

国泰君安君得盛债券型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

上海国泰君安证券资产管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月17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。

本报告期自2023年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
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	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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
8.6 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	63
8.7 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	63
8.8 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	63
8.9 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	63

8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
8.12 投资组合报告附注.....	64
§9 基金份额持有人信息.....	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
9.3 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.....	66
§10 开放式基金份额变动.....	67
§11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
11.2 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.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
11.4 基金投资策略的改变.....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
11.8 其他重大事件.....	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
12.1 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.....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§13 备查文件目录.....	72
13.1 备查文件目录.....	72
13.2 存放地点.....	72
13.3 查阅方式.....	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得盛债券型证券投资基金	
基金简称	国泰君安君得盛债券	
基金主代码	952024	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年09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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	109,201,368.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安君得盛债券 A	国泰君安君得盛债券 C
下属分级基金的交易代码	952024	015603
报告期末下属分级基金的份额总额	109,100,471.11份	100,897.32份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益品种，在承担合理风险和保持资产流动性的基础上，适度参与权益类资产投资，力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益，通过积极的权益类资产投资策略追求基金资产的增强型回报。 1、资产配置策略 本基金将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将基金资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。 本基金将在稳健的资产配置策略基础上，根据股票的运行状况和收益预期，在严格控制风险的基础上，

	积极并适时适度地参与权益类资产配置，把握市场时机力争为基金资产获取增强型回报。 2、固定收益品种投资策略 本基金将采取利率策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。 3、股票投资策略 本基金将密切关注国内外经济运行情况、国内财政政策和产业政策等政策取向，深入分析国民经济各行业的发展现状及政策影响，并结合行业景气分析，对具有良好发展前景特别是国家重点扶植的行业进行重点配置。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×100%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	朱萍
	联系电话	021-38676022	021-61618888
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		95521	95528
传真		021-38871190	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		谢乐斌	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022年		2021年		2020年	
	国泰君安君得盛债券A	国泰君安君得盛债券C	国泰君安君得盛债券A	国泰君安君得盛债券C	国泰君安君得盛债券A	国泰君安君得盛债券C
本期已实现收益	-10,844,425.02	-4,602.72	9,031,344.03	-	36,342,230.72	-
本期利润	-14,438,693.04	-6,854.64	13,015,679.88	-	25,057,347.16	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1139	-0.0496	0.0931	-	0.0282	-
本期加权平均净值利润率	-9.60%	-4.20%	7.92%	-	2.52%	-
本期基金份额净值增长率	-8.58%	-1.84%	9.33%	-	3.35%	-

3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末		2020年末	
期末可供分配利润	11,844,110.48	12,922.56	27,688,175.39	-	30,028,917.98	-
期末可供分配基金份额利润	0.1086	0.1281	0.1925	-	0.1203	-
期末基金资产净值	125,119,760.92	115,464.55	180,379,100.99	-	286,377,470.58	-
期末基金份额净值	1.1468	1.1444	1.2544	-	1.1474	-
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末		2020年末	
基金份额累计净值增长率	4.25%	-1.84%	14.04%	-	4.31%	-

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、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）。

4、国泰君安君得盛债券C类份额首次确认日为2022年5月13日。

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

国泰君安君得盛债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.98%	0.33%	-0.02%	0.08%	-0.96%	0.25%
过去六个月	-4.86%	0.31%	1.45%	0.07%	-6.31%	0.24%
过去一年	-8.58%	0.38%	3.31%	0.06%	-11.89%	0.32%
过去三年	3.30%	0.34%	11.80%	0.07%	-8.50%	0.27%
自基金合同生效起至今	4.25%	0.33%	13.26%	0.07%	-9.01%	0.26%

国泰君安君得盛债券C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-1.05%	0.33%	-0.02%	0.08%	-1.03%	0.25%
过去六个月	-5.01%	0.31%	1.45%	0.07%	-6.46%	0.24%
自基金合同 生效起至今	-1.84%	0.31%	1.79%	0.06%	-3.63%	0.25%

注：国泰君安君得盛债券C类份额首次确认日为2022年5月13日。

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

国泰君安君得盛债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

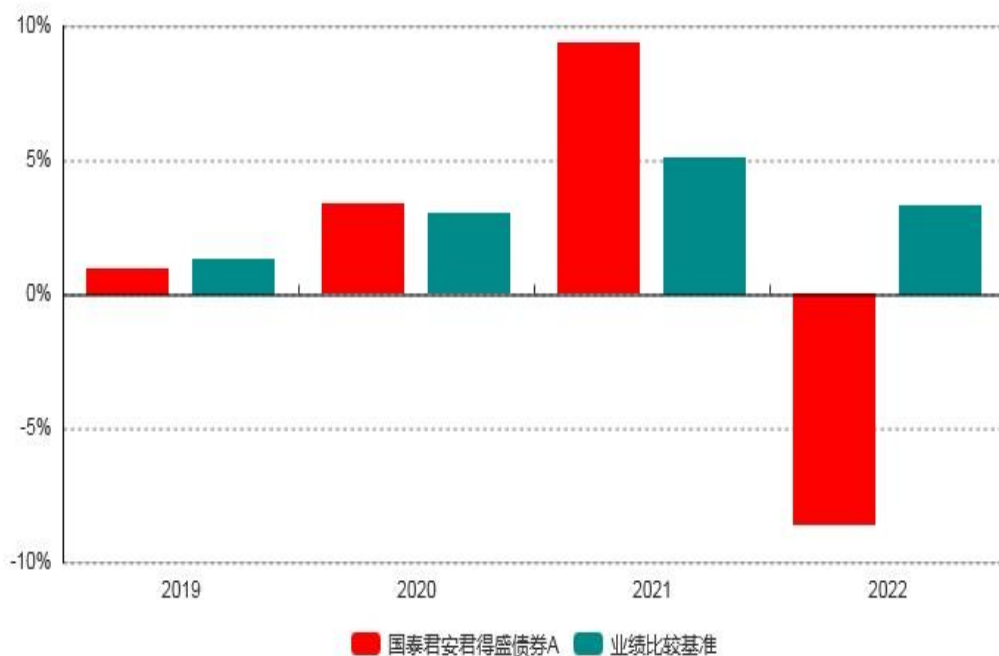
(2019年09月25日-2022年12月31日)



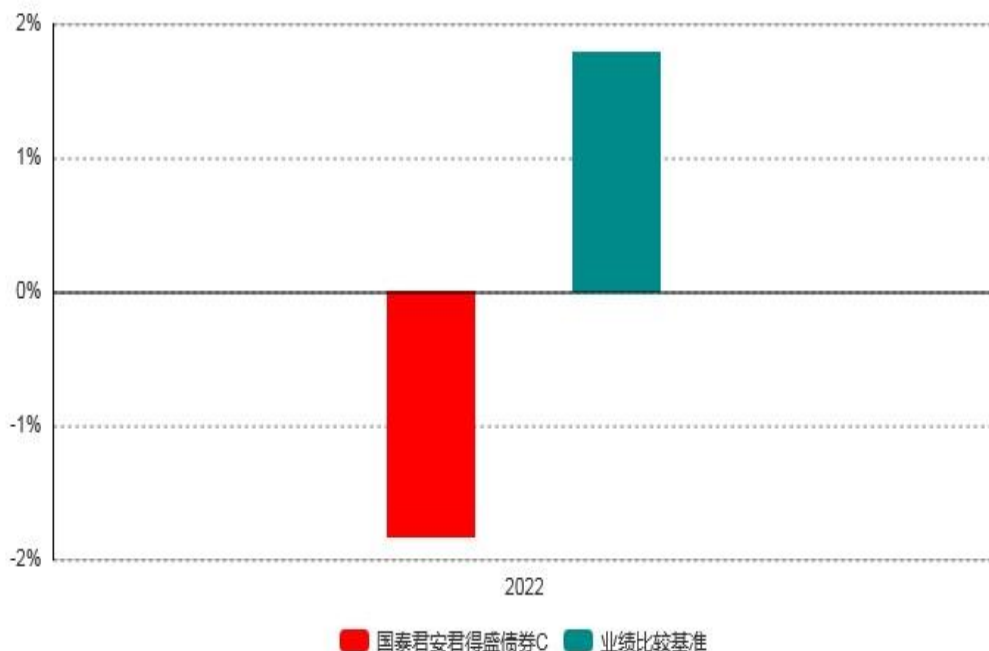


注：国泰君安君得盛债券C类份额首次确认日为2022年5月13日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2019年按实际存续期计算。



注：2022年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§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12月31日，本基金管理人共管理了30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、国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安君得盛债券型证券投资基金、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）、国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金、国泰君安稳债双利6个月持有期债券型发起式证券投资基金、国泰君安品质生活混合型发起式证券投资基金、国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰君安价值精选混合型发起式证券投资基金、国泰君安中证1000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、国泰君安临港创新智造产业园封闭式基础设施证券投资基金、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、国泰君安善元稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰君安善吾养老目标日期2045五年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金、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90天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨坤	本基金基金经理，国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理。现任固定收益投资部基金经理。	2021-04-13	-	10年	杨坤，英国华威大学金融硕士，约克大学金融数学硕士。12年债券从业经验。现任本公司基金经理、“固收+”投资组主管。曾就职于工银安盛人寿资产管理部、国泰君安证券研究所债券团队、平安养老固定收益部债券研究团队。
杜浩然	本基金的基金经理（已于2022年3月9日离任）	2020-09-28	2022-03-09	8年	杜浩然，复旦大学金融硕士，2014年7月入职上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任固定收益投资部助理研究员、投资经理；

					基金投资部基金经理；现任本公司固定收益投资部基金经理，主要负责固定收益类产品的投资研究工作。
周晨	本基金的基金经理（已于2022年3月9日离任）	2020-06-18	2022-03-09	11年	周晨，北京大学光华管理学院金融学硕士,拥有11年从业经验,历任本公司研究发展部研究员、高级研究员、资深研究员、本公司权益与衍生品部高级投资经理、公募权益投资部基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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年宏观经济延续了2021年4季度之后一路向下的态势，权益市场表现不佳，债券有阶段性机会但全年收益有限。1季度经济相对于2021年4季度环比有改善，主要来自于政府稳增长力度加强，基建前置，且配合相对宽松的货币环境，但构成了全年基本面的顶部。3月之后俄乌冲突和上海疫情为全年弱势埋下了伏笔，分别对应了美联储超预期加息和疫情扰动两大利空。2季度上海疫情之后基本面回落有一定缓和，6月出现了轻微补库存，基本对应了全年乐观情绪的高点。3季度开始基本面复苏被证伪，地产数据继续下滑，疫情有多点开花的趋势，且美联储加息预期被再次提升，构成了1季度的重复。4季度之后，随着重要会议的结束，以及疫情管控逐步放松，美联储加息开始收敛，避险情绪有一定平复。但从基本面来看，依然处于弱势回落中。回顾市场来看，权益方面，2022年基本构成了单边熊市，全年找不到持续表现的板块或线索：年初的基建投资，年中的新能源汽车持续时间都很短。但年尾开始的高端装备和数字经济或值得重视。债券方面，前三季度虽然受到大宗扰动和美联储加息的影响，但表现较为稳健。短端流动性非常充裕，虽然在2021年初债券重新进入牛市以后估值已经不具备优势，但短久期的中高等级信用债的利差却被不断压缩。4季度以后，市场对于基本面的预期上修，理财赎回等因素导致债券市场出现明显回调。但和前三季度形成镜像：中长期利率债下跌有限，短久期、低评级信用利差扩张相对明显。

本报告期内，产品规模受市场原因有一定收缩。期间仓位也出现了一定波动，我们在年初对于泛权益资产有一定减持，在4季度重新将仓位提升至较高水平。结构上来看，我们在上半年主要偏好消费、基建等传统蓝筹板块，一方面是年初顺应稳增长的预期，另一方面也有防御考虑。8月之后，我们的持仓逐步向成长转移，逐步提升医药、半导体设备、工业自动化、数字经济等持仓比例。对于新能源板块，我们逐步将持仓的白马品种向新技术、新需求转移，市值适度下沉。对于债券市场，我们在3季度减仓，目前

久期维持较低水平。回顾2022年，组合净值下跌较多，给客户带来了明显损失，深表抱歉。虽然君得盛从定位来看属于二级债基中偏弹性的产品，但毕竟还是偏债类产品，对于回撤控制是有要求的。反省来看，主要还是低估了2022年低迷的宏观环境，无论是新冠疫情带来的大面积封控，还是美国高启的通胀带来的超预期加息，都属于过去十多年未见的情况。本轮基本面下行的时间和深度也超出了过去几轮库存周期的经验范畴。在这个过程中，希望通过选股或分散来控制绝对的回撤基本是徒劳的。应该从自上而下的角度在基本面和市场走弱初期去控制仓位，赢得后续防守反击的主动点。

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盛债券A基金份额净值为1.1468元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.58%，同期业绩比较基准收益率为3.31%；截至报告期末国泰君安君得盛债券C基金份额净值为1.1444元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.84%，同期业绩比较基准收益率为1.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2023年，我们的判断相对简单，中国经济将开启新一轮向上库存周期，且持续1-2年。在这个过程的前半段市场风险偏好，微观主体的信心都将明显改善。但相对于历次复苏之年，本轮政府行为可能偏向于“温和疗法”，高质量发展，可持续增长是重要考虑点。从传统宏观角度来看，基建、地产、外需三因素全年能够提供的向上弹性可能并不大。类似的经济周期可以参考2014-2015年。因此，我们权益投资的基本思路是更偏向于成长，更偏向于新兴产业，重点包括数字经济，工业自动化。对于新能源产业，我们认为未来2年将面临竞争格局恶化和增速下滑的问题，但是行业的深度和广度已经足够大，且总体没有到达天花板。一些新技术、新模式将不断涌现，一些传统龙头可能会率先出清，同样有机会。对于传统行业，我们认为疫情后生活半径扩大带来的消费复苏是必然趋势，且还没有演绎充分。除传统的餐饮出行外，更看好医药、家电板块的机会。风险来看，外需的不确定以及国际形势变化都值得关注。美国通胀回落速度可能构成全年最大的超预期事件。债券市场来看，我们倾向于认为可能会重复2019年的状态，在经历2022年4季度调整会后，我们认为年内利率的高点相对于2022年有限，至少从上半年来看不具备明显风险，不排除年中之后有一波机会，可以采取逢高配置的策略逐步提升久期和仓位。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等

角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰君安君得盛债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国泰君安君得盛债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度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本托管人复核的本报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第61438993_B02号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安君得盛债券型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了国泰君安君得盛债券型证券投资基金的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的国泰君安君得盛债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国泰君安君得盛债券型证券投资基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国泰君安君得盛债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	国泰君安君得盛债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重

	大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估国泰君安君得盛债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督国泰君安君得盛债券型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出

	结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国泰君安君得盛债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安君得盛债券型证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	石静筠	陈雯
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2023-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得盛债券型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	9,164,784.88	10,461,668.08
结算备付金		723,549.30	559,693.32
存出保证金		-	17,292.24
交易性金融资产	7.4.7.2	136,260,266.19	202,107,169.71

其中：股票投资		24,295,550.00	33,492,104.64
基金投资		-	-
债券投资		111,964,716.19	168,615,065.07
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		618,127.93	1,390,481.70
应收股利		-	-
应收申购款		1,428.44	1,404,186.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.3	-	1,747,403.70
资产总计		146,768,156.74	217,687,895.66
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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		-	-
卖出回购金融资产款		21,303,183.30	36,749,032.37
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,516.00	40,985.47

应付管理人报酬		76,202.54	106,389.57
应付托管费		21,772.15	30,397.01
应付销售服务费		25.07	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,134.31	9,240.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.4	122,097.90	372,750.11
负债合计		21,532,931.27	37,308,794.67
净资产：			
实收基金	7.4.7.5	109,201,368.43	143,800,609.27
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.6	16,033,857.04	36,578,491.72
净资产合计		125,235,225.47	180,379,100.99
负债和净资产总计		146,768,156.74	217,687,895.66

注：1、报告截止日2022年12月31日，基金份额总额109,201,368.43份。其中：国泰君安君得盛债券A份额净值1.1468元，份额总额109,100,471.11份；国泰君安君得盛债券C份额净值1.1444元，份额总额100,897.32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。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安君得盛债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-12,290,179.95	15,959,165.69

1.利息收入		36,535.89	4,389,576.96
其中：存款利息收入	7.4.7.7	36,535.89	67,113.07
债券利息收入		-	4,311,908.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	10,555.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,774,471.36	7,365,839.02
其中：股票投资收益	7.4.7.8	-10,575,167.52	-2,973,288.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.9	1,450,704.01	9,935,203.53
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.10	349,992.15	403,923.77
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）	7.4.7.11	-3,596,519.94	3,984,335.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	44,275.46	219,413.86
减：二、营业总支出		2,155,367.73	2,943,485.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,057,334.33	1,154,938.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	302,095.58	329,982.39
3. 销售服务费		311.20	-
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		659,609.82	856,092.68
其中：卖出回购金融资产支出		659,609.82	856,092.68
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		5,967.83	18,630.17
8. 其他费用	7.4.7.13	130,048.97	583,842.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,445,547.68	13,015,679.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,445,547.68	13,015,679.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,445,547.68	13,015,679.88

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。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得盛债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年12月31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）	143,800,609.27	-	36,578,491.72	180,379,100.99
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）	143,800,609.27	-	36,578,491.72	180,379,100.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-34,599,240.84	-	-20,544,634.68	-55,143,875.52
（一）、综合收益总额	-	-	-14,445,547.68	-14,445,547.68
（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）	-34,599,240.84	-	-6,099,087.00	-40,698,327.84
其中：1.基金申购款	11,385,648.04	-	2,492,566.26	13,878,214.30
2.基金赎回款	-45,984,888.88	-	-8,591,653.26	-54,576,542.14
（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）	109,201,368.43	-	16,033,857.04	125,235,225.47
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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）	249,581,538.66	-	36,795,931.92	286,377,470.58
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）	249,581,538.66	-	36,795,931.92	286,377,470.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-105,780,929.39	-	-217,440.20	-105,998,369.59
（一）、综合收益总额	-	-	13,015,679.88	13,015,679.88
（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）	-105,780,929.39	-	-13,233,120.08	-119,014,049.47
其中：1.基金申购款	119,240,979.15	-	25,871,210.20	145,112,189.35
2.基金赎回款	-225,021,908.54	-	-39,104,330.28	-264,126,238.82
（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）	143,800,609.27	-	36,578,491.72	180,379,100.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰君安君得盛债券型证券投资基金(以下简称"本基金")由国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划由国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，于2012年1月30日经中国证监会证监许可[2012]127号文核准设立，自2012年5月7日起开始募集，于2012年6月7日结束募集工作，并于2012年6月13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，国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划变更为国泰君安君得盛债券型证券投资基金，即本基金，并相应修改《国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划管理合同》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盛债券型集合资产管理计划变更注册得批复》（证监许可[2021]3521号文）注册。

《国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金合同》自2021年12月7日起生效，原《国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

本基金为契约型开放式，基金存续期限为不定期。本基金的管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券、可交换债、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)。

本基金的投资组合比例为:债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,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。

本基金业绩比较基准为:中债综合指数收益率×100%。

7.4.2 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》、《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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金每一份额享有同等分配权；

(2) 期末可供分配收益为截至可供分配收益计算日，未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数；

(3) 本计划收益分配方式分为2种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入基金份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红；

(4) 选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利登记日的份额净值转成相应的份额。投资人在不同销售机构处可以选择不同的分红方式；

(5) 当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

- (6) 基金收益分配后，收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值，收益分配基准日即当期期末可供分配利润计算截止日；
- (7) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

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10,461,668.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币735.32 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10,462,403.40 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559,693.32元，自应收利息转入的重分类金额为人民币277.09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559,970.41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17,292.24元，自应收利息转入的重分类金额为人民币8.58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17,300.82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1,404,186.91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1,404,186.91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1,747,403.70元，转出至其他资产的重分类金额为人民币1,747,403.70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，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,747,403.70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1,747,403.70元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于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202,107,169.71元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.00元。经上述重分类后，交易性金融资产于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202,107,169.71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。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

基金目前比照证券投资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、增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，通知自2018年1月1日起施行。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2、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。

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[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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	9,164,784.88	10,461,668.08
等于：本金	9,164,116.93	10,461,668.08
加：应计利息	667.95	-
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	9,164,784.88	10,461,668.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		25,376,615.20	-	24,295,550.00	-1,081,065.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	30,266,378.10	235,374.07	30,211,631.25	-290,120.92
	银行间市场	80,552,096.43	1,213,084.94	81,753,084.94	-12,096.43
	合计	110,818,474.53	1,448,459.01	111,964,716.19	-302,217.35
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		136,195,089.73	1,448,459.01	136,260,266.19	-1,383,282.55
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		33,883,945.21	-	33,492,104.64	-391,840.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,681,341.64	-	27,584,065.07	1,902,723.43
	银行间市场	140,328,645.47	-	141,031,000.00	702,354.53
	合计	166,009,987.11	-	168,615,065.07	2,605,077.96
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	199,893,932.32	-	202,107,169.71	2,213,237.39

7.4.7.3 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	1,747,403.70
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,747,403.70

7.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	12.45	62.35
应付交易费用	22,785.45	39,149.39
其中：交易所市场	20,313.85	32,404.16
银行间市场	2,471.60	6,745.23
应付利息	-	24,238.37
预提费用	99,300.00	309,300.00
合计	122,097.90	372,750.11

7.4.7.5 实收基金

7.4.7.5.1 国泰君安君得盛债券A

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安君得盛债券A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	143,800,609.27	143,800,609.27
本期申购	10,933,817.82	10,933,817.82
本期赎回（以“-”号填列）	-45,633,955.98	-45,633,955.98
本期末	109,100,471.11	109,100,471.11

7.4.7.5.2 国泰君安君得盛债券C

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安君得盛债券C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	451,830.22	451,830.22
本期赎回（以“-”号填列）	-350,932.90	-350,932.90
本期末	100,897.32	100,897.32

注：1、申购含红利再投、转换入份额、赎回含转换出份额。

2、国泰君安君得盛债券C类份额首次确认日为2022年5月13日。

7.4.7.6 未分配利润

7.4.7.6.1 国泰君安君得盛债券A

单位：人民币元

项目 (国泰君安君得盛债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	27,688,175.39	8,890,316.33	36,578,491.72
本期利润	-10,844,425.02	-3,594,268.02	-14,438,693.04
本期基金份额交易产生的变动数	-4,999,639.89	-1,120,868.98	-6,120,508.87
其中：基金申购款	1,973,604.36	433,722.80	2,407,327.16
基金赎回款	-6,973,244.25	-1,554,591.78	-8,527,836.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,844,110.48	4,175,179.33	16,019,289.81

7.4.7.6.2 国泰君安君得盛债券C

单位：人民币元

项目 (国泰君安君得盛债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-4,602.72	-2,251.92	-6,854.64
本期基金份额交易产生的变动数	17,525.28	3,896.59	21,421.87
其中：基金申购款	71,192.25	14,046.85	85,239.10
基金赎回款	-53,666.97	-10,150.26	-63,817.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,922.56	1,644.67	14,567.23

7.4.7.7 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	19,320.48	41,689.16
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	17,215.41	25,423.91
其他	-	-
合计	36,535.89	67,113.07

7.4.7.8 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	80,950,825.65	111,732,504.07

减：卖出股票成本总额	91,311,762.65	114,705,792.35
减：交易费用	214,230.52	-
买卖股票差价收入	-10,575,167.52	-2,973,288.28

7.4.7.9 债券投资收益

7.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	3,489,386.85	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-2,038,682.84	9,935,203.53
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	1,450,704.01	9,935,203.53

7.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	197,656,262.61	360,255,933.46
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	197,492,984.89	343,568,565.12
减：应计利息总额	2,191,310.45	6,752,164.81
减：交易费用	10,650.11	-

买卖债券差价收入	-2,038,682.84	9,935,203.53
----------	---------------	--------------

7.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
股票投资产生的股利收益	349,992.15	403,923.77
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	349,992.15	403,923.77

7.4.7.11 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12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-3,596,519.94	3,984,335.85
——股票投资	-689,224.63	725,174.80
——债券投资	-2,907,295.31	3,259,161.05
——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	-3,596,519.94	3,984,335.85

7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	44,275.46	219,413.86
合计	44,275.46	219,413.86

7.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	60,000.00	120,000.00
汇划手续费	2,848.97	12,682.34
帐户维护费	37,200.00	37,200.00
交易费用	-	292,333.05
差价收入增值税抵减	-	81,626.69
合计	130,048.97	583,842.08

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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。

关联方名称	与本基金的关系
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
上海国泰君安证券资产管理有限公司	基金管理人
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)	基金托管人、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	163,755,258.29	100.00%	208,998,039.47	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券	156,488,159.06	100.00%	263,282,802.81	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2022年01月01日至2022年12月31日		2021年01月01日至2021年12月31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	2,298,700,000.00	100.00%	2,161,600,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 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12月31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	124,428.82	100.00%	20,313.85	100.00%
关联方名 称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	154,912.33	100.00%	32,404.16	100.00%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至202	上年度可比期间 2021年01月01日至202
----	-----------------------	----------------------------

	2年12月31日	1年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,057,334.33	1,154,938.49
其中：支付销售机构的客户维护费	491,077.05	536,400.13

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	302,095.58	329,982.39

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安君得盛债券A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年12月31日
报告期初持有的基金份额	7,750,968.99	7,750,968.99

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	7,750,968.99	7,750,968.99
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.10%	5.39%

国泰君安君得盛债券C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年12月31日
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%

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	9,164,784.88	19,320.48	10,461,668.08	41,689.16

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币9,705,895.21元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101800823	18广州地铁MT N004	2023-01-04	101.51	100,000	10,151,490.41
合计				100,000	10,151,490.41

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币11,597,288.09元，于2023年1月3日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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上海浦东发展银行股份有限公司，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	8,161,676.71	10,003,000.00
合计	8,161,676.71	10,003,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金持有的未评级债券包括国债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日

AAA	60,729,750.40	69,093,680.00
AAA以下	12,136,785.51	8,731,385.07
未评级	30,936,503.57	80,787,000.00
合计	103,803,039.48	158,612,065.07

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金持有的未评级债券包括政策性金融债、中期票据。

7.4.13.3 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2022年12月31日除卖出回购金融资产款余额中有21,303,183.30元将在一个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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公司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%。

本基金所持证券一部分在证券交易所交易，其余亦可在银行间市场交易，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7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 1 2 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	9,164,784.88	-	-	-	9,164,784.88
结算备付金	723,549.30	-	-	-	723,549.30
交易性金融资产	76,872,892.61	31,899,448.98	3,192,374.60	24,295,550.00	136,260,266.19
应收清算款	-	-	-	618,127.93	618,127.93
应收申购款	-	-	-	1,428.44	1,428.44
资产总计	86,761,226.79	31,899,448.98	3,192,374.60	24,915,106.37	146,768,156.74
负债					
卖出回购金融资产款	21,303,183.30	-	-	-	21,303,183.30
应付赎回款	-	-	-	5,516.00	5,516.00
应付管理人报酬	-	-	-	76,202.54	76,202.54
应付托管费	-	-	-	21,772.15	21,772.15
应付销售服务费	-	-	-	25.07	25.07
应交税费	-	-	-	4,134.31	4,134.31
其他负债	-	-	-	122,097.90	122,097.90
负债总计	21,303,183.30	-	-	229,747.97	21,532,931.27
利率敏感度缺口	65,458,043.49	31,899,448.98	3,192,374.60	24,685,358.40	125,235,225.47
上年度末 2021 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	10,461,668.08	-	-	-	10,461,668.08
结算备	559,693.32	-	-	-	559,693.32

付金					
存出保证金	17,292.24	-	-	-	17,292.24
交易性金融资产	24,454,560.00	135,160,055.07	9,000,450.00	33,492,104.64	202,107,169.71
应收证券清算款	-	-	-	1,390,481.70	1,390,481.70
其他资产	-	-	-	1,747,403.70	1,747,403.70
应收申购款	-	-	-	1,404,186.91	1,404,186.91
资产总计	35,493,213.64	135,160,055.07	9,000,450.00	38,034,176.95	217,687,895.66
负债					
卖出回购金融资产款	36,749,032.37	-	-	-	36,749,032.37
应付赎回款	-	-	-	40,985.47	40,985.47
应付管理人报酬	-	-	-	106,389.57	106,389.57
应付托管费	-	-	-	30,397.01	30,397.01
应交税费	-	-	-	9,240.14	9,240.14
其他负债	-	-	-	372,750.11	372,750.11
负债总计	36,749,032.37	-	-	559,762.30	37,308,794.67
利率敏感度缺口	-1,255,818.73	135,160,055.07	9,000,450.00	37,474,414.65	180,379,100.99

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	影响生息资产公允价值其他变量不变，仅利率发生变动；利率变动范围合理。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)

		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	基准利率点利率增加0.1%	-139,795.97	-410,259.18
	基准利率点利率减少0.1%	139,907.94	410,427.79

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。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债券，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	24,295,550.00	19.40	33,492,104.64	18.57
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	24,295,550.00	19.40	33,492,104.64	18.57

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2022年12月31日本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为19.40%（2021年12月31日：18.57%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	46,345,504.54	61,076,169.71
第二层次	89,914,761.65	141,031,000.00
第三层次	-	-
合计	136,260,266.19	202,107,169.71

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行业务情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

7.4.15 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。

本财务报表已于2023年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	24,295,550.00	16.55
	其中：股票	24,295,550.00	16.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	111,964,716.19	76.29
	其中：债券	111,964,716.19	76.29
	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	9,888,334.18	6.74

8	其他各项资产	619,556.37	0.42
9	合计	146,768,156.74	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	552,400.00	0.44
C	制造业	19,201,190.00	15.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	270,300.00	0.22
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	1,965,750.00	1.57
J	金融业	582,000.00	0.46
K	房地产业	453,900.00	0.36
L	租赁和商务服务业	432,060.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	837,950.00	0.67
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	24,295,550.00	19.40

8.3 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	300059	东方财富	30,000	582,000.00	0.46
2	600887	伊利股份	18,000	558,000.00	0.45
3	002508	老板电器	20,000	555,200.00	0.44
4	601088	中国神华	20,000	552,400.00	0.44
5	600060	海信视像	40,000	541,600.00	0.43
6	600600	青岛啤酒	5,000	537,500.00	0.43
7	000921	海信家电	40,000	526,800.00	0.42
8	600519	贵州茅台	300	518,100.00	0.41
9	300750	宁德时代	1,300	511,446.00	0.41
10	002859	洁美科技	18,000	508,140.00	0.41
11	000568	泸州老窖	2,200	493,416.00	0.39
12	600690	海尔智家	20,000	489,200.00	0.39
13	600048	保利发展	30,000	453,900.00	0.36
14	300012	华测检测	20,000	446,000.00	0.36
15	603105	芯能科技	30,000	441,900.00	0.35
16	688008	澜起科技	7,000	438,200.00	0.35
17	601888	中国中免	2,000	432,060.00	0.34
18	000733	振华科技	3,700	422,651.00	0.34
19	002597	金禾实业	13,000	422,500.00	0.34
20	002960	青鸟消防	15,000	419,850.00	0.34
21	300760	迈瑞医疗	1,300	410,761.00	0.33
22	002179	中航光电	7,000	404,320.00	0.32
23	002929	润建股份	10,000	392,600.00	0.31
24	300416	苏试试验	13,000	391,950.00	0.31
25	600285	羚锐制药	30,000	391,200.00	0.31
26	600875	东方电气	18,000	378,360.00	0.30
27	300496	中科创达	3,700	371,110.00	0.30
28	002384	东山精密	15,000	370,950.00	0.30
29	688033	天宜上佳	17,000	370,090.00	0.30
30	002049	紫光国微	2,800	369,096.00	0.29
31	600872	中炬高新	10,000	368,700.00	0.29

32	601677	明泰铝业	20,000	362,800.00	0.29
33	002555	三七互娱	20,000	362,000.00	0.29
34	000887	中鼎股份	25,000	361,750.00	0.29
35	002273	水晶光电	30,000	353,700.00	0.28
36	002709	天赐材料	8,000	350,880.00	0.28
37	002557	洽洽食品	7,000	350,000.00	0.28
38	600166	福田汽车	120,000	337,200.00	0.27
39	000661	长春高新	2,000	332,900.00	0.27
40	601238	广汽集团	30,000	330,900.00	0.26
41	300682	朗新科技	15,000	329,700.00	0.26
42	600460	士兰微	10,000	327,900.00	0.26
43	301266	宇邦新材	4,300	325,080.00	0.26
44	603345	安井食品	2,000	323,760.00	0.26
45	002466	天齐锂业	4,000	315,960.00	0.25
46	002832	比音勒芬	12,000	307,320.00	0.25
47	688596	正帆科技	9,000	305,550.00	0.24
48	603690	至纯科技	8,000	302,720.00	0.24
49	002531	天顺风能	20,000	302,600.00	0.24
50	600522	中天科技	18,000	290,700.00	0.23
51	688700	东威科技	2,000	286,300.00	0.23
52	688232	新点软件	5,000	285,300.00	0.23
53	002140	东华科技	30,000	270,300.00	0.22
54	603085	天成自控	25,000	266,000.00	0.21
55	601882	海天精工	10,000	262,000.00	0.21
56	688599	天合光能	4,000	255,040.00	0.20
57	300394	天孚通信	10,000	253,500.00	0.20
58	688059	华锐精密	1,500	241,500.00	0.19
59	601369	陕鼓动力	21,000	240,660.00	0.19
60	605020	永和股份	6,000	235,680.00	0.19
61	300351	永贵电器	15,000	232,050.00	0.19
62	600276	恒瑞医药	6,000	231,180.00	0.18

63	300217	东方电热	40,000	226,800.00	0.18
64	002368	太极股份	8,000	225,040.00	0.18
65	002223	鱼跃医疗	7,000	223,020.00	0.18
66	600566	济川药业	8,000	217,760.00	0.17

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000002	万科A	1,542,539.00	0.86
2	688599	天合光能	1,508,230.43	0.84
3	002472	双环传动	1,471,032.00	0.82
4	601677	明泰铝业	1,399,881.00	0.78
5	000739	普洛药业	1,373,083.00	0.76
6	002459	晶澳科技	1,248,848.00	0.69
7	002271	东方雨虹	1,224,719.00	0.68
8	600522	中天科技	1,217,559.00	0.68
9	601800	中国交建	1,119,313.00	0.62
10	600460	士兰微	1,108,665.00	0.61
11	002531	天顺风能	1,103,483.00	0.61
12	000887	中鼎股份	1,079,486.00	0.60
13	002463	沪电股份	1,041,052.00	0.58
14	603899	晨光股份	1,034,507.00	0.57
15	300682	朗新科技	996,155.00	0.55
16	002245	蔚蓝锂芯	907,133.00	0.50
17	000921	海信家电	881,488.00	0.49
18	000333	美的集团	843,309.00	0.47
19	601117	中国化学	838,400.00	0.46
20	601888	中国中免	829,043.00	0.46

8.4.2 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	002472	双环传动	2,079,893.03	1.15
2	601677	明泰铝业	1,672,418.00	0.93
3	002271	东方雨虹	1,631,179.00	0.90
4	000887	中鼎股份	1,381,246.00	0.77
5	000002	万科A	1,371,185.00	0.76
6	300682	朗新科技	1,217,614.00	0.68
7	002459	晶澳科技	1,179,346.00	0.65
8	600036	招商银行	1,173,561.00	0.65
9	688599	天合光能	1,161,888.70	0.64
10	000739	普洛药业	1,160,080.00	0.64
11	300207	欣旺达	1,159,126.45	0.64
12	600486	扬农化工	1,084,589.00	0.60
13	601800	中国交建	1,076,630.00	0.60
14	688005	容百科技	1,073,994.65	0.60
15	002003	伟星股份	1,032,392.40	0.57
16	002463	沪电股份	987,050.00	0.55
17	688232	新点软件	959,424.27	0.53
18	603899	晨光股份	959,356.00	0.53
19	002756	永兴材料	949,410.00	0.53
20	002690	美亚光电	894,842.00	0.50

8.4.3 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	82,804,432.64
卖出股票收入（成交）总额	80,950,825.65

8.5 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	8,161,676.71	6.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,719,775.35	16.54
	其中：政策性金融债	20,719,775.35	16.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,033,309.59	48.73
7	可转债(可交换债)	22,049,954.54	17.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	111,964,716.19	89.40

8.6 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	200203	20国开03	100,000	10,465,035.62	8.36
2	210207	21国开07	100,000	10,254,739.73	8.19
3	102000326	20南电MTN006	100,000	10,246,093.15	8.18
4	102100967	21电网MTN003	100,000	10,216,728.22	8.16
5	102000621	20中油股MTN001	100,000	10,172,619.73	8.12

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金持有的前十名证券发行主体国家开发银行，在报告编制日前一年曾被中国银保监会处以罚款的行政处罚。

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

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

8.12.2 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。

8.12.3 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	-
2	应收清算款	618,127.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,428.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	619,556.37

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	1,852,095.51	1.48
2	110079	杭银转债	1,743,070.89	1.39
3	113024	核建转债	1,735,096.44	1.39
4	127016	鲁泰转债	1,687,535.21	1.35
5	110053	苏银转债	1,608,360.53	1.28
6	113046	金田转债	1,554,319.93	1.24
7	127012	招路转债	1,344,020.71	1.07
8	132018	G三峡EB1	1,195,061.42	0.95
9	127032	苏行转债	1,189,504.52	0.95
10	127058	科伦转债	1,113,004.79	0.89
11	113641	华友转债	1,106,783.29	0.88
12	113044	大秦转债	1,098,054.52	0.88
13	123108	乐普转2	1,058,747.05	0.85
14	113622	杭叉转债	876,408.63	0.70
15	110045	海澜转债	656,568.49	0.52
16	110081	闻泰转债	646,324.93	0.52
17	110077	洪城转债	612,411.16	0.49
18	110085	通22转债	595,951.64	0.48

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
国泰君安君得盛债券A	7,351	14,841.58	8,451,835.63	7.75%	100,648,635.48	92.25%
国泰君安君得盛债券C	19	5,310.39	0.00	0.00%	100,897.32	100.00%
合计	7,370	14,817.01	8,451,835.63	7.74%	100,749,532.80	92.26%

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

9.2 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	国泰君安君得盛债券A	260,667.75	0.24%
	国泰君安君得盛债券C	8.58	0.01%
	合计	260,676.33	0.24%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区
----	------	--------------

		间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安君得盛债券A	0~10
	国泰君安君得盛债券C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安君得盛债券A	0
	国泰君安君得盛债券C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安君得盛债券A	国泰君安君得盛债券C
基金合同生效日(2019年09月25日)基金份额总额	82,827,927.78	-
本报告期期初基金份额总额	143,800,609.27	-
本报告期基金总申购份额	10,933,817.82	451,830.22
减：本报告期基金总赎回份额	45,633,955.98	350,932.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	109,100,471.11	100,897.32

注：国泰君安君得盛债券C类份额首次确认日为2022年5月13日。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

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

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

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

2、本报告期内，经上海浦东发展银行股份有限公司决定，总行资产托管部原总经理孔建同志自2022年11月7日起不再担任资产托管部总经理职务，由李国光同志担任部门负责人。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未有改变。

11.5 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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	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	

	数量					
国泰君安	2	163,755,258.29	100.00%	124,428.82	100.00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	156,488,159.06	100.00%	2,298,700.000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-01-19
3	国泰君安君得盛债券型证券投资基金2021年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-01-24
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	证券时报	2022-01-24
5	国泰君安君得盛债券型证券投资基金产品资料概要（更新）	证监会指定网站、公司官网	2022-03-09
6	国泰君安君得盛债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年第1号）	证监会指定网站、公司官网	2022-03-09

7	国泰君安君得盛债券型证券投资基金2022年经理变更公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-09
8	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
9	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
10	国泰君安君得盛债券型证券投资基金2021年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-03-31
11	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金和集合计划年度报告提示性公告	证券时报	2022-03-31
12	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
13	国泰君安君得盛债券型证券投资基金2022年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-04-22
14	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金季度报告提示性公告	证券时报	2022-04-22
15	国泰君安君得盛债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2022年第2号)	证监会指定网站、公司官网	2022-04-29
16	国泰君安君得盛债券型证券投资基金(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	2022-04-29
17	国泰君安君得盛债券型证券投资基金(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	2022-04-29

18	国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2022-04-29
19	国泰君安君得盛债券型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2022-04-29
20	关于国泰君安君得盛债券型证券投资基金增加C类份额并修改法律文件的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2022-04-29
21	国泰君安君得盛债券型证券投资基金2022年第二季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-07-21
22	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金季度报告提示性公告	证券时报	2022-07-21
23	国泰君安君得盛债券型证券投资基金2022年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2022-08-31
24	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金2022年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2022-08-31
25	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宝证券开展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	2022-09-28
26	国泰君安君得盛债券型证券投资基金2022年第三季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-10-26
27	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金2022年3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	2022-10-26
28	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下产品开展直销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	2022-11-02
29	国泰君安君得盛债券型证券	证监会指定网站、公司官网	2022-12-06

	投资基金招募说明书(更新) (2022年第3号)		
30	国泰君安君得盛债券型证券投资基金(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	2022-12-06
31	国泰君安君得盛债券型证券投资基金(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	2022-12-06

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得盛债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得盛债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网网站<http://www.gtjazg.com>。

13.3 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

二〇二三年三月三十一日