

国泰君安君享重阳阿尔法对冲一号限额特定集合资产 管理计

划2021年1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2021年04月16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2021年01月01日起至2021年03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	国泰君安君享重阳阿尔法对冲一号限额 特定集合资产管理计划
成立日期	2012年12月27日
成立规模	79,026,464.60
业绩比较基准	无
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	兴业银行股份有限公司

(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：上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层

法定代表人：江伟

电话：021-38676631

传真：021-38871190

联系人：李艳

(三) 托管人

名称：兴业银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城路167号4楼

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）

电话：021-62677777

信息披露人：吴荣

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 2021年01月01日 - 2021年03月31日
本期利润	618,185.20
加权平均基金份额本期利润	0.0323
本期基金份额净值增长率	1.15%
期末数据和指标	2021年03月31日
期末可供分配利润	34,563,011.68
期末可供分配基金份额利润	1.8152

期末基金资产净值	53,603,850.49
期末基金份额净值	2.815
累计期末指标	2021年03月31日
基金份额累计净值增长率	240.15%

(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

国泰君安君享重阳阿尔法对冲一号限额特定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



四、 报告期内资产运作情况

(一) 业绩表现

截至2021年03月31日，集合计划单位净值为2.815元，本期净值增长率为1.15%，集合计划累计增长率为240.15%。

(二) 投资经理简介

陈蓉

复旦大学金融学硕士；16年证券从业经验；历任国泰君安证券资产管理有限公司高级研究员、高级投资经理等职；现任“君享新利”系列、“君享得盈”系列等产品投资经理。

(三) 投资经理工作报告

本产品2021年一季度累计净值增长1.15%，自本产品运行开始日截至2021年一季度末，本产品份额净值累计增长209.4%。

春节后A股出现明显调整，节前涨幅较大的个股跌幅较大，但市场整体面对的环境并未显著变差。一季度中国经济延续了去年下半年以来的复苏态势，从陆续公布的上市公司盈利数据也能得到体现。与此相对应，利率和流动性环境边际

上出现了偏紧的信号，特别是春节前后的“小钱荒”超出大多数投资者预期，但整体上符合央行“不急转弯”的政策基调。展望二季度，我们认为经济复苏的态势有望延续，但需要关注海外经济复苏对国内企业的影响，特别是后疫情时代海外产能的恢复是否对国内制造业盈利造成负面冲击。我们对流动性环境维持稳定的判断，需要关注央行为应对去年宏观杠杆率上升可能采取的措施。投资策略方面，我们认为目前需要重点考察上市公司业绩与估值的匹配程度，重点发掘未被市场充分发掘的标的。

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
资 产：		
银行存款	4,961,946.88	4,979,805.41
结算备付金	358,142.13	416,278.97
存出保证金	50,617.50	50,607.28
交易性金融资产	49,089,009.41	59,047,399.00
其中：股票投资	49,089,009.41	59,047,399.00
基金投资	-	-
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	545.96	768.71
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
其他资产	-	-
资产合计	54,460,261.88	64,494,859.37
负债及持有人权益	本期末 2021年03月31日	上年度末 2020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	305,286.01	43,748.87
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	69,987.36	81,837.11
应付托管费	4,665.80	5,455.80
应付投资咨询费	-	-
应付交易费用	425,491.83	354,596.45
应交税费	6,049.29	7,108.06
应付利息	-	-
应付利润	-	-
其他负债	44,931.10	40,000.00
负债合计	856,411.39	532,746.29
所有者权益：		

实收基金	19,040,838.81	22,985,784.19
未分配利润	34,563,011.68	40,976,328.89
持有人权益合计	53,603,850.49	63,962,113.08
负债及持有人权益总计	54,460,261.88	64,494,859.37

2. 损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计
一、收入	985,215.57	985,215.57
1. 利息收入	6,230.23	6,230.23
其中：存款利息收入	6,230.23	6,230.23
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）	-920,417.58	-920,417.58
其中：股票投资收益	-920,417.58	-920,417.58
债券投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
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	-	-
其他收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,892,183.72	1,892,183.72
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7,219.20	7,219.20

二、费用	367,030.37	367,030.37
1. 管理人报酬	203,404.90	203,404.90
2. 托管费	13,560.32	13,560.32
3. 客户服务费	-	-
4. 交易费用	144,445.92	144,445.92
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	5,619.23	5,619.23
三、净利润	618,185.20	618,185.20

(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	300296	利亚德	1,143,500.00	8,256,070.00	15.40%
2	002833	弘亚数控	93,100.00	5,434,247.00	10.14%
3	01610	中粮肉食	1,485,000.00	5,011,491.87	9.35%
4	002001	新和成	81,200.00	3,104,276.00	5.79%
5	600114	东睦股份	417,800.00	3,083,364.00	5.75%
6	002157	正邦科技	184,800.00	2,796,024.00	5.22%
7	300575	中旗股份	66,200.00	2,436,160.00	4.54%
8	603236	移远通信	10,900.00	2,282,024.00	4.26%
9	600406	国电南瑞	70,100.00	2,182,914.00	4.07%
10	01992	复星旅游文化	207,400.00	1,912,066.23	3.57%

(三) 重大关联交易状况

(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	1.50%	每日计提	按月
托管费	0.10%	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	0.00%	20.00%	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、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)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	49,089,009.41	90.14
	其中：股票	49,089,009.41	90.14
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	5,320,089.01	9.77
8	其他各项资产	51,163.46	0.09
9	合计	54,460,261.88	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	50,617.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	545.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,163.46

七、 集合计划份额变动

单位：份

期初集合计划份额总额	22,985,784.19
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	3,944,945.38
报告期末集合计划份额总额	19,040,838.81

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、《国泰君安君享重阳阿尔法对冲一号限额特定集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君享重阳阿尔法对冲一号限额特定集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君享重阳阿尔法对冲一号限额特定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

投资者可于本集合计划管理人办公时间预约查阅,或登录集合计划管理人网站www.gtjzjg.com查阅,还可拨打本公司客服电话(95521)查询相关信息。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二一年四月二十二日