

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 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 2023 年 07 月 14 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 04 月 01 日起至 2023 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：021-38676631

传真：021-38676022

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 04 月 01 日 - 2023 年 06 月 30 日
本期利润	475,177.14
本期基金份额净值增长率	2.65%
期末可供分配利润	-79,049.84
期末基金资产净值	19,672,070.34
期末基金份额净值	1.0272

(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) 本报告期集合计划份额净值收益率

阶段	份额净值增长率①
过去三个月	2.65%

(二) 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06月30日)



四、报告期内资产运作情况

(一) 业绩表现

截止 2023 年 06 月 30 日，集合计划单位净值为 1.0272 元，本期净值增长率为 2.65%，集合计划累计净值增长率为 2.72%。

(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；16 年证券从业经验；历任国泰君安证券衍生产品部研究员、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

随着经济社会全面恢复常态化运行，前期受到压抑的生产需求出现了反弹，由于去年基数较低，二季度经济增长明显快于一季度。在供给端，工业和服务业生产双双反弹，1-5 月份，规模以上工业增加值同比增长 3.6%；服务性消费增势良好，服务业生产指数同比增长 9.1%，有利于就业扩大。在需求端，1-5 月份，固定资产投资同比增长 4%，其中基础设施投资和制造业投资分别增长 7.5%和 6%，保持较快增长；1-5 月份，社会消费品零售总额同比增长 9.3%，比一季度明显加快；1-5 月份，我国货物进出口总额同比增长 4.7%，与“一带一路”沿线国家进出口总额增长 13.2%。虽然 5 月份

主要经济指标增速有所回落，引发部分人士对经济复苏前景的担忧，但我国经济运行总体延续恢复态势，回稳基础仍需巩固，长期向好的基本面没有变。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，中期仍然看好历史估值分位较低品种。

从海外来看，美 6 月制造业 PMI 46.3 低于预期及前值，服务业 PMI 54.1 高于预期，显示美国制造业和服务业出现了分化迹象，但总体来看美国经济活动正以近一年来最快的速度扩张；6 月密歇根大学消费者信心指数初值 63.9，达到四个月来最高水平；5 月 CPI 4%，连续 11 个月下降；强劲经济数据令市场对美联储进一步加息的预期迅速升温，美股冲高后震荡。欧元区 6 月制造业 PMI 降至 43.6，达 3 年内最低，服务业 PMI 跌至 52.4 低于预期，综合 PMI 降至 50.3，创 5 个月新低，显示经济普遍放缓；5 月 CPI 降至 6.1%，低于预期，但绝对水平仍然较高，欧央行预计通胀压力仍然较大并再次加息，欧股冲高回落。从全球角度来看，美银行系统流动性问题似乎暂时得到解决，但风险仍然不可忽视；此外，在乌克兰危机持续、多国央行继续收紧货币政策等多重负面冲击相互叠加的影响下，全球经济仍处于不稳定状态，美国利率快速走高对新兴市场和发达经济体造成重大挑战，出现金融危机的可能性升高。银行业动荡或进一步收紧的货币政策可能会导致全球经济增长更加疲弱。

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	17,122,042.72	86.88
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	2,439,462.54	12.38
8	其他各项资产	146,671.20	0.74
9	合计	19,708,176.46	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	003358	易方达中债 7-10 年期国 开行债券指数 A	3,935,147.72	4,765,857.40	24.23%
2	511520	富国中债 7-10 年政策 性金融债 ETF	46,400.00	4,756,046.40	24.18%
3	003376	广发中债 7-10 年国开 债指数 A	3,703,989.42	4,752,959.22	24.16%
4	513500	博时标普 500ETF(QDII)	1,229,200.00	1,847,487.60	9.39%
5	511880	银华日利货币 A	9,900.00	999,692.10	5.08%

(三) 重大关联交易状况

2023 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
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%	每日计提	按月支付
托管费	0.03%	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	146,671.20
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	146,671.20

六、 集合计划份额变动

单位：份

期初集合计划份额总额	16,686,163.81
报告期内集合计划总申购份额	2,465,897.95
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	19,152,061.76

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
二〇二三年七月二十一日