

国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划

2020年中期报告

2020年06月30日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2020年08月28日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人根据本集合计划合同规定，于2020年8月26日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。集合计划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集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年1月6日起至2020年6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划	
基金简称	君得鑫	
基金主代码	952009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年01月06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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,432,412,399.85份	
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过三年。	
下属分级基金的基金简称	君得鑫两年持有期混合A	君得鑫两年持有期混合C
下属分级基金的交易代码	952009	952099
报告期末下属分级基金的份额总额	1,413,511,927.85份	3,018,900,472.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划利用管理人的研究优势，主要投资于具备持续增长能力的优秀企业，并通过严谨的行业需求和公司前景分析，寻找价格相对于价值有所低估的上市公司，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划根据泛价值投资策略进行个股的甄选，在个股甄选的基础上进行行业、风格的均衡配置。在大类资产比较方面，采取定性与定量相结合的方式，依据宏观风险溢价等模型决定权益资产的比例。
业绩比较基准	$60\% \times \text{沪深300指数收益率} + 30\% \times \text{一年期银行定期存款利率} + 10\% \times \text{恒生指数收益率}$
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合

	资产管理计划，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李艳	李申
	联系电话	021-38676999	021-60637102
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		95521	021-60637111
传真		021-68872521	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区东园路111号2楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		江伟	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区东园路111号2楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月06日（基金合同生效日）-2020年06月30日)	
	君得鑫两年持有期混合A	君得鑫两年持有期混合C
本期已实现收益	70,194,170.02	123,890,229.35
本期利润	395,400,784.62	784,755,945.74
加权平均基金份额本期利润	0.2236	0.2723
本期加权平均净值利润率	12.92%	15.60%
本期基金份额净值增长率	16.47%	15.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	1,254,499,157.24	2,692,867,986.66
期末可供分配基金份额利润	0.8875	0.8920
期末基金资产净值	2,816,827,957.45	6,031,251,715.18
期末基金份额净值	1.9928	1.9978
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	16.47%	15.49%

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

君得鑫两年持有期混合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
过去一个月	11.19%	0.91%	5.26%	0.66%	5.93%	0.25%

过去三个月	25.92%	0.98%	8.17%	0.67%	17.75%	0.31%
自基金合同生效起至今	16.47%	1.59%	-0.68%	1.07%	17.15%	0.52%

君得鑫两年持有期混合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
过去一个月	11.25%	0.91%	5.26%	0.66%	5.99%	0.25%
过去三个月	26.12%	0.98%	8.17%	0.67%	17.95%	0.31%
自基金合同生效起至今	15.49%	1.37%	1.77%	0.98%	13.72%	0.39%

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





注：2020 年 2 月 6 日，我司发布的《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划 C 类份额开放日常申购、赎回业务公告》中提示：“君得鑫 C 类（代码：952099）份额的首日（即 2020 年 2 月 12 日）集合计划净值同原国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划转换而来的本集合计划 A 类份额净值，之后 C 类份额的净值将按照《管理合同》约定的方法计算。”因此，在 C 类份额分红之前，C 类份额累计净值增长率计算及业绩报酬计提均以君得鑫 C 类参与的份额净值作为期初计算依据。

§ 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2020年6月30日，本集合计划管理人共管理了4只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：国泰君安君得明混合型集合资产管理计划、国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划、国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划、国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划。

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		
张骏	基金投资部总经理，本产品的投资经理，国泰君安君得明混合型集合资产管理计划、“君享弘利系列”等产品的投资经理	2020-01-06	-	19 年	上海交通大学金融学学士，CFA，2011年10月至2018年3月任国泰君安证券资产管理公司投资管理部高级投资经理、副总经理。2012年9月起任国泰君安君得明（原明星价值）投资经理。2012年9月至2018年5月任国泰君安君享富利投资经理。2013年2月至2017年9月任国泰君安君得稳一号投资经理。2013年12月起任国泰君安君享弘利投资经理。2014年9月起任国泰君安君得鑫投资经理。2014年11月起任国泰君安君享弘利二号投资经理。2015年3月起任国泰君安君享弘利三号投资经理。2015年3月起任国泰君安君享弘利五号投资经理。2015年11月起任国泰君安君享同利投资经理。2018年4月起任国泰君安君享弘利6号投资经理。
周晨	本产品的投资经理，国泰君安君得明混合型集合资产管理计划、国泰君安君	2020-01-06	-	10 年	北京大学金融学硕士，2010年8月至2018年6月任国泰君安证券资产管理公司

	得盛债券型集合资产管理计划、国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划、国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划的投资经理				研究发展部研究员、高级研究员、资深研究员。2018年8月起任国泰君安君得鑫投资经理。2019年2月起任国泰君安君得明（原明星价值）投资经理。2019年6月起任国泰君安君得诚（原君得稳一号）投资经理。2020年6月起任国泰君安君得盛投资经理。2020年4月21日至2020年6月6日、2020年6月23日起任国泰君安君得惠二号投资经理。
--	---	--	--	--	---

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、相关规定以及集合计划合同、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集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同、招募说明书约定的行为，无侵害计划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本集合计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》的规定。

本集合计划管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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,未发现本集合计划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

2020年上半年权益市场整体波动加大,结构上分化加剧。一季度在疫情冲击下,我们沿着既定的投资策略对组合的持仓行业及标的进行了一些调整。主要方向是增加了一些表现受到疫情较大冲击的行业,随之产品仓位在一季度末提升到90%左右。二季度随着市场的悲观预期修复带来估值水平有了一定程度的回升,我们根据风险溢价模型,产品的仓位水平略有下降。在择时上我们坚持做大择时,避免短期过度频繁调整仓位。

回顾行业选择的方向,我们的配置主线依旧为消费、科技以及部分供给收缩的周期性行业。我们通过不断的平衡组合内个股的风险收益比,使得我们的组合在保持风格相对均衡的条件下,尽可能提高组合的盈利质量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末君得鑫两年持有期混合A基金份额净值为1.9928元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为16.47%,同期业绩比较基准收益率为-0.68%;截至报告期末君得鑫两年持有期混合C基金份额净值为1.9978元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为15.49%,同期业绩比较基准收益率为1.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年上半年权益市场在疫情的冲击下出现了巨大的波动。疫情在一季度超预期的进展对权益资产的估值水平冲击巨大,全球央行在美联储的带领下快速宽松,避免了疫情进一步传导至金融市场带来更剧烈的波动。国内疫情防控措施迅速、得当,在二季度大多数国内的行业都完成了复工,国内权益资产的估值水平得到了迅速的修复。

国内无风险利率下行至历史新低,与以往不同的是,国内货币政策与财政政策在托底经济的同时,并没有过度宽松,避免了大水漫灌过度推高资产价格。可以预计的是,虽然无风险利率在二季度出现一些反弹,长期利率水平依旧处于下行通道,无风险利率对估值水平的影响大概率未来半年维持中性。

国内及时复工以后,市场参与者对企业盈利的预期也逐渐稳定下来。科创板和创业板对科技企业的支持力度前所未有,在国内工程师红利的促进下,产业升级并没有被疫情的冲击暂停,反而在大力度政策的驱动下加速进行。

尽管国内权益资产的估值水平在二季度得到了一定程度的修复，但是横向比较来看，国内权益资产的风险收益比依旧在全球有非常强的吸引力，海外资金流入的速度和强度维持在非常高的水平。

国内权益市场整体估值水平并不高，我们会继续坚持自下而上的方式构建高品质组合，坚守盈利的主线，同时关注企业盈利的数量与质量，按照长期持有的视角，寻找优质公司共同成长，分享企业高速增长的红利。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日集合计划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集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	1,088,954,946.76
结算备付金		7,875,680.64
存出保证金		1,591,738.85
交易性金融资产	6.4.7.2	7,776,605,177.55
其中：股票投资		7,776,605,177.55
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产		—
买入返售金融资产		—
应收证券清算款		52,145,857.67
应收利息	6.4.7.3	221,517.34
应收股利		9,859,939.30
应收申购款		1,783,296.44
递延所得税资产		—
其他资产		—
资产总计		8,939,038,154.55

负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30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		—
应付证券清算款		8,776,272.22
应付赎回款		15,587,200.22
应付管理人报酬		6,007,075.03
应付托管费		1,519,304.79
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.4	2,705,704.70
应交税费		53,227,566.04
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.5	3,135,358.92
负债合计		90,958,481.92
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.6	4,432,412,399.85
未分配利润	6.4.7.7	4,415,667,272.78
所有者权益合计		8,848,079,672.63
负债和所有者权益总计		8,939,038,154.55

注：(1)报告截止日 2020 年 6 月 30 日，国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划 A 类份额净值 1.9928 元，份额总额 1,413,511,927.85 份。国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划 C 类份额净值 1.9978 元，份额总额 3,018,900,472.00 份。

(2) 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 6 日（合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
一、收入		1,235,821,372.71
1. 利息收入		3,389,645.38
其中：存款利息收入	6.4.7.8	3,389,645.38
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）		245,200,895.59
其中：股票投资收益	6.4.7.9	185,548,232.12
基金投资收益		-
债券投资收益		-
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	6.4.7.10	59,652,663.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	986,072,330.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	1,158,500.75
减：二、费用		55,664,642.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	29,304,645.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,541,575.04
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.13	12,659,737.66
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6. 4. 7. 14	6, 158, 684. 56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 180, 156, 730. 36
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 180, 156, 730. 36

注：本集合计划合同变更生效日为2020年1月6日，因此无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2, 190, 889, 856. 68	1, 558, 499, 162. 42	3, 749, 389, 019. 10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0. 00	1, 180, 156, 730. 36	1, 180, 156, 730. 36
三、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）	2, 241, 522, 543. 17	1, 677, 011, 380. 00	3, 918, 533, 923. 17
其中：1. 基金申购款	3, 112, 612, 648. 41	2, 294, 224, 653. 92	5, 406, 837, 302. 33
2. 基金赎回款	-871, 090, 105. 24	-617, 213, 273. 92	-1, 488, 303, 379. 16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动		0. 00	0. 00

(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	4,432,412,399.85	4,415,667,272.78	8,848,079,672.63

注：1、申购含红利再投份额。

2、期初数据是指2020年1月5日的日终数据，合同生效日数据是指2020年1月6日的日终数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

江伟

陶耿

茹建江

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）由国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划变更而来，国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》（证监会令第17号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告[2008]26号）、《国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准设立。

根据中国证监会于2018年11月30日发布的《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》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公布的生效之日起生效，原《国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本集合计划前，需充分了解本集合计划的产品特性，并承担集合计划投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于集合计划投资人连续大量赎回集合

计划份额产生的流动性风险，管理人在集合计划管理实施过程中产生的集合计划管理风险，本集合计划的特定风险等。

本集合计划可投资于股指期货、国债期货、股票期权。股指期货、国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。投资股票期权所面临的主要风险是股票期权价格波动带来的市场风险；因保证金不足、备兑证券数量不足或持仓超限而导致的强行平仓风险；股票期权具有高杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失；包括对手方风险和连带风险在内的第三方风险；以及各类操作风险。

本集合计划可投资于资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。

本集合计划参与内地与香港股票市场交易互联互通机制（以下简称“港股通机制”）下港股通相关业务，集合计划资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股或选择不将集合计划资产投资于港股，集合计划资产并非必然投资港股。

本集合计划可投资于科创板股票，科创板股票的特有风险包括：科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。此外，科创板企业可能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、

有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

本集合计划为逐笔计提业绩报酬的集合计划，由于管理人可能计提业绩报酬，投资者实际赎回份额净值可能低于每日披露的集合计划份额净值。投资者实际赎回金额，以登记机构确认数据为准。

本集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资者投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第33号发布、财政部令第76号修订）、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会公告（2010）5号的规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本计划2020年6月30日的财务状况以及2020年1-6月的经营成果和所有者权益（计划净值）变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划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。

6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度采用公历年度，即每年自1月1日至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币。记账单位为元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、买入返售金融资产、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的

分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前持有的股票投资、基金投资和债券投资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。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债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。本集合计划持有的其他金融负债主要为各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量；直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

估值对象：本集合计划所拥有的股票、债券、资产支持证券、期货合约、股票期权合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

(i) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(ii) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(iii) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(iv) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(v) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

(vi) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(i) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(ii) 首次公开发行未上市的股票和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(iii) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

(5) 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

(6) 股指期货合约、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(7) 股票期权合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(8) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本集合计划将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致集合计划实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，集合计划将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

(9) 暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停估值；

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于计划申购确认日及计划赎回确认日认列。

计划申购、赎回的确认，在收到计划投资人申购或赎回申请之日后，于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。于确认日按照实收基金、未分配利润的余额占本集合计划净值的比例，将确认有效的申购或赎回款项分割为两部分，分别确认为实收基金和损益平准金的增加或减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占计划净值比例计算的金额。损益平准金于本集合计划申购确认日或计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

(2) 交易所上市的债券差价收入于成交日、非交易所上市的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息的差额确认。

(3) 债券利息收入按票面利率在实际持有期内逐日计提。

(4) 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

(5) 买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(6) 持有的货币市场基金，投资收益按估值日前一交易日基金管理公司的每万份收益计算。

(7) 持有的保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、信托公司发行的集合资金信托计划、基金子公司发行的专项资产管理计划等以成本列示。持有的有明确预期收益率的银行理财计划、集合资金信托计划和专项资产管理计划按持有到期的预期收益率每日计提收益；浮动收益的投资品种，到期确认投资收益。

(8) 其他收入在主要风险和报酬已转移给交易对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本集合计划A类份额的管理费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的1.2%年费率计提。本集合计划C类份额的管理费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.6 %年费率计提。

(2) 本集合计划A类份额的托管费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.25%年费率计提。本集合计划C类份额的托管费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.2%的年费率计提。

(3) 其他费用：依据发生额对集合计划单位净值的影响大小，分别采取预提、待摊或者于费用支付时按照实际支付的金额确认费用。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年可根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《集合计划合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 在本集合计划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相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

产品管理人运用产品买卖股票税率为1%，为单边征收。

2、增值税

参照财政部、税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》：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。

3、企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	1,088,954,946.76
定期存款	—

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	-
合计	1,088,954,946.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		6,171,434,951.23	7,776,605,177.55	1,605,170,226.32
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		6,171,434,951.23	7,776,605,177.55	1,605,170,226.32

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	217,171.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,346.21

应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	221,517.34

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	2,705,704.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,705,704.70

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,567.72
预提费用	118,727.35
其他应付	3,008,063.85
合计	3,135,358.92

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 君得鑫两年持有期混合A

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
----	------------------------------------

(君得鑫两年持有期混合A)	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	2,257,431,843.17	2,257,431,843.17
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-843,919,915.32	-843,919,915.32
本期末	1,413,511,927.85	1,413,511,927.85

6.4.7.6.2 君得鑫两年持有期混合C

金额单位：人民币元

项目 (君得鑫两年持有期混合C)	本期2020年01月06日 (基金合同生效日) 至2020年06月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	3,018,900,472.00	3,018,900,472.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	3,018,900,472.00	3,018,900,472.00

注：期初数据是指2020年1月5日的日终数据，合同生效日数据是指2020年1月6日的日终数据。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 君得鑫两年持有期混合A

单位：人民币元

项目 (君得鑫两年持有期混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	1,913,592,874.26	-308,125,270.12	1,605,467,604.14
本期利润	62,957,988.29	332,785,706.11	395,743,694.40
本期基金份额交易产生的变动数	-722,051,705.31	124,156,436.37	-597,895,268.94
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-722,051,705.31	124,156,436.37	-597,895,268.94
本期已分配利润	-	-	-

本期末	1, 254, 499, 157. 24	148, 816, 872. 36	1, 403, 316, 029. 60
-----	----------------------	-------------------	----------------------

6.4.7.7.2 君得鑫两年持有期混合C

单位：人民币元

项目 (君得鑫两年持有期混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	123, 890, 229. 35	660, 865, 716. 39	784, 755, 945. 74
本期基金份额交易产生的变动数	2, 568, 977, 757. 31	-341, 382, 459. 87	2, 227, 595, 297. 44
其中：基金申购款	2, 568, 977, 757. 31	-341, 382, 459. 87	2, 227, 595, 297. 44
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2, 692, 867, 986. 66	319, 483, 256. 52	3, 012, 351, 243. 18

注：期初数据是指2020年1月5日的日终数据，合同生效日数据是指2020年1月6日的日终数据。

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
活期存款利息收入	3, 225, 212. 60
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	157, 015. 99
其他	7, 416. 79
合计	3, 389, 645. 38

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
卖出股票成交总额	3,807,011,939.64
减：卖出股票成本总额	3,621,463,707.52
买卖股票差价收入	185,548,232.12

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	59,652,663.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	59,652,663.47

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	1,019,336,175.01
——股票投资	1,019,336,175.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增	-33,263,844.02

增值税	
合计	986,072,330.99

6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
基金赎回费收入	1,158,500.75
合计	1,158,500.75

6.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
交易所市场交易费用	12,659,737.66
银行间市场交易费用	-
合计	12,659,737.66

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
银行费用	20,780.59
信息披露费	58,836.57
审计费用	19,344.33
帐户维护费	18,600.00
增值税及附加税	6,041,123.07
合计	6,158,684.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰君安证券资产管理有限公司	集合计划管理人
国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”）	集合计划管理人的股东
中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）	集合计划托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	10,368,631,422.35	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	7,187,211.11	100.00%	2,705,704.70	100.00%

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	29,304,645.09
其中：支付销售机构的客户维护费	-

本集合计划A类份额的管理费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的1.2%年费率计提。本集合计划C类份额的管理费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.6 %年费率计提。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,541,575.04

本集合计划A类份额的托管费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.25%年费率计提。本集合计划C类份额的托管费按前一日该类份额对应的集合计划资产净值的0.2%的年费率计提。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

君得鑫两年持有期混合A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
基金合同生效日（2020年01月06日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00%

额占基金总份额比例	
-----------	--

君得鑫两年持有期混合C

份额单位：份

项目	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日
基金合同生效日（2020年01月06日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	86,714,649.09
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	86,714,649.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.96%

注：期初数据是指 2020 年 1 月 5 日的日终数据，合同生效日数据是指 2020 年 1 月 6 日的日终数据。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月06日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,088,954,946.76	3,225,212.60

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本集合计划本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300845	捷安高科	2020-06-23	2020-07-03	-	17.63	17.63	500	8,815.00	8,815.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年6月30日止，本集合计划无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年6月30日止，本集合计划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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划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。

本集合计划管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险管理委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门的四级风险管理体系。风险管理部门主要包括风险管理部、法务监察部等专职履行风险管理职责的部门，营运管理部 and 综合管理部等其他部门。监事承担全面风险管理的监督责任。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本集合计划本报告期末未持有债券投资、同业存单投资、资产支持证券投资，评估应无重大信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的集合计划管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全集合计划流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的集合计划管理人采用监控集合计划组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹

配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的集合计划管理人在集合计划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带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过集合计划资产净值的 15%。

本集合计划本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,088,954,946.76	-	-	-	-	-	1,088,954,946.76
结算备付金	7,875,680.64	-	-	-	-	-	7,875,680.64
存出保证金	1,591,738.85	-	-	-	-	-	1,591,738.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,776,605,177.55	7,776,605,177.55
应收证券清算款	-	-	-	-	-	52,145,857.67	52,145,857.67
应收利息	-	-	-	-	-	221,517.34	221,517.34
应收股利	-	-	-	-	-	9,859,939.30	9,859,939.30
应收申购款	-	-	-	-	-	1,783,296.44	1,783,296.44
资产总计	1,098,422,366.2	-	-	-	-	7,840,615,788.3	8,939,038,154.5

	5					0	5
负债							
应付证 券清算 款	-	-	-	-	-	8,776,272.22	8,776,272.22
应付赎 回款	-	-	-	-	-	15,587,200.22	15,587,200.22
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	6,007,075.03	6,007,075.03
应付托 管费	-	-	-	-	-	1,519,304.79	1,519,304.79
应付交 易费用	-	-	-	-	-	2,705,704.70	2,705,704.70
应交税 费	-	-	-	-	-	53,227,566.04	53,227,566.04
其他负 债	-	-	-	-	-	3,135,358.92	3,135,358.92
负债总 计	-	-	-	-	-	90,958,481.92	90,958,481.92
利率敏 感度缺 口	1,098,422,366.25	-	-	-	-	7,749,657,306.38	8,848,079,672.63

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本集合计划的管理人每日对本集合计划的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	502,571,034.24	-	502,571,034.24
应收股利	-	9,859,939.30	-	9,859,939.30
应收证券清算款	-	41,364,862.80	-	41,364,862.80
资产合计	-	553,795,836.34	-	553,795,836.34
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	2.99	-	2.99
负债合计	-	2.99	-	2.99
资产负债表外汇风险敞口净额	-	553,795,833.35	-	553,795,833.35
项目	上年度末 2020年01月06日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

本集合计划其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指集合计划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。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	7,776,605,177.55	87.89
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	7,776,605,177.55	87.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	权益投资公允价值增加 5%	388,830,258.88	—
	权益投资公允价值减少 5%	-388,830,258.88	—

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(c) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30日，本集合计划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中属于第一层次的余额为7,776,596,362.55元，属于第二层次的余额为8,815.00元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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，本集合计划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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本集合计划本期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。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的承诺事项。

(3) 其他事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的其他重要事项。

(4) 财务报表的批准

本财务报表已于2020年8月26日经本集合计划的集合计划管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------

			例 (%)
1	权益投资	7,776,605,177.55	87.00
	其中：股票	7,776,605,177.55	87.00
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	1,096,830,627.40	12.27
8	其他各项资产	65,602,349.60	0.73
9	合计	8,939,038,154.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	39,420,000.00	0.45
C	制造业	5,437,578,219.64	61.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	122,900,000.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	57,912,000.00	0.65
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	956,104,839.47	10.81
J	金融业	505,338,000.00	5.71
K	房地产业	—	—

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	108,181,084.20	1.22
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	10,740,000.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	35,860,000.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	7,274,034,143.31	82.21

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	39,570,220.80	0.45
非日常生活消费品	8,220,960.00	0.09
日常消费品	27,622,425.60	0.31
金融	163,297,495.68	1.85
医疗保健	103,565,827.20	1.17
电信服务	160,294,104.96	1.81
合计	502,571,034.24	5.68

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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

1	600352	浙江龙盛	52,000,000	665,080,000.00	7.52
2	002690	美亚光电	11,980,000	630,148,000.00	7.12
3	000568	泸州老窖	6,909,984	629,637,742.08	7.12
4	002250	联化科技	17,800,000	388,040,000.00	4.39
5	300369	绿盟科技	15,400,000	358,666,000.00	4.05
6	000799	酒鬼酒	4,300,000	328,993,000.00	3.72
7	300724	捷佳伟创	3,500,000	309,855,000.00	3.50
8	600315	上海家化	6,000,000	287,400,000.00	3.25
9	300450	先导智能	6,099,767	281,870,233.07	3.19
10	300166	东方国信	21,999,950	273,019,379.50	3.09
11	600036	招商银行	6,300,000	212,436,000.00	2.40
12	002372	伟星新材	17,399,898	202,360,813.74	2.29
13	02318	中国平安	400,000	28,316,640.00	0.32
13	601318	中国平安	1,980,000	141,372,000.00	1.60
14	000858	五 粮 液	980,000	167,697,600.00	1.90
15	00700	腾讯控股	340,000	154,850,002.56	1.75
16	600557	康缘药业	10,800,000	150,336,000.00	1.70
17	601128	常熟银行	18,000,000	135,180,000.00	1.53
18	02359	药明康德	200,000	18,396,681.60	0.21
18	603259	药明康德	1,119,887	108,181,084.20	1.22
19	600803	新奥股份	11,600,000	119,944,000.00	1.36
20	002439	启明星辰	2,600,035	109,383,472.45	1.24
21	002600	领益智造	9,600,000	102,048,000.00	1.15
22	000661	长春高新	220,000	95,766,000.00	1.08
23	300253	卫宁健康	4,160,000	95,430,400.00	1.08
24	600872	中炬高新	1,599,955	93,645,366.15	1.06
25	02196	复星医药	3,600,000	85,169,145.60	0.96
26	000963	华东医药	3,000,000	75,900,000.00	0.86
27	603338	浙江鼎力	980,000	74,254,600.00	0.84
28	600132	重庆啤酒	1,000,000	73,000,000.00	0.83

29	600177	雅戈尔	12,000,000	71,520,000.00	0.81
30	603308	应流股份	3,099,930	63,238,572.00	0.71
31	603203	快克股份	2,190,000	62,831,100.00	0.71
32	600779	水井坊	1,000,000	62,420,000.00	0.71
33	000333	美的集团	1,000,000	59,790,000.00	0.68
34	600004	白云机场	3,800,000	57,912,000.00	0.65
35	002624	完美世界	1,000,000	57,640,000.00	0.65
36	600546	山煤国际	4,000,000	47,000,000.00	0.53
37	000725	京东方 A	10,000,000	46,700,000.00	0.53
38	603043	广州酒家	1,350,000	43,902,000.00	0.50
39	600519	贵州茅台	30,000	43,886,400.00	0.50
40	06030	中信证券	3,200,000	42,851,297.28	0.48
41	603583	捷昌驱动	600,000	41,028,000.00	0.46
42	300523	辰安科技	849,803	39,804,772.52	0.45
43	02899	紫金矿业	12,000,000	39,570,220.80	0.45
44	601808	中海油服	3,000,000	39,420,000.00	0.45
45	688016	心脉医疗	110,000	38,198,600.00	0.43
46	01336	新华保险	1,600,000	37,926,028.80	0.43
47	00998	中信银行	12,000,000	37,049,126.40	0.42
48	300413	芒果超媒	550,000	35,860,000.00	0.41
49	00921	海信家电	1,000,000	8,220,960.00	0.09
49	000921	海信家电	2,200,000	26,752,000.00	0.30
50	600276	恒瑞医药	360,000	33,228,000.00	0.38
51	002156	通富微电	1,300,000	32,565,000.00	0.37
52	002003	伟星股份	5,800,000	31,146,000.00	0.35
53	688085	三友医疗	370,000	29,337,300.00	0.33
54	00291	华润啤酒	700,000	27,622,425.60	0.31
55	603596	伯特利	600,000	21,120,000.00	0.24
56	601233	桐昆股份	1,500,000	19,140,000.00	0.22
57	002833	弘亚数控	750,000	18,397,500.00	0.21

58	300750	宁德时代	100,000	17,436,000.00	0.20
59	603983	丸美股份	200,000	17,206,000.00	0.19
60	06837	海通证券	3,000,000	17,154,403.20	0.19
61	601601	中国太保	600,000	16,350,000.00	0.18
62	603658	安图生物	99,915	16,230,192.60	0.18
63	603225	新风鸣	1,500,000	14,970,000.00	0.17
64	300760	迈瑞医疗	40,000	12,228,000.00	0.14
65	603882	金域医学	120,000	10,740,000.00	0.12
66	300348	长亮科技	500,000	9,500,000.00	0.11
67	002368	太极股份	200,000	8,738,000.00	0.10
68	688029	南微医学	30,000	7,276,200.00	0.08
69	000823	超声电子	500,000	6,955,000.00	0.08
70	02400	心动公司	200,000	5,444,102.40	0.06
71	300010	立思辰	200,000	3,914,000.00	0.04
72	300845	捷安高科	500	8,815.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000568	泸州老窖	490,871,763.57	5.55
2	600352	浙江龙盛	399,126,466.50	4.51
3	601318	中国平安	358,786,004.86	4.05
4	600036	招商银行	332,008,454.21	3.75
5	300450	先导智能	258,202,654.24	2.92
6	300724	捷佳伟创	147,691,564.42	1.67
7	601128	常熟银行	138,415,586.41	1.56
8	300166	东方国信	125,817,557.08	1.42
9	00700	腾讯控股	123,595,961.49	1.40
10	000858	五粮液	120,723,554.80	1.36

11	603338	浙江鼎力	118,053,373.76	1.33
12	000661	长春高新	113,111,688.00	1.28
13	02899	紫金矿业	112,211,557.76	1.27
14	002372	伟星新材	108,730,756.16	1.23
15	300523	辰安科技	107,854,967.35	1.22
16	002439	启明星辰	106,894,951.97	1.21
17	002600	领益智造	106,554,188.11	1.20
18	600872	中炬高新	102,536,998.64	1.16
19	000799	酒鬼酒	98,788,204.48	1.12
20	01336	新华保险	94,340,342.22	1.07

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	224,908,739.73	2.54
2	600315	上海家化	210,991,136.49	2.38
3	600036	招商银行	159,335,181.97	1.80
4	603338	浙江鼎力	107,702,677.15	1.22
5	000568	泸州老窖	100,640,902.22	1.14
6	000661	长春高新	94,819,877.61	1.07
7	000963	华东医药	93,721,600.35	1.06
8	02899	紫金矿业	85,207,013.84	0.96
9	300369	绿盟科技	84,877,423.06	0.96
10	300124	汇川技术	80,459,725.15	0.91
11	600352	浙江龙盛	78,137,625.83	0.88
12	603583	捷昌驱动	74,910,189.73	0.85
13	600566	济川药业	72,536,137.69	0.82
14	601166	兴业银行	71,553,434.76	0.81
15	002304	洋河股份	71,173,959.87	0.80
16	600177	雅戈尔	70,115,684.94	0.79

17	601888	中国中免	64,428,272.50	0.73
18	600872	中炬高新	60,165,947.60	0.68
19	601225	陕西煤业	59,736,321.21	0.68
20	300244	迪安诊断	58,871,970.13	0.67

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,561,643,087.71
卖出股票收入（成交）总额	3,807,011,939.64

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股本集合计划本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在股指期货投资上，本集合计划以套期保值为主要目标，在控制风险的前提下，谨慎参与股指期货的投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划参与国债期货交易以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，运用国债期货对冲风险，谨慎参与国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本集合计划持有的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 集合计划投资的前十名股票中，没有投资于超出集合计划合同规定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,591,738.85
2	应收证券清算款	52,145,857.67
3	应收股利	9,859,939.30
4	应收利息	221,517.34
5	应收申购款	1,783,296.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	65,602,349.60

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
君得 鑫两 年持 有期 混合A	10,353	136,531.63	935,778.99	0.07%	1,412,576,148.86	99.93%
君得 鑫两 年持 有期 混合C	49,556	60,918.97	115,167,226.91	3.81%	2,903,733,245.09	96.19%
合计	59,909	73,985.75	116,103,005.90	2.62%	4,316,309,393.95	97.38%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	君得鑫两年持有 期混合A	1,515,427.31	0.03%
	君得鑫两年持有 期混合C	1,399,939.33	0.03%
	合计	2,915,366.64	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	君得鑫两年持有期混合A	0~10
	君得鑫两年持有期混合C	50~100
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	君得鑫两年持有期混合A	10~50
	君得鑫两年持有期混合C	0~10
	合计	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	君得鑫两年持有期混合A	君得鑫两年持有期混合C
基金合同生效日(2020年01月06日)基金份额总额	2,257,431,843.17	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—	3,018,900,472.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	843,919,915.32	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,413,511,927.85	3,018,900,472.00

注：期初数据是指 2020 年 1 月 5 日的日终数据，合同生效日数据是指 2020 年 1 月 6 日的日终数据。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本集合计划管理人重大人事变动如下：

2020年4月17日，本集合计划管理人发布了《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》，江伟女士新任本集合计划管理人的董事长，龚德雄先生不再担任本集合计划管理人董事长职务。

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：

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本集合计划投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本集合计划管理人、集合计划托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰	2	10,368,631,422.35	100.0	7,187,211.11	100.0	-

君安			0%		0%	
----	--	--	----	--	----	--

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-01-06
2	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划A类份额开放日常赎回业务公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-01-16
3	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划C类份额暂停大额申购公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-01-23
4	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划C类份额开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-01-23
5	关于国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划C类份额暂时取消发行的通知	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-02-04
6	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划C类份额开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-02-06
7	国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划C类份额暂停大额申购公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-02-20
8	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-04-17

	变更公告		
9	国泰君安君得鑫两年持有期 混合型集合资产管理计划20 20年第1季度报告	证监会指定网站、公司官网	2020-04-21
10	上海国泰君安证券资产管理 有限公司旗下部分集合计划 季度报告提示性公告	中国证券报	2020-04-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于同意国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划合同变更的函；
- 2、《国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得鑫股票集合资产管理计划说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、集合计划托管人业务资格批件、营业执照。
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人互联网站<http://www.gtjazg.com>。

12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划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
二〇二〇年八月二十八日

