

国泰君安君得明混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2022年8月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至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	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	13
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	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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	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	56
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	56
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	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
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 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得明混合型证券投资基金
基金简称	国泰君安君得明混合
基金主代码	952004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年08月30日
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	958,477,412.74份
基金合同存续期	不定期

注：国泰君安君得明混合型集合资产管理计划于2022年3月14日起正式变更为国泰君安君得明混合型证券投资基金。

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
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，辅之以基金管理人自行开发的数量化辅助模型，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采取的是自上而下和自下而上相结合的选股策略。本基金将从行业配置策略和公司精选两方面进行具体股票筛选，并基于此形成两级股票池。</p> <p>3、组合调整策略</p> <p>本基金采用两级仓位配置策略确定股票的仓位。股票总仓位包含基本仓位和动态仓位两部分。其中，</p>

	<p>基本仓位一般保持在50%左右，主要投资增长明确、可长期持有的成长股（即明星股）和估值便宜、有一定行业发展机遇的价值股（即价值股）。动态仓位主要体现策略研究和行业研究的成果，通过宏观、市场流动性和行为金融分析，选择具有阶段性机会的蓝筹股和主题股票，以期通过灵活的动态仓位调整策略，体现研究价值，获得超额收益。但从整体而言，产品仓位会较为稳定在一个合适的水平，年均换手率也将明显低于同类产品，从而更好地体现研究和长期投资的价值。</p> <p>本基金的投资策略还包括股指期货、国债期货投资策略、债券的投资策略资产支持证券等品种投资策略、股票期权的投资策略等策略。</p>
业绩比较基准	70%*沪深300指数收益率+30%*中债综合指数收益率
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，属于中风险/收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海国泰君安证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
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	95595
传真	021-38871190	010-63639132
注册地址	上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200120	100033

法定代表人	谢乐斌	李晓鹏
-------	-----	-----

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)
本期已实现收益	-567,349,969.66
本期利润	-413,419,559.79
加权平均基金份额本期利润	-0.4060
本期加权平均净值利润率	-17.19%
本期基金份额净值增长率	-13.23%
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	1,302,863,700.75
期末可供分配基金份额利润	1.3593
期末基金资产净值	2,331,604,893.66

期末基金份额净值	2.4326
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	31.75%

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	9.78%	1.00%	6.67%	0.75%	3.11%	0.25%
过去三个月	10.12%	1.27%	4.77%	1.00%	5.35%	0.27%
过去六个月	-13.23%	1.37%	-5.87%	1.02%	-7.36%	0.35%
过去一年	-17.07%	1.16%	-9.14%	0.87%	-7.93%	0.29%
自基金合同生效起至今	31.75%	1.19%	15.59%	0.90%	16.16%	0.29%

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



§ 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		
郑伟	本基金基金经理，国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金经理，本公司权益投资部总经理。	2022-03-22	-	12年	郑伟，经济学硕士，毕业于复旦经济学院国际金融系。于2021年9月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司公募权益投资部。从业时间超过15年，具备丰富的行业研究经验及管理基金经历。此前就职于中信保诚基金，历任研究员、基金经理、高级基金经理。自2022年2月21日起担任“国泰君安君得诚混合型证券投资基金”基金经理。自2022年3月22日起担任“国泰君安君得明混合型证券投资基金”基金经理。
李子波	本基金基金经理，国泰君安创新医药混合型发起式证券投资基金基金经理	2022-03-22	-	13年	李子波，2021.01-至今，上海国泰君安证券资产管理有限公司，任公募权益投资部基金经理。2010.12-2021.01，上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任全球研究院医药行业研究员、高级研究员。2008.02-2010.12，泰信基金管理有限公司，历任助理

					行业研究员、行业研究员。自2021年12月23日起担任“国泰君安创新医药混合型发起式证券投资基金”基金经理。自2022年3月22日起担任“国泰君安君得明混合型证券投资基金”基金经理。
陈思靖	本基金基金经理，国泰君安信息行业混合型发起式证券投资基金基金经理。	2022-03-22	-	8年	陈思靖，2013年7月至2013年12月任职于财富里昂证券有限公司研究部，任TMT行业研究员，2014年2月至2015年1月任职于上海从容投资管理有限公司研究部，任TMT研究员，2015年2月至2016年11月任职于上海原点资产管理有限公司研究部，任TMT研究员。自2016年11月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司研究发展部担任研究员，目前担任公募权益投资部基金经理。自2021年12月24日起担任“国泰君安信息行业混合型发起式证券投资基金”基金经理。自2022年3月22日起担任“国泰君安君得明混合型证券投资基金”基金经理。
周晨	本基金基金经理（已于2022年3月22日离任）	2019-08-30	2022-03-22	11年	周晨，北京大学光华管理学院金融学硕士，拥有11年从业经验，历任本公司研究发展部研究员、高级研究员、资深研究员、本

				<p>公司权益与衍生品部高级投资经理、公募权益投资部基金经理。自2019年8月30日至2022年3月13日担任“国泰君安君得明混合型集合资产管理计划”投资经理，自2020年1月6日至2021年8月17日担任“国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划”投资经理，自2020年3月25日至2021年8月17日担任“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”投资经理，自2020年6月18日至2021年12月6日担任“国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划”投资经理，自2021年1月28日至2022年1月16日担任“国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划”投资经理，自2021年12月7日至2022年3月9日担任“国泰君安君得盛债券型证券投资基金”基金经理，自2022年1月17日至2022年3月9日担任“国泰君安君得盈债券型证券投资基金”基金经理，自2022年3月14日至2022年3月22日担任“国泰君安君得明混合型证券投资基金”基金经理。</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。

4.1.3 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遵规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年一季度，在全球疫情、地缘冲突背景下，市场震荡下行，且呈现出明显的风格切换特点，诸如医药、新能源、科技等过去两年的若干景气赛道大幅回调，而以煤炭、地产、养殖等为代表的行业表现强势。二季度初期行业延续了一季度的跌势，在4月底行业迎来了反弹，随着国内疫情得到控制，同时国内市场流动性也较为充裕，政府对经济的支持政策也在持续出台，带来了五六月份国内市场的强势。

报告期内，本基金保持谨慎的操作思路，适当进行了行业分散，重点在消费、医药、金融、新能源、装备制造、TMT等方向布局，同时在稳增长方向也做了适当配置。长期而言，我们对中国经济转型仍然充满信心，这一信心来自全球低碳产业的蓬勃发展，来自科技进步带动的产业升级，也来自收入上升推动的内需增长。

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明混合基金份额净值为2.4326元，本报告期内，基金份额净值增长率为-13.23%，同期业绩比较基准收益率为-5.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，虽然经历了过去两个月的反弹，但是市场整体估值还是处于相对较低的水平，在宏观条件没有大变动下，风险依然相对有限。我们长期依然看好大消费、医药、TMT和先进制造等，我们会持续跟踪产业和个股的变化，保持稳健的投资组合，陪伴优秀企业一起成长，力争为投资者奉献长期稳定的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会对公司依法管理的资管产品的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定资管产品估值业务的操作流程和风险控制，确保资管产品估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值委员会由营运管理部分管领导、协管领导（若有）、投资部门负责人、投资研究院负责人、营运管理部负责人、法务监察部负责人、风险管理部负责人及市场部门负责人组成。具体参会的投资部门负责人依据待决议事项对应的资管产品确定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本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，中国光大银行股份有限公司在国泰君安君得明混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对

本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国泰君安君得明混合型证券投资基金2022年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得明混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	505,867,172.80	417,864,208.43
结算备付金		928,007.32	3,290,585.56
存出保证金		566,350.50	541,290.99
交易性金融资产	6.4.7.2	1,840,301,833.16	2,706,783,704.50
其中：股票投资		1,840,301,833.16	2,706,783,704.50

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		-	-
应收申购款		558,318.24	1,612,908.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	167,776.27
资产总计		2,348,221,682.02	3,130,260,474.02
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		3,316,304.89	-
应付赎回款		7,174,552.82	4,834,302.11
应付管理人报酬		2,189,821.61	3,266,352.94

应付托管费		364,970.26	544,392.15
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	3,571,138.78	4,394,313.44
负债合计		16,616,788.36	13,039,360.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	958,477,412.74	1,111,854,964.54
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,373,127,480.92	2,005,366,148.84
净资产合计		2,331,604,893.66	3,117,221,113.38
负债和净资产总计		2,348,221,682.02	3,130,260,474.02

注：（1）报告截止2022年6月30日，基金份额净值2.4326元，基金总份额958,477,412.74份。

（2）比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安君得明混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-396,275,478.38	440,141,120.27
1. 利息收入		2,753,460.90	4,600,723.57

其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,753,460.90	4,600,723.57
债券利息收入		-	-
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）		-553,215,558.29	1,033,359,778.30
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-566,112,631.16	999,474,887.93
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	12,897,072.87	33,884,890.37
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）	6.4.7.17	153,930,409.87	-604,428,652.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	256,209.14	6,609,270.76
减：二、营业总支出		17,144,081.41	77,799,468.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,381,276.85	32,121,959.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,396,879.43	5,353,659.96

3. 销售服务费		-	-
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		-	-
7. 税金及附加		30,173.84	-
8. 其他费用	6.4.7.19	335,751.29	40,323,848.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-413,419,559.79	362,341,651.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-413,419,559.79	362,341,651.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-413,419,559.79	362,341,651.58

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得明混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,111,854,964.54	-	2,005,366,148.84	3,117,221,113.38
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)	1,111,854,96 4.54	-	2,005,366,14 8.84	3,117,221,11 3.38
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-153,377,55 1.80	-	-632,238,66 7.92	-785,616,21 9.72
(一)、综合收益总额	-	-	-413,419,55 9.79	-413,419,55 9.79
(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)	-153,377,55 1.80	-	-218,819,10 8.13	-372,196,65 9.93
其中:1.基金申购款	9,485,577.28	-	13,190,199.1 1	22,675,776.3 9
2.基金赎回款	-162,863,12 9.08	-	-232,009,30 7.24	-394,872,43 6.32
(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)	958,477,412. 74	-	1,373,127,48 0.92	2,331,604,89 3.66
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)	2,358,172,78 8.18	-	4,137,622,04 8.75	6,495,794,83 6.93

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)	2,358,172,78 8.18	-	4,137,622,04 8.75	6,495,794,83 6.93
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-691,233,91 8.83	-	-914,950,54 9.59	-1,606,184,4 68.42
(一)、综合收益总额	-	-	362,341,651. 58	362,341,651. 58
(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)	-691,233,91 8.83	-	-1,277,292,2 01.17	-1,968,526,1 20.00
其中：1. 基金申购款	348,031,778. 68	-	636,144,895. 52	984,176,674. 20
2. 基金赎回款	-1,039,265,6 97.51	-	-1,913,437,0 96.69	-2,952,702,7 94.20
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	1,666,938,86 9.35	-	3,222,671,49 9.16	4,889,610,36 8.51

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

国泰君安君得明混合型证券投资基金由国泰君安君得明混合型集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得明混合型集合资产管理计划由国泰君安明星价值股票集合资产管理计划变更而来。

国泰君安明星价值股票集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2009 年 11 月 20 日经中国证监会证监许可[2009]1215 号文核准设立，自 2010 年 1 月 8 日起开始募集，于 2010 年 2 月 8 日结束募集工作，并于 2010 年 2 月 12 日正式成立。

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》等法律法规的规定及《国泰君安君得明混合型集合资产管理计划资产管理合同》的约定，国泰君安君得明混合型集合资产管理计划变更为国泰君安君得明混合型证券投资基金，即本基金，并相应修改《国泰君安君得明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 5 日，本基金经中国证监会《关于准予国泰君安君得明混合型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可[2021]3517 号文）注册。

《国泰君安君得明混合型证券投资基金基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安君得明混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含创业板及其他依法发行上市的股票）、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、次级债、地方政府债、可分离交易债券、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金等，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%；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。

本基金的业绩比较基准为：70%*沪深 300 指数收益率+30%*中债综合指数收益率

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、解释以及其他相关规定（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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 会计年度

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

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（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、以摊余成本计量的金融负债。

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；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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。对于以摊余成本计量的金融负债，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

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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，按实际利率法确认利息收入，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。

以摊余成本计量的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；

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、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

无。

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。

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。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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。

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。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币417,864,208.43元，自应收利息转入的重分类金额为人民币165,879.54元，重新计量预

期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币418,030,087.97元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币3,290,585.56元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,628.77元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币3,292,214.33元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币541,290.99元，自应收利息转入的重分类金额为人民币267.96元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币541,558.95元。

应收申购款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,612,908.27元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.00元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币1,612,908.27元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币167,776.27元，转出至银行存款的重分类金额为人民币165,879.54元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币1,628.77元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币267.96元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币0.00元，转出至其他资产的重分类金额为人民币0.00元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

其他资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币0.00元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币0.00元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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	505,867,172.80
等于：本金	505,692,398.10
加：应计利息	174,774.70
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	505,867,172.80

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	1,724,583,376.76	-	1,840,301,833.16	115,718,456.40
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	1,724,583,376.76	-	1,840,301,833.16	115,718,456.40

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 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	11,926.11
应付交易费用	1,261,829.19
其中：交易所市场	1,261,829.19
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	204,302.56
其他应付	2,093,080.92

合计	3,571,138.78
----	--------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,111,854,964.54	1,111,854,964.54
本期申购	9,485,577.28	9,485,577.28
本期赎回（以“-”号填列）	-162,863,129.08	-162,863,129.08
本期末	958,477,412.74	958,477,412.74

注：申购函转换转入份额；赎回含转换转出份额。

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
本期期初	2,141,029,732.03	-135,663,583.19	2,005,366,148.84
本期利润	-567,349,969.66	153,930,409.87	-413,419,559.79
本期基金份额交易产生的变动数	-270,816,061.62	51,996,953.49	-218,819,108.13
其中：基金申购款	16,304,686.98	-3,114,487.87	13,190,199.11
基金赎回款	-287,120,748.60	55,111,441.36	-232,009,307.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,302,863,700.75	70,263,780.17	1,373,127,480.92

6.4.7.9 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
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	25,567.72
其他	4,436.83
合计	2,753,460.90

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
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	2,252,405,595.07
减：卖出股票成本总额	2,812,957,941.71
减：交易费用	5,560,284.52
买卖股票差价收入	-566,112,631.16

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 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	-

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 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	12,897,072.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,897,072.87

6.4.7.17 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	153,930,409.87
——股票投资	153,930,409.87
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	153,930,409.87

6.4.7.18 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	256,209.14
合计	256,209.14

6.4.7.19 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
差价收入增值税抵减	251,448.73
合计	335,751.29

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，本基金并无须作披露的或有事项。

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“国泰君安证券资管”）	基金管理人
国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”）	基金管理人的股东

中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）	基金托管人
国泰君安金控投资（上海）有限公司	基金管理人股东的关联方

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 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	4,043,468,149.89	100.00%	5,131,968,079.76	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比例		额的比例
国泰君安证券	2,956,994.00	100.00%	1,261,829.19	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	3,753,024.22	100.00%	1,406,091.75	100.00%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,381,276.85	32,121,959.89
其中：支付销售机构的客户维护费	6,620,362.50	15,818,871.05

注：支付基金管理人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 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	2,396,879.43	5,353,659.96

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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

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（2019年08月30日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	22,244,420.99	22,244,420.99
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	22,244,420.99	22,244,420.99
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.32%	1.33%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安	50,000,000.00	5.22%	50,000,000.00	4.50%

证券股份 有限公司				
国泰君安 金控投资 (上海) 有限公司	7,223,867.66	0.75%	7,223,867.66	0.65%

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
中国光大 银行股份 有限公司	505,867,172.80	2,723,456.35	675,397,036.74	4,567,939.39

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

无。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金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	505,867,172.80	-	-	-	-	-	505,867,172.80
结算备付金	928,007.32	-	-	-	-	-	928,007.32
存出保证金	566,350.50	-	-	-	-	-	566,350.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,840,301,833.16	1,840,301,833.16
应收申购款	-	-	-	-	-	558,318.24	558,318.24
资产总计	507,361,530.62	-	-	-	-	1,840,860,151.40	2,348,221,682.02
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	3,316,304.89	3,316,304.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,174,552.82	7,174,552.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,189,821.61	2,189,821.61
应付托管费	-	-	-	-	-	364,970.26	364,970.26
其他负债	-	-	-	-	-	3,571,138.78	3,571,138.78
负债总计	-	-	-	-	-	16,616,788.36	16,616,788.36
利率敏感度缺	507,361,530.62	-	-	-	-	1,824,243,363.04	2,331,604,893.66

口							
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	417,864,208.43	-	-	-	-	-	417,864,208.43
结算备付金	3,290,585.56	-	-	-	-	-	3,290,585.56
存出保证金	541,290.99	-	-	-	-	-	541,290.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,706,783,704.50	2,706,783,704.50
应收利息	-	-	-	-	-	167,776.27	167,776.27
应收申购款	-	-	-	-	-	1,612,908.27	1,612,908.27
资产总计	421,696,084.98	-	-	-	-	2,708,564,389.04	3,130,260,474.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,834,302.11	4,834,302.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,266,352.94	3,266,352.94
应付托管费	-	-	-	-	-	544,392.15	544,392.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,132,838.55	2,132,838.55
其他负债	-	-	-	-	-	2,261,474.89	2,261,474.89
负债总计	-	-	-	-	-	13,039,360.64	13,039,360.64
利率敏感度缺口	421,696,084.98	-	-	-	-	2,695,525,028.40	3,117,221,113.38

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日

	基准利率点利率增加0.1%	-	0.00
	基准利率点利率减少0.1%	-	0.00

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	1,840,301,833.16	78.93	2,706,783,704.50	86.83
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	1,840,301,833.16	78.93	2,706,783,704.50	86.83

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 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%	83,319,665.50	155,351,246.60
	业绩比较基准下降5%	-83,319,665.50	-155,351,246.60

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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	1,840,301,833.16	2,706,517,593.27
第二层次	-	-
第三层次	-	266,111.23
合计	1,840,301,833.16	2,706,783,704.50

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

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,840,301,833.16	78.37
	其中：股票	1,840,301,833.16	78.37
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	506,795,180.12	21.58

8	其他各项资产	1,124,668.74	0.05
9	合计	2,348,221,682.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,290,500.00	0.36
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,442,778,425.90	61.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,042,000.00	0.82
F	批发和零售业	645.04	0.00
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	91,991,072.56	3.95
J	金融业	168,802,899.88	7.24
K	房地产业	12,824,800.00	0.55
L	租赁和商务服务业	17,928,736.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	59,823,274.70	2.57
N	水利、环境和公共设施管理业	7,560.96	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,807,703.08	0.81
R	文化、体育和娱乐业	4,215.04	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,840,301,833.16	78.93

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	79,000	161,555,000.00	6.93
2	000858	五粮液	440,046	88,858,488.78	3.81
3	002129	TCL中环	1,257,900	74,077,731.00	3.18
4	000568	泸州老窖	294,024	72,488,676.96	3.11
5	600600	青岛啤酒	690,000	71,704,800.00	3.08
6	000799	酒鬼酒	350,000	65,033,500.00	2.79
7	300316	晶盛机电	809,200	54,693,828.00	2.35
8	600809	山西汾酒	133,100	43,230,880.00	1.85
9	601318	中国平安	900,000	42,021,000.00	1.80
10	600690	海尔智家	1,527,400	41,942,404.00	1.80
11	002690	美亚光电	1,747,330	37,882,114.40	1.62
12	002142	宁波银行	1,036,820	37,128,524.20	1.59
13	600132	重庆啤酒	251,200	36,825,920.00	1.58
14	002594	比亚迪	106,200	35,416,638.00	1.52
15	603486	科沃斯	273,700	33,361,293.00	1.43
16	002475	立讯精密	978,300	33,056,757.00	1.42
17	000792	盐湖股份	1,102,100	33,018,916.00	1.42
18	601012	隆基绿能	462,000	30,783,060.00	1.32
19	688072	拓荆科技	182,456	28,298,925.60	1.21
20	002460	赣锋锂业	185,500	27,583,850.00	1.18
21	600456	宝钛股份	441,400	26,219,160.00	1.12
22	600036	招商银行	600,000	25,320,000.00	1.09
23	688536	思瑞浦	44,000	24,709,960.00	1.06
24	603833	欧派家居	160,000	24,108,800.00	1.03
25	601128	常熟银行	3,075,000	23,493,000.00	1.01
26	002179	中航光电	350,705	22,206,640.60	0.95
27	600315	上海家化	500,000	21,375,000.00	0.92
28	601939	建设银行	3,500,000	21,210,000.00	0.91
29	300015	爱尔眼科	419,978	18,802,415.06	0.81
30	300012	华测检测	759,989	17,639,344.69	0.76
31	601888	中国中免	75,000	17,469,750.00	0.75

32	300759	康龙化成	177,500	16,901,550.00	0.72
33	002049	紫光国微	88,900	16,866,108.00	0.72
34	688777	中控技术	225,000	16,371,000.00	0.70
35	603288	海天味业	180,742	16,331,847.12	0.70
36	603659	璞泰来	179,600	15,158,240.00	0.65
37	300347	泰格医药	130,000	14,878,500.00	0.64
38	600585	海螺水泥	410,000	14,464,800.00	0.62
39	000408	藏格矿业	437,300	14,404,662.00	0.62
40	688200	华峰测控	39,483	14,071,741.20	0.60
41	002466	天齐锂业	112,200	14,002,560.00	0.60
42	002245	蔚蓝锂芯	600,000	13,926,000.00	0.60
43	688232	新点软件	353,178	13,286,556.36	0.57
44	600406	国电南瑞	484,920	13,092,840.00	0.56
45	600703	三安光电	523,600	12,870,088.00	0.55
46	000002	万科A	625,600	12,824,800.00	0.55
47	600660	福耀玻璃	300,000	12,543,000.00	0.54
48	600893	航发动力	267,700	12,183,027.00	0.52
49	600309	万华化学	125,000	12,123,750.00	0.52
50	601398	工商银行	2,400,000	11,448,000.00	0.49
51	002028	思源电气	317,700	11,329,182.00	0.49
52	300850	新强联	126,800	11,289,004.00	0.48
53	601668	中国建筑	2,100,000	11,172,000.00	0.48
54	002938	鹏鼎控股	369,700	11,168,637.00	0.48
55	688012	中微公司	95,521	11,152,076.75	0.48
56	002371	北方华创	38,900	10,779,968.00	0.46
57	300633	开立医疗	350,000	10,510,500.00	0.45
58	002439	启明星辰	524,500	10,453,285.00	0.45
59	603259	药明康德	100,000	10,399,000.00	0.45
60	002484	江海股份	395,500	9,230,970.00	0.40
61	300760	迈瑞医疗	27,500	8,613,000.00	0.37
62	002714	牧原股份	150,000	8,290,500.00	0.36

63	002311	海大集团	137,500	8,251,375.00	0.35
64	600958	东方证券	801,408	8,182,375.68	0.35
65	603927	中科软	350,000	8,162,000.00	0.35
66	603517	绝味食品	140,200	8,106,364.00	0.35
67	601669	中国电建	1,000,000	7,870,000.00	0.34
68	300737	科顺股份	575,000	7,578,500.00	0.33
69	688037	芯源微	50,403	7,306,922.91	0.31
70	300750	宁德时代	13,000	6,942,000.00	0.30
71	603919	金徽酒	200,000	6,798,000.00	0.29
72	300604	长川科技	148,000	6,682,200.00	0.29
73	000333	美的集团	110,000	6,642,900.00	0.28
74	603899	晨光股份	112,500	6,309,000.00	0.27
75	000538	云南白药	92,000	5,555,880.00	0.24
76	603338	浙江鼎力	105,034	5,325,223.80	0.23
77	300630	普利制药	150,000	5,272,500.00	0.23
78	002832	比音勒芬	208,043	5,242,683.60	0.22
79	002335	科华数据	166,700	5,142,695.00	0.22
80	002139	拓邦股份	410,000	5,030,700.00	0.22
81	002705	新宝股份	225,000	4,947,750.00	0.21
82	002048	宁波华翔	290,000	4,645,800.00	0.20
83	300003	乐普医疗	250,000	4,642,500.00	0.20
84	002508	老板电器	122,500	4,413,675.00	0.19
85	600941	中国移动	61,300	3,708,650.00	0.16
86	688085	三友医疗	137,936	2,986,314.40	0.13
87	300595	欧普康视	50,000	2,859,500.00	0.12
88	300699	光威复材	37,500	2,207,625.00	0.09
89	688369	致远互联	48,920	2,206,781.20	0.09
90	300132	青松股份	280,098	1,960,686.00	0.08
91	002273	水晶光电	88,100	1,066,891.00	0.05
92	002027	分众传媒	68,200	458,986.00	0.02
93	301050	雷电微力	261	26,507.16	0.00

94	301090	华润材料	1,225	13,364.75	0.00
95	301089	拓新药业	97	12,185.14	0.00
96	301069	凯盛新材	249	11,481.39	0.00
97	688016	心脉医疗	45	8,766.45	0.00
98	301093	华兰股份	220	7,455.80	0.00
99	300994	久祺股份	173	5,676.13	0.00
100	301092	争光股份	178	5,599.88	0.00
101	301060	兰卫医学	151	5,288.02	0.00
102	301046	能辉科技	141	4,880.01	0.00
103	301052	果麦文化	128	4,215.04	0.00
104	300774	倍杰特	185	3,729.60	0.00
105	301072	中捷精工	95	3,042.85	0.00
106	300814	中富电路	165	3,019.50	0.00
107	301055	张小泉	156	2,773.68	0.00
108	301057	汇隆新材	107	2,605.45	0.00
109	301053	远信工业	95	2,219.20	0.00
110	301049	超越科技	92	2,181.32	0.00
111	301048	金鹰重工	191	2,102.91	0.00
112	301063	海锅股份	75	2,089.50	0.00
113	301036	双乐股份	92	2,068.16	0.00
114	301059	金三江	118	1,982.40	0.00
115	301083	百胜智能	130	1,814.80	0.00
116	300854	中兰环保	83	1,650.04	0.00
117	301079	邵阳液压	63	1,562.40	0.00
118	301068	大地海洋	63	1,521.45	0.00
119	688107	安路科技	10	687.00	0.00
120	301078	孩子王	44	645.04	0.00
121	301056	森赫股份	45	389.70	0.00
122	301062	上海艾录	24	280.08	0.00

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	601939	建设银行	60,812,259.00	1.95
2	002129	TCL中环	53,857,371.00	1.73
3	600600	青岛啤酒	51,074,068.00	1.64
4	600132	重庆啤酒	48,643,708.00	1.56
5	300316	晶盛机电	45,225,216.00	1.45
6	002142	宁波银行	35,857,376.34	1.15
7	603259	药明康德	34,018,599.60	1.09
8	601398	工商银行	32,177,677.00	1.03
9	000792	盐湖股份	32,078,988.00	1.03
10	300059	东方财富	31,640,415.43	1.02
11	002594	比亚迪	30,494,572.00	0.98
12	000651	格力电器	29,691,151.00	0.95
13	603338	浙江鼎力	28,237,914.00	0.91
14	600690	海尔智家	27,888,696.00	0.89
15	002475	立讯精密	27,856,071.00	0.89
16	603486	科沃斯	27,523,285.00	0.88
17	688232	新点软件	26,838,155.51	0.86
18	002460	赣锋锂业	25,737,549.00	0.83
19	601888	中国中免	25,203,809.28	0.81
20	688536	思瑞浦	25,153,168.89	0.81

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	002690	美亚光电	161,487,478.85	5.18

2	600872	中炬高新	85,367,502.93	2.74
3	603259	药明康德	83,122,116.36	2.67
4	603338	浙江鼎力	78,010,972.66	2.50
5	000860	顺鑫农业	72,347,491.77	2.32
6	600315	上海家化	64,721,136.00	2.08
7	002250	联化科技	60,826,148.98	1.95
8	688085	三友医疗	53,895,304.72	1.73
9	600009	上海机场	52,796,208.18	1.69
10	300724	捷佳伟创	50,169,176.25	1.61
11	601318	中国平安	43,613,562.79	1.40
12	002372	伟星新材	42,566,409.60	1.37
13	002245	蔚蓝锂芯	41,972,047.00	1.35
14	601128	常熟银行	39,942,851.63	1.28
15	601939	建设银行	38,870,062.00	1.25
16	000858	五粮液	38,234,833.00	1.23
17	300059	东方财富	37,629,283.88	1.21
18	002832	比音勒芬	36,078,050.00	1.16
19	002415	海康威视	33,850,735.00	1.09
20	002048	宁波华翔	32,312,043.00	1.04

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	1,792,545,660.50
卖出股票收入（成交）总额	2,252,405,595.07

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金持有的前十名证券发行主体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	566,350.50
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	558,318.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,124,668.74

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
29,985	31,965.23	81,615,698.99	8.52%	876,861,713.75	91.48%

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	266,059.57	0.03%

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	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年08月30日)基金份额总额	209,198,951.02
本报告期期初基金份额总额	1,111,854,964.54
本报告期基金总申购份额	9,485,577.28
减：本报告期基金总赎回份额	162,863,129.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	958,477,412.74

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2022年1月17日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，谢乐斌同志担任公司董事长，江伟同志不再担任公司董事长。

2022年3月12日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告》，谢乐斌同志担任公司董事和董事长，江伟同志不再担任公司董事和董事长职务。陶耿同志担任公司董事和副董事长；王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇同志担任公司董事，蒋忆明、喻健同志不再兼任公司董事职务。经过上述变更，公司现任董事会成员为谢乐斌、陶耿、王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇。

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

2022年4月8日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，吕巍同志担任公司合规总监、督察长，叶明同志不再担任公司合规总监。

本基金基金经理变动详见“4.1 基金管理人及基金经理情况”章节。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无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	2	4,043,468,149.89	100.00%	2,956,994.00	100.00%	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监	2022-01-19

	变更公告	会指定网站、公司官网	
3	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划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	国泰君安君得明混合型证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2022-03-11
6	国泰君安君得明混合型证券投资基金基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2022-03-11
7	国泰君安君得明混合型证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2022-03-11
8	国泰君安君得明混合型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2022-03-11
9	关于国泰君安君得明混合型集合资产管理计划变更注册为国泰君安君得明混合型证券投资基金的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-11
10	国泰君安君得明混合型证券投资基金基金合同和招募说明书提示性公告	上海证券报	2022-03-11
11	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
12	国泰君安君得明混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2022年第1号)	证监会指定网站、公司官网	2022-03-22
13	国泰君安君得明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	2022-03-22
14	国泰君安君得明混合型证券	上海证券报、证监会指定网	2022-03-22

	投资基金基金经理变更公告	站、公司官网	
15	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
16	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划2021年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-03-31
17	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金和集合计划年度报告提示性公告	上海证券报	2022-03-31
18	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
19	国泰君安君得明混合型证券投资基金2022年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-04-22
20	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
21	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

国泰君安君得明混合型集合资产管理计划于2022年3月14日起正式变更为国泰君安君得明混合型证券投资基金。

§ 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明混合型集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰君安君得明混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得明混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得明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
二〇二二年八月三十一日