

# 国泰君安君得诚混合型证券投资基金

2022年第1季度报告

2022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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年04月22日

## § 1 重要提示

基金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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年4月18日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现和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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至2022年3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安君得诚混合
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	270,991,105.64份
投资目标	本基金利用基金管理人的研究优势，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，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、 资产配置策略</li> <li>2、 股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 行业配置策略</li> <li>(2) 公司股票精选策略</li> </ol> </li> <li>3、 组合调整策略</li> <li>4、 股指期货、国债期货交易策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 股指期货投资策略</li> <li>(2) 国债期货投资策略</li> </ol> </li> <li>5、 债券的投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 利率策略</li> </ol> </li> </ol>

	(2) 信用策略 (3) 债券选择策略 (4) 可转债的投资策略 6、 资产支持证券等品种投资策略 7、 股票期权的投资策略 8、 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	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。
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

注：国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划自2022年2月14日变更为国泰君安君得诚混合型证券投资基金。

### § 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（2022年01月01日 - 2022年03月31日）
1. 本期已实现收益	-42,375,213.02
2. 本期利润	-72,315,641.36
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2445
4. 期末基金资产净值	269,106,527.33
5. 期末基金份额净值	0.9930

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去 三个 月	-19.35%	1.30%	-9.16%	1.08%	-10.19%	0.22%
过去 六个 月	-21.88%	1.13%	-8.39%	0.85%	-13.49%	0.28%
过去 一年	-28.56%	1.18%	-10.73%	0.80%	-17.83%	0.38%
自基 金合 同生 效起 至今	-0.70%	1.23%	12.53%	0.84%	-13.23%	0.39%

### 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证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年03月25日-2022年03月31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		
季鹏	本基金基金经理，现担任公募权益投资部基金经理。	2021-08-17	-	14年	季鹏，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。自2021年8月17日至2022年2月13日担任“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”投资经理，自2022年2月14日起担任“国泰君安君得诚混合型证券投资基金”基金经理。
郑伟	本基金基金经理，国泰君安君得明混合型证券投资基金基金经理。	2022-02-21	-	12年	郑伟，经济学硕士，毕业于复旦经济学院国际金融系。于2021年9月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司公募权益投资部。从业时间超过15年，具备丰富的行业研究经验及管理基金经历。此前就职于中信保诚基金，历任研究员、基金经理、高级基金

					经理。自2022年2月21日起担任“国泰君安君得诚混合型证券投资基金”基金经理。自2022年3月22日起担任“国泰君安君得明混合型证券投资基金”基金经理。
葛瑾洁	本基金基金经理，9年证券从业经验，研究功底扎实，具备复合专业背景及产业工作经验。	2022-02-21	-	9年	葛瑾洁，复旦大学硕士。于2021年11月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司权益研究部。9年证券从业经验，研究功底扎实，具备复合专业背景及产业工作经验。历任深圳华大基因研究院知识产权部专利顾问，华润元大基金管理有限公司投资管理部高级研究员，基金经理助理。2017年9月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、社保基金经理助理、投资经理。自2022年2月21日起担任“国泰君安君得诚混合型证券投资基金”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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 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、相关规定以及基金合同、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基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金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，本基金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，未发现本基金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

2022年一季度，在全球疫情、地缘冲突背景下，市场震荡下行，且呈现出明显的风格切换特点，诸如医药、新能源、过去两年的若干景气赛道大幅回调，而以煤炭、地产、养殖等为代表的行业表现强势。

报告期内，本基金仍旧保持谨慎灵活的操作思路，适当进行了行业分散，重点在光伏、医药、电子等新兴成长方向布局，同时在稳增长方向也做了适当配置。长期而言，我们对中国经济转型仍然充满信心，这一信心，来自全球低碳产业的蓬勃发展，来自科技进步带动的产业升级，也来自收入上升推动的内需增长。

年初以来，复杂的国内外形势和动荡的资本市场环境，为权益基金管理带来了较大的挑战。但我们回顾过去十年的市场，短期大幅回调的局面亦有多次，但仍有大批优秀的公司脱颖而出，贡献了丰厚的收益。向后展望，在分化的市场中，我们需保持耐心，相机而动。感谢基金持有人对本基金的支持，我们将继续勤勉尽责，更加着眼于寻找符合产业趋势和拥有长期竞争力的方向，为投资者奉献长期稳定的投资回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安君得诚混合基金份额净值为0.9930元，本报告期内，基金份额净值增长率为-19.35%，同期业绩比较基准收益率为-9.16%。

### 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基金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基金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	226,160,076.75	78.47
	其中：股票	226,160,076.75	78.47
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	61,705,766.71	21.41
8	其他资产	346,317.57	0.12
9	合计	288,212,161.03	100.00

注：本基金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34.22元，占期末净值比例为0.00%；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	200,460,655.47	74.49
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,150,598.55	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,801.60	0.00



I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,688,399.72	3.23
J	金融业	8,597,830.50	3.19
K	房地产业	410,880.00	0.15
L	租赁和商务服务业	3,829,821.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	18,055.69	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	226,160,042.53	84.04

### 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	34.22	0.00
合计	34.22	0.00

### 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	002129	中环股份	301,700	12,882,590.00	4.79
2	300630	普利制药	264,200	11,479,490.00	4.27
3	300316	晶盛机电	177,800	10,668,000.00	3.96
4	601012	隆基股份	131,900	9,521,861.00	3.54
5	688536	思瑞浦	14,014	8,688,399.72	3.23
6	002142	宁波银行	229,950	8,597,830.50	3.19
7	002475	立讯精密	259,500	8,226,150.00	3.06
8	603987	康德莱	424,700	8,200,957.00	3.05
9	688599	天合光能	138,209	8,140,510.10	3.03
10	300233	金城医药	214,900	7,938,406.00	2.95

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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 本基金持有的前十名证券发行主体宁波银行，2021年12月因信用卡业务管理不到位，被中国银保监会宁波分局处以罚款的行政处罚。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金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	329,830.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	16,487.21
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	346,317.57

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金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	325,295,209.48
报告期期间基金总申购份额	1,058,826.35
减：报告期期间基金总赎回份额	55,362,930.19
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	270,991,105.64

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

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

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2022-02-15	-28,935,239.34	-31,319,503.06	0.0000

2	赎回	2022-02-15	-5,692,932.67	-6,162,030.32	0.0000
合计			-34,628,172.01	-37,481,533.38	

## § 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金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

国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划自2022年2月14日变更为国泰君安君得诚混合型证券投资基金。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更注册的批复
- 2、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金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

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网网站<http://www.gtjazg.com>。

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站[www.gtjazg.com](http://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04月22日