

# 国泰君安君得悦股票集合资产管理计划

## 2019年第4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2020年1月17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10月1日起至2019年12月31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02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	本期
	2019年10月01日 - 2019年12月31日
本期利润	953,341.26
加权平均基金份额本期利润	0.1296
本期加权平均净值利润率	7.59%
本期基金份额净值增长率	7.74%
期末数据和指标	2019年12月31日
期末可供分配利润	5,849,904.78
期末可供分配基金份额利润	0.7952
期末基金资产净值	13,206,005.29
期末基金份额净值	1.795
累计期末指标	2019年12月31日

基金份额累计净值增长率	185.35%
-------------	---------

(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，并与同期业绩比较基准的变动的比较

国泰君安君得悦股票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对比图

(2013年02月28日-2019年12月31日)



— 君得悦 — 业绩比较基准

## 四、报告期内资产运作情况

### (一) 业绩表现

截至2019年12月31日，集合计划单位净值为1.7950元，本期净值增长率为7.74%，集合计划累计增长率为185.35%。

### (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“明星价值”、“君得悦”、君享同利系列、君享智选系列投资经理。

### (三) 投资经理工作报告

2019年四季度，随着中美就第一阶段贸易协议达成一致，投资者信心得到提振。通胀CPI在四季度出现显著上行，但鉴于经济增长总体偏弱，且物价上行主要由猪价上涨拉动，央行小幅下调了公开市场利率。资金面方面，MSCI指数进一步提高A股纳入权重及陆港通北向资金持续流入为A股市场提供了增量资金。

展望后市，我们认为中美第一阶段贸易协议的达成将有助于缓解投资者担忧情绪，但中美之间贸易关系的协调和平衡仍是一个长期的过程。国内经济增长短期虽在放缓，但仍然体现了较强的韧性，制造业PMI也出现了小幅的回升。消费升级、国产替代、结构性改革等进程仍将驱动中国经济稳健增长。在此过程中将有大量优秀企业持续扩大市场份额及提升盈利水平。我们将基于盈利与估值的匹配度选择风险收益比具有吸引力的公司进行配置，行业与风格方面继续保持稳健、均衡的原则，通过自下而上精选投资标的，努力为投资者创造合理的投资回报。

投资经理变更情况：

无

资产管理计划收益分配情况

无

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	上年度末
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,371,944.69	252,808.48
结算备付金	7,426.75	389,306.48
存出保证金	1,166.71	2,798.76
交易性金融资产	12,110,730.77	8,169,880.38
其中：股票投资	12,110,730.77	7,798,368.72
基金投资	-	371,511.66
债券投资	-	-
权证投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融工具	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	306.03	101.64
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
其他资产	-	-
<b>资产合计</b>	<b>13,491,574.95</b>	<b>8,814,895.74</b>
<b>负债及持有人权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

	2019年12月31日	2018年12月31日
<b>负 债:</b>		
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	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	13,015.99	9,105.17
应付托管费	2,711.68	1,896.90
应付投资咨询费	-	-
应付交易费用	182,842.69	169,227.79
应交税费	66,999.30	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
其他负债	20,000.00	20,000.00
<b>负债合计</b>	<b>285,569.66</b>	<b>200,229.86</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7,356,100.51	7,646,113.12
未分配利润	5,849,904.78	968,552.76
<b>持有人权益合计</b>	<b>13,206,005.29</b>	<b>8,614,665.88</b>
<b>负债及持有人权益总计</b>	<b>13,491,574.95</b>	<b>8,814,895.74</b>

2. 损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计
<b>一、收入</b>	1,038,535.85	5,343,821.23
1. 利息收入	2,664.51	11,686.17
其中：存款利息收入	2,664.51	11,686.17
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售证券资产收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	809,083.65	2,496,181.87
其中：股票投资收益	718,858.42	2,224,308.77
债券投资收益	--	-
基金投资收益	90,225.23	90,225.23
权证投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	181,647.87
其他收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	226,787.69	2,835,892.65
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	60.54
<b>二、费用</b>	85,194.59	291,550.18
1. 管理人报酬	37,929.30	138,344.57
2. 托管费	7,901.93	28,821.74
3. 客户服务费	-	-
4. 交易费用	7,157.92	22,274.69

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	32,205.44	102,109.18
三、净利润	953,341.26	5,052,271.05

## (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	资产代码	资产名称	数量（股/张）	期末市值（元）	占净值比例
1	000651	格力电器	15,100.00	990,258.00	7.50%
2	002353	杰瑞股份	19,200.00	709,632.00	5.37%
3	300724	捷佳伟创	18,700.00	708,543.00	5.37%
4	601336	新华保险	13,880.00	682,202.00	5.17%
5	002048	宁波华翔	43,000.00	664,780.00	5.03%
6	600036	招商银行	17,100.00	642,618.00	4.87%
7	600352	浙江龙盛	43,909.00	635,363.23	4.81%
8	600803	新奥股份	59,379.00	631,792.56	4.78%
9	300244	迪安诊断	28,000.00	619,640.00	4.69%
10	002583	海能达	70,900.00	596,269.00	4.52%

### 2. 报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的其他投资明细

无

## (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4季度末关联方持有本集合计划数据

产品代码	期间份额变动情况	期末持有份额
952032	-	1,300,315.89

(四) 两费及业绩报酬情况

项目	当前费率	计提方式	支付方式
管理费	1.20%	每日计提	按月
托管费	0.25%	每日计提	按月

项目	当前计提基准	计提比例	计提方式	支付方式
业绩报酬	0%	20%	分红或退出时 计提	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、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。

2、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。

六、 资产配置情况

(一) 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	12,110,730.77	89.77
	其中：股票	12,110,730.77	89.77
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	1,379,371.44	10.22
8	其他各项资产	1,472.74	0.01
9	合计	13,491,574.95	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
1	存出保证金	1,166.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	306.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,472.74

## 七、 集合计划份额变动

单位：份

期初集合计划份额总额	7,356,100.51
报告期内集合计划总申购份额	-
报告期内集合计划总赎回份额	-
报告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](mailto: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

