

# 国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划

2021 年第 1 季度报告

2021 年 03 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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2021 年 04 月 22 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2021年4月16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2021年1月28日（集合计划合同变更生效日）起至2021年3月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 国君资管君得盈债券   |
| 场内简称       | 国君资管君得盈债券   |
| 基金主代码      | 952020  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2021年01月28日   |
| 报告期末基金份额总额 | 482,193,588.19份   |
| 投资目标       | 本集合计划以固定收益品种为主要投资对象，在以资产安全性为优先考虑的前提下，力争获取风险控制下更高的稳健收益。  |
| 投资策略       | <p>本集合计划将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将集合计划资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。</p> <p>本集合计划将在稳健的资产配置策略基础上，根据</p> |

股票的运行状况和收益预期，在严格控制风险的基础上，积极并适时适度地参与权益类资产配置，把握市场时机力争为集合计划资产获取增强型回报。

## 2、固定收益品种投资策略

本集合计划将采取利率策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。

本集合计划投资的信用债券（不包括可转换债券、可交换债券、可分离交易债券）经国内信用评级机构认定的债项评级或主体评级须在AA（含AA）以上，其中投资于评级AA的信用债比例不超过集合计划信用债资产的30%（评级AA的同一信用债券不超过集合计划信用债资产的3%）；投资评级AA+的信用债比例不超过集合计划信用债资产的50%；投资评级AAA的信用债比例不低于集合计划信用债资产的50%。上述评级为该债券的最新债项评级（不含中债资信），无债项评级或者债项评级为A-1的以主体评级为准。

### （1）利率策略

通过全面研究GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本集合计划将根据对市场利率变化趋势的预期，制定出组合的目标久期：预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

### （2）信用策略

根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差。

债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息，同时需要考虑企业的经营环境等外部因素，着重分析企业未来的偿债能力，评估其违约风险水平。

### (3) 债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，主要选择定价合理或价值被低估的企业（公司）债券进行投资。

### (4) 可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略

可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性。本集合计划将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的上述债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。本集合计划持有的上述债券可以转换为股票。

### (5) 资产支持证券投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本集合计划将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

### 3、杠杆投资策略

在利率风险和流动性风险可控情况下，通过回购融资形式来获取息差收益，或更大程度博取价差收益的投资策略。

### 4、国债期货投资策略

在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，

|                 |   |                 |
|-----------------|---|-----------------|
|                 | <p>以达到降低投资组合整体风险的目的。</p> <p>5、股票投资策略</p> <p>本集合计划主要侧重于沪深300成分股、上证50成分股以及部分高分红标的股票，将采用自下而上和自上而下相结合的分析方法进行投资，根据上市公司所处行业的前景、公司本身竞争力和成长性、治理结构和财务健康状况等因素，再结合股票的价值评估，以及对公司经营有实质性影响的事件，精选个股，构建投资组合。首先，选择竞争格局较好的行业。其次，从公司商业模式、创新能力、成本控制、公司治理等多方面评估公司在行业内的竞争力。再次对公司财务状况、盈利质量、成长能力、估值评估等方面进行综合评估，选择盈利能力强、财务健康、成长性好、估值较低或合理的公司。</p> <p>本集合计划将采用定性与定量相结合的方法，对公司股价的驱动要素进行建模，考虑公司财务基本面、发展预期、交易特征等各个层面的因素，综合评估股价的增值潜力。选股要素包括成长性、估值、重大事项、流动性等等。在做好选股的基础上，本集合计划还将根据宏观经济周期、市场流动性变化、市场情绪波动的分析，结合股票组合的净值波动情况，优化股票组合的风格特征，把股票组合对集合计划整体波动率的影响控制在合理范围。</p> |                 |
| 业绩比较基准          | 中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深300指数收益率×10%   |                 |
| 风险收益特征          | 本集合计划为债券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，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划，属于中低风险/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     | 国君资管君得盈债券A  | 国君资管君得盈债券C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 952020  | 952320          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 210,135,935.91份   | 272,057,652.28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(2021年01月28日 - 2021年03月31日) |                |
|-----------------|--------------------------------|----------------|
|                 | 国君资管君得盈债券A                     | 国君资管君得盈债券C     |
| 1. 本期已实现收益      | 315,407.53                     | 288,095.74     |
| 2. 本期利润         | 299,945.43                     | 393,864.60     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0032                         | 0.0022         |
| 4. 期末基金资产净值     | 211,108,190.47                 | 273,255,040.00 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0046                         | 1.0044         |

注：本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，国君资管君得盈债券C类份额首次确认日为2021年3月9日。

#### 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

国君资管君得盈债券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    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.16%  | 0.05%     | -0.42%     | 0.17%         | 0.58% | -0.12% |

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日。

国君资管君得盈债券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    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.18%  | 0.06%     | 0.25%      | 0.15%         | -0.07% | -0.09% |

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，国君资管君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

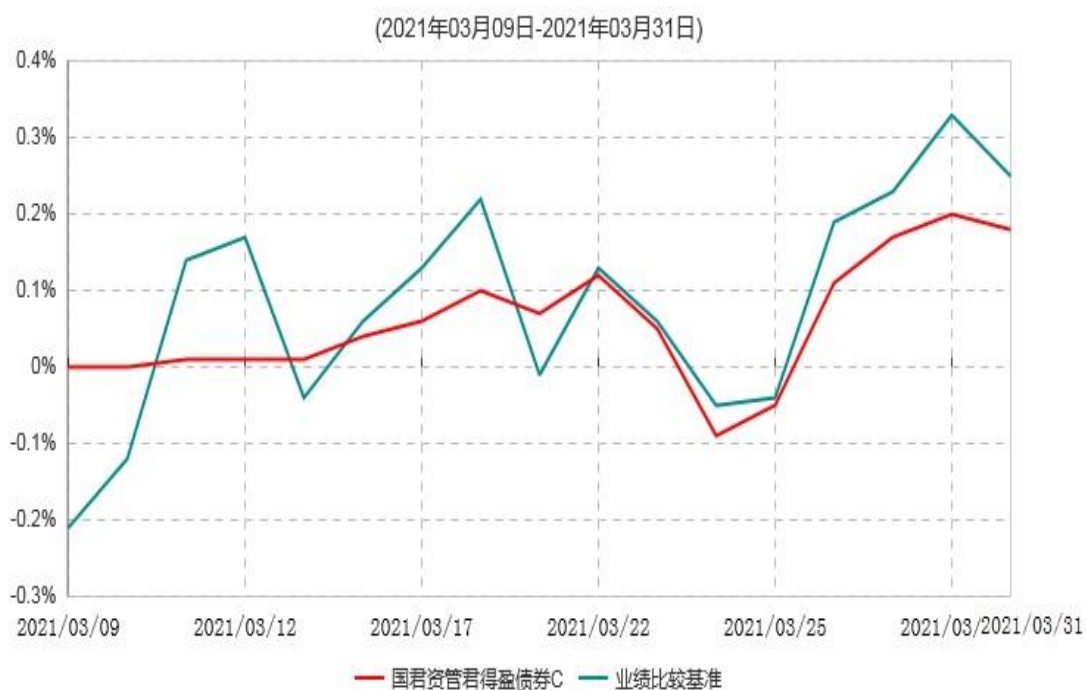
##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国君资管君得盈债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日。

国君资管君得盈债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，国君资管君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

## § 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 |        |  |
| 杜浩然 | 本产品的投资经理，国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利一号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得惠债券集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利二号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安现金管家货币集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得金债券分级专项资产管理计划投资经理，国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划投资经理。 | 2021-01-28  | -    | 6年     | 复旦大学金融硕士。2014年7月至2020年5月任国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部助理投资经理、投资经理。2017年9月起任国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划投资经理。2018年6月起任国泰君安君得利一号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得惠债券集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利二号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划投资经理。2018年11月起任国泰君安现金管家货币集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得金债券分级专项资产管理计划投资经理。2018年12月起任国泰君安君得稳一号投资经理（于2020年03月25日更名为国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划）。2020年9月28日起任国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划投资经理。2021年1月28日起任国泰君安君得盈 |



|    |   |            |   |      |   |
|----|---|------------|---|------|---|
|    |   |            |   |      | (原国泰君安君得惠二号) 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产管理计划、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的投资经理。 | 2021-01-28 | - | 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。2021年1月28日起任国泰君安君得盈（原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

1季度基本面继续处于复苏的通道中。虽然2020年4季度海外疫情有一定的反复，但疫苗在全球开始快速推进，欧美等国家新增疫情得到了很大遏制。国内层面，春节期间以电影为代表的娱乐消费恢复好，春节之后“原地过年”推动快速复工，海外出口数据良好。经济上行过程中市场在逐步反应随之而来的中长期利率上行预期。以美债10年利率为代表，在一季度末逐步上行到1.7%左右，回到了2020年1季度疫情之前的水平。利率的上行导致了部分高估值权益类资产的波动，传导机制是远期折现率的上行，这是1季度权益市场表现疲软的主要原因。不过，值得关注的是，1季度国内债券市场本身波澜不惊，因此可以判断美债利率的上行更多是来自基本面修复的跟随反应，本质上没有超出市场的预期。权益市场的波动可能来自于部分资产高估值情况下自发的再平衡过程。

本报告期内，本集合计划规模出现了一定变动，但是整体的权益、债券仓位变动并不大。对于2021年市场行情，我们前期认为权益大概率从趋势性行情转入震荡市，因此在品种选择上，我们对于转债和股票主要的出发点是短期业绩的确定性以及盈利数据和估值的匹配度。此外，基于2021年上半年企业盈利上行的判断，我们加大了顺周期类转债资产的配置。对于债券市场而言，短期基本面上行，中长期通胀压力可能逐步显现，市场机会有限，维持相对低的仓位。

#### 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盈债券A集合计划份额净值为1.0046元，本报告期内，该类集合计划份额净值增长率为0.16%，同期业绩比较基准收益率为-0.42%；截至报告期末国君资管君得盈债券C集合计划份额净值为1.0044元，本报告期内，该类集合计划份额净值增长率为0.18%，同期业绩比较基准收益率为0.25%。

#### 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              | 13,149,812.00  | 2.59          |
|    | 其中：股票             | 13,149,812.00  | 2.59          |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 467,928,838.74 | 92.08         |
|    | 其中：债券             | 467,928,838.74 | 92.08         |
|    | 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      | 16,416,674.31  | 3.23          |
| 8  | 其他资产              | 10,699,157.02  | 2.11          |
| 9  | 合计                | 508,194,482.07 | 100.00        |

**5.2 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         | -            | -             |
| B  | 采矿业              | -            | -             |
| C  | 制造业              | 7,449,105.00 | 1.54          |
| 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           | 409,315.00   | 0.08          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 719,026.00   | 0.15          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,527,506.00 | 0.52          |
| J  | 金融业              | 1,452,036.00 | 0.30          |
| 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    | -             | -    |
| 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       | -             | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 592,824.00    | 0.12 |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 13,149,812.00 | 2.71 |

### 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  | 000860 | 顺鑫农业 | 29,100 | 1,365,663.00 | 0.28         |
| 2  | 300253 | 卫宁健康 | 62,600 | 1,027,266.00 | 0.21         |
| 3  | 002439 | 启明星辰 | 26,400 | 880,968.00   | 0.18         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 10,200 | 802,740.00   | 0.17         |
| 5  | 603027 | 千禾味业 | 20,800 | 769,600.00   | 0.16         |
| 6  | 603313 | 梦百合  | 22,200 | 752,580.00   | 0.16         |
| 7  | 600872 | 中炬高新 | 15,200 | 736,136.00   | 0.15         |
| 8  | 600004 | 白云机场 | 53,900 | 719,026.00   | 0.15         |
| 9  | 002142 | 宁波银行 | 16,700 | 649,296.00   | 0.13         |
| 10 | 002555 | 三七互娱 | 28,200 | 619,272.00   | 0.13         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 19,904,000.00 | 4.11         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 78,419,000.00 | 16.19        |
|    | 其中：政策性金融债 | 78,419,000.00 | 16.19        |
| 4  | 企业债券      | 46,694,300.00 | 9.64         |
| 5  | 企业短期融资券   | 23,492,000.00 | 4.85         |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 6  | 中期票据      | 272,530,000.00 | 56.27 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 26,889,538.74  | 5.55  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 467,928,838.74 | 96.61 |

#### 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

| 序号 | 债券代码      | 债券名称         | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 200202    | 20国开02       | 700,000 | 68,390,000.00 | 14.12        |
| 2  | 102000621 | 20中油股MTN001  | 300,000 | 29,478,000.00 | 6.09         |
| 3  | 101800883 | 18江岸国资MTN001 | 200,000 | 20,846,000.00 | 4.30         |
| 4  | 101900834 | 19南电MTN005   | 200,000 | 20,140,000.00 | 4.16         |
| 5  | 101901410 | 19光明MTN001   | 200,000 | 20,050,000.00 | 4.14         |

#### 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或在报告编制日前一年受到公开谴责、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   | 807.73        |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 8,896,584.88  |
| 5  | 应收申购款   | 1,801,764.41  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 10,699,157.02 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|--------------|--------------|
| 1  | 127011 | 中鼎转2  | 1,065,969.40 | 0.22         |
| 2  | 113025 | 明泰转债  | 1,008,272.00 | 0.21         |
| 3  | 128097 | 奥佳转债  | 967,482.00   | 0.20         |
| 4  | 128029 | 太阳转债  | 882,314.40   | 0.18         |
| 5  | 113602 | 景20转债 | 872,480.00   | 0.18         |
| 6  | 128113 | 比音转债  | 871,552.00   | 0.18         |
| 7  | 128017 | 金禾转债  | 868,137.60   | 0.18         |
| 8  | 128126 | 赣锋转2  | 842,792.74   | 0.17         |
| 9  | 110043 | 无锡转债  | 834,564.00   | 0.17         |
| 10 | 113504 | 艾华转债  | 832,680.00   | 0.17         |
| 11 | 127012 | 招路转债  | 813,131.60   | 0.17         |
| 12 | 128078 | 太极转债  | 811,684.80   | 0.17         |
| 13 | 128046 | 利尔转债  | 801,870.00   | 0.17         |
| 14 | 113021 | 中信转债  | 799,824.00   | 0.17         |

|    |        |        |            |      |
|----|--------|--------|------------|------|
| 15 | 128119 | 龙大转债   | 790,738.00 | 0.16 |
| 16 | 113024 | 核建转债   | 790,552.00 | 0.16 |
| 17 | 128101 | 联创转债   | 781,682.80 | 0.16 |
| 18 | 128125 | 华阳转债   | 780,763.20 | 0.16 |
| 19 | 113011 | 光大转债   | 780,096.00 | 0.16 |
| 20 | 113012 | 骆驼转债   | 776,448.00 | 0.16 |
| 21 | 128083 | 新北转债   | 767,014.80 | 0.16 |
| 22 | 123058 | 欣旺转债   | 759,769.60 | 0.16 |
| 23 | 128109 | 楚江转债   | 755,978.65 | 0.16 |
| 24 | 110066 | 盛屯转债   | 687,960.00 | 0.14 |
| 25 | 132018 | G三峡EB1 | 415,072.00 | 0.09 |
| 26 | 127005 | 长证转债   | 344,154.00 | 0.07 |
| 27 | 113037 | 紫银转债   | 203,780.00 | 0.04 |

#### 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

|                                    | 国君资管君得盈债券A     | 国君资管君得盈债券C     |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年01月28日)基金份额总额         | 52,306,382.53  | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 215,496,280.73 | 278,931,750.08 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 57,666,727.35  | 6,874,097.80   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额                        | 210,135,935.91 | 272,057,652.28 |

注：本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，国君资管君得盈债券C类份额首次确认日为2021年3月9日。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

## § 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

本集合计划合同变更生效日为2021年1月28日，国君资管君得盈债券C类份额首次确认日为2021年3月9日。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划合同（现为国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划）变更的回函；
- 2、《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得盈债券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。

### 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  
2021年04月22日