

国泰君安君得明混合型集合资产管理计划

2020 年年度报告

2020 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:2021 年 03 月 30 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。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合计划合同约定，于2021年3月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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及其更新。

本报告的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2020年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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遵规守信情况的说明	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	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	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 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	61
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息	68
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	68
§13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
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集合资产管理计划
基金简称	国君资管君得明混合
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	2, 358, 172, 788. 18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。本集合计划自资产管理合同变更生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。

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	70%*沪深300指数收益率+30%*一年期银行定期存款利率
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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李艳	石立平
	联系电话	021-38676631	010-63639180
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	shiliping@cebbank.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		江伟	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.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年	2019年08月30日（基金合同生效日）-2019年12月31日
本期已实现收益	1,290,283,185.13	50,456,333.31
本期利润	1,979,825,134.41	310,115,197.71
加权平均基金份额本期利润	0.6263	0.0565
本期加权平均净值利润率	28.42%	2.95%
本期基金份额净值增长率	39.17%	7.20%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	3,054,987,625.10	4,903,999,498.19
期末可供分配基金份额利润	1.2955	0.7982
期末基金资产净值	6,495,794,836.93	12,160,557,379.18
期末基金份额净值	2.7546	1.9793
3.1.3 累计期末指标	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	49.19%	7.20%

注：1. 所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益扣除暂估税金及附加后的余额。

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	①-③	②-④

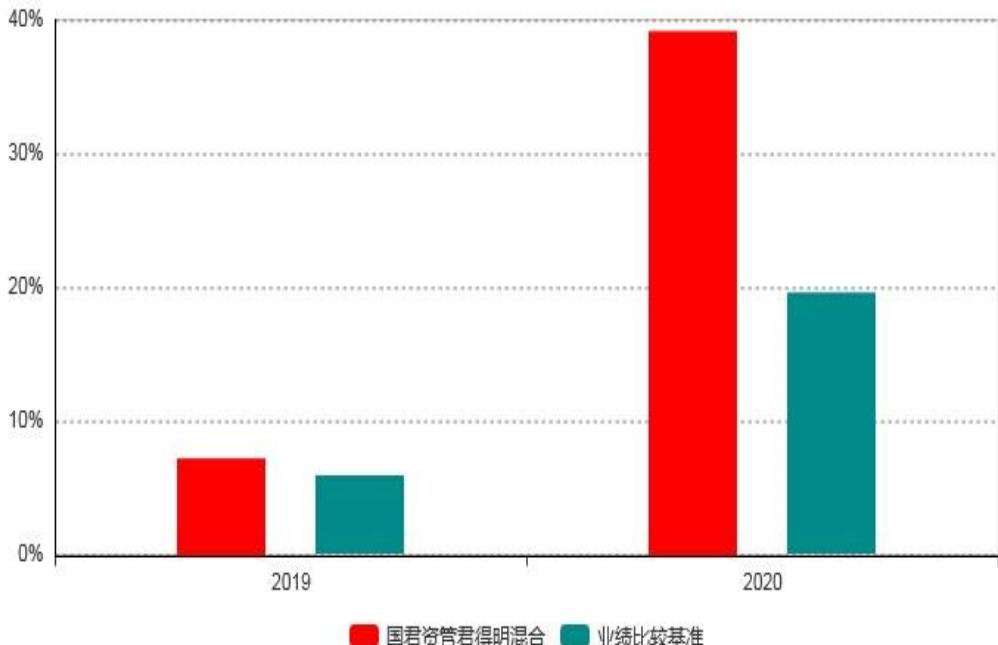
				(4)		
过去三个月	10.71%	1.05%	9.53%	0.69%	1.18%	0.36%
过去六个月	20.04%	1.27%	17.56%	0.95%	2.48%	0.32%
过去一年	39.17%	1.42%	19.52%	1.00%	19.65%	0.42%
自基金合同生效起至今	49.19%	1.27%	26.46%	0.91%	22.73%	0.36%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰君安君得明混合型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图



3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2019年计算期间为本集合计划的合同变更生效日2019年8月30日至2019年12月31日，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

截止本报告期末，根据本集合资产管理计划资产管理合同和相关法律法规的规定，本集合计划无应分配但尚未实施的利润。

§ 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12月31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	基金投资部副总经理，本产品的投资经理，国泰君安君得鑫两年持有期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	2019-08-30	-	20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，国泰君安君得盛债券型集合资	2019-08-30	-	10年	北京大学金融学硕士，2010年8月至2018年6月任国

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，国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划的投资经理			泰君安证券资产管理公司 研究发展部研究员、高级 研究员、资深研究员。20 18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202 0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。
---	--	--	--

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；
 2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；
 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和集合计划管理合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制投资风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益，没有损害集合计划份额持有人利益的行为。报告期内，本集合计划无重大违法违规行为，本集合计划投资组合符合有关法律法规和合同的约定。

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

本集合计划管理人根据《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。

4.3.3 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。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年权益市场整体波动加大，全年市场受到疫情和政策宽松的影响，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观受到疫情较大冲击的消费行业。四季度随着部分行业估值较为充分，我们对持仓进行了一定调整，消费略有减仓，替换为科技、高端制造。回顾全年持仓方向，我们的配置主线为消费、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

截至报告期末本集合计划份额净值为2.7546元，报告期内，集合计划份额净值增长率为39.17%，同期业绩比较基准收益率为19.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2020年全年来看，权益市场逐渐摆脱了疫情带来的冲击，特别是二季度国内经济先于海外反弹，全年来看上市公司盈利U型反转，国内出口链条表现更为抢眼。

展望未来，我们依然看好权益资产长期的获利潜力。外生冲击或许会短期加剧市场的波动，但是长期来看影响市场的最重要的因素还是企业创造盈利的能力。国内工程师红利优势明显，产业链升级的潜力巨大。

无风险利率处于长期下降通道中，但是随着通胀压力增强，短期宽松的政策受到一定程度上的制约。企业盈利大概率出现显著分化，龙头公司盈利优势增强。

我们始终坚持稳健的投资组合，坚持自下而上均衡持仓的风格。以企业长期盈利为主线，同时关注盈利的数量与质量，寻找高质量的企业，伴随优秀公司共同成长。

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，本集合计划管理人从维护集合计划份额持有人利益、保障集合计划合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审核及检查、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，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，保障集合计划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

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、投资研究院负责人、营运管理部负责人、法务监察部负责人、风险管理部负责人及市场部门负责人组成。具体参会的投资部门负责人依据待决议事项对应的资管产品确定。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及集合计划合同的规定。

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的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在国泰君安君得明混合型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、集合计划合同、托管协议等的规定，依法安全保管了集合计划的全部资产，对本集合计划的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本集合计划运作情况报告，没有发生任何损害集合计划份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为集合计划托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》

及其他法律法规、集合计划合同、托管协议等的规定，对集合计划管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现集合计划管理人在投资运作、集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、集合计划费用开支等方面存在损害集合计划份额持有人利益的行为。该集合计划在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据集合计划合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对集合计划管理人编制的《国泰君安君得明混合型集合资产管理计划2020年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 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 (2021) 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集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了国泰君安君得明混合型集合资产管理计划的财务报表，包括2020年12月31日的资产负债表，2020年度的利润表、所有者权益（集合计划净值）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集合资产管理计划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集合资产管理计划2020年12月31日的财务状况以及2020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集合资产管理计划，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集合资产管理计划管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估国泰君安君得明混合型集合资产管理计划的持续经营能力，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集合资产管理计划的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平

	<p>的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国泰君安君得明混合型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安君得明混合型集合资产管理计划不能持续经营。（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</p>
--	--

	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	蒋燕华	丁鹏飞
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	2021年3月26日	

§ 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集合资产管理计划

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7. 4. 7. 1	1, 064, 926, 712. 00	1, 672, 835, 173. 82
结算备付金		4, 678, 236. 18	11, 242, 620. 96
存出保证金		1, 061, 595. 57	4, 029, 882. 44
交易性金融资产	7. 4. 7. 2	5, 509, 937, 345. 94	10, 579, 901, 338. 98
其中：股票投资		5, 509, 937, 345. 94	10, 579, 901, 338. 98
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		-	10, 287, 955. 40
应收利息	7. 4. 7. 3	401, 058. 89	681, 414. 92
应收股利		-	-
应收申购款		31, 482, 448. 13	-
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		6,612,487,396.71	12,278,978,386.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,030,889.53	15,341,821.30
应付赎回款		55,393,396.65	62,084,059.41
应付管理人报酬		6,484,721.66	12,275,342.52
应付托管费		1,080,786.96	2,045,890.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.4	1,828,606.31	12,616,120.73
应交税费		41,514,537.45	11,768,867.08
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	2,359,621.22	2,288,905.89
负债合计		116,692,559.78	118,421,007.34
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.6	2,358,172,788.18	6,143,940,435.57
未分配利润	7.4.7.7	4,137,622,048.75	6,016,616,943.61
所有者权益合计		6,495,794,836.93	12,160,557,379.18
负债和所有者权益总计		6,612,487,396.71	12,278,978,386.52

注: (1) 报告截止日2020年12月31日, 集合计划份额净值2.7546元, 集合计划份额总额2,358,172,788.18份。

(2)本财务报表的上年度编制期间为2019年8月30日(集合计划合同变更生效日)至2019年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安君得明混合型集合资产管理计划

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效日）至2019年12月31日
一、收入		2,147,909,224.93	377,323,852.67
1. 利息收入		11,402,801.70	13,155,692.84
其中：存款利息收入	7.4.7.8	11,402,801.70	13,154,321.67
债券利息收入		—	1,371.17
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）		1,422,829,998.12	102,028,287.91
其中：股票投资收益	7.4.7.9	1,348,963,208.52	100,603,737.49
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.10	—	1,357,050.42
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益		—	—
股利收益	7.4.7.11	73,866,789.60	67,500.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	689,541,949.28	259,658,864.40
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. 13	24, 134, 475. 83	2, 481, 007. 52
减：二、费用		168, 084, 090. 52	67, 208, 654. 96
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	84, 657, 158. 56	42, 478, 850. 91
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	14, 109, 526. 58	7, 084, 843. 19
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 14	25, 265, 480. 49	14, 215, 004. 52
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	7. 4. 7. 15	44, 051, 924. 89	3, 429, 956. 34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 979, 825, 134. 41	310, 115, 197. 71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 979, 825, 134. 41	310, 115, 197. 71

注：本财务报表的上年度编制期间为2019年8月30日（集合计划合同变更生效日）至2019年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得明混合型集合资产管理计划

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2020年01月01日至2020年12月31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）	6, 143, 940, 435. 57	6, 016, 616, 943. 61	12, 160, 557, 379. 18
二、本期经营活动	-	1, 979, 825, 134. 41	1, 979, 825, 134. 41

产生的基金净值变动数(本期利润)			
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)	-3,785,767,647.39	-3,858,820,029.27	-7,644,587,676.66
其中: 1. 基金申购款	1,435,425,528.04	2,210,712,145.87	3,646,137,673.91
2. 基金赎回款	-5,221,193,175.43	-6,069,532,175.14	-11,290,725,350.57
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,358,172,788.18	4,137,622,048.75	6,495,794,836.93
项 目	上年度可比期间		
	2019年08月30日(基金合同生效日)至2019年12月31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)	209,198,951.02	177,064,243.00	386,263,194.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	310,115,197.71	310,115,197.71
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)	5,934,741,484.55	5,529,437,502.90	11,464,178,987.45
其中: 1. 基金申购	6,306,349,484.93	5,872,472,641.32	12,178,822,126.25

款			
2. 基金赎回款	-371, 608, 000. 38	-343, 035, 138. 42	-714, 643, 138. 80
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6, 143, 940, 435. 57	6, 016, 616, 943. 61	12, 160, 557, 379. 18

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：

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

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

根据中国证监会于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,国泰君安明星价值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,自2019年8月30日起,《国泰君安君得明混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《国泰君安明星价值股票集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式,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。本集合计划自资产管理合同变更生效日起三年后,按照中国证监会有关规定执行。本集合计划的管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,托管人为中国光大银行股份有限公司。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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集合资产管理计划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集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产比例为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集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划业绩比较基准为：70%*沪深300指数收益率+30%*一年期银行定期存款利率。

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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《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》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本集合计划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、完整地反映了本集合计划于2020年12月31日的财务状况以及2020年1月1日至2020年12月31日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划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集合计划的金融资产（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

本集合计划的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本集合计划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的股票、债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本集合计划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；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本集合计划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。本集合计划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，本集合计划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)是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划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。本集合计划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，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。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。

本集合计划持有的金融工具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，集合计划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，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，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

当本集合计划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，同时本集合计划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集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

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收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认。

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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

- (10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (11) 公允价值变动收益/（损失）系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、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；
- (12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本集合计划每一份额享有同等分配权；
- (2) 期末可供分配收益为截至可供分配收益计算日，未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数；
- (3) 本计划收益分配方式分为2种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入集合计划份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为集合计划份额进行再投资；若投资人不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红；
- (4) 选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利登记日的份额净值转成相应的份额。投资人在不同销售机构处可以选择不同的分红方式；
- (5) 当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- (6) 集合计划收益分配后，收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值，收益分配基准日即当期期末可供分配利润计算截止日；
- (7) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

1. 增值税

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

2. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	1,064,926,712.00	1,672,835,173.82
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	1,064,926,712.00	1,672,835,173.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,467,591,716.92	5,509,937,345.94	1,042,345,629.02
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	4,467,591,716.92	5,509,937,345.94	1,042,345,629.02

项目	上年度末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,250,466,879.10	10,579,901,338.98	329,434,459.88
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	10,250,466,879.10	10,579,901,338.98	329,434,459.88

7.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	398,217.70	673,855.06
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	2,315.72	5,565.12
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	525.47	1,994.74
合计	401,058.89	681,414.92

7.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,828,606.31	12,616,120.73
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,828,606.31	12,616,120.73

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	106,540.30	155,824.97
预提费用	160,000.00	40,000.00
其他应付款	2,093,080.92	2,093,080.92
合计	2,359,621.22	2,288,905.89

7.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,143,940,435.57	6,143,940,435.57
本期申购	1,435,425,528.04	1,435,425,528.04
本期赎回（以“-”号填列）	-5,221,193,175.43	-5,221,193,175.43
本期末	2,358,172,788.18	2,358,172,788.18

7.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,903,999,498.19	1,112,617,445.42	6,016,616,943.61

本期利润	1, 290, 283, 185. 13	689, 541, 949. 28	1, 979, 825, 134. 41
本期基金份额交易产生的变动数	-3, 139, 295, 058. 22	-719, 524, 971. 05	-3, 858, 820, 029. 27
其中：基金申购款	1, 563, 263, 057. 10	647, 449, 088. 77	2, 210, 712, 145. 87
基金赎回款	-4, 702, 558, 115. 32	-1, 366, 974, 059. 82	-6, 069, 532, 175. 14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3, 054, 987, 625. 10	1, 082, 634, 423. 65	4, 137, 622, 048. 75

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年08月30日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	11, 305, 295. 42	13, 006, 522. 65
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	58, 638. 57	133, 989. 34
其他	38, 867. 71	13, 809. 68
合计	11, 402, 801. 70	13, 154, 321. 67

7.4.7.9 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01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	11, 790, 017, 868. 07	1, 495, 390, 374. 11
减：卖出股票成本总额	10, 441, 054, 659. 55	1, 394, 786, 636. 62
买卖股票差价收入	1, 348, 963, 208. 52	100, 603, 737. 49

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2 020年12月31日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	1,357,050.42
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	-	1,357,050.42

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效日） 至2019年12月31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付) 成交总额	-	8,141,662.81
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	-	6,783,200.00
减：应收利息总额	-	1,412.39
买卖债券差价收入	-	1,357,050.42

7.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2020年01月01日至 2020年12月31日	2019年08月30日(基金合同生效 日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	73,866,789.60	67,500.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	73,866,789.60	67,500.00

7.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至20 20年12月31日	上年度可比期间 2019年08月30日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	712,911,169.14	268,424,989.31
——股票投资	712,911,169.14	268,424,989.31
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	23,369,219.86	8,766,124.91
合计	689,541,949.28	259,658,864.40

7.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年08月30日(基金合同生效 日)至2019年12月31日

基金赎回费收入	24,134,475.83	2,481,007.52
合计	24,134,475.83	2,481,007.52

7.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	25,265,480.49	14,215,004.52
银行间市场交易费用	—	—
合计	25,265,480.49	14,215,004.52

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
审计费用	40,000.00	13,588.81
信息披露费	120,000.00	100,000.00
差价收入增值税抵减	39,189,218.64	2,961,038.03
增值税金及附加税	4,702,706.25	355,329.50
合计	44,051,924.89	3,429,956.34

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，本集合计划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，本集合计划无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）	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。

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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效日） 至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	16,397,218,712.15	100.00%	12,836,976,786.80	100.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效日） 至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券	-	-	8,141,662.81	100.00%

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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 基金交易

本集合计划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 2020年01月01日至2020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	11,991,296.91	100.00%	1,828,606.31	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生效日）至2019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	11,580,590.48	100.00%	12,616,120.73	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。

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 2020年01月01日 至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同 生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	84,657,158.56	42,478,850.91
其中：支付销售机构的客户维护费	43,406,121.69	22,192,922.57

注：支付集合计划管理人国泰君安资管的管理人报酬按前一日集合计划资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日集合计划资产净值*1.20%/365

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日 至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同生 效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	14,109,526.58	7,084,843.19

注：支付集合计划托管人光大银行的托管费按前一日集合计划资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日集合计划资产净值*0.20%/365

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。

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 2020年01月01日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年08月30日（基金合同 生效日）至2019年12月31日
基金合同生效日（2019 年08月30日）持有的基	0.00	0.00

金份额		
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期内申购/买入总份额	22,244,420.99	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	22,244,420.99	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9433%	0.00%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2020年12月31日	持有的基金份额	2019年12月31日	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安证券	50,000,00 0.00	2.1203%	50,000,00 0.00	0.81%

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	
	2020年01月01日至2020年12月31日	2019年08月30日(基金合同生效日)至2019年12月31日	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	1,064,926,712.0 0	11,305,295.4 2	1,672,835,173.8 2	13,006,522.6 5

注：本集合计划的银行存款由集合计划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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
002156	通富微电	2020-11-24	2021-05-24	非公开发行锁定	18.66	23.70	1,607,717	99,999.22	38,102,892.90	-
300680	隆盛科技	2020-10-23	2021-04-23	非公开发行锁定	22.08	29.06	135,869	2,999,987.52	3,948,353.14	-
300577	开润股份	2020-11-23	2021-05-24	非公开发行锁定	29.55	24.36	101,523	3,000,004.65	2,473,100.28	-
603313	梦百合	2020-12-02	2021-05-31	非公开发行锁定	27.08	30.09	62,117	1,682,128.36	1,869,100.53	-

				定						
3009 99	金龙 鱼	2020 -09- 29	2021 -04- 15	创业 板打 新限 售	25. 7 0	88. 2 9	9, 877	253, 838. 90	872, 040. 33	-
3008 96	爱美 客	2020 -09- 21	2021 -03- 29	创业 板打 新限 售	118. 27	603. 36	473	55, 9 41. 7 1	285, 389. 28	-
6886 17	惠泰 医疗	2020 -12- 30	2021 -01- 07	新股 未上 市	74. 4 6	74. 4 6	1, 031	76, 7 68. 2 6	76, 7 68. 2 6	-
3008 61	美畅 股份	2020 -08- 06	2021 -02- 24	创业 板打 新限 售	43. 7 6	51. 1 0	821	35, 9 26. 9 6	41, 9 53. 1 0	-
3009 19	中伟 股份	2020 -12- 15	2021 -06- 23	创业 板打 新限 售	24. 6 0	61. 5 1	342	8, 41 3. 20	21, 0 36. 4 2	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -01- 07	新股 未上 市	10. 7 6	10. 7 6	1, 620	17, 4 31. 2 0	17, 4 31. 2 0	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 07	创业 板打 新限 售	10. 7 6	10. 7 6	181	1, 94 7. 56	1, 94 7. 56	-
3009 00	广联 航空	2020 -10- 19	2021 -04- 29	创业 板打 新限 售	17. 8 7	33. 1 6	448	8, 00 5. 76	14, 8 55. 6 8	-
3008 64	南大 环境	2020 -08- -	2021 -02- -	创业 板打	71. 7 1	90. 8 5	156	11, 1 86. 7	14, 1 72. 6	-

		13	24	新限售				6	0	
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -01- 07	新股 未上 市	13. 3 9	13. 3 9	900	12, 0 51. 0 0	12, 0 51. 0 0	-
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	创业 板打 新限 售	13. 3 9	13. 3 9	100	1, 33 9. 00	1, 33 9. 00	-
3008 92	品渥 食品	2020 -09- 11	2021 -03- 24	创业 板打 新限 售	26. 6 6	60. 0 1	223	5, 94 5. 18	13, 3 82. 2 3	-
3008 87	谱尼 测试	2020 -09- 09	2021 -03- 16	创业 板打 新限 售	44. 4 7	74. 5 2	166	7, 38 2. 02	12, 3 70. 3 2	-
3008 76	蒙泰 高新	2020 -08- 14	2021 -02- 24	创业 板打 新限 售	20. 0 9	36. 6 2	307	6, 16 7. 63	11, 2 42. 3 4	-
3008 79	大叶 股份	2020 -08- 25	2021 -03- 01	创业 板打 新限 售	10. 5 8	27. 1 2	409	4, 32 7. 22	11, 0 92. 0 8	-
3008 90	翔丰 华	2020 -09- 10	2021 -03- 17	创业 板打 新限 售	14. 6 9	48. 8 5	215	3, 15 8. 35	10, 5 02. 7 5	-
3009 10	瑞丰 新材	2020 -11- 20	2021 -05- 27	创业 板打 新限 售	30. 2 6	47. 8 7	208	6, 29 4. 08	9, 95 6. 96	-

3008 94	火星人	2020 -12- 24	2021 -07- 01	创业板打 新限 售	14. 0 7	36. 9 7	266	3, 74 2. 62	9, 83 4. 02	-
3008 91	惠云 钛业	2020 -09- 10	2021 -03- 17	创业板打 新限 售	3. 64	16. 4 0	562	2, 04 5. 68	9, 21 6. 80	-
3009 08	仲景 食品	2020 -11- 13	2021 -05- 24	创业板打 新限 售	39. 7 4	60. 4 4	139	5, 52 3. 86	8, 40 1. 16	-
3008 84	狄耐 克	2020 -11- 05	2021 -05- 12	创业板打 新限 售	24. 8 7	33. 5 1	247	6, 14 2. 89	8, 27 6. 97	-
3009 07	康平 科技	2020 -11- 11	2021 -05- 18	创业板打 新限 售	14. 3 0	26. 8 5	283	4, 04 6. 90	7, 59 8. 55	-
3008 93	松原 股份	2020 -09- 17	2021 -03- 24	创业板打 新限 售	13. 4 7	35. 0 8	212	2, 85 5. 64	7, 43 6. 96	-
3008 89	爱克 股份	2020 -09- 09	2021 -03- 16	创业板打 新限 售	27. 9 7	30. 1 2	237	6, 62 8. 89	7, 13 8. 44	-
3008 98	熊猫 乳品	2020 -10- 09	2021 -04- 16	创业板打 新限 售	10. 7 8	33. 0 3	200	2, 15 6. 00	6, 60 6. 00	-
3009	法本	2020	2021	创业	20. 0	37. 3	174	3, 49	6, 49	-

25	信息	-12-21	-06-30	板打 新限 售	8	3		3.92	5.42	
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	创业 板打 新限 售	29.57	40.67	150	4,43 5.50	6,10 0.50	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	创业 板打 新限 售	24.35	33.06	168	4,09 0.80	5,55 4.08	-
300886	华业 香料	2020-09-08	2021-03-16	创业 板打 新限 售	18.59	45.67	121	2,24 9.39	5,52 6.07	-
300918	南山 智尚	2020-12-15	2021-06-22	创业 板打 新限 售	4.97	8.94	546	2,71 3.62	4,88 1.24	-
300922	天秦 装备	2020-12-18	2021-06-25	创业 板打 新限 售	16.05	31.58	152	2,43 9.60	4,80 0.16	-

7.4.12.2 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。

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2020年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31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。

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，营运管理部和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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

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。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在7.4.12中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,064,926,712.00	—	—	—	—	—	1,064,926,712.00
结算备付金	4,678,236.18	—	—	—	—	—	4,678,236.18
存出保证金	1,061,595.57	—	—	—	—	—	1,061,595.57
交易性金融资产	—	—	—	—	—	5,509,937,345.94	5,509,937,345.94
应收利息	—	—	—	—	—	401,058.89	401,058.89
应收申购款	—	—	—	—	—	31,482,448.13	31,482,448.13
资产总计	1,070,666,543.75	—	—	—	—	5,541,820,852.96	6,612,487,396.71
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	8,030,889.53	8,030,889.53
应付赎回款	—	—	—	—	—	55,393,396.65	55,393,396.65
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,484,721.66	6,484,721.66
应付托管费	—	—	—	—	—	1,080,786.96	1,080,786.96
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,828,606.31	1,828,606.31
应交税费	—	—	—	—	—	41,514,537.45	41,514,537.45
其他负债	—	—	—	—	—	2,359,621.22	2,359,621.22
负债总计	—	—	—	—	—	116,692,559.78	116,692,559.78
利率敏感度缺口	1,070,666,543.75	—	—	—	—	5,425,128,293.18	6,495,794,836.93

上年度末2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,672,835,173.82	—	—	—	—	—	1,672,835,173.82
结算备付金	11,242,620.96	—	—	—	—	—	11,242,620.96
存出保证金	4,029,882.44	—	—	—	—	—	4,029,882.44
交易性金融资产	—	—	—	—	—	10,579,901,338.98	10,579,901,338.98
应收证券清算款	—	—	—	—	—	10,287,955.40	10,287,955.40
应收利息	—	—	—	—	—	681,414.92	681,414.92
资产总计	1,688,107,677.22	—	—	—	—	10,590,870,709.30	12,278,978,386.52
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	15,341,821.30	15,341,821.30
应付赎回款	—	—	—	—	—	62,084,059.41	62,084,059.41
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	12,275,342.52	12,275,342.52
应付托管费	—	—	—	—	—	2,045,890.41	2,045,890.41
应付交易费用	—	—	—	—	—	12,616,120.73	12,616,120.73
应交税费	—	—	—	—	—	11,768,867.08	11,768,867.08
其他负债	—	—	—	—	—	2,288,905.89	2,288,905.89
负债总计	—	—	—	—	—	118,421,007.34	118,421,007.34
利率敏感度缺口	1,688,107,677.22	—	—	—	—	10,472,449,701.96	12,160,557,379.18

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本期末及上年度末均未持有债券资产（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。

7.4.13.4.2 外汇风险

本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

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		上年度末	
	2020年12月31日		2019年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净值比例 (%)		资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5, 509, 937, 345. 94	84. 82	10, 579, 901, 338. 98	87. 00
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	5, 509, 937, 345. 94	84. 82	10, 579, 901, 338. 98	87. 00

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除权益投资公允价值发生变动，其他影响集合计划资产公允价值的风险变量保持不变。			
	分析	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
相关风险变量的变动		本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日	
		权益投资公允价值增加 5%	275, 496, 867. 30	
		权益投资公允价值减少 5%	-275, 496, 867. 30	
			528, 995, 066. 95	
			-528, 995, 066. 95	

7.4.14 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12月31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5,462,018,501.61元，属于第二层次的余额为47,918,844.33元，无第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间重大变动

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2021年3月26日经本集合计划的集合计划管理人批准。

§ 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	5, 509, 937, 345. 94	83. 33
	其中：股票	5, 509, 937, 345. 94	83. 33
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, 069, 604, 948. 18	16. 18
8	其他各项资产	32, 945, 102. 59	0. 50
9	合计	6, 612, 487, 396. 71	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	678, 480. 00	0. 01
B	采矿业	3, 018, 633. 40	0. 05
C	制造业	4, 021, 698, 797. 70	61. 91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41, 782, 998. 60	0. 64
E	建筑业	194, 824, 000. 00	3. 00
F	批发和零售业	3, 527, 797. 23	0. 05
G	交通运输、仓储和邮政业	57, 334, 878. 00	0. 88
H	住宿和餐饮业	669, 890. 00	0. 01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	644, 693, 900. 79	9. 92
J	金融业	465, 037, 008. 00	7. 16
K	房地产业	3, 656, 315. 00	0. 06
L	租赁和商务服务业	6, 318, 428. 00	0. 10

M	科学研究和技术服务业	53,346,671.12	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	14,172.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	940,569.00	0.01
Q	卫生和社会工作	11,639,934.50	0.18
R	文化、体育和娱乐业	754,872.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	5,509,937,345.94	84.82

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	600352	浙江龙盛	34,007,800	463,186,236.00	7.13
2	002690	美亚光电	8,805,994	389,929,414.32	6.00
3	300450	先导智能	4,461,900	374,754,981.00	5.77
4	000799	酒鬼酒	2,095,900	328,008,350.00	5.05
5	002250	联化科技	12,100,000	290,279,000.00	4.47
6	300724	捷佳伟创	1,841,700	268,151,520.00	4.13
7	000568	泸州老窖	1,079,005	244,027,770.80	3.76
8	601668	中国建筑	39,200,000	194,824,000.00	3.00
9	601128	常熟银行	26,173,400	193,159,692.00	2.97
10	300369	绿盟科技	11,759,870	179,690,813.60	2.77
11	600519	贵州茅台	87,803	175,430,394.00	2.70
12	300166	东方国信	15,403,600	168,669,420.00	2.60
13	600315	上海家化	4,800,000	166,704,000.00	2.57
14	601318	中国平安	1,822,800	158,547,144.00	2.44
15	002372	伟星新材	8,000,000	149,600,000.00	2.30

16	603308	应流股份	3,870,334	114,948,919.80	1.77
17	600872	中炬高新	1,700,791	113,357,720.15	1.75
18	600036	招商银行	2,461,600	108,187,320.00	1.67
19	600557	康缘药业	9,599,680	97,628,745.60	1.50
20	300316	晶盛机电	2,960,000	89,036,800.00	1.37
21	002439	启明星辰	2,661,176	77,732,950.96	1.20
22	002798	帝欧家居	3,608,856	73,981,548.00	1.14
23	002600	领益智造	6,140,500	73,624,595.00	1.13
24	002851	麦格米特	2,086,018	71,049,773.08	1.09
25	600004	白云机场	4,040,000	57,085,200.00	0.88
26	600196	复星医药	1,035,100	55,885,049.00	0.86
27	603259	药明康德	395,890	53,334,300.80	0.82
28	603589	口子窖	720,000	49,608,000.00	0.76
29	600132	重庆啤酒	383,500	45,632,665.00	0.70
30	000860	顺鑫农业	604,900	43,879,446.00	0.68
31	300253	卫宁健康	2,442,379	42,741,632.50	0.66
32	600803	新奥股份	3,074,540	41,782,998.60	0.64
33	688085	三友医疗	1,055,076	40,894,745.76	0.63
34	002156	通富微电	1,624,517	38,526,924.90	0.59
35	600276	恒瑞医药	319,340	35,593,636.40	0.55
36	300271	华宇软件	1,369,856	32,698,462.72	0.50
37	002624	完美世界	1,099,343	32,430,618.50	0.50
38	603203	快克股份	1,005,001	27,949,077.81	0.43
39	002368	太极股份	841,957	21,983,497.27	0.34
40	300132	青松股份	1,101,398	20,695,268.42	0.32
41	002003	伟星股份	3,000,000	20,460,000.00	0.31
42	603043	广州酒家	503,141	19,486,650.93	0.30
43	603228	景旺电子	640,000	19,296,000.00	0.30
44	300010	豆神教育	1,960,357	19,133,084.32	0.29
45	300674	宇信科技	560,000	19,000,800.00	0.29

46	603338	浙江鼎力	164,006	16,595,767.14	0.26
47	600887	伊利股份	285,000	12,645,450.00	0.19
48	002555	三七互娱	400,000	12,492,000.00	0.19
49	002153	石基信息	400,000	12,436,000.00	0.19
50	688111	金山办公	30,033	12,343,563.00	0.19
51	000651	格力电器	190,100	11,774,794.00	0.18
52	603882	金域医学	86,500	11,082,380.00	0.17
53	603983	丸美股份	209,000	10,911,890.00	0.17
54	688016	心脉医疗	32,780	8,234,336.00	0.13
55	300577	开润股份	319,923	8,168,972.28	0.13
56	300680	隆盛科技	235,849	7,068,728.94	0.11
57	688030	山石网科	160,000	6,048,000.00	0.09
58	002127	南极电商	442,100	6,047,928.00	0.09
59	603583	捷昌驱动	78,260	6,045,585.00	0.09
60	600031	三一重工	152,000	5,316,960.00	0.08
61	603313	梦百合	142,089	4,461,792.77	0.07
62	601100	恒立液压	36,784	4,156,592.00	0.06
63	600546	山煤国际	383,300	3,261,883.00	0.05
64	601336	新华保险	55,900	3,240,523.00	0.05
65	688369	致远互联	40,000	3,072,000.00	0.05
66	600048	保利地产	190,700	3,016,874.00	0.05
67	601088	中国神华	128,500	2,314,285.00	0.04
68	000333	美的集团	22,000	2,165,680.00	0.03
69	300751	迈为股份	3,100	2,098,731.00	0.03
70	000725	京东方A	292,900	1,757,400.00	0.03
71	600660	福耀玻璃	35,000	1,681,750.00	0.03
72	600346	恒力石化	46,400	1,297,808.00	0.02
73	300760	迈瑞医疗	2,800	1,192,800.00	0.02
74	600309	万华化学	12,900	1,174,416.00	0.02
75	600176	中国巨石	58,100	1,159,676.00	0.02

76	300146	汤臣倍健	45,000	1,086,750.00	0.02
77	002304	洋河股份	4,300	1,014,757.00	0.02
78	300348	长亮科技	53,100	1,008,900.00	0.02
79	002230	科大讯飞	22,900	935,923.00	0.01
80	300596	利安隆	22,600	887,728.00	0.01
81	600570	恒生电子	8,400	881,160.00	0.01
82	002597	金禾实业	27,100	878,853.00	0.01
83	000858	五粮液	3,000	875,550.00	0.01
84	300999	金龙鱼	9,877	872,040.33	0.01
85	002601	龙蟒佰利	27,800	855,406.00	0.01
86	688981	中芯国际	14,600	843,150.00	0.01
87	002607	中公教育	22,300	783,399.00	0.01
88	300144	宋城演艺	42,600	754,872.00	0.01
89	600547	山东黄金	29,820	704,348.40	0.01
90	002714	牧原股份	8,800	678,480.00	0.01
91	600754	锦江酒店	13,000	669,890.00	0.01
92	001914	招商积余	29,700	639,441.00	0.01
93	601688	华泰证券	35,500	639,355.00	0.01
94	300523	辰安科技	19,350	631,390.50	0.01
95	300347	泰格医药	3,450	557,554.50	0.01
96	000661	长春高新	1,200	538,692.00	0.01
97	000921	海信家电	37,000	533,170.00	0.01
98	601939	建设银行	83,800	526,264.00	0.01
99	603596	伯特利	15,000	513,300.00	0.01
100	002242	九阳股份	14,100	451,764.00	0.01
101	603658	安图生物	3,000	435,540.00	0.01
102	300451	创业慧康	27,900	377,487.00	0.01
103	002643	万润股份	16,200	352,674.00	0.01
104	688029	南微医学	1,669	307,112.69	0.00
105	601966	玲珑轮胎	8,400	295,428.00	0.00

106	300078	思创医惠	32,500	294,125.00	0.00
107	600030	中信证券	10,000	294,000.00	0.00
108	300896	爱美客	473	285,389.28	0.00
109	300662	科锐国际	5,000	270,500.00	0.00
110	002410	广联达	3,300	259,842.00	0.00
111	002402	和而泰	15,000	259,050.00	0.00
112	603939	益丰药房	2,800	252,532.00	0.00
113	600009	上海机场	3,300	249,678.00	0.00
114	601288	农业银行	60,000	188,400.00	0.00
115	002353	杰瑞股份	4,900	171,500.00	0.00
116	000526	紫光学大	3,000	157,170.00	0.00
117	600837	海通证券	10,000	128,600.00	0.00
118	000001	平安银行	6,500	125,710.00	0.00
119	300036	超图软件	6,500	119,860.00	0.00
120	000895	双汇发展	2,000	93,880.00	0.00
121	688617	惠泰医疗	1,031	76,768.26	0.00
122	300861	美畅股份	821	41,953.10	0.00
123	300919	中伟股份	342	21,036.42	0.00
124	300926	博俊科技	1,801	19,378.76	0.00
125	300192	科德教育	1,000	15,030.00	0.00
126	300900	广联航空	448	14,855.68	0.00
127	300864	南大环境	156	14,172.60	0.00
128	300927	江天化学	1,000	13,390.00	0.00
129	300892	品渥食品	223	13,382.23	0.00
130	300887	谱尼测试	166	12,370.32	0.00
131	300876	蒙泰高新	307	11,242.34	0.00
132	300879	大叶股份	409	11,092.08	0.00
133	300890	翔丰华	215	10,502.75	0.00
134	300910	瑞丰新材	208	9,956.96	0.00
135	300894	火星人	266	9,834.02	0.00

136	300891	惠云钛业	562	9, 216. 80	0. 00
137	300908	仲景食品	139	8, 401. 16	0. 00
138	300884	狄耐克	247	8, 276. 97	0. 00
139	300907	康平科技	283	7, 598. 55	0. 00
140	300893	松原股份	212	7, 436. 96	0. 00
141	300889	爱克股份	237	7, 138. 44	0. 00
142	300898	熊猫乳品	200	6, 606. 00	0. 00
143	300925	法本信息	174	6, 495. 42	0. 00
144	300909	汇创达	150	6, 100. 50	0. 00
145	300911	亿田智能	168	5, 554. 08	0. 00
146	300886	华业香料	121	5, 526. 07	0. 00
147	300918	南山智尚	546	4, 881. 24	0. 00
148	300922	天秦装备	152	4, 800. 16	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	000568	泸州老窖	300, 674, 774. 47	2. 47
2	300450	先导智能	286, 934, 567. 09	2. 36
3	002690	美亚光电	239, 049, 084. 89	1. 97
4	601668	中国建筑	209, 564, 327. 49	1. 72
5	300369	绿盟科技	190, 123, 681. 84	1. 56
6	002250	联化科技	160, 441, 056. 27	1. 32
7	600519	贵州茅台	155, 461, 866. 51	1. 28
8	601128	常熟银行	137, 829, 376. 63	1. 13
9	000799	酒鬼酒	125, 012, 500. 60	1. 03
10	600557	康缘药业	113, 690, 064. 49	0. 93
11	300166	东方国信	106, 326, 522. 80	0. 87
12	002600	领益智造	103, 401, 875. 90	0. 85

13	603308	应流股份	102, 402, 473. 67	0. 84
14	002798	帝欧家居	98, 344, 644. 92	0. 81
15	600872	中炬高新	91, 821, 016. 17	0. 76
16	002439	启明星辰	91, 528, 842. 50	0. 75
17	300724	捷佳伟创	91, 230, 259. 58	0. 75
18	300316	晶盛机电	90, 215, 576. 51	0. 74
19	600315	上海家化	89, 967, 886. 44	0. 74
20	000860	顺鑫农业	83, 444, 613. 62	0. 69

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	000568	泸州老窖	862, 451, 463. 51	7. 09
2	600036	招商银行	673, 051, 833. 03	5. 53
3	002304	洋河股份	536, 071, 525. 31	4. 41
4	600352	浙江龙盛	499, 310, 853. 31	4. 11
5	300724	捷佳伟创	468, 095, 370. 03	3. 85
6	000799	酒鬼酒	441, 219, 154. 65	3. 63
7	601318	中国平安	440, 331, 271. 80	3. 62
8	600315	上海家化	412, 786, 584. 09	3. 39
9	600177	雅戈尔	406, 662, 669. 58	3. 34
10	600196	复星医药	356, 418, 669. 19	2. 93
11	000963	华东医药	287, 223, 466. 66	2. 36
12	600585	海螺水泥	251, 176, 609. 04	2. 07
13	002372	伟星新材	238, 235, 716. 51	1. 96
14	002690	美亚光电	209, 076, 549. 51	1. 72
15	600546	山煤国际	206, 717, 971. 03	1. 70
16	002250	联化科技	192, 347, 532. 15	1. 58
17	601166	兴业银行	177, 970, 052. 79	1. 46
18	300166	东方国信	160, 593, 987. 00	1. 32

19	600566	济川药业	159,741,424.96	1.31
20	300450	先导智能	159,692,386.00	1.31

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	4,658,179,497.37
卖出股票收入（成交）总额	11,790,017,868.07

8.5 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。

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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体（除“常熟银行”公告违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。根据常熟银行2020年1月到2020年12月期间发布的公告，常熟银行因承兑汇票业务不真实、虚增存贷款规模、贷款流入房地产市场、投资非标不规范、销售不规范、与票据中介开展票据业务事项，受到银保监局公开处罚。本集合计划管理人此前投资常熟银行发行的股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本集合计划股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。该情况发生后，本集合计划管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本集合计划管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

8.12.2 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。

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	1,061,595.57
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	401,058.89
5	应收申购款	31,482,448.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	32,945,102.59

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划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
48,356	48,766.91	83,973,749.04	3.56%	2,274,199,039.14	96.44%

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	6,688,875.53	0.2836%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 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	6,143,940,435.57
本报告期基金总申购份额	1,435,425,528.04

减: 本报告期基金总赎回份额	5,221,193,175.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,358,172,788.18

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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》，江伟同志新任本集合计划管理人的董事长，龚德雄同志不再担任本集合计划管理人的董事长。

2020年8月29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董事会成员变更事宜的公告》，江伟同志为公司董事和董事长，龚德雄同志不再担任公司董事和董事长职务。喻健同志担任公司董事，聂小刚同志不再担任公司董事职务。经过上述变更，公司现任董事会成员为江伟、蒋忆明和喻健。

2020年9月18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》，胡旭鹏同志不再担任本集合计划管理人的副总裁。

2、本报告期内本集合计划托管人的专门集合计划托管部门重大人事变动如下：

2020年7月，中国光大银行股份有限公司聘任李守靖先生担任资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 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。

11.5 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。本集合计划本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊合伙）的报酬为4万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为2年。

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	16,397,218,712.15	100.00%	11,991,296.91	100.00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期内，本集合计划无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划2019年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2020-01-20
2	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	上海证券报	2020-01-20
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-02-27

	明混合型集合资产管理计划增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告		
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得明混合型集合资产管理计划增加中国银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-03-24
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得明混合型集合资产管理计划增加兴业银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-03-24
6	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-03-24
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得明混合型集合资产管理计划增加江苏银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-03-25
8	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划2019年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2020-03-30
9	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划年度报告提示性公告	上海证券报	2020-03-30
10	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、证监会指定网站、公司官网	2020-04-17
11	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划2020年第1季度报告	证监会指定网站、公司官网	2020-04-21

12	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	上海证券报	2020-04-21
13	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得明混合型集合资产管理计划增加北京肯特瑞基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-05-14
14	中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部”	中国证监会指定的媒介	2020-04-15
15	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划招募说明书更新（2020年第1号）	证监会指定网站、公司官网	2020-07-02
16	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划招募说明书（更新）摘要（2020年第1号）	证监会指定网站、公司官网	2020-07-02
17	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划资产管理合同	证监会指定网站、公司官网	2020-07-02
18	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划托管协议	证监会指定网站、公司官网	2020-07-02
19	关于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的公告	证监会指定网站、公司官网	2020-07-02
20	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划2020年第二季度报告	证监会指定网站、公司官网	2020-07-21
21	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	上海证券报	2020-07-21
22	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下集合资产	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-08-12

	管理计划投资托管行关联方承销期内承销证券的公告		
23	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划2020年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2020-08-28
24	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划中期报告提示性公告	上海证券报	2020-08-28
25	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2020-08-28
26	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、证监会指定网站、公司官网	2020-08-29
27	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、证监会指定网站、公司官网	2020-09-18
28	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下参公大集合变更简称的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-09-25
29	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2020-09-29
30	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配隆盛科技（300680）非公开发行A股的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-10-27
31	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划2020年第三季度报告	证监会指定网站、公司官网	2020-10-28
32	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	上海证券报	2020-10-28

33	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配开润股份（300577）非公开发行A股的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-11-25
34	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配通富微电（002156）非公开发行A股的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-11-26
35	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配梦百合（603313）非公开发行A股的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2020-12-04
36	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划更新招募说明书（2020年第2号）	证监会指定网站、公司官网	2020-12-25
37	国泰君安君得明混合型集合资产管理计划产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2020-12-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于同意国泰君安明星价值股票集合资产管理计划合同变更的函；
- 2、《国泰君安君得明混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得明混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得明混合型集合资产管理计划招募说明书》
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、集合计划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>。

13.3 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

二〇二一年三月三十日