

# 国泰君安君得明混合型证券投资基金

## 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人光大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主要财务指标、净值表现、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2022年1月1日起至2022年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	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
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	62
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	62
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	62
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	63

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
8.12 投资组合报告附注.....	63
§9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§10 开放式基金份额变动.....	64
§11 重大事件揭示.....	65
11.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
11.4 基金投资策略的改变.....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
11.8 其他重大事件.....	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§13 备查文件目录.....	69
13.1 备查文件目录.....	69
13.2 存放地点.....	69
13.3 查阅方式.....	69

## §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	843,760,727.70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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtjzq.com
基金年度报告备置地点	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
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
本期已实现收益	-649,542,478.72	1,197,701,488.94	1,290,283,185.13
本期利润	-656,308,381.94	151,146,637.62	1,979,825,134.41
加权平均基金份额本期利润	-0.6902	0.0936	0.6263
本期加权平均净值利润率	-29.85%	3.32%	28.42%
本期基金份额净值增长率	-22.87%	1.78%	39.17%
3.1.2 期末数据和指	2022年末	2021年末	2020年末

标			
期末可供分配利润	980,849,433.25	2,005,366,148.84	3,054,987,625.10
期末可供分配基金份额利润	1.1625	1.8036	1.2955
期末基金资产净值	1,824,610,160.95	3,117,221,113.38	6,495,794,836.93
期末基金份额净值	2.1625	2.8036	2.7546
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022年末	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	17.12%	51.84%	49.19%

注：1、上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。

### 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
过去三个月	-2.29%	1.20%	1.33%	0.90%	-3.62%	0.30%
过去六个月	-11.10%	1.03%	-9.24%	0.77%	-1.86%	0.26%
过去一年	-22.87%	1.20%	-14.56%	0.90%	-8.31%	0.30%
过去三年	9.26%	1.21%	-0.84%	0.91%	10.10%	0.30%
自基金合同生效起至今	17.12%	1.17%	4.91%	0.88%	12.21%	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



### 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## §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发起式基金中基金（FOF）、国泰君安善吾养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（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	说明
		任职	离任		

		日期	日期	年限	
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。
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。现任公募权益投资部基金经理。	2022-03-22	-	14年	李子波，英国拉夫堡大学金融专业硕士，14年证券从业经验，具备基金从业资格。现任本公司公募权益投资部基金经理，历任全球研究院医药行业研究员、高级研究员。2008年02月至2010年12月，任职于泰信基金管理有限公司，历任助理行业研究员、行业研究员。
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。现任公募权益投资部基金经理。	2022-03-22	-	9年	陈思靖，上海交通大学金融专业硕士，9年证券从业经验，具备基金从业资格。现任本公司公募权益投资部基金经理。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。
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

因国内疫情防控政策较严，Q2上海封控等因素影响，2022年全年经济增长回落，股市表现欠佳。同时海外进入加息周期，资金成本不断攀升，股价也相应下挫。人民币汇率低迷，外资流出为主。2022年沪深300指数下跌21.63%，回顾全年，表现较好的板块为社会服务、煤炭、商贸零售等，而竣工、电子、计算机等板块下跌幅度较大。

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2.1625元，本报告期内，基金份额净值增长率为-22.87%，同期业绩比较基准收益率为-14.56%。

## 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2023年，我们认为中国经济有望迎来复苏，在政策面、资金面相对宽松的环境下，市场有望迎来反弹。我们长期依然看好科技主导的国内行业崛起，包括TMT、医药和先进制造等，消费复苏也是贯穿全年的主线之一，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集合计划资产，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §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_B01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	国泰君安君得明混合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明混合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明混合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明混合型证券投资基金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明混合型证券投资基金，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	-
其他事项	-
其他信息	国泰君安君得明混合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

	<p>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明混合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明混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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，就可能对国泰君安君得利短债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</p>

	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利短债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：国泰君安君得明混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	306,791,664.99	417,864,208.43
结算备付金		1,305,394.42	3,290,585.56
存出保证金		335,608.37	541,290.99
交易性金融资产	7.4.7.2	1,522,279,859.99	2,706,783,704.50
其中：股票投资		1,522,279,859.99	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		54,541.40	1,612,908.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	167,776.27
资产总计		1,830,767,069.17	3,130,260,474.02
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,007,343.77	4,834,302.11
应付管理人报酬		1,886,302.22	3,266,352.94
应付托管费		314,383.68	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	7.4.7.6	2,948,878.55	4,394,313.44
负债合计		6,156,908.22	13,039,360.64
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	843,760,727.70	1,111,854,964.54
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	980,849,433.25	2,005,366,148.84
净资产合计		1,824,610,160.95	3,117,221,113.38
负债和净资产总计		1,830,767,069.17	3,130,260,474.02

注：1. 报告截止日2022年12月31日，基金份额净值2.1625元，基金份额总额843,760,727.70份。本财务报表的上年度编制期间为2021年1月1日至2021年12月31日。

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：国泰君安君得明混合型证券投资基金

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		-625,174,272.67	274,366,247.94
1.利息收入		4,436,345.16	7,826,813.87
其中：存款利息收入	7.4.7.9	4,436,345.16	7,826,813.87
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)		-623,224,684.77	1,304,750,690.40
其中: 股票投资收益	7.4.7.10	-647,143,771.73	1,252,389,544.63
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收 益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	23,919,086.96	52,361,145.77
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)	7.4.7.17	-6,765,903.22	-1,046,554,851.32
4.汇兑收益(损失以“-”号填 列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	7.4.7.18	379,970.16	8,343,594.99
<b>减: 二、营业总支出</b>		31,134,109.27	123,219,610.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	26,514,801.91	54,801,445.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,419,133.52	9,133,574.25
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	7.4.7.19	170,000.00	59,284,590.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-656,308,381.94	151,146,637.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-656,308,381.94	151,146,637.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-656,308,381.94	151,146,637.62

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：国泰君安君得明混合型证券投资基金

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）	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）	1,111,854,964.54	-	2,005,366,148.84	3,117,221,113.38
三、本期增减变	-268,094,236.84	-	-1,024,516,715.	-1,292,610,952.

动额(减少以“-”号填列)			59	43
(一)、综合收益总额	-	-	-656,308,381.94	-656,308,381.94
(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)	-268,094,236.84	-	-368,208,333.65	-636,302,570.49
其中: 1.基金申购款	15,164,177.14	-	20,259,877.01	35,424,054.15
2.基金赎回款	-283,258,413.98	-	-388,468,210.66	-671,726,624.64
(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)	843,760,727.70	-	980,849,433.25	1,824,610,160.95
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)	2,358,172,788.18	-	4,137,622,048.75	6,495,794,836.93
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）	2,358,172,788.18	-	4,137,622,048.75	6,495,794,836.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,246,317,823.64	-	-2,132,255,899.91	-3,378,573,723.55
（一）、综合收益总额	-	-	151,146,637.62	151,146,637.62
（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）	-1,246,317,823.64	-	-2,283,402,537.53	-3,529,720,361.17
其中：1.基金申购款	395,725,770.00	-	722,241,599.38	1,117,967,369.38
2.基金赎回款	-1,642,043,593.64	-	-3,005,644,136.91	-4,647,687,730.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,111,854,964.54	-	2,005,366,148.84	3,117,221,113.38

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

国泰君安君得明混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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： $70% * \text{沪深300指数收益率} + 30% * \text{中债综合指数收益率}$

#### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《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>》及其他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2022年度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

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。

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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

##### 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。

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。

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费用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) 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。

## 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。此外，本基金亦已执行财政部于2022年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14号）。

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”项目中，不单独列示“应收利息”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。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。

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：

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 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。

##### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。

#### 7.4.6.5 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。

### 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	306,791,664.99	417,864,208.43
等于：本金	306,727,489.43	417,864,208.43
加：应计利息	64,175.56	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以 内	-	-
存款期限1-3个 月	-	-
存款期限3个月 以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	306,791,664.99	417,864,208.43

#### 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	1,567,257,716.68	-	1,522,279,859.99	-44,977,856.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债   交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,567,257,716.68	-	1,522,279,859.99	-44,977,856.69
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		2,744,995,657.97	-	2,706,783,704.50	-38,211,953.47
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		2,744,995,657.97	-	2,706,783,704.50	-38,211,953.47

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 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	-	167,776.27
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	167,776.27

无。

#### 7.4.7.6 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	2,204.85	8,393.97
应付交易费用	563,592.78	2,132,838.55
其中：交易所市场	563,592.78	2,132,838.55
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	290,000.00	160,000.00
其他应付	2,093,080.92	2,093,080.92
合计	2,948,878.55	4,394,313.44

#### 7.4.7.7 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12月31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	15,164,177.14	15,164,177.14
本期赎回（以“-”号填列）	-283,258,413.98	-283,258,413.98
本期末	843,760,727.70	843,760,727.70

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

#### 7.4.7.8 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	-649,542,478.72	-6,765,903.22	-656,308,381.94
本期基金份额交易产生的变动数	-419,975,823.63	51,767,489.98	-368,208,333.65
其中：基金申购款	23,672,320.33	-3,412,443.32	20,259,877.01
基金赎回款	-443,648,143.96	55,179,933.30	-388,468,210.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,071,511,429.68	-90,661,996.43	980,849,433.25

#### 7.4.7.9 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 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	4,392,082.71	7,756,391.84
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	35,992.53	58,138.77
其他	8,269.92	12,283.26
合计	4,436,345.16	7,826,813.87

#### 7.4.7.10 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 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	3,180,612,006.00	7,791,227,919.94
减：卖出股票成本总额	3,819,827,486.15	6,538,838,375.31
减：交易费用	7,928,291.58	-
买卖股票差价收入	-647,143,771.73	1,252,389,544.63

#### 7.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

无。

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 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	23,919,086.96	52,361,145.77
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	23,919,086.96	52,361,145.77
----	---------------	---------------

#### 7.4.7.17 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	-6,765,903.22	-1,080,557,582.49
——股票投资	-6,765,903.22	-1,080,557,582.49
——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	-	-34,002,731.17
合计	-6,765,903.22	-1,046,554,851.32

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 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	379,970.16	8,343,594.99
合计	379,970.16	8,343,594.99

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年01月01日至2022年 12月31日	2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
交易费用	-	18,106,923.20
差价收入增值税抵减	-	36,622,917.23
税金及附加	-	4,394,750.08
合计	170,000.00	59,284,590.51

#### 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
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、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	成交金额	占当期 股票成

		交总额 的比例		交总额 的比例
国泰君安 证券	5,820,966,996.45	100.00%	12,526,946,154.06	100.00%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年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	4,256,871.35	100.00%	563,592.78	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	9,160,982.35	100.00%	2,132,838.55	100.00%

证券				
----	--	--	--	--

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

#### 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管理费	26,514,801.91	54,801,445.56
其中：支付销售机构的客户维护费	12,269,294.76	25,821,646.55

注：基金管理人报酬按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬逐日累计至每月月底，按月支付。

##### 7.4.10.2.2 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	4,419,133.52	9,133,574.25

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

$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$

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

基金托管费逐日累计至每月月底，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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	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
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	22,244,420.99	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	22,244,420.99
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	2.00%

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31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
国泰君安证券股份有限公司	30,000,000.00	3.56%	50,000,000.00	4.50%

##### 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		上年度可比期间	
	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	
	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	306,791,664.99	4,392,082.71	417,864,208.43	7,756,391.84

有限公司				
------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022-12-26	重大资产重组	46.41	2023-01-10	51.05	346,900	15,056,513.63	16,099,629.00	-
300850	新强联	2022-12-30	重大资产	53.28	2023-01-10	56.88	126,800	11,010,481.42	6,755,904.00	-

			重 组							
--	--	--	--------	--	--	--	--	--	--	--

### 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，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

### 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中国光大银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2022年12月31日，本基金未持有信用类债券(2021年12月31日：本基金未持有信用类债券)。

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

#### 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发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和结算备付金等。

##### 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	306,791,664.99	-	-	-	306,791,664.99
结算备付金	1,305,394.42	-	-	-	1,305,394.42
存出保证金	335,608.37	-	-	-	335,608.37
交易性金融资产	-	-	-	1,522,279,859.99	1,522,279,859.99
应收申购款	-	-	-	54,541.40	54,541.40
资产总	308,432,667.78	-	-	1,522,334,401.39	1,830,767,069.17

计					
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,007,343.77	1,007,343.77
应付管理人报酬	-	-	-	1,886,302.22	1,886,302.22
应付托管费	-	-	-	314,383.68	314,383.68
其他负债	-	-	-	2,948,878.55	2,948,878.55
负债总计	-	-	-	6,156,908.22	6,156,908.22
利率敏感度缺口	308,432,667.78	-	-	1,516,177,493.17	1,824,610,160.95
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	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
其他资产	-	-	-	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

其他负债	-	-	-	4,394,313.44	4,394,313.44
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例0.00%(2021年12月31日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021年12月31日：同)

#### 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。

##### 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	1,522,279,859.99	83.43	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	1,522,279,859.99	83.43	2,706,783,704.50	86.83

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注7.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	110,948,096.06	155,351,246.60
	业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-110,948,096.06	-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。

#### 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	1,499,424,326.99	2,706,517,593.27
第二层次	22,855,533.00	-
第三层次	-	266,111.23
合计	1,522,279,859.99	2,706,783,704.50

##### 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。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	266,111.23	266,111.23
当期购买	-	0.00	0.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	122,747.05	122,747.05

当期利得或损失总额	-	-143,364.18	-143,364.18
其中：计入损益的利得或损失	-	-143,364.18	-143,364.18
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	0.00	0.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	0.00	0.00
项目	上年度可比同期		
	2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,415,860.46	1,415,860.46
当期购买	-	272,230.92	272,230.92
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	608,636.95	608,636.95
当期利得或损失总额	-	-813,343.20	-813,343.20
其中：计入损益的利得或损失	-	-813,343.20	-813,343.20
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	266,111.23	266,111.23
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	143,364.18	143,364.18

注: 本基金本期末未持有第三层次的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位: 人民币元

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	266,111.23	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	10%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债, 其因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

##### (2) 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。

##### (3) 财务报表的批准

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	1,522,279,859.99	83.15
	其中：股票	1,522,279,859.99	83.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	308,097,059.41	16.83
8	其他各项资产	390,149.77	0.02
9	合计	1,830,767,069.17	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	-	-
C	制造业	1,219,492,301.95	66.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,943,000.00	0.82
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,192,218.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	135,943,217.85	7.45
J	金融业	40,571,337.52	2.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,947,166.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	66,227,040.35	3.63

N	水利、环境和公共设施管理业	5,354.53	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	16,955,374.51	0.93
R	文化、体育和娱乐业	2,849.28	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,522,279,859.99	83.43

### 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	600519	贵州茅台	60,500	104,483,500.00	5.73
2	600600	青岛啤酒	640,000	68,800,000.00	3.77
3	300316	晶盛机电	809,200	51,432,752.00	2.82
4	002129	TCL中环	1,257,900	47,372,514.00	2.60
5	002690	美亚光电	1,747,330	41,761,187.00	2.29
6	000568	泸州老窖	171,524	38,469,402.72	2.11
7	600690	海尔智家	1,377,318	33,689,198.28	1.85
8	002475	立讯精密	978,300	31,061,025.00	1.70
9	688200	华峰测控	96,834	26,771,695.98	1.47
10	000049	德赛电池	593,100	25,787,988.00	1.41
11	603259	药明康德	312,900	25,344,900.00	1.39
12	000792	盐湖股份	1,102,100	25,006,649.00	1.37
13	600132	重庆啤酒	181,200	23,081,256.00	1.26
14	002594	比亚迪	87,200	22,407,784.00	1.23
15	600809	山西汾酒	78,100	22,257,719.00	1.22
16	000858	五粮液	122,546	22,142,836.74	1.21
17	300115	长盈精密	2,090,500	21,594,865.00	1.18
18	688777	中控技术	225,000	20,436,750.00	1.12

19	300012	华测检测	904,989	20,181,254.70	1.11
20	002179	中航光电	346,105	19,991,024.80	1.10
21	601939	建设银行	3,500,000	19,705,000.00	1.08
22	601012	隆基绿能	462,000	19,524,120.00	1.07
23	600941	中国移动	284,500	19,252,115.00	1.06
24	300633	开立医疗	350,000	19,190,500.00	1.05
25	002635	安洁科技	1,543,700	19,064,695.00	1.04
26	002459	晶澳科技	306,000	18,387,540.00	1.01
27	688536	思瑞浦	65,560	18,055,879.60	0.99
28	002460	赣锋锂业	259,700	18,051,747.00	0.99
29	600456	宝钛股份	441,400	18,035,604.00	0.99
30	301155	海力风电	203,954	17,815,381.90	0.98
31	603986	兆易创新	168,800	17,296,936.00	0.95
32	688588	凌志软件	1,678,899	17,040,824.85	0.93
33	603105	芯能科技	1,153,000	16,983,690.00	0.93
34	300015	爱尔眼科	545,620	16,952,413.40	0.93
35	000408	藏格矿业	637,300	16,550,681.00	0.91
36	603345	安井食品	101,400	16,414,632.00	0.90
37	300760	迈瑞医疗	51,900	16,398,843.00	0.90
38	601888	中国中免	75,000	16,202,250.00	0.89
39	600038	中直股份	346,900	16,099,629.00	0.88
40	600166	福田汽车	5,140,100	14,443,681.00	0.79
41	601877	正泰电器	515,100	14,268,270.00	0.78
42	002555	三七互娱	788,200	14,266,420.00	0.78
43	688041	海光信息	336,732	13,509,687.84	0.74
44	000799	酒鬼酒	95,000	13,104,300.00	0.72
45	688053	思科瑞	200,000	12,312,000.00	0.67
46	603508	思维列控	753,919	12,311,497.27	0.67
47	002028	思源电气	317,700	12,142,494.00	0.67
48	601717	郑煤机	1,082,755	12,083,545.80	0.66
49	600406	国电南瑞	484,920	11,832,048.00	0.65

50	600309	万华化学	125,000	11,581,250.00	0.63
51	300003	乐普医疗	500,000	11,485,000.00	0.63
52	601668	中国建筑	2,100,000	11,403,000.00	0.62
53	688017	绿的谐波	117,612	11,382,489.36	0.62
54	600893	航发动力	267,700	11,318,356.00	0.62
55	300604	长川科技	250,200	11,153,916.00	0.61
56	300643	万通智控	780,200	11,094,444.00	0.61
57	300223	北京君正	156,100	10,995,684.00	0.60
58	600760	中航沈飞	182,200	10,682,386.00	0.59
59	601111	中国国航	961,530	10,192,218.00	0.56
60	300451	创业慧康	1,287,000	10,180,170.00	0.56
61	688122	西部超导	106,102	10,046,798.38	0.55
62	300595	欧普康视	270,000	9,639,000.00	0.53
63	600315	上海家化	300,000	9,555,000.00	0.52
64	000636	风华高科	626,100	9,285,063.00	0.51
65	002466	天齐锂业	112,200	8,862,678.00	0.49
66	002484	江海股份	395,500	8,847,335.00	0.48
67	688033	天宜上佳	400,200	8,712,354.00	0.48
68	601128	常熟银行	1,125,000	8,493,750.00	0.47
69	300347	泰格医药	80,000	8,384,000.00	0.46
70	002335	科华数据	166,700	8,316,663.00	0.46
71	002410	广联达	131,500	7,883,425.00	0.43
72	600958	东方证券	801,408	7,164,587.52	0.39
73	600884	杉杉股份	386,900	7,041,580.00	0.39
74	600660	福耀玻璃	200,000	7,014,000.00	0.38
75	002007	华兰生物	300,000	6,789,000.00	0.37
76	300850	新强联	126,800	6,755,904.00	0.37
77	000938	紫光股份	320,000	6,243,200.00	0.34
78	603658	安图生物	100,000	6,185,000.00	0.34
79	688018	乐鑫科技	68,600	6,184,290.00	0.34
80	300036	超图软件	287,500	5,361,875.00	0.29

81	300496	中科创达	53,000	5,315,900.00	0.29
82	601398	工商银行	1,200,000	5,208,000.00	0.29
83	300750	宁德时代	13,000	5,114,460.00	0.28
84	603338	浙江鼎力	105,034	5,025,876.90	0.28
85	688153	唯捷创芯	133,000	4,885,090.00	0.27
86	000423	东阿阿胶	120,000	4,884,000.00	0.27
87	002223	鱼跃医疗	153,000	4,874,580.00	0.27
88	603659	璞泰来	89,600	4,649,344.00	0.25
89	688212	澳华内镜	70,000	4,584,300.00	0.25
90	600085	同仁堂	100,000	4,468,000.00	0.24
91	002139	拓邦股份	410,000	4,251,700.00	0.23
92	603690	至纯科技	109,999	4,162,362.16	0.23
93	300702	天宇股份	149,920	3,825,958.40	0.21
94	601669	中国电建	500,000	3,540,000.00	0.19
95	688690	纳微科技	60,000	3,106,200.00	0.17
96	600867	通化东宝	300,000	2,754,000.00	0.15
97	300699	光威复材	37,500	2,709,375.00	0.15
98	603833	欧派家居	20,000	2,430,600.00	0.13
99	605369	拱东医疗	20,000	2,112,200.00	0.12
100	688012	中微公司	18,497	1,812,890.97	0.10
101	002707	众信旅游	130,500	1,289,340.00	0.07
102	002273	水晶光电	88,100	1,038,699.00	0.06
103	002073	软控股份	118,000	725,700.00	0.04
104	688037	芯源微	4,148	649,162.00	0.04
105	002027	分众传媒	68,200	455,576.00	0.02
106	002371	北方华创	1,900	428,070.00	0.02
107	000333	美的集团	3,000	155,400.00	0.01
108	688232	新点软件	2,340	133,520.40	0.01
109	301050	雷电微力	261	20,141.37	0.00
110	301090	华润材料	825	8,299.50	0.00
111	301089	拓新药业	97	6,984.00	0.00

112	301093	华兰股份	220	5,588.00	0.00
113	301046	能辉科技	141	4,885.65	0.00
114	300994	久祺股份	173	3,411.56	0.00
115	300814	中富电路	165	2,979.90	0.00
116	301060	兰卫医学	151	2,961.11	0.00
117	301052	果麦文化	128	2,849.28	0.00
118	301063	海锅股份	75	2,551.50	0.00
119	301055	张小泉	156	2,374.32	0.00
120	301059	金三江	118	2,183.00	0.00
121	301057	汇隆新材	107	2,153.91	0.00
122	300774	倍杰特	185	2,147.85	0.00
123	301072	中捷精工	95	1,947.50	0.00
124	301049	超越科技	92	1,938.44	0.00
125	301053	远信工业	95	1,927.55	0.00
126	301048	金鹰重工	191	1,627.32	0.00
127	301068	大地海洋	63	1,547.28	0.00
128	301036	双乐股份	92	1,525.36	0.00
129	301083	百胜智能	130	1,435.20	0.00
130	300854	中兰环保	83	1,268.24	0.00
131	301079	邵阳液压	63	1,153.53	0.00
132	301056	森赫股份	45	342.45	0.00
133	301062	上海艾录	24	187.20	0.00

#### 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	601939	建设银行	60,812,259.00	1.95
2	002129	TCL中环	53,857,371.00	1.73
3	603259	药明康德	52,719,738.60	1.69

4	600600	青岛啤酒	51,074,068.00	1.64
5	600132	重庆啤酒	48,643,708.00	1.56
6	688232	新点软件	47,032,745.40	1.51
7	300316	晶盛机电	45,225,216.00	1.45
8	002594	比亚迪	38,424,524.86	1.23
9	600690	海尔智家	36,252,515.94	1.16
10	002142	宁波银行	35,857,376.34	1.15
11	300595	欧普康视	33,977,421.85	1.09
12	601398	工商银行	32,177,677.00	1.03
13	000792	盐湖股份	32,078,988.00	1.03
14	300059	东方财富	31,640,415.43	1.02
15	000651	格力电器	29,691,151.00	0.95
16	002555	三七互娱	28,736,364.13	0.92
17	603338	浙江鼎力	28,237,914.00	0.91
18	002475	立讯精密	27,856,071.00	0.89
19	002371	北方华创	27,836,329.00	0.89
20	603486	科沃斯	27,523,285.00	0.88

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。

#### 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	002690	美亚光电	161,487,478.85	5.18
2	000858	五粮液	89,592,890.52	2.87
3	600872	中炬高新	85,367,502.93	2.74
4	603259	药明康德	83,122,116.36	2.67
5	601318	中国平安	81,265,284.79	2.61
6	603338	浙江鼎力	78,010,972.66	2.50
7	000860	顺鑫农业	72,347,491.77	2.32

8	600315	上海家化	70,519,777.00	2.26
9	688232	新点软件	63,775,697.48	2.05
10	002250	联化科技	60,826,148.98	1.95
11	688085	三友医疗	57,078,332.05	1.83
12	601128	常熟银行	54,928,818.63	1.76
13	002245	蔚蓝锂芯	54,115,047.00	1.74
14	600009	上海机场	52,796,208.18	1.69
15	600036	招商银行	50,325,695.04	1.61
16	300724	捷佳伟创	50,169,176.25	1.61
17	000799	酒鬼酒	47,391,828.68	1.52
18	688072	拓荆科技	45,159,662.29	1.45
19	002372	伟星新材	42,566,409.60	1.37
20	002832	比音勒芬	40,610,470.98	1.30

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。

#### 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	2,641,838,096.13
卖出股票收入（成交）总额	3,180,612,006.00

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。

#### 8.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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。

### 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投资。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 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。

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	335,608.37
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,541.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	390,149.77

### 8.12.4 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可转换债券。

### 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

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
28,072	30,057.02	39,370,275.00	4.67%	804,390,452.70	95.33%

### 9.2 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	249,297.27	0.03%

### 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	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

## §10 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	15,164,177.14
减：本报告期基金总赎回份额	283,258,413.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	843,760,727.70

## §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、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：  
无。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币50,000.00元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	5,820,966,996.45	100.00%	4,256,871.35	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	证监会指定网站、公司官网	2022-03-11

	投资基金基金产品资料概要		
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投资基金基金经理变更公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-22
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
22	国泰君安君得明混合型证券 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
23	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	2022-07-21
24	国泰君安君得明混合型证券 投资基金2022年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2022-08-31
25	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
26	上海国泰君安证券资产管理 有限公司关于旗下部分基金 在光大银行开展费率优惠活 动的公告	上海证券报、证监会指定网 站、公司官网	2022-09-09
27	国泰君安君得明混合型证券 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
28	上海国泰君安证券资产管理 有限公司旗下基金2022年3	上海证券报、中国证券报、 证券时报、证券日报	2022-10-26

	季度报告提示性公告		
29	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

## §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

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。

## §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。

### 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