

国泰君安君享大类资产全天候 1 号集合资产管理计划

2023 年第 3 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 2023 年 10 月 17 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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 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	国泰君安君享大类资产全天候 1 号集合资产管理计划
成立日期	2023 年 01 月 17 日
成立规模	12,689,009.67
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：陶耿

电话：021-38676022

传真：021-38871190

联系人：吕巍

（三）托管人

名称：兴业银行股份有限公司
 办公地址：上海市银城路 167 号
 法定代表人：吕家进
 电话：021-52629999
 信息披露人：洪锦芳

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
	2023 年 07 月 01 日 - 2023 年 09 月 30 日
本期利润	296,093.18
本期基金份额净值增长率	1.62%
期末可供分配利润	846,032.86
期末基金资产净值	26,112,442.14
期末基金份额净值	1.0438

（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

国泰君安君享大类资产全天候1号集合资产管理计划累计净值增长率走势图
(2023年01月17日-2023年09月30日)



四、报告期内资产运作情况

(一) 业绩表现

截止 2023 年 09 月 30 日，集合计划单位净值为 1.0438 元，本期净值增长率为 1.62%，集合计划累计净值增长率为 4.38%。

(二) 投资经理简介

钟玉聪

中国科学院数学与系统科学研究院概率论与数理统计博士；17 年证券从业经验；历任国泰君安证券衍生品部研究员、国泰君安证券资产管理总部研究员等职，现任“君享优量全天候”系列等投资经理。

(三) 投资经理工作报告

投资回顾

中国经济在经历了上半年的下滑之后，下半年开始出现触底回升的迹象。在供给端，工业生产加快，装备制造业增速回升，1-8 月份规模以上工业增加值同比增长 3.9%；服务业较快增长，现代服务业增势良好，服务业生产指数同比增长 8.1%。在需求端，固定资产投资规模继续扩大，1-8 月固定资产投资同比增长 3.2%，其中基础设施投资和制造业投资分别增长 6.4%和 5.9%，高技术产业投资保持较快增长；1-8 月份，社会消费品零售总额同比增长 7%，市场销售加快恢复，服务消费增长较快；1-8 月份，我国货物进出口总额同比下降 0.1%，同比降幅收窄，贸易结构继续优化。总的

来看，8 月份主要指标边际改善，国民经济恢复向好，高质量发展扎实推进，积极因素累积增多；同时，外部不稳定不确定因素依然较多，国内需求仍显不足，经济恢复向好基础仍需巩固。行业分化则进一步加大，7 月，非银、地产、建材、钢铁等周期行业及商贸、食品饮料等消费行业表现较好，军工、TMT 等行业则表现较差；8 月，煤炭、石油石化、环保及 TMT 等行业表现略好，农林牧渔、电力设备、商贸零售、建筑装饰等行业则表现较差；9 月，煤炭、石油石化、环保及 TMT 等行业表现略好，农林牧渔、电力设备、商贸零售、建筑装饰等行业则表现较差。总的来说，未来权益市场仍然是结构性的机会，大部分行业历史估值分位已处于历史底部，投资价值明显显现，中期仍然看好创业板等历史估值分位较低的品种。

从海外来看，美 9 月服务业 PMI 创 1 月来新低，制造业 PMI 连续五个月萎缩，反映紧缩货币政策对总需求的抑制效果逐渐显现，美国经济已经出现放缓迹象；9 月密歇根大学消费者信心指数初值 67.7，低于 8 月终值；8 月 CPI 3.7%，超预期反弹；虽然美联储 9 月维持利率不变，但市场预期年内大概率还要加息一次，美股高位震荡回落。欧元区 9 月综合 PMI 终值为 47.2，高于预期及前值，表明欧元区私营部门商业活动收缩的速度轻微放缓；9 月 CPI 降至 4.3%，低于预期及前值，核心通胀率降至俄乌冲突来最低水平，预示高通胀时代已接近尾声，同时进一步巩固欧央行结束加息的预期，欧股同样震荡走低。从全球角度来看，当前全球经济增速依然处于较低水平，高通胀风险仍在持续，发达经济体以抑制通胀为名持续加息，不仅自身经济面临风险，也将对全球经济产生进一步负面影响。

市场展望

本集合计划作为一只跟踪国泰君安安全全天候指数的产品，我们将继续秉承指数化投资策略，积极应对申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本集合计划的跟踪误差，给投资者提供一个间接投资国泰君安安全全天候指数的有效投资工具。

(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	20,920,078.10	79.22
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	4,667,337.42	17.68
8	其他各项资产	818,881.61	3.10
9	合计	26,406,297.13	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	511880	银华日利货币 A	60,000.00	6,086,760.00	23.31%
2	003358	易方达中债 7-10 年期国开行债券指数 A	4,939,581.14	5,983,314.63	22.91%
3	003376	广发中债 7-10 年期国开债指数 A	3,796,137.57	4,681,776.47	17.93%
4	511990	华宝添益货币 A	39,000.00	3,902,067.00	14.94%
5	159937	博时黄金 ETF	60,000.00	266,160.00	1.02%

(三) 重大关联交易状况

2023 年 3 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
953831	0	0

(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	1.0000%	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	无	无	本计划不收取业绩报酬	无

(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	588,994.81
2	应收证券清算款	229,886.80
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	818,881.61

六、 集合计划份额变动

单位：份

期初集合计划份额总额	19,152,061.76
报告期内集合计划总申购份额	5,864,105.37
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	25,016,167.13

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、《国泰君安君享大类资产全天候 1 号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君享大类资产全天候 1 号集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君享大类资产全天候 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
二〇二三年十月二十七日