

国泰君安君得诚混合型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月28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

§ 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11

§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
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	42
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	42
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	42
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	42
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 投资组合报告附注	43

§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得诚混合型证券投资基金
基金简称	国泰君安君得诚混合
基金主代码	952035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 03 月 25 日
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	230,281,684.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用基金管理人的研究优势，主要投资于具备持续增长能力的优秀企业，并通过宏观、市场和价值分析，捕捉价值型公司（价值公司）的投资机会。通过科学合理的资产配置和股票组合，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、 资产配置策略 2、 股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 行业配置策略 (2) 公司股票精选策略 3、 组合调整策略 4、 股指期货、 国债期货交易策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 股指期货投资策略 (2) 国债期货投资策略 5、 债券的投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 利率策略 (2) 信用策略 (3) 债券选择策略 (4) 可转债的投资策略 6、 资产支持证券等品种投资策略 7、 股票期权的投资策略 8、 港股投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	张姗
	联系电话	021-38676022	0755-83077987
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95521	95555
传真		021-38871190	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		陶耿	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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）
本期已实现收益	-24,087,723.19
本期利润	1,652,042.88
加权平均基金份额本期利润	0.0069
本期加权平均净值利润率	0.76%

本期基金份额净值增长率	0.64%
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	-142,612.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0006
期末基金资产净值	207,170,724.45
期末基金份额净值	0.8996
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	-10.04%

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

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	3.62%	1.19%	1.22%	0.64%	2.40%	0.55%
过去三个月	0.13%	1.07%	-3.31%	0.59%	3.44%	0.48%
过去六个月	0.64%	1.10%	0.02%	0.61%	0.62%	0.49%
过去一年	-13.20%	1.49%	-8.69%	0.72%	-4.51%	0.77%
过去三年	-31.21%	1.37%	-2.40%	0.83%	-28.81%	0.54%
自基金合同生效起至今	-10.04%	1.36%	6.98%	0.82%	-17.02%	0.54%

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

国泰君安君得诚混合型证券投资基金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03月25日-2023年06月30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 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、国泰君安君得鑫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、国泰君安君得利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 业 年 限	说 明
		任职日期	离任日期		

王海军	<p>国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金经理，国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理。现任公募权益投资部基金经理。</p>	2023-02-13	-	15年	<p>王海军，厦门大学工商管理硕士，具备证券业、基金业从业资格。历任中国中投证券有限公司研究所分析师；富国基金管理有限公司权益研究部高级研究员、权益投资部高级基金经理；长安基金管理有限公司研究部总监、投决会成员、基金经理；2021年9月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司私募权益投资部担任投资经理，现任公募权益投资部基金经理。</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

报告期内本基金总体维持食品饮料、通用机械、机器人及工业自动化、家电、机床、光通信、旅游酒店等行业配置；第二季度国内经济指标处于底部是大概率事件，配置策略侧重于经济向好趋势且底部向上逐渐恢复的行业。港股持仓维持第二季度的配置比例。

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诚混合基金份额净值为 0.8996 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 0.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年，国内 GDP 增长 5.5%，略低于资本市场的 6% 预期。社会商品零售总额整体增速远好于 2022 年同期，制造业 PMI 处于 50 的枯荣线附近，PPI 继续下行导致 CPI 和 PPI 差进入历史新高。工业增加值增速不及预期，企业盈利指标方面的工业企业利润增速依然处于同比负区间波动，投资端增速较弱。国内证券市场因货币环境宽松，经济复苏比较弱，上半年以 GPT 为代表的人工智能涨幅领先，使得 TMT 整体涨幅远远领先其他一级子行业。展望下半年，随着国家促销费政策的进一步发力，资本市场和经济底部有望确立，有利于提升资本市场的风险偏好。

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“基金的收益与分配”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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：国泰君安君得诚混合型证券投资基金

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	21,862,902.97	31,701,520.10
结算备付金		566,372.22	106,784.15
存出保证金		97,172.37	52,379.55
交易性金融资产	6.4.7.2	185,378,296.16	189,460,164.23
其中：股票投资		185,378,296.16	189,460,164.23

基金投资		-	-
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		-	-
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		-	-
应收股利		33,354.31	-
应收申购款		12,152.43	2,201.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		207,950,250.46	221,323,049.16
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
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		16,956.97	0.01
应付赎回款		88,031.34	4,059.82
应付管理人报酬		202,300.01	230,212.55
应付托管费		42,145.83	47,960.93
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	430,091.86	295,726.63
负债合计		779,526.01	577,959.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	177,655,109.76	190,520,009.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	29,515,614.69	30,225,080.02
净资产合计		207,170,724.45	220,745,089.22
负债和净资产总计		207,950,250.46	221,323,049.16

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8996 元，基金份额总额 230,281,684.39 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安君得诚混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		3,320,400.14	-59,180,918.22
1. 利息收入		55,797.10	143,167.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	55,797.10	118,596.81
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		-	24,570.55
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）		-22,476,470.82	-77,142,343.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-23,922,018.21	-77,641,432.90
基金投资收益		-	0
债券投资收益		-	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	1,445,547.39	499,089.18
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	25,739,766.07	17,813,732.97
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	1,307.79	4,525.17

减：二、营业总支出		1,668,357.26	2,191,456.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,302,698.11	1,723,347.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	271,395.45	359,030.83
3. 销售服务费		-	0
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		-	0
8. 其他费用	6.4.7.14	94,263.70	109,077.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,652,042.88	-61,372,374.30
减：所得税费用		-	0
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,652,042.88	-61,372,374.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,652,042.88	-61,372,374.30

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得诚混合型证券投资基金

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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	190,520,009.20	-	30,225,080.02	220,745,089.22
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	190,520,009.20	-	30,225,080.02	220,745,089.22

净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,864,899.44	-	-709,465.33	-13,574,364.77
(一)、综合收益总额	-	-	1,652,042.88	1,652,042.88
(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)	-12,864,899.44	-	-2,361,508.21	-15,226,407.65
其中: 1. 基金申购款	4,186,047.11	-	566,788.46	4,752,835.57
2. 基金赎回款	-17,050,946.55	-	-2,928,296.67	-19,979,243.22
(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)	177,655,109.76	-	29,515,614.69	207,170,724.45
	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
项 目	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)	250,955,433.11	-	149,555,416.73	400,510,849.84
加: 会计政策变更	-	-	0	0
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	250,955,433.11	-	149,555,416.73	400,510,849.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-47,869,306.25	-	-79,801,673	-127,670,979.25
(一)、综合收益总额	-	-	-61,372,374.30	-61,372,374.3
(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)	-47,869,306.25	-	-18,429,298.7	-66,298,604.95
其中: 1. 基金申购款	1,456,412.44	-	462,869.32	1,919,281.76
2. 基金赎回款	-49,325,718.69	-	-18,892,168.02	-68,217,886.71
(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、本期期末净资产(基金净值)	203,086,126.86	-	69,753,743.73	272,839,870.59

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

国泰君安君得诚混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划由国泰君安君得稳一号集合资产管理计划变更而来。本基金的基金合同于 2022 年 2 月 14 日正式生效。本基金为契约型开放式。

国泰君安君得稳一号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，自 2013 年 2 月 19 日开始募集，于 2013 年 2 月 21 日结束募集工作，并于 2013 年 2 月 27 日成立。2013 年 5 月 31 日，国泰君安君得稳一号集合资产管理计划取得《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司发起设立国泰君安君得稳一号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕941 号）。

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》等法律法规的规定及《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》的约定，国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更为国泰君安君得诚混合型证券投资基金，即本基金，并相应修改《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》等法律文件，2021 年 11 月 8 日，本基金经中国证监会《关于准予国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2021〕3516 号文）注册。

经中国证监会批准，《国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金合同》自基金管理人公布的生效之日起生效，原《国泰君安君得诚混合型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，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、金融债、可转换债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可交换债券、可分离交易债券的纯债部分、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：股票资产占基金资产比例为 50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保

证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

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

(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) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	21,862,902.97
等于：本金	21,860,715.65
加：应计利息	2,187.32
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	21,862,902.97

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	178,762,723.53	-	185,378,296.16	6,615,572.63
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	178,762,723.53	-	185,378,296.16	6,615,572.63

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 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	0.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	346,408.04
其中：交易所市场	346,408.04
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	14,876.39
预提账户维护费	9,300.00
合计	430,091.86

6.4.7.7 实收基金

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	246,957,675.27	190,520,009.20
本期申购	5,425,924.39	4,186,047.11
本期赎回（以“-”号填列）	-22,101,915.27	-17,050,946.55
本期末	230,281,684.39	177,655,109.76

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。

6.4.7.8 未分配利润

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	24,510,335.69	5,714,744.33	30,225,080.02
本期利润	-24,087,723.19	25,739,766.07	1,652,042.88
本期基金份额交易产生的变动数	-565,224.96	-1,796,283.25	-2,361,508.21
其中：基金申购款	273,529.81	293,258.65	566,788.46
基金赎回款	-838,754.77	-2,089,541.90	-2,928,296.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-142,612.46	29,658,227.15	29,515,614.69

6.4.7.9 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	45,102.73
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	10,167.83
其他	526.54
合计	55,797.10

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	694,652,624.08
减：卖出股票成本总额	716,685,213.84
减：交易费用	1,889,428.45
买卖股票差价收入	-23,922,018.21

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	1,445,547.39
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,445,547.39

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	25,739,766.07
——股票投资	25,739,766.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	
合计	25,739,766.07

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	1,307.79
合计	1,307.79

6.4.7.14 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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,279.94
账户维护费	18,600.00
合计	94,263.70

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
招商银行股份有限公司(以下简称“招	基金托管人、代销机构

商银行”)	
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

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
国泰君安证券股份有限公司	1,381,516,203.78	100.00%	1,562,495,885.85	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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	246,000,000.00	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 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	占期末应付佣金总额的

			余额	比例
国泰君安证券股份有限公司	1,009,141.46	100.00%	346,408.04	100.00%
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
国泰君安证券股份有限公司	1,142,330.52	100.00%	371,480.11	100.00%

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	1,302,698.11	1,723,347.59
其中：支付销售机构的客户维护费	421,453.16	825,654.52

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 1.20% 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*1.20%/当年天数。

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	271,395.45	359,030.83

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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*0.25%/当年天数。

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

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 03 月 25 日）持有的基金份额	-	6,676,326.56
报告期初持有的基金份额	0.00	34,628,172.01
报告期间申购/买入总份额	-	0
报告期间因拆分变动份额	-	0
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	34,628,172.01
报告期末持有的基金份额	0.00	0
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0%

注：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

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
招商银行股份有限公司	21,862,902.97	45,102.73	31,689,165.1	97,738.81

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

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的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

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招商银行股份有限公司，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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。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、存出保证金和结算备付金等。

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	21,862,902.97	-	-	-	21,862,902.97
结算备付金	566,372.22	-	-	-	566,372.22
存出保证金	97,172.37	-	-	-	97,172.37
交易性金融资产	-	-	-	185,378,296.16	185,378,296.16
应收股利	-	-	-	33,354.31	33,354.31
应收申购款	-	-	-	12,152.43	12,152.43
资产总计	22,526,447.56	-	-	185,423,802.90	207,950,250.46
负债					
应付清算款	-	-	-	16,956.97	16,956.97
应付赎回款	-	-	-	88,031.34	88,031.34
应付管理人报酬	-	-	-	202,300.01	202,300.01
应付托管费	-	-	-	42,145.83	42,145.83
其他负债	-	-	-	430,091.86	430,091.86
负债总计	-	-	-	779,526.01	779,526.01

利率敏感度缺口	22,526,447.56	-	-	184,644,276.89	207,170,724.45
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	31,701,520.10	-	-	-	31,701,520.10
结算备付金	106,784.15	-	-	-	106,784.15
存出保证金	52,379.55	-	-	-	52,379.55
交易性金融资产	-	-	-	189,460,164.23	189,460,164.23
应收申购款	-	-	-	2,201.13	2,201.13
资产总计	31,860,683.80	-	-	189,462,365.36	221,323,049.16
负债					
应付清算款	-	-	-	0.01	0.01
应付赎回款	-	-	-	4,059.82	4,059.82
应付管理人报酬	-	-	-	230,212.55	230,212.55
应付托管费	-	-	-	47,960.93	47,960.93
其他负债	-	-	-	295,726.63	295,726.63
负债总计	-	-	-	577,959.94	577,959.94
利率敏感度缺口	31,860,683.80	-	-	188,884,405.42	220,745,089.22

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 0.00%(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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	11,594,696.38	-	11,594,696.38
应收股利	-	33,354.31	-	33,354.31
资产合计	-	11,628,050.69	-	11,628,050.69
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	11,628,050.69	-	11,628,050.69
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	31.62	-	31.62
资产合计	-	31.62	-	31.62
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	0.01	-	0.01
负债合计	-	0.01	-	0.01
资产负债表外汇风险敞口净额	-	31.61	-	31.61

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口		
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
	港币相对人民币贬值 1%	-116,280.51	-0.32
	港币相对人民币升值 1%	116,280.51	0.32

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	185,378,296.16	89.48	189,460,164.23	85.83
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	185,378,296.16	89.48	189,460,164.23	85.83

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%	11,672,371.39	11,984,298.91
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-11,672,371.39	-11,984,298.91

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	185,378,296.16	189,444,133.43
第二层次	-	-
第三层次	-	16,030.80
合计	185,378,296.16	189,460,164.23

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	185,378,296.16	89.15
	其中：股票	185,378,296.16	89.15
2	基金投资	-	-
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	22,429,275.19	10.79
8	其他各项资产	142,679.11	0.07
9	合计	207,950,250.46	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 11,594,696.38 元，占期末净值比例为 5.60%；通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	173,783,599.78	83.88
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	173,783,599.78	83.88

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	11,594,696.38	5.60
合计	11,594,696.38	5.60

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	占基金资产净值比例 (%)
1	688697	纽威数控	309,844	8,003,270.52	3.86
2	688308	欧科亿	191,517	7,660,680.00	3.70
3	003000	劲仔食品	602,600	7,586,734.00	3.66
4	600060	海信视像	295,100	7,303,725.00	3.53
5	603027	千禾味业	338,932	7,158,243.84	3.46
6	002050	三花智控	235,600	7,129,256.00	3.44
7	000921	海信家电	258,400	6,963,880.00	3.36
8	601882	海天精工	208,500	6,943,050.00	3.35
9	688558	国盛智科	190,392	6,808,417.92	3.29
10	000568	泸州老窖	31,900	6,685,283.00	3.23
11	300763	锦浪科技	58,000	6,037,800.00	2.91
12	300308	中际旭创	40,800	6,015,960.00	2.90
13	002847	盐津铺子	70,600	6,004,530.00	2.90
14	688059	华锐精密	70,410	5,896,837.50	2.85
15	06862	海底捞	369,085	5,866,582.16	2.83
16	300856	科思股份	74,300	5,852,611.00	2.83
17	002459	晶澳科技	139,700	5,825,490.00	2.81
18	688017	绿的谐波	35,600	5,781,440.00	2.79
19	000938	紫光股份	180,800	5,758,480.00	2.78
20	03690	美团-W	50,800	5,728,114.22	2.76
21	603369	今世缘	107,900	5,697,120.00	2.75
22	603868	飞科电器	88,200	5,564,538.00	2.69
23	603915	国茂股份	249,200	5,278,056.00	2.55
24	600587	新华医疗	145,600	5,144,048.00	2.48

25	603806	福斯特	132,400	4,923,956.00	2.38
26	605337	李子园	267,336	4,886,902.08	2.36
27	603019	中科曙光	94,000	4,784,600.00	2.31
28	002737	葵花药业	191,288	4,655,949.92	2.25
29	000988	华工科技	121,000	4,599,210.00	2.22
30	002946	新乳业	310,000	4,448,500.00	2.15
31	600298	安琪酵母	121,100	4,385,031.00	2.12

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	688017	绿的谐波	19,046,849.44	8.63
2	688308	欧科亿	14,421,000.20	6.53
3	688059	华锐精密	14,102,104.02	6.39
4	01579	颐海国际	13,891,384.82	6.29
5	000921	海信家电	13,080,711.00	5.93
6	600809	山西汾酒	12,994,906.60	5.89
7	601186	中国铁建	12,012,943.25	5.44
8	603868	飞科电器	11,922,829.00	5.40
9	002050	三花智控	11,336,571.00	5.14
10	603501	韦尔股份	10,618,172.25	4.81
11	003000	劲仔食品	10,583,587.00	4.79
12	688558	国盛智科	10,241,742.64	4.64
13	002459	晶澳科技	10,065,991.60	4.56
14	600612	老凤祥	9,890,263.00	4.48
15	002959	小熊电器	9,652,202.00	4.37
16	688697	纽威数控	9,492,506.96	4.30
17	300308	中际旭创	9,232,461.00	4.18
18	300595	欧普康视	8,344,879.00	3.78
19	002035	华帝股份	8,306,765.00	3.76
20	06862	海底捞	8,222,363.84	3.72
21	601882	海天精工	8,186,083.00	3.71
22	00520	呷哺呷哺	8,062,596.00	3.65
23	603486	科沃斯	7,901,501.00	3.58
24	603915	国茂股份	7,826,564.00	3.55
25	000799	酒鬼酒	7,755,580.00	3.51
26	000651	格力电器	7,721,126.00	3.50
27	000568	泸州老窖	7,388,637.00	3.35
28	603529	爱玛科技	7,377,335.00	3.34

29	603027	千禾味业	7,355,686.72	3.33
30	300707	威唐工业	7,350,300.00	3.33
31	000938	紫光股份	7,289,280.00	3.30
32	605336	帅丰电器	7,232,580.60	3.28
33	603019	中科曙光	7,210,163.45	3.27
34	300911	亿田智能	7,144,198.87	3.24
35	00558	力劲科技	7,108,067.34	3.22
36	603369	今世缘	7,078,984.00	3.21
37	002979	雷赛智能	6,968,522.16	3.16
38	600298	安琪酵母	6,940,664.68	3.14
39	688169	石头科技	6,908,588.90	3.13
40	000338	潍柴动力	6,701,610.00	3.04
41	000988	华工科技	6,675,185.00	3.02
42	603057	紫燕食品	6,673,997.80	3.02
43	600060	海信视像	6,624,552.00	3.00
44	000951	中国重汽	6,622,175.58	3.00
45	601390	中国中铁	6,565,391.81	2.97
46	603517	绝味食品	6,545,254.00	2.97
47	002847	盐津铺子	6,525,642.00	2.96
48	603129	春风动力	6,421,041.25	2.91
49	600984	建设机械	6,291,306.00	2.85
50	601939	建设银行	6,219,890.69	2.82
51	688596	正帆科技	6,112,917.41	2.77
52	300763	锦浪科技	6,106,491.00	2.77
53	688598	金博股份	5,996,925.67	2.72
54	002946	新乳业	5,963,859.00	2.70
55	600988	赤峰黄金	5,875,769.50	2.66
56	600176	中国巨石	5,817,425.00	2.64
57	605339	南侨食品	5,611,117.00	2.54
58	03690	美团-W	5,475,378.85	2.48
59	603901	永创智能	5,434,362.30	2.46
60	002064	华峰化学	5,370,269.00	2.43
61	605337	李子园	5,217,214.48	2.36
62	688408	中信博	5,162,981.55	2.34
63	300856	科思股份	5,161,511.00	2.34
64	00388	香港交易所	5,058,197.61	2.29
65	002737	葵花药业	4,982,897.00	2.26
66	600309	万华化学	4,878,433.00	2.21
67	601100	恒立液压	4,870,254.79	2.21
68	002601	龙佰集团	4,832,815.00	2.19
69	600031	三一重工	4,831,680.00	2.19
70	002230	科大讯飞	4,790,637.00	2.17
71	002043	兔宝宝	4,790,231.00	2.17

72	300861	美畅股份	4,744,513.00	2.15
73	603638	艾迪精密	4,729,755.00	2.14
74	300059	东方财富	4,714,007.00	2.14
75	603801	志邦家居	4,676,368.00	2.12
76	601138	工业富联	4,648,117.00	2.11
77	001269	欧晶科技	4,622,145.00	2.09
78	603806	福斯特	4,494,511.02	2.04
79	000157	中联重科	4,491,526.00	2.03
80	688048	长光华芯	4,444,856.28	2.01
81	300577	开润股份	4,443,937.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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	688596	正帆科技	17,716,966.24	8.03
2	300316	晶盛机电	14,135,047.12	6.40
3	688017	绿的谐波	13,972,724.71	6.33
4	300308	中际旭创	13,675,901.00	6.20
5	002129	TCL 中环	12,706,566.61	5.76
6	01579	颐海国际	12,361,371.00	5.60
7	601186	中国铁建	11,491,107.45	5.21
8	600809	山西汾酒	11,213,540.00	5.08
9	002011	盾安环境	10,548,677.00	4.78
10	300014	亿纬锂能	10,219,195.16	4.63
11	603501	韦尔股份	10,103,397.20	4.58
12	300750	宁德时代	10,069,986.00	4.56
13	600612	老凤祥	9,316,318.00	4.22
14	002959	小熊电器	9,229,741.00	4.18
15	300331	苏大维格	9,210,380.00	4.17
16	002459	晶澳科技	8,258,700.00	3.74
17	300595	欧普康视	8,060,188.00	3.65
18	000049	德赛电池	7,848,711.00	3.56
19	603529	爱玛科技	7,742,159.44	3.51
20	002035	华帝股份	7,690,034.00	3.48
21	300724	捷佳伟创	7,567,587.20	3.43
22	688599	天合光能	7,512,454.44	3.40
23	000921	海信家电	7,477,030.00	3.39
24	603486	科沃斯	7,237,568.00	3.28
25	300707	威唐工业	7,122,085.00	3.23

26	002741	光华科技	7,064,257.00	3.20
27	000651	格力电器	6,977,527.00	3.16
28	605376	博迁新材	6,858,510.00	3.11
29	688169	石头科技	6,660,390.68	3.02
30	000338	潍柴动力	6,603,743.00	2.99
31	300916	朗特智能	6,567,728.00	2.98
32	000799	酒鬼酒	6,535,674.00	2.96
33	605336	帅丰电器	6,386,041.60	2.89
34	603019	中科曙光	6,354,867.00	2.88
35	603057	紫燕食品	6,349,190.31	2.88
36	601390	中国中铁	6,317,770.00	2.86
37	00558	力劲科技	6,311,376.12	2.86
38	000951	中国重汽	6,265,875.00	2.84
39	002635	安洁科技	6,195,837.00	2.81
40	603191	望变电气	6,125,685.00	2.78
41	002979	雷赛智能	6,003,954.12	2.72
42	00520	呷哺呷哺	5,977,864.04	2.71
43	300115	长盈精密	5,970,354.00	2.70
44	603517	绝味食品	5,790,441.38	2.62
45	600984	建设机械	5,745,212.80	2.60
46	603129	春风动力	5,714,260.94	2.59
47	601939	建设银行	5,708,536.00	2.59
48	600176	中国巨石	5,634,925.34	2.55
49	688598	金博股份	5,618,611.77	2.55
50	603868	飞科电器	5,484,198.00	2.48
51	000988	华工科技	5,466,759.00	2.48
52	600988	赤峰黄金	5,412,923.15	2.45
53	601012	隆基绿能	5,357,067.80	2.43
54	601877	正泰电器	5,314,467.00	2.41
55	002050	三花智控	5,298,037.00	2.40
56	688190	云路股份	5,271,445.25	2.39
57	688059	华锐精密	5,215,016.04	2.36
58	002230	科大讯飞	5,188,957.00	2.35
59	00388	香港交易所	5,177,454.87	2.35
60	603901	永创智能	5,125,618.74	2.32
61	300911	亿田智能	5,124,210.60	2.32
62	603348	文灿股份	5,045,465.00	2.29
63	603259	药明康德	4,950,534.00	2.24
64	605339	南侨食品	4,913,077.00	2.23
65	601717	郑煤机	4,865,949.00	2.20
66	002484	江海股份	4,857,471.20	2.20
67	300337	银邦股份	4,806,832.60	2.18
68	688408	中信博	4,772,947.62	2.16

69	002064	华峰化学	4,766,955.00	2.16
70	001269	欧晶科技	4,745,780.90	2.15
71	002335	科华数据	4,608,827.00	2.09
72	300861	美畅股份	4,586,420.00	2.08
73	002436	兴森科技	4,499,391.00	2.04
74	603638	艾迪精密	4,490,503.60	2.03
75	600031	三一重工	4,485,109.00	2.03
76	688048	长光华芯	4,434,233.18	2.01
77	300577	开润股份	4,427,485.00	2.01
78	603105	芯能科技	4,426,517.00	2.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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	686,863,579.70
卖出股票收入（成交）总额	694,652,624.08

注：买入股票成本（成交）总额和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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。

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。

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

在股指期货投资上，本基金以套期保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率，并利用股指期货流动性较好的特点对冲基金的流动性风险，如大额申购赎回等。

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

在风险可控的前提下，本基金将本着谨慎原则适度参与国债期货投资。本基金参与国债期货交易以套期保值为主要目的，运用国债期货对冲风险。本基金将根据对债券现货市场和期货市场的分析，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，发挥国债期货杠杆效应和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲收益率曲线平坦、陡峭等形态变化的风险、对冲关键期限利率波动的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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

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	97,172.37
2	应收清算款	-
3	应收股利	33,354.31
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,152.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	142,679.11

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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
4,316	53,355.35	4,075,463.27	1.77%	226,206,221.12	98.23%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	684,456.45	0.2972%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 03 月 25 日）基金份额总额	33,122,666.91
本报告期期初基金份额总额	246,957,675.27
本报告期基金总申购份额	5,425,924.39
减：本报告期基金总赎回份额	22,101,915.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	230,281,684.39

§ 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 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

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.7 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	
国泰君安证券股份有限公司	2	1,381,516,203.78	100.00%	1,009,141.46	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	国泰君安君得诚混合型证券投资基金 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	国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2023-02-13
4	国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-02-13
5	国泰君安君得诚混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 1 号)	证监会指定网站、公司官网	2023-02-13
6	国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-03-16
7	国泰君安君得诚混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 2 号)	证监会指定网站、公司官网	2023-03-16
8	国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2023-03-16

9	国泰君安君得诚混合型证券投资基金 2022 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-03-31
10	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
11	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人变更登记的公告	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	2023-04-08
12	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
13	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
14	国泰君安君得诚混合型证券投资基金 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诚混合型集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得诚混合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