

# 国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

## 2023 年中期报告

2023 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

报告送出日期:2023 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2023年08月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>7</b>
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	12
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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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

<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计) .....</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	18
6.3 净资产 (基金净值) 变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	21
<b>§ 7 投资组合报告 .....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	42
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 .....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	42
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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 本报告期投资基金情况 .....	44

7.13 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	50
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.9 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	53

12.3 查阅方式 .....53

## § 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, 225, 143, 117. 92 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	905, 875, 266. 09 份	319, 267, 851. 83 份

### 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>

	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。
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	陆志俊
	联系电话	021-38676022	95559
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	luzj@bankcomm.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		陶耿	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	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 50 楼

## § 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 (2023 年 01 月 01 日-2023 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	-40,157,663.69	-15,158,173.10
本期利润	-1,981,405.11	-1,311,829.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0021	-0.0038
本期加权平均净值利润率	-0.16%	-0.30%
本期基金份额净值增长率	-0.39%	-0.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	227,928,118.67	76,397,436.32
期末可供分配基金份额利润	0.2516	0.2393
期末基金资产净值	1,133,803,384.76	395,665,288.15
期末基金份额净值	1.2516	1.2393
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-10.50%	-19.15%

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF)A 净值表现

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	0.95%	0.80%	0.92%	0.65%	0.03%	0.15%
过去三个月	-3.72%	0.68%	-3.62%	0.62%	-0.10%	0.06%
过去六个月	-0.39%	0.67%	-0.18%	0.63%	-0.21%	0.04%
过去一年	-10.84%	0.79%	-10.45%	0.74%	-0.39%	0.05%
自基金合同 生效起至今	-10.50%	0.98%	-9.45%	0.93%	-1.05%	0.05%

##### 国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF)C 净值表现

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基准收	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	---------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	益率标准差④		
过去一个月	0.92%	0.80%	0.92%	0.65%	0.00%	0.15%
过去三个月	-3.81%	0.68%	-3.62%	0.62%	-0.19%	0.06%
过去六个月	-0.59%	0.67%	-0.18%	0.63%	-0.41%	0.04%
过去一年	-11.19%	0.79%	-10.45%	0.74%	-0.74%	0.05%
自基金合同 生效起至今	-19.15%	1.00%	-18.20%	0.93%	-0.95%	0.07%

### 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  
(2020年11月16日-2023年06月30日)



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 2023 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-2023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2023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2023年6月30日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得益两年持有期混合型证券投资基金、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、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得益明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得益短债债券型证券投资基金、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30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证1000指数增强型证券投资基金等39只公开募集证券投资基金。

#### 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	说明
		任职日期	离任		

			日期	业 年 限	
高琛	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, 国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的基金经理。现任基金投资部基金经理。	2020-11-16	-	13 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。
丁一戈	国泰君安善吾养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理, 国泰君安善元稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理, 国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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, 国泰君安善兴平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理。现任公司基金投资部副总经理 (主持工作)。	2022-12-21	-	6 年	丁一戈, 中国科学技术大学数学系学士, 哥伦比亚大学运筹系硕士。历任纽约 NYPPEX 副总裁, 中国工商银行总行私人银行部投资组合经理, 平安资产管理有限公司基金投资部投资副总监, 申万宏源证券有限公司财富管理事业部产品与资产配置中心负责人、申万宏源基金投顾投资决策委员会委员、申万宏源资管业务委员会常务委员。2022 年 8 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司基金投资部, 担任副总经理 (主持工作) 职务。

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。

#### 4.2 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，因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 5 次。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

海外来看，国际地缘政治风险反复，对市场有诸多扰动；美联储加息暂缓，以 GPT 为代表的科技浪潮席卷全球，美股盈利仍有韧性，表现强劲。国内来看，上半年国内经济复苏力度偏弱，货币政策较为宽松，消费通胀温和，市场情绪仍在修复，A 股表现较弱，债市在去年底“理财赎回潮”冲击后反弹表现超预期。

具体权益市场方面，由于投资者对经济的预期从一季度的过度乐观修正至过度悲观，再加上由于没有新增资金进入股市，二季度股票市场整体弱势调整，呈现场内资金存量博弈特征，市场波动较大且热点切换较快。在弱市中，“中特估”概念及 TMT 相关股票获得市场青睐，表现相对强劲。行业层面，通信、家电、汽车等行业涨幅靠前，而消费者服务、房地产、建材等行业表现靠后。

从债券市场的表现看来，上半年债券市场整体走牛。年初随着理财规模回升、保险开门红等因素，信用债明显走强，“大行放贷、小行买债”成为重要推动力。伴随配置资金入场和降准落地，国债收益率震荡下行，信用利差大幅压降。4 月起经济修复预期放缓，叠加资金面宽松和降息预期，债市继续走牛，二季度国债收益率下行至 2.65% 附近，6 月下旬央行早于市场预期降息后出现一定的获利回吐走势，债券收益率小幅波动。转债市场自股指从 2 月份持续回落以来保持窄幅震荡走平的态势，仍有一定的配置价值。

君得益：上半年仓位上小幅波动，在经历 1 月份快速上涨后出于谨慎期间小幅调降的仓位，也为后续行业和基金调整做准备，后续在市场连续回调过程中逐步加仓，目前阶段在仓位上保持相对乐观水平。行业风格上，主要向科技成长类行业进行切换，主要减持了新能源行业上配置。基金投资上，对均衡类基金进行调整，关注量化指增类产品的投资价值，一定程度上避开公募基金重仓股的回调。

#### 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 1.2516 元，本报告期内，

该类基金份额净值增长率为-0.39%，同期业绩比较基准收益率为-0.18%；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 1.2393 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.59%，同期业绩比较基准收益率为-0.18%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市：

海外来看，预期下半年国际地缘关系或有阶段性缓和，投资者风险偏好和市场信心得到边际修复。国内来看，考虑到资产负债表仍在修复过程中，下半年经济增长情况会有所改善。我们认为政策托底预期愈发强烈，但强刺激的概率较低，预期政策仍将专注于提升长期增长潜力而非追求短期脉冲式回升。

目前股债性价比 ERP 指标处于历史阶段 85%左右分位，权益市场具备高性价比配置价值。在权益市场估值较低、流动性环境边际改善、整体增长修复趋势向上的背景下，我们对中长期的权益市场保持乐观。但当前宏观依然存在不确定性，且经济修复不会一蹴而就，我们对短期权益市场保持谨慎乐观。

结构方面主要关注三大方向性机会：一是，科技成长方向，虽然短期存在过热特征，长期看来 AI 推动的产业趋势仍有望保持高景气特征，重点关注业绩支撑性强、产业衍生空间较大的相关领域；二是，国企改革方向，当前仍有大量公司依然处于估值历史低位，重点关注受益于国企改革三年行动方案且估值性价比较高的央企国企板块。三是，顺周期方向，在中长期经济复苏趋势不变，前期调整较多的顺周期资产会在复苏趋势下存在交易性机会，重点关注的板块包括：港股、机械设备、大金融、大消费等。

债券方面，资金面稳定性预计好转，货币政策相对宽松，机构配置力量或有所延续，经济复苏预期的兑现仍需要一定过程，整体对债市偏中性。未来更关注对此类资产的仓位和久期的中性配置，同时关注海外债券资产的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 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

本报告期内，基金托管人在国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (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

本报告期内，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基金中基金 (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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，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基金中基金 (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 半年度财务会计报告 (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基金中基金 (FOF)

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	46,617,214.63	116,730,127.20

结算备付金		40,017.56	291,042.73
存出保证金		29,992.30	23,980.01
交易性金融资产	6.4.7.2	1,477,834,046.65	1,538,314,639.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		1,412,917,751.03	1,538,314,639.60
债券投资		64,916,295.62	-
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	6.4.7.3	-	-
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		9,957,843.75	37,616,355.16
应收股利		-	3,747.54
应收申购款		228,196.21	18,743.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.4	115,919.71	-
资产总计		1,534,823,230.81	1,692,998,635.98

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,828,751.77	964,700.62
应付管理人报酬		943,594.15	1,161,555.20
应付托管费		254,940.63	293,949.38
应付销售服务费		131,793.32	154,060.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	71,541.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	195,478.03	292,734.52
负债合计		5,354,557.90	2,938,542.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	1,225,143,117.92	1,347,916,350.38
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	304,325,554.99	342,143,743.41
净资产合计		1,529,468,672.91	1,690,060,093.79
负债和净资产总计		1,534,823,230.81	1,692,998,635.98

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,225,143,117.92 份。其中国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A 基金份额净值 1.2516 元，基金份额总额 905,875,266.09 份；国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C 基金份额净值 1.2393 元，基金份额总额 319,267,851.83 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,560,553.75	-338,451,257.11
1. 利息收入		315,200.18	801,341.70
其中：存款利息收入	6.4.7.8	315,200.18	801,341.70
债券利息收入		-	0
资产支持证券利息收入		-	0
买入返售金融资产收入		-	0
证券出借利息收入		-	0
其他利息收入		-	0
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-46,909,268.26	-63,570,859.48
其中：股票投资收益		-	0
基金投资收益	6.4.7.9	-50,032,381.71	-70,701,873.44
债券投资收益	6.4.7.10	443,050.40	0
资产支持证券投资收益		-	0
贵金属投资收益		-	0
衍生工具收益		-	0
股利收益	6.4.7.11	2,680,063.05	7,131,013.96
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	0

其他投资收益		-	0
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	52,022,602.42	-275,958,538.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	132,019.41	276,799.53
<b>减：二、营业总支出</b>		8,853,788.12	12,097,284.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,290,468.40	8,705,698.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,658,094.22	2,199,300.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	867,804.14	1,098,058.70
4. 投资顾问费		-	0
5. 利息支出		-	0
其中：卖出回购金融资产支出		-	0
6. 信用减值损失		-	0
7. 税金及附加		2,842.17	0
8. 其他费用	6.4.7.15	34,579.19	94,227.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,293,234.37	-350,548,541.92
减：所得税费用		-	0
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,293,234.37	-350,548,541.92
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-3,293,234.37	-350,548,541.92

### 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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益		
一、上期期末净资产（基金净值）	1,347,916,350.38	-	342,143,743.41	1,690,060,093.79
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）	1,347,916,350.38	-	342,143,743.41	1,690,060,093.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-122,773,232.46	-	-37,818,188.42	-160,591,420.88
（一）、综合收益总额	-	-	-3,293,234.37	-3,293,234.37
（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）	-122,773,232.46	-	-34,524,954.05	-157,298,186.51
其中：1. 基金申购款	2,069,035.69	-	591,057.35	2,660,093.04
2. 基金赎回款	-124,842,268.15	-	-35,116,011.40	-159,958,279.55
（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）	1,225,143,117.92	-	304,325,554.99	1,529,468,672.91
	<b>上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日</b>			
<b>项目</b>	<b>实收基金</b>	<b>其他综合收益</b>	<b>未分配利润</b>	<b>净资产合计</b>
一、上期期末净资产（基金净值）	1,709,571,725.82	-	1,028,029,930.10	2,737,601,655.92
加：会计政策变更	-	-	0	0
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,709,571,725.82	-	1,028,029,930.10	2,737,601,655.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-234,536,223.27	-	-435,616,872.83	-670,153,096.1
（一）、综合收益总额	-	-	-350,548,541.92	-350,548,541.92
（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）	-234,536,223.27	-	-85,068,330.91	-319,604,554.18
其中：1. 基金申购款	30,516,366.69	-	13,619,230.19	44,135,596.88

2. 基金赎回款	-265,052,589.96	-	-98,687,561.1	-363,740,151.06
(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)	0	-	0	0
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,475,035,502.55	-	592,413,057.27	2,067,448,559.82

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) (以下简称“本基金”) 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。本基金的基金合同于 2022 年 3 月 21 日正式生效。本基金为契约型开放式。

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》自基金管理人公告的生效之日起生效，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，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。

基金的投资组合比例为:投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%,其中,股票、股票型基金、混合型基金(混合型基金仅包含以下两类:基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金;根据基金披露的定期报告,最近四个季度股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金)合计占基金资产的比例为 60%-95%,投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%;本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

#### 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

## 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 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 2023 年 06 月 30 日
活期存款	46,617,214.63
等于：本金	46,608,060.68
加：应计利息	9,153.95
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	46,617,214.63

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	64,061,008.00	679,575.62	64,916,295.62	175,712.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	64,061,008.00	679,575.62	64,916,295.62	175,712.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	1,458,334,665.07	-	1,412,917,751.03	-45,416,914.04	
其他	-	-	-	-	
合计	1,522,395,673.07	679,575.62	1,477,834,046.65	-45,241,202.04	

#### 6.4.7.3 买入返售金融资产

##### 6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	115,919.71
待摊费用	-
合计	115,919.71

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	77.32
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	605.52
其中：交易所市场	605.52
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	120,000.00
预提审计费	74,795.19
合计	195,478.03

6.4.7.6 实收基金

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	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	989,136,928.92	989,136,928.92
本期申购	987,334.57	987,334.57
本期赎回（以“-”号填列）	-84,248,997.40	-84,248,997.40
本期末	905,875,266.09	905,875,266.09

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	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	358,779,421.46	358,779,421.46

本期申购	1,081,701.12	1,081,701.12
本期赎回(以“-”号填列)	-40,593,270.75	-40,593,270.75
本期末	319,267,851.83	319,267,851.83

注：申购含红利再投、份额转换入、份额升降级等原因导致的份额调增，赎回含份额转换出、份额升降级等原因导致的份额调减。

#### 6.4.7.7 未分配利润

##### 国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	541,334,571.97	-287,655,058.02	253,679,513.95
本期利润	-40,157,663.69	38,176,258.58	-1,981,405.11
本期基金份额交易产生的变动数	-44,099,260.50	20,329,270.33	-23,769,990.17
其中：基金申购款	526,956.66	-237,488.58	289,468.08
基金赎回款	-44,626,217.16	20,566,758.91	-24,059,458.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	457,077,647.78	-229,149,529.11	227,928,118.67

##### 国泰君安君得益三个月持有混合(FOF)C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	153,998,728.20	-65,534,498.74	88,464,229.46
本期利润	-15,158,173.10	13,846,343.84	-1,311,829.26
本期基金份额交易产生的变动数	-16,122,285.01	5,367,321.13	-10,754,963.88
其中：基金申购款	446,555.92	-144,966.65	301,589.27
基金赎回款	-16,568,840.93	5,512,287.78	-11,056,553.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	122,718,270.09	-46,320,833.77	76,397,436.32

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	313,238.94
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	1,635.24
其他	326.00
合计	315,200.18

#### 6.4.7.9 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	621,546,556.20
减：卖出/赎回基金成本总额	670,702,550.84
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	23,684.88
减：交易费用	852,702.19
基金投资收益	-50,032,381.71

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	446,265.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	-3,214.70
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	443,050.40

##### 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	3,214.70
买卖债券差价收入	-3,214.70

#### 6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	2,680,063.05
合计	2,680,063.05

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	51,958,250.73
——股票投资	-
——债券投资	175,712.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	51,782,538.73
——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	-64,351.69
合计	52,022,602.42

6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	16,099.70
销售服务费返还收入	115,919.71
合计	132,019.41

6.4.7.14 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	397,269.03
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	10,521,402.78
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,760,986.57

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)、销售服务费等销售费用。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。

#### 6.4.7.15 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	784.00
账户维护费	9,000.00
合计	34,579.19

#### 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 (以下简称“国泰君安资管”)	基金管理人
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、代销机构
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间2022年01月01日至 2022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
国泰君安证券	64,061,008	100%	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2023年01月01日至2023年06月 30日		上年度可比期间2022年01月01日至 2022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	148,654,028.60	100%	4,999,382.20	100%

##### 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2023年01月01日至2023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	4,702.19	100%	605.52	100%
关联方名称	上年度可比期间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%	49.99	100%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

#### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,290,468.40	8,705,698.49
其中：支付销售机构的客户维护费	2,749,864.52	3,986,394.02

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提，但本基金投资于基金管理人所管理的其他基金的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金部分（若为负数，则取 0）

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,658,094.22	2,199,300.06

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提，但本基金投资于基金托管人所托管的其他公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分（若为负数，则取 0）

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

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	合计

		益三个月持有 混合 (FOF)C	
国泰君安证券	-	774,238.71	774,238.71
国泰君安资管	-	5,111.58	5,111.58
交通银行	-	20,960.28	20,960.28
合计	-	800,310.57	800,310.57
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 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	-	979,238.96	979,238.96
国泰君安资管	-	7,119.44	7,119.44
交通银行	-	28,271.32	28,271.32
合计	-	1,014,629.72	1,014,629.72

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

##### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	19,933,547.52	161,783,547.52
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	107,450,000
报告期末持有的基金份额	19,933,547.52	54,333,547.52
报告期末持有的基金份额占基	2.20%	4.99%

金总份额比例		
--------	--	--

**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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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**

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末及上年度末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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	46,617,214.63	313,238.94	239,848,271.77	801,180.06

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间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 其他关联交易事项的说明**

于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人国泰君安资管及其关联方华安基金所管理的公开募集证券投资基金合计 262,374,326.51 元，占本基金资产净值的比例为 17.15% (2022 年 12 月 31 日，本基金持有基金管理人国泰君安资管及其关联方华安基金所管理的公开募集证券投资基金合计 213,666,325.87 元，占本基金资产净值的比例为 12.64%)。

**6.4.10.7.2 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	3,000.00
当期交易基金产生的赎回费（元）	37,738.44	241,083.65
当期持有基金产生的应支付销售 服务费（元）	68,226.71	0
当期持有基金产生的应支付管理 费（元）	1,497,348.56	2,339,691.61
当期持有基金产生的应支付托管 费（元）	245,870.23	390,030.60
当期交易基金产生的交易费（元）	-	-

**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**  
无

**6.4.12 期末（2023 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**

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于2023年6月30日，本基金未持有信用类债券(2022年12月31日：本基金未持有信用类债券)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF联接基金除外)不超过被投资基金净资产的20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证

券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的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(不含本基金所投资的基金份额)不得超过该证券的10%。

本基金所持部分证券在银行间或证券交易所上市，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

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

#### 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

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金和交易性债券等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	46,617,214.63	-	-	-	46,617,214.63
结算备付金	40,017.56	-	-	-	40,017.56
存出保证金	29,992.30	-	-	-	29,992.30
交易性金融资产	64,916,295.62	-	-	1,412,917,751.03	1,477,834,046.65
应收清算款	-	-	-	9,957,843.75	9,957,843.75
应收申购款	-	-	-	228,196.21	228,196.21
其他资产	-	-	-	115,919.71	115,919.71
资产总计	111,603,520.11	-	-	1,423,219,710.70	1,534,823,230.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,828,751.77	3,828,751.77
应付管理人报酬	-	-	-	943,594.15	943,594.15
应付托管费	-	-	-	254,940.63	254,940.63
应付销售服务费	-	-	-	131,793.32	131,793.32
其他负债	-	-	-	195,478.03	195,478.03
负债总计	-	-	-	5,354,557.90	5,354,557.90
利率敏感度缺口	111,603,520.11	-	-	1,417,865,152.80	1,529,468,672.91
上年度末 2022年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	116,730,127.20	-	-	-	116,730,127.20
结算备付金	291,042.73	-	-	-	291,042.73
存出保证金	23,980.01	-	-	-	23,980.01
交易性金融资产	-	-	-	1,538,314,639.60	1,538,314,639.60
应收清算款	-	-	-	37,616,355.16	37,616,355.16
应收股利	-	-	-	3,747.54	3,747.54
应收申购款	-	-	-	18,743.74	18,743.74
资产总计	117,045,149.94	-	-	1,575,953,486.04	1,692,998,635.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	964,700.62	964,700.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,161,555.20	1,161,555.20
应付托管费	-	-	-	293,949.38	293,949.38

应付销售服务费	-	-	-	154,060.74	154,060.74
应交税费	-	-	-	71,541.73	71,541.73
其他负债	-	-	-	292,734.52	292,734.52
负债总计	-	-	-	2,938,542.19	2,938,542.19
利率敏感度缺口	117,045,149.94	-	-	1,573,014,943.85	1,690,060,093.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日或行权日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 4.24%(2022 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	1,412,917,751.03	92.38	1,538,314,639.60	91.02

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	1,412,917,751.03	92.38	1,538,314,639.60	91.02

#### 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（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	76,680,947.00	88,824,908.08
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-76,680,947.00	-88,824,908.08

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,412,917,751.03	1,538,314,639.60
第二层次	64,916,295.62	-
第三层次	-	-
合计	1,477,834,046.65	1,538,314,639.60

###### 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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	1,412,917,751.03	92.06
3	固定收益投资	64,916,295.62	4.23
	其中：债券	64,916,295.62	4.23
	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	46,657,232.19	3.04

8	其他各项资产	10,331,951.97	0.67
9	合计	1,534,823,230.81	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股票。

### 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港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未进行股票投资。

### 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

本基金本报告期末未进行股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票投资。

## 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	64,916,295.62	4.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,916,295.62	4.24

## 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	019688	22 国债 23	406,000	41,054,419.67	2.68
2	019694	23 国债 01	236,000	23,861,875.95	1.56

## 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。

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，本基金按照所设定的目标风险，确定权益类资产和非权益类资产的配置比例，控制本基金的波动性，从而实现本基金的风险设定目标。本基金主要投资于开放式基金，总体风险中等，符合本基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

### 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	003293	易方达科瑞灵活配置混合	契约型 开放式	49,330,681.93	96,022,172.38	6.28	否
2	519002	华安安信消费混合A	契约型 开放式	20,622,702.54	90,678,023.07	5.93	是
3	001736	圆信永丰优加生活股票	契约型 开放式	25,162,320.27	81,000,025.18	5.30	否
4	519133	海富通改革驱动混合	契约型 开放式	34,604,557.09	75,579,813.14	4.94	否
5	550002	中信保诚精萃成长混合A	契约型 开放式	82,356,102.59	71,559,217.54	4.68	否
6	014156	国泰君安中证500指数增强C	契约型 开放式	75,143,334.76	71,498,883.02	4.67	是
7	001694	华安沪港深外延增长灵活配置混合A	契约型 开放式	13,948,711.36	56,854,947.50	3.72	是
8	001955	中欧养老混合A	契约型 开放式	15,555,100.52	50,316,083.65	3.29	否
9	163822	中银主题策略混合A	契约型 开放式	10,740,870.03	47,238,346.39	3.09	否
10	952004	国泰君安君得益明混合	契约型 开放式	19,477,136.98	43,342,472.92	2.83	是
11	110013	易方达科翔混合	契约型 开放式	8,592,688.97	38,357,763.56	2.51	否
12	000326	南方中小盘	契约型	29,767,503.46	36,551,517.50	2.39	否

		成长股票	开放式				
13	270006	广发策略优选混合	契约型 开放式	11,355,378.96	33,546,060.52	2.19	否
14	410007	华富价值增长混合	契约型 开放式	12,679,978.10	32,761,259.42	2.14	否
15	513180	华夏恒生科技ETF(QDII)	契约型 开放式	57,705,900.00	30,872,656.50	2.02	否
16	206002	鹏华精选成长混合A	契约型 开放式	13,076,738.81	29,370,355.37	1.92	否
17	570008	诺德周期策略混合	契约型 开放式	9,202,343.63	29,364,678.52	1.92	否
18	159920	恒生ETF(QDII)	契约型 开放式	23,753,800.00	26,532,994.60	1.73	否
19	540003	汇丰晋信动态策略混合A	契约型 开放式	6,340,813.93	25,706,927.84	1.68	否
20	015208	信澳健康中国混合C	契约型 开放式	9,607,152.99	24,450,204.36	1.60	否
21	013500	南方金融主题灵活配置混合C	契约型 开放式	17,216,346.72	24,412,779.65	1.60	否
22	002980	华夏创新前沿股票	契约型 开放式	9,281,140.77	22,729,513.75	1.49	否
23	001473	建信大安全战略精选股票	契约型 开放式	8,010,431.93	21,994,242.95	1.44	否
24	070027	嘉实周期优选混合	契约型 开放式	8,573,849.67	21,991,924.40	1.44	否
25	002686	中欧丰泓沪港深灵活配置混合C	契约型 开放式	19,617,729.61	21,473,566.83	1.40	否
26	008187	淳厚信睿混合C	契约型 开放式	10,898,588.63	20,754,182.33	1.36	否
27	017493	东方红新动力混合C	契约型 开放式	4,961,548.00	20,372,116.09	1.33	否
28	001404	招商移动互联网产业股票A	契约型 开放式	13,479,772.15	19,675,075.43	1.29	否
29	519714	交银消费新驱动股票	契约型 开放式	10,184,980.46	18,190,375.10	1.19	否
30	016858	国金量化多因子股票C	契约型 开放式	7,916,118.67	16,394,281.77	1.07	否
31	013280	宏利睿智稳	契约型	14,559,780.75	16,025,950.67	1.05	否

		健混合 C	开放式				
32	000893	工银创新动力股票	契约型 开放式	14,962,675.31	15,995,099.91	1.05	否
33	014243	富国新材料 新能源混合 C	契约型 开放式	8,583,849.26	13,688,664.41	0.89	否
34	015773	招商移动互联网产业股票 C	契约型 开放式	8,402,736.51	12,378,071.15	0.81	否
35	161611	融通内需驱动混合 A	契约型 开放式	4,440,053.29	12,165,746.01	0.80	否
36	007146	鹏华研究智选混合	契约型 开放式	6,203,558.01	11,949,293.44	0.78	否
37	720001	财通价值动量混合	契约型 开放式	2,849,768.70	11,079,900.71	0.72	否
38	007130	中庚小盘价值股票	契约型 开放式	4,420,424.40	10,416,730.10	0.68	否
39	017967	华富新能源股票型发起式 C	契约型 开放式	11,980,352.22	10,210,854.20	0.67	否
40	014109	融通内需驱动混合 C	契约型 开放式	3,698,301.51	10,055,681.81	0.66	否
41	001645	国泰大健康股票 A	契约型 开放式	3,382,916.10	9,773,244.61	0.64	否
42	519710	交银策略回报混合	契约型 开放式	5,132,956.88	9,367,646.31	0.61	否
43	011068	华宝资源优选混合 C	契约型 开放式	3,093,102.38	9,174,141.66	0.60	否
44	000772	景顺长城中国回报混合	契约型 开放式	5,636,922.21	9,165,635.51	0.60	否
45	700003	平安策略先锋混合	契约型 开放式	1,528,516.66	8,226,476.66	0.54	否
46	004075	交银医药创新股票 A	契约型 开放式	2,658,869.59	6,973,151.39	0.46	否
47	004224	南方军工改革灵活配置混合 A	契约型 开放式	4,939,483.76	6,809,572.31	0.45	否
48	011148	南方军工改革灵活配置混合 C	契约型 开放式	4,971,590.91	6,788,210.23	0.44	否
49	510900	易方达恒生国企 (QDII-ETF)	契约型 开放式	7,683,800.00	6,162,407.60	0.40	否
50	159819	易方达中证	契约型	5,800,400.00	5,266,763.20	0.34	否

		人工智能主题 ETF	开放式				
51	009908	湘财长泽灵活配置混合 C	契约型 开放式	3,886,513.80	5,090,167.12	0.33	否
52	007013	湘财长顺混合发起式 C	契约型 开放式	5,968,723.89	4,625,164.14	0.30	否
53	517180	南方富时中国国企开放共赢 ETF	契约型 开放式	1,437,800.00	1,936,716.60	0.13	否

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	29,992.30
2	应收清算款	9,957,843.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	228,196.21
6	其他应收款	115,919.71
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,331,951.97

#### 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处于转股期的可转换债券。

### 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
国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF) A	15,518	58,375.77	55,829,115.58	6.16%	850,046,150.51	93.84%
国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF) C	9,011	35,430.90	2,300,709.14	0.72%	316,967,142.69	99.28%
合计	24,529	49,946.72	58,129,824.72	4.74%	1,167,013,293.20	95.26%

### 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	425,256.42	0.0469%
	国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF) C	2,102,328.69	0.6585%
	合计	2,527,585.11	0.2063%

### 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	国泰君安君得益三个月持有混	0~10

和研究部门负责人持有本开放式基金	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
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF) A	0~10
	国泰君安君得益三个月持有混合 (FOF) C	10~50
	合计	10~50

## § 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	30,436,055.24	0.00
本报告期期初基金份额总额	989,136,928.92	358,779,421.46
本报告期基金总申购份额	987,334.57	1,081,701.12
减：本报告期基金总赎回份额	84,248,997.40	40,593,270.75
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	0.00	0.00
本报告期期末基金份额总额	905,875,266.09	319,267,851.83

## § 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：

本基金管理人于 2023 年 04 月 08 日发布公告，上海国泰君安证券资产管理有限公司法定代表人变更为陶耿先生，相关工商变更手续已于 2023 年 04 月 06 日在上海市场监督管理局办理完毕。

2、本报告期内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

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，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。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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	
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	4,702.19	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	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	成交	占当期债券回购成	成交	占当期权	成交金额	占当期基金成

称		额的比例	金 额	交总额的 比例	金 额	证成 交总 额 的 比 例		交总额的 比例
国泰君安证券股份有限公司	64,294,318.52	100.00%	-	-	-	-	148,654,028.60	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	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2022 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-01-20
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-01-20
3	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) 基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-03-20
4	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) 基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-03-20
5	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 (更新) (2023 年第 1 号)	证监会指定网站、公司官网	2023-03-20
6	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2022 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-03-31
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
8	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网	2023-04-08

	人变更登记的公告	站、公司官网	
9	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与直销 APP 费率优惠活动的公告	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	2023-04-17
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-04-22
11	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2023 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23

## § 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

在本报告截止日至报告批准送出日之间，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等法律文件的相关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 24 日起，调低本基金的托管费率并相应修订法律文件。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

## § 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  
二〇二三年八月三十一日