

国泰君安君享年华定开债1号集合资产管理计划

2024年第2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，并对其内容的真实性、准确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2024年07月15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。

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2024年04月01日起至2024年06月30日止。

一、集合资产管理计划简介

(一) 基本资料

集合计划名称	国泰君安君享年华定开债1号集合资产管理计划
成立日期	2018年09月12日
成立规模	107,343,995.90
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	海通证券股份有限公司

(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：陶耿

电话：021-38676022

传真：021-38871190

联系人：吕巍

(三) 托管人

名称：海通证券股份有限公司
 办公地址：上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场
 法定代表人：周杰
 电话：021-23185481
 信息披露人：邓来承

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
	2024 年 04 月 01 日 - 2024 年 06 月 30 日
本期利润	1,903,372.71
本期基金份额净值增长率	1.41%
期末可供分配利润	5,052,583.42
期末基金资产净值	136,519,591.71
期末基金份额净值	1.0623

(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、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

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

国泰君安君享年华定开债1号集合资产管理计划累计净值增长率走势图
(2018年09月12日-2024年06月30日)



四、报告期内资产运作情况

(一) 业绩表现

截止 2024 年 06 月 30 日，集合计划单位净值为 1.0623 元，本期净值增长率为 1.41%，集合计划累计净值增长率为 34.74%。

(二) 投资经理简介

何小溪，金融学硕士，10 年证券从业经历。曾就职于光大保德信基金管理有限公司，2017 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部。历任固定收益部研究员与投资经理助理，现任投资经理，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，无外部兼职。

陆鹏飞，本科毕业于北京大学经济专业，研究生毕业于复旦大学金融专业，9 年金融行业从业经验，曾就职于中国工商银行总行贵金属部，负责贵金属及外汇的研究和交易。2017 年加入国泰君安证券资产管理公司，从事债券的投资研究工作，现担任固定收益部投资经理。

赵博阳，香港城市大学数学系本科，香港科技大学金融工程硕士。12 年证券期货从业经验，8 年固定收益投资经验。现任国泰君安证券资产管理公司固定收益部（私募）副总经理、高级投资经理。投资风格稳健，历史业绩优异，关注长期稳定的绝对收益。2015 年加入国泰君安证券资产管理有限公司，历任固定收益部研究员、投资经理、（私募）副总经理。已取得基金从业资格，无外部兼职，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

(三) 投资经理工作报告

2024 年上半年结束，市场整体表现为震荡走牛，收益率曲线整体下移，信用利差、期限利差、

品种利差均压缩至极致水平，但站在当前时点，仍难言下车。

在资产荒背景下，利率债在内外双重制约下，中短久期性价比较高，长端利率可能延续震荡下行，但空间有限，警惕央行指导和机构止盈带来的波动。城投债方面，在供长期供需矛盾难以逆转的背景下，仍具备长期配置价值；地产债方面，收益率在继续下降，但较高等级信用溢价有所回升，性价比小幅上行，建议继续对中高等级地方国有房企保持关注。金融债方面，资产荒格局下继续关注二永债配置机会，在二永债监管批文加快、TLAC非资本债工具上市和年末银行资本补充需求的背景下，金融债发行量或继续上升，市场整体供需两旺；继续挖掘保险、产业永续债等票息相对高、信用风险相对可控品种债券。

(四) 投资经理变更情况

无

(五) 资产管理计划收益分配情况

无

(六) 托管人履职报告

详见附件。

五、 集合计划投资组合报告

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	143,622,652.59	98.93
	其中：债券	143,622,652.59	98.93
	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	1,550,116.24	1.07
8	其他各项资产	-	-
9	合计	145,172,768.83	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) 期末按公允价值占集合计划资产净值比例情况

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	102382588	23 鲁钢铁 MTN006	100,000.00	10,668,213.11	7.81%
2	102383080	23 天安煤业 MTN003(科创 票据)	100,000.00	10,528,997.27	7.71%
3	032280803	22 港兴港投 PPN003	100,000.00	10,453,174.86	7.66%
4	032380413	23 唐山控股 PPN001	100,000.00	10,335,027.40	7.57%
5	102481128	24 山西建投 MTN003A	100,000.00	10,325,657.53	7.56%
6	102481277	24 平煤化 MTN001	100,000.00	10,305,756.16	7.55%
7	012384168	23 冀中能源 SCP010	100,000.00	10,251,360.66	7.51%
8	194238	22 十堰 01	100,000.00	10,120,342.47	7.41%
9	182477	22 濮阳 03	90,000.00	9,406,319.18	6.89%
10	2080329	20 平江债 01	100,000.00	8,492,262.30	6.22%

(三) 重大关联交易状况

2024年2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
953211	0	9,878,494.52

(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	0.3000%	每日计提	按月支付
托管费	0.0300%	每日计提	按月支付

项目	当前计提基准	计提比例	计提方式	支付方式
业绩报酬	详见业绩基准公告	60.0000%	退出，分红以及终止清算时计提	发生时支付

(五) 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) 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	-

六、 集合计划份额变动

单位：份

期初集合计划份额总额	128,508,272.98
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	128,508,272.98

七、 重要事项提示

无

八、 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、《国泰君安君享年华定开债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君享年华定开债 1 号集合资产管理计划托管协议》；

- 4、《国泰君安君享年华定开债 1 号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.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
二〇二四年七月十九日