880,775.21	2,490,950.66

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

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

项目	本期费用 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年01月01日 至2021年06月30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	3,000.00	14,000.00
当期交易基金产生的赎回费（元）	241,083.65	0.00
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	0.00
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,339,691.61	2,494,219.35
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	390,030.60	415,703.30

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本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，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本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。

6.4.13.3 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	239,848,271.77	-	-	-	-	-	239,848,271.77
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,781,860,541.21	1,781,860,541.21
应收清算款	-	-	-	-	-	59,374,055.32	59,374,055.32
应收申购款	-	-	-	-	-	334,762.77	334,762.77
资产总计	239,848,271.77	-	-	-	-	1,841,569,359.30	2,081,417,631.07
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	4,999,582.18	4,999,582.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,917,506.42	6,917,506.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,328,499.07	1,328,499.07
应付托管费	-	-	-	-	-	334,261.38	334,261.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	171,953.34	171,953.34
其他负债	-	-	-	-	-	217,268.86	217,268.86
负债总计	-	-	-	-	-	13,969,071.25	13,969,071.25

计							
利率敏 感度缺 口	239,848,271.7 7	-	-	-	-	1,827,600,288.0 5	2,067,448,559.8 2
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	154,680,140.7 8	-	-	-	-	-	154,680,140.78
存出保 证金	107,932.95	-	-	-	-	-	107,932.95
交易性 金融资 产	-	-	-	-	-	2,608,579,648.8 8	2,608,579,648.8 8
应收利 息	-	-	-	-	-	27,357.59	27,357.59
应收申 购款	-	-	-	-	-	943,296.55	943,296.55
资产总 计	154,788,073.7 3	-	-	-	-	2,609,550,303.0 2	2,764,338,376.7 5
负债							
应付赎 回款	-	-	-	-	-	23,774,621.55	23,774,621.55
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	1,967,715.63	1,967,715.63
应付托 管费	-	-	-	-	-	502,673.70	502,673.70
应付销 售服务 费	-	-	-	-	-	243,029.70	243,029.70
其他负 债	-	-	-	-	-	248,680.25	248,680.25
负债总 计	-	-	-	-	-	26,736,720.83	26,736,720.83
利率敏 感度缺 口	154,788,073.7 3	-	-	-	-	2,582,813,582.1 9	2,737,601,655.9 2

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响

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 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	1,781,860,541.21	86.19	2,608,579,648.88	95.29
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	1,781,860,541.21	86.19	2,608,579,648.88	95.29

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
业绩比较基准上升5%	89,093,027.06	130,428,982.44
业绩比较基准下降5%	-89,093,027.06	-130,428,982.44

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,781,860,541.21	2,608,579,648.88
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,781,860,541.21	2,608,579,648.88

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期未发生公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金本报告期无不以公允价值计量的金融工具。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,781,860,541.21	85.61
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	239,848,271.77	11.52
8	其他各项资产	59,708,818.09	2.87
9	合计	2,081,417,631.07	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票资产。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票资产。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本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投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

(1) 开放式基金投资策略

本基金以权益类基金为重点投资方向，在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。

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

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

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

(2) 场内ETF等基金投资策略

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

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	519002	华安安信消费混	契约型	32,145,85	155,007,3	7.50	是

		合A	开放式	7.17	23.27		
2	519133	海富通改革驱动混合	契约型 开放式	39,543,96 6.32	108,718,2 26.60	5.26	否
3	003293	易方达科瑞灵活配置混合	契约型 开放式	49,330,68 1.93	102,676,8 81.37	4.97	否
4	001694	华安沪港深外延增长灵活配置混合A	契约型 开放式	24,058,59 2.13	99,554,45 4.23	4.82	是
5	001410	信澳新能源产业股票	契约型 开放式	20,381,91 0.83	96,875,22 2.17	4.69	否
6	001054	工银新金融股票A	契约型 开放式	30,401,58 7.44	93,576,08 6.14	4.53	否
7	550002	中信保诚精萃成长混合A	契约型 开放式	90,533,67 2.68	90,090,05 7.68	4.36	否
8	519003	海富通收益增长混合	契约型 开放式	34,754,53 0.98	86,990,59 1.04	4.21	否
9	110013	易方达科翔混合	契约型 开放式	17,138,48 5.28	86,635,04 3.09	4.19	否
10	001736	圆信永丰优加生活股票	契约型 开放式	25,162,32 0.27	79,533,06 1.91	3.85	否
11	163409	兴全绿色投资混合(LOF)	契约型 开放式	36,893,21 4.22	76,073,80 7.72	3.68	否
12	001975	景顺长城环保优势股票	契约型 开放式	21,401,17 4.49	73,020,80 7.36	3.53	否
13	002593	富国美丽中国混合A	契约型 开放式	23,505,97 3.97	65,370,11 3.61	3.16	否
14	004958	圆信永丰优享生活混合	契约型 开放式	25,882,43 0.47	56,959,46 4.74	2.76	否
15	001955	中欧养老混合A	契约型 开放式	19,134,71 1.06	53,940,75 0.48	2.61	否
16	501064	国泰价值优选灵活配置混合(LOF)	契约型 开放式	14,371,46 3.21	47,622,71 7.64	2.30	否

17	519710	交银策略回报混合	契约型 开放式	23,563,31 1.86	47,197,31 3.66	2.28	否
18	002980	华夏创新前沿股票	契约型 开放式	13,489,89 4.98	32,888,36 3.96	1.59	否
19	320022	诺安研究精选股票	契约型 开放式	12,570,87 1.28	28,209,03 5.15	1.36	否
20	360016	光大保德信行业轮动混合	契约型 开放式	14,163,83 3.81	27,576,98 4.43	1.33	否
21	003984	嘉实新能源新材料股票A	契约型 开放式	7,851,05 5.95	26,112,61 2.09	1.26	否
22	410007	华富价值增长混合	契约型 开放式	9,106,48 1.80	25,480,84 6.72	1.23	否
23	001616	嘉实环保低碳股票	契约型 开放式	6,823,59 7.03	24,517,18 4.13	1.19	否
24	519126	浦银安盛新经济结构混合A	契约型 开放式	6,903,17 9.04	22,696,27 2.05	1.10	否
25	540003	汇丰晋信动态策略混合A	契约型 开放式	4,292,55 2.05	20,954,95 1.34	1.01	否
26	003847	华安鼎丰债券	契约型 开放式	17,992,80 2.52	20,004,39 7.84	0.97	是
27	164902	交银信用添利债券(LOF)	契约型 开放式	15,976,19 4.28	19,997,40 2.38	0.97	否
28	001990	中欧数据挖掘混合A	契约型 开放式	9,196,60 4.21	15,911,04 4.94	0.77	否
29	519091	新华泛资源优势混合	契约型 开放式	2,067,39 9.19	13,810,01 9.85	0.67	否
30	720001	财通价值动量混合	契约型 开放式	2,078,36 2.09	10,159,03 3.90	0.49	否
31	003751	万家瑞隆混合A	契约型 开放式	4,350,98 5.60	10,074,27 2.06	0.49	否
32	570008	诺德周期策略混合	契约型 开放式	2,589,07 3.02	10,032,65 7.95	0.49	否
33	003258	博时富祥纯债债	契约型	9,655,27	10,002,86	0.48	否

		券A	开放式	2.31	2.11		
34	004200	博时富瑞纯债债券A	契约型 开放式	9,526,48 6.28	10,001,85 7.95	0.48	否
35	100066	富国纯债债券发起A	契约型 开放式	9,108,21 6.43	10,001,73 2.46	0.48	否
36	003634	嘉实农业产业股票A	契约型 开放式	4,704,74 7.56	9,816,92 6.26	0.47	否
37	502000	西部利得中证500指数增强(LOF)A	契约型 开放式	2,954,49 1.73	5,150,86 0.88	0.25	否
38	510580	ZZ500ETF	契约型 开放式	6,575,90 0.00	4,991,10 8.10	0.24	否
39	003095	中欧医疗健康混合A	契约型 开放式	1,304,16 6.77	3,628,19 1.95	0.18	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 本基金本报告期末未持有股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	59,374,055.32
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	334,762.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,708,818.09

7.13.4 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可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票资产。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
国泰 君安 君得 益三 个月 持有 混合 (FOF) A	17,627	61,757.98	90,875,057.00	8.35%	997,732,877.41	91.65%
国泰 君安 君得 益三 个月	10,426	37,063.84	4,678,833.44	1.21%	381,748,734.70	98.79%

持有混合(FOF)C						
合计	28,053	52,580.31	95,553,890.44	6.48%	1,379,481,612.11	93.52%

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（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	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A	389,575.53	0.04%
	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C	2,517,656.58	0.65%
	合计	2,907,232.11	0.20%

注：分类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，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（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	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A	0
	国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基	国泰君安君得益三	0~10

金	个月持有混合 (FOF)A	
	国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF)C	50~100
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF)A	国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF)C
基金合同生效日 (2020年11月16日) 基金份额总额	29,941,966.04	-
本报告期期初基金份额总额	1,281,177,315.74	428,394,410.08
本报告期基金总申购份额	25,409,029.30	5,107,337.39
减：本报告期基金总赎回份额	217,978,410.63	47,074,179.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,088,607,934.41	386,427,568.14

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本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。

2. 本报告期内本基金托管人重大人事变动如下：

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期所持有的基金未发生具有重大影响的事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	-	-	49.99	100.00%	-

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-	4,999,382.20	100.00%

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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
2	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
3	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划2021年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-01-24
4	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	上海证券报	2022-01-24
5	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(A类份额)基金产品资料概要更新更正公告	证监会指定网站	2022-02-14
6	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
7	国泰君安君得益三个月持有	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18

	期混合型基金中基金(FOF)招募说明书		
8	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)(C类份额)基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
9	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)(A类份额)基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
10	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
11	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议	证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
12	关于国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更注册为国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-18
13	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同和招募说明书提示性公告	上海证券报	2022-03-18
14	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
15	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划2021年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-03-31
16	上海国泰君安证券资产管理	上海证券报	2022-03-31

	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		
17	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
18	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2022年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-04-22
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季度报告提示性公告	上海证券报	2022-04-22
20	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在华瑞保险开展费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-06-22

§ 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更注册的批复；

- 2、《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》；
- 3、《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议》；
- 4、《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)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