

国泰君安君得悦股票集合资产管理计划

2019年第3季度报告

重要提示

集合计划管理人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2019年10月18日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年7月1日起至2019年9月30日止。

一、集合资产管理计划简介

(一) 基本资料

集合计划名称:	国泰君安君得悦股票集合资产管理计划
成立日期:	2013年2月28日
成立规模:	217,465,540.96
集合计划管理人:	上海国泰君安证券资产管理有限公司
集合计划托管人:	中国建设银行股份有限公司

(二) 管理人

法定名称: 上海国泰君安证券资产管理有限公司

办公地址: 上海市浦东新区东园路111号2楼

法定代表人: 龚德雄

电话: 021-38676631

传真: 021-38871190

联系人: 李艳

(三) 托管人

名称：中国建设银行股份有限公司
 办公地址：北京市西城区金融大街25号
 法定代表人：田国立
 电话：010-67595017
 信息披露人：田青

二、主要财务指标

(一) 主要财务指标

下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。

期间数据和指标	2019年7月1日-2019年9月30日
本期利润	953,190.32
加权平均基金份额本期利润	0.1289
本期加权平均净值利润率	0.0803
本期基金份额净值增长率	8.39%
期末数据和指标	2019年9月30日
期末可供分配利润	4,896,563.52
期末可供分配基金份额利润	0.6656
期末基金资产净值	12,252,664.03
期末基金份额净值	1.666
累计期末指标	2019年9月30日
基金份额累计净值增长率	164.84%

(二) 财务指标的计算公式

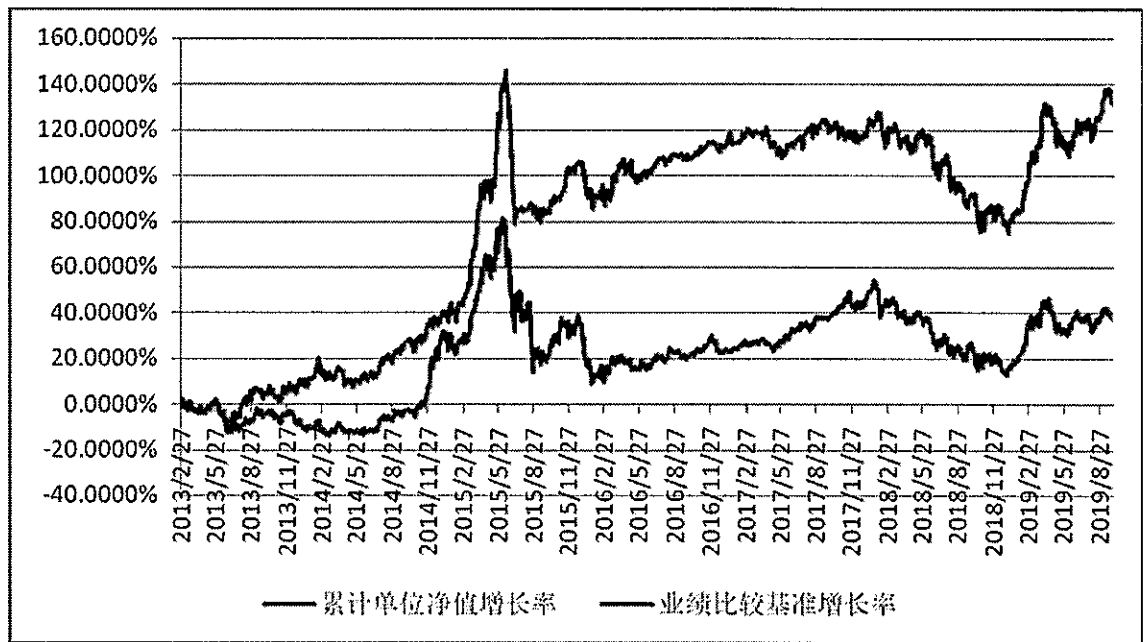
- 1、期末单位集合计划资产净值=期末集合计划资产净值÷集合计划份额
- 2、累计单位集合计划资产净值=期末单位集合计划资产净值+单位集合计划已分红收益
- 3、本期单位基金净值增长率=(本期第一次分红或扩募前单位基金资产净值÷期初单位基金资产净值)×(本期第二次分红或扩募前单位基金资产净值÷本期第一次分红或扩募后单位基金资产净值)×……×(期末单位基金资产净值÷本期最后一次分红或扩募后单位基金资产净值)-1

4、单位基金累计净值增长率=(第一年度单位基金资产净值增长率+1)×(第二年度单位基金资产净值增长率+1)×(第三年度单位基金资产净值增长率+1)×……×(上年度单位基金资产净值增长率+1)×(本期单位基金资产净值增长率+1)-1

三、价值变动情况

(一)自集合计划合同生效以来集合计划份额净值的变动情况。

集合计划累计份额净值增长率历史走势图



四、报告期内资产运作情况

(一)业绩表现

截至2019年9月30日，集合计划单位净值为1.666元，本期净值增长率为8.39%，集合计划累计净值增长率为164.84%。

(二)投资经理简介

李根

8年证券从业经验，天津大学管理学博士，金融工程学方向。曾任国泰君

安证券资产委托管理总部、上海国泰君安证券资产管理有限公司宏观策略研究员，负责大类资产配置与仓位建议；擅长自上而下宏观判断，主动结合量化策略研究。现任国泰君安、“君得悦”、君享同利系列、君享智选系列投资经理。

投资经理变更情况：

无

（三）投资经理工作报告

当前经济有下行压力，但是预期稳定的局面可以维持，同时资金宽松局面将持续。7-8月，工业生产平均增速4.6%，2季度为5.6%，工业领域有一定下行压力。但是，地产数据韧性较强，7月8月房地产销售小幅回暖，销售额累计增速从5.6%上升到6.7%，同时房地产投资保持稳定。基建投资8月份增长3.9%，呈现回升态势，将给固定资产投资带来很大的韧性。欧美依次降息之下，国内货币政策短期显示出更多独立性，降息慎重，但是四季度国内经济和全球宏观仍有下行压力，国内降息趋势不变，预计MLF降息不远。PPI进一步下行，预计政策托底力度只能继续增强，流动性宽松的局面将继续维持。中美贸易战波折，但对股市影响逐步下降。

当前宏观层面呈现增长偏弱但有韧性、资金偏宽松的局面，同时权益市场呈现整体偏便宜的局面，预计系统性风险不大、结构性机会突出。这种环境下，中观、微观的基本面亮点、估值和业绩比较匹配的领域和个股仍将得到市场资金的追逐，呈现较好的结构性机会。因此权益投资将保持积极心态，寻找结构性机会。

资产管理计划收益分配情况：

无

（四）内部监察报告

1、集合计划运作合规性声明

在本报告期内，本管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《国泰君安君得悦股票集合资产管理计划合同》、《国泰君安君得悦股票集合资产管理计划说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划财产。本报告期内，产品运作合法合规，没有发生损害产品份额持有人利益的行为。

2、内部监察报告

2019年第三季度，公司持续完善合规管理制度体系，扎实推进合规文化建设，全面有效地开展合规审查与检查工作，进而提升合规与风控管理工作的质量和实效，确保公司各项业务和日常经营合规、平稳和高效运行。

（一）扎实推进合规文化建设

2019年第三季度，公司通过组织外部律师或内部法务人员授课、合规风控岗培训、全员合规考试、重要法规政策解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种方式，确保常态化的合规文化建设机制正常运行，使得公司广大员工守法合规和诚实守信的意识得到提高，逐步从思想意识上筑起合规防火墙，有效推动了“全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”企业合规文化理念的树立，为公司业务的规范和健康发展提供良好的文化土壤。

（二）完善公司合规管理制度体系

根据法规新变化、结合行业新动态、围绕业务新需要，适时组织更新合规管理制度，不断优化内控环节，合规管理制度体系进一步完善，业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性都明显提升，为公司规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

（三）全面有效开展日常合规管理

1、合规法务审查

依照法律法规、监管要求及公司制度规定，从法律合规角度向公司各大业务板块和职能部门提供全面支持和服务保障，并对新业务、新产品、重大决策事项从管理程序、潜在风险和防控措施等方面提出法律合规审查意见、提供相关法务咨询解答，确保公司各项的业务能够合法合规开展。

2、员工执业与投资行为管理

督促新员工入职时完善基本信息、完成相关申报工作，根据法律法规及公司制度进行投资申报。对投资管理人员通讯工具集中管理予以督促且定期检查，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执行合规检查。通过常态化的员工执业和投资行为合规管理机制，促使员工执业和投资行为持续符合监管要求。

3、反洗钱合规管理

本年度开展日常可疑交易监控排查、协助开展客户风险等级划分、修订反洗钱

内控管理制度等工作，完成2019年第三季度反洗钱工作报告，开展2019年第三季度反洗钱金融机构分类评级自评工作，持续跟进反洗钱系统改造，制定了反洗钱工作方案并在年度内按照工作方案持续推进落实。

（四）加强合规检查

按照法律法规以及监管机构的要求，定期对公司各业务部门执行制度的情况进行合规检查，查漏补缺、排查隐患、防范潜在风险。并就合规检查发现问题与相关部门制定整改方案；同时加大整改跟踪力度和调整跟进方法。合规检查工作促进了公司内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

五、集合计划投资组合报告

（一）集合计划财务报表

1、集合计划资产负债表

单位：人民币元

资产	本期末 2019年9月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	1,482,883.05	252,808.48
结算备付金	1,612.61	389,306.48
存出保证金	1,410.94	2,798.76
交易性金融资产	11,035,280.83	8,169,880.38
其中：股票投资	10,542,345.56	7,798,368.72
债券投资	0.00	0.00
基金投资	492,935.27	371,511.66
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	296.72	101.64
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	12,521,484.15	8,814,895.74

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债及持有人权益	2019年9月30日	2018年12月31日
----------	------------	-------------

负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	12,287.06	9,105.17
应付托管费	2,559.82	1,896.90
应付投资咨询费	0.00	0.00
应付交易费用	178,092.44	169,227.79
应交税费	60,923.13	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	14,957.67	20,000.00
负债合计	268,820.12	200,229.86
所有者权益：		
实收基金	7,356,100.51	7,646,113.12
未分配利润	4,896,563.52	968,552.76
持有人权益合计	12,252,664.03	8,614,665.88
负债及持有人权益总计	12,521,484.15	8,814,895.74

2、损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计
一、收入	1,031,227.98	4,305,285.38
1、利息收入	2,598.30	9,021.66
其中：存款利息收入	2,598.30	9,021.66
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券资产收入	0.00	0.00
2、投资收益（损失以“-”填列）	792,814.46	1,687,098.22
其中：股票投资收益	689,361.27	1,505,450.35
债券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	0.00	0.00
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	103,453.19	181,647.87
其他收益	0.00	0.00
3、公允价值变动收益（损失以“-”	235,815.22	2,609,104.96

填列)		
4、汇兑损益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5、其他收入（损失以“-”填列）	0.00	60.54
二、费用	78,037.66	206,355.59
1、管理人报酬	35,957.46	100,415.27
2、托管费	7,491.13	20,919.81
3、客户服务费	0.00	0.00
4、交易费用	5,666.97	15,116.77
5、利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
6、其他费用	28,922.10	69,903.74
三、净利润	953,190.32	4,098,929.79

（二）投资组合报告

1、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	期末市值（元）	占净值比例
1	002583	海能达	70,900.00	727,434.00	5.94%
2	000651	格力电器	10,900.00	624,570.00	5.10%
3	600803	新奥股份	59,379.00	621,698.13	5.07%
4	000963	华东医药	23,640.00	619,368.00	5.05%
5	300244	迪安诊断	25,200.00	617,652.00	5.04%
6	600352	浙江龙盛	43,909.00	617,360.54	5.04%
7	300271	华宇软件	27,700.00	602,475.00	4.92%
8	601336	新华保险	11,980.00	583,066.60	4.76%
9	600583	海油工程	105,731.00	569,890.09	4.65%
10	600036	招商银行	15,800.00	549,050.00	4.48%

（三）重大关联交易状况

证券期货经营机构董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与证券期货经营机构设立的资产管理计划，证券期货经营机构

应当向投资者进行披露，对该资产管理计划账户进行监控，并及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

2019年3季度末关联方持有本集合计划数据

产品代码	份额
952032	1,102,287.09

(四) 两费及业绩报酬情况

项目	计提基准或费率	计提方式	支付频率
管理费	1.20%	每日计提	按月
托管费	0.25%	每日计提	按月
业绩报酬	0	分红和退出	发生时支付

(五) 远期交易情况说明

无

(六) 投资组合报告附注

1、报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、集合计划投资的前十名证券中，没有投资于超出集合计划合同规定可投资证券库之外的。

六、资产配置情况

(一) 期末集合计划资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占总资产比例
1	权益投资	10,542,345.56	84.19%
	其中：股票	10,542,345.56	84.19%
2	基金投资	492,935.27	3.94%
3	固定收益投资	0.00	0.00%
	其中：债券	0.00	0.00%

	资产支持证券	0.00	0.00%
4	贵金属投资	0.00	0.00%
5	金融衍生品投资	0.00	0.00%
6	买入返售金融资产	0.00	0.00%
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00%
7	银行存款和结算备付金合计	1,484,495.66	11.86%
8	其他各项资产	1,707.66	0.01%
9	合计	12,521,484.15	100.00%

注：在以上表格中由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

(二) 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,410.94
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	296.72
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	固定收益	0.00
9	合计	1,707.66

七、集合计划份额变动

单位：份

期初集合计划份额总额	7,554,327.31
期间集合计划参与份额	0.00
期间集合计划退出份额	198,226.80
期末集合计划份额总额	7,356,100.51

八、重要事项提示

无

九、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会核准集合计划募集的无异议函；
- 2、《国泰君安君得悦股票集合资产管理计划资产管理合同》；

- 3、《国泰君安君得悦股票集合资产管理计划集合计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得悦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。

(二)存放地点及查阅方式

文件存放地点：上海市浦东新区东园路111号2楼

网址：<http://www.gtjazg.com>

信息披露电话：021-38676631

联系人：李艳

EMAIL：liyan016199@gtjas.com

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

