

国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划

2020年第3季度报告

2020年09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

报告送出日期:2020年10月27日

§ 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及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责任。

集合计划托管人根据本集合计划合同规定，于2020年10月23日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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7月1日起至2020年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国君资管君得鑫2年期混合
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
报告期末基金份额总额	4,245,389,210.87份
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%×沪深300指数收益率+30%×一年期银行定期存款利率+10%×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。
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	
下属分级基金的基金简称	国君资管君得鑫2年期混合A	国君资管君得鑫2年期混合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	1,179,614,010.78份	3,065,775,200.09份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年07月01日 - 2020年09月30日)	
	国君资管君得鑫2年期混合A	国君资管君得鑫2年期混合C
1. 本期已实现收益	138,375,605.83	348,823,994.26
2. 本期利润	214,055,567.46	459,708,101.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1697	0.1509
4. 期末基金资产净值	2,526,267,737.72	6,593,150,306.31
5. 期末基金份额净值	2.1416	2.1506

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国君资管君得鑫2年期混合A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.47%	1.43%	5.89%	1.05%	1.58%	0.38%
过去六个月	35.32%	1.24%	14.54%	0.88%	20.78%	0.36%
自基金合同生效起至今	25.17%	1.53%	5.17%	1.06%	20.00%	0.47%

国君资管君得鑫2年期混合C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.65%	1.43%	5.89%	1.05%	1.76%	0.38%

过去六个月	35.77%	1.24%	14.54%	0.88%	21.23%	0.36%
自基金合同生效起至今	24.33%	1.39%	7.76%	1.01%	16.57%	0.38%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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： 1、本基金合同于 2020 年 1 月 6 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。
2、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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	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。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划与本管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期内，未发现本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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度国内复工复产持续进行，大多数行业都从疫情的冲击中逐渐恢复正常。权益市场在7月份甚至经历了一轮明显的估值修复过程。在疫情控制良好的前提下，货币政策开始逐渐恢复正常。

在疫苗大规模使用之前，国内外的疫情都面临着反复发酵的风险。国内控制得当，生产恢复较为充分，成为全球的产品供应中心。

三季度我们的组合继续围绕产业升级和消费升级两个方向调整持仓，根据个股的估值和成长空间进行仓位之间的调整，我们始终坚定持有竞争格局占优的细分行业龙头，伴随优质公司共同成长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国君资管君得鑫2年期混合A基金份额净值为2.1416元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.47%，同期业绩比较基准收益率为5.89%；截至报告期末国君资管君得鑫2年期混合C基金份额净值为2.1506元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.65%，同期业绩比较基准收益率为5.89%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,236,322,057.09	89.51
	其中：股票	8,236,322,057.09	89.51
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	944,686,778.68	10.27
8	其他资产	20,257,278.54	0.22
9	合计	9,201,266,114.31	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	32,452,000.00	0.36
C	制造业	5,771,185,258.76	63.28
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	79,959,403.91	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	56,797,252.00	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,047,771,419.90	11.49
J	金融业	328,628,400.00	3.60
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	111,661,709.64	1.22
N	水利、环境和公共设施管理业	14,423.76	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,273,600.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	7,440,743,467.97	81.59

5.2.2 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(%)
非日常生活消费品	12,748,469.76	0.14
日常消费品	156,192,480.00	1.71
金融	342,004,853.76	3.75
医疗保健	81,712,172.80	0.90
电信服务	173,874,523.20	1.91
地产业	29,046,089.60	0.32
合计	795,578,589.12	8.72

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000568	泸州老窖	5,120,000	734,976,000.00	8.06
2	600352	浙江龙盛	52,000,000	706,680,000.00	7.75
3	002690	美亚光电	13,831,568	663,223,685.60	7.27
4	300450	先导智能	10,839,767	524,536,325.13	5.75
5	002250	联化科技	16,500,000	407,385,000.00	4.47
6	000799	酒鬼酒	4,879,963	401,864,953.05	4.41
7	300724	捷佳伟创	3,660,000	384,592,800.00	4.22
8	300369	绿盟科技	17,699,907	340,369,211.61	3.73
9	300166	东方国信	24,649,950	322,421,346.00	3.54
10	002372	伟星新材	17,400,000	278,226,000.00	3.05

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	826,956.39
2	应收证券清算款	17,095,654.32
3	应收股利	2,032,776.49
4	应收利息	200,413.53
5	应收申购款	101,477.81

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	20,257,278.54

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	国君资管君得鑫2年期 混合A	国君资管君得鑫2年期 混合C
报告期期初基金份额总额	1,413,511,927.85	3,018,900,472.00
报告期期间基金总申购份额	-	46,874,728.09
减：报告期期间基金总赎回份额	233,897,917.07	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,179,614,010.78	3,065,775,200.09

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

单位：份

	国君资管君得鑫2年期 混合A	国君资管君得鑫2年期 混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	86,714,649.09
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	86,714,649.09
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	2.04

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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、《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划管理合同》；
- 3、《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- 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。

9.2 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>。

9.3 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

2020年10月27日