

国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划

2021年第4季度报告

2021年12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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年01月24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2022年1月19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10月1日起至2021年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国君资管君得诚混合
基金主代码	952035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年03月25日
报告期末基金份额总额	325,295,209.48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，并通过宏观、市场和价值分析，捕捉价值型公司（价值公司）的投资机会。通过科学合理的资产配置和股票组合，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，辅之以管理人自行开发的数量化辅助模型，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。 本集合计划投资策略还包括：股票投资策略、组合调整策略、股指期货、国债期货交易策略、债券的投资策略、资产支持证券等品种投资策略、股票期权的投资策略、港股投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%

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	招商银行股份有限公司

§ 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10月01日 - 2021年12月31日）
1. 本期已实现收益	-22,090,838.32
2. 本期利润	-13,631,721.52
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0382
4. 期末基金资产净值	400,510,849.84
5. 期末基金份额净值	1.2312

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

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	-3.14%	0.93%	0.84%	0.53%	-3.98%	0.40%
过去六个月	-15.92%	1.24%	-4.30%	0.70%	-11.62%	0.54%
过去一年	-17.10%	1.18%	-2.76%	0.79%	-14.34%	0.39%
自基金合	23.12%	1.21%	23.87%	0.80%	-0.75%	0.41%

同生效起至今						
--------	--	--	--	--	--	--

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

国泰君安君得诚混合型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



§ 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		
季鹏	本集合资产管理计划的投资经理	2021-08-17	-	14年	硕士研究生学历，拥有CFA、FRM资格。曾在海通国际证券、光大保德信基金公司、华宝基金公司从事行业高级研究员、首席策

				略分析师、基金经理等工作，拥有14年证券从业经验、7年基金管理经验，先后管理华宝宝康灵活配置等多只基金产品。2021年1月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现担任公募权益投资部基金经理。
--	--	--	--	---

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

2021年四季度，国内经济增长继续保持总体平稳、结构分化的特点。投资方面，国内房地产行业进入四季度后出现了拿地和销售趋缓的状态，使得相关地产投资产业链的需求有走弱迹象；同时，出口和消费行业仍延续今年以来的增速逐步小幅下降但总体平稳的态势。经过几个季度的经济增速的回落，目前基本已经接近本轮经济周期的底部，

中央稳增长的态度和举措日益明显。12月的中央经济会议核心定调就是2022年的经济要稳，12月中旬的降准已经实施，预计未来将进一步逐步降准降息以及加大经济刺激举措。

2021年下半年以来，全球经济复苏趋势进一步确认，在疫苗大面积接种普及的背景下，欧美等发达国家疫情得到控制，经济活动逐步回归正常，特别是美国的就业和消费市场快速恢复，经济有过热的迹象。预计2022年，随着美国经济的逐步复苏和通胀抬头将迫使美联储逐步退出宽松货币政策，但从具体实施的节奏来看，美联储收紧流动性的速度并不太会快。为对冲美联储的流动性收缩，预计中央将进一步放松流动性和适当放宽信用，以保证国内流动性的平稳适度。

本季度，上证指数总体维持在3450-3700点区间窄幅波动，但是内部行业轮动速度明显加快，行业表现差异较大。此前表现较好的新能源和周期股在四季度都出现了较大幅度的回落，而元宇宙、军工、绿电、电子信息等相关股票涨幅居前。本基金仓位相比三季度有所提高，主要布局于光伏、先进制造、电子半导体和部分消费医药，并适当减少了新能源车的持仓比例。展望2022年，随着中央保增长措施和流动性宽松的逐步兑现，国内经济将企稳反弹，市场机会预计将明显增多。目前市场需要一定时间看到更多中央刺激举措和经济企稳的迹象。所以，我们将继续保持目前谨慎的操作思路，紧跟行业景气度、优选个股，保持此前的稳健灵活的投资组合，为投资者追求长期稳定的投资回报。

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诚混合基金份额净值为1.2312元，本报告期内，基金份额净值增长率为-3.14%，同期业绩比较基准收益率为0.84%。

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	338,447,904.12	82.48
	其中：股票	338,447,904.12	82.48
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	69,236,998.67	16.87
8	其他资产	2,677,130.46	0.65
9	合计	410,362,033.25	100.00

注：本集合计划本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 3,434,700.77 元，占期末净值比例为 0.8576%；通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

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	-	-
C	制造业	277,439,121.74	69.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,784,000.00	1.44
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	539,491.04	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	15,710,926.50	3.92
H	住宿和餐饮业	2,304.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,456,247.01	1.11
J	金融业	16,631,890.00	4.15
K	房地产业	8,596,500.00	2.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	103,899.93	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	9,193.51	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	4,671.94	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,734,957.68	1.43
S	综合	-	-
	合计	335,013,203.35	83.65

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(%)
日常消费品	31,097.38	0.01
工业	3,403,603.39	0.85
合计	3,434,700.77	0.86

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	002475	立讯精密	265,000	13,038,000.00	3.26
2	601677	明泰铝业	285,838	12,602,597.42	3.15
3	688599	天合光能	150,209	11,851,490.10	2.96
4	000568	泸州老窖	45,100	11,449,537.00	2.86
5	002821	凯莱英	25,000	10,875,000.00	2.72
6	688097	博众精工	225,959	10,543,246.94	2.63
7	600029	南方航空	1,534,250	10,448,242.50	2.61
8	600519	贵州茅台	5,010	10,270,500.00	2.56
9	002245	蔚蓝锂芯	370,000	10,178,700.00	2.54
10	000333	美的集团	133,000	9,816,730.00	2.45

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	280,333.91
2	应收证券清算款	2,381,711.34
3	应收股利	-
4	应收利息	9,419.03
5	应收申购款	5,666.18
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,677,130.46

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

报告期期初基金份额总额	374,296,717.76
报告期期间基金总申购份额	1,101,690.96
减：报告期期间基金总赎回份额	50,103,199.24
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	325,295,209.48

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	42,628,172.01
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	8,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	34,628,172.01
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	10.65

§ 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。

§ 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稳一号集合资产管理计划合同变更的函
- 2、《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得诚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.gtjazg.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

2022年01月24日