

国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划

2019 年年度报告

2019 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:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2020 年 03 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本集合计划合同约定，于2020年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本报告的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2019年9月25日（集合计划合同变更生效日）起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
8.6 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	47
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
8.8 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贵金属投资明细	48
8.9 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	48
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
8.12 投资组合报告附注	48

§9 基金份额持有人信息.....	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	50
§10 开放式基金份额变动.....	50
§11 重大事件揭示.....	51
11.1 基金份额持有人大会决议.....	51
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
11.4 基金投资策略的改变.....	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
11.8 其他重大事件.....	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划
基金简称	君得盛
基金主代码	952024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年09月25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	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1, 533, 063, 851. 81份
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过三年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划主要投资于固定收益品种，在承担合理风险和保持资产流动性的基础上，适度参与权益类资产投资，力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本集合计划将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益，通过积极的权益类资产投资策略追求基金资产的增强型回报。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将集合计划资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。本集合计划将在稳健的资产配置策略基础上，根据股票的运行状况和收益预期，在严格控制风险的基础上，积极并适时适度地参与权益类资产配置，把握市场时机力争为集合计划资产获取增强型回报。</p> <p>2、固定收益品种投资策略</p>

	<p>本集合计划将采取利率策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本集合计划在个股选择中将坚持价值投资理念，理性地分析中国证券市场的特点和运行规律，用产业投资眼光，采用长期投资战略，辅以金融工程技术，发掘出价值被市场低估的，具有长期增长能力的公司的股票，买入并长期持有，将中国经济长期增长的潜力最大程度地转化为投资者的长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率*100%
风险收益特征	本集合计划为债券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，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划，属于中低风险/收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李艳
	联系电话	021-38676999
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	95528
传真	021-68872521	021-63602540
注册地址	上海市黄浦区南苏州路381号409A10室	上海市中山东一路12号
办公地址	上海市浦东新区东园路111号2楼	上海市北京东路689号
邮政编码	200120	200001
法定代表人	龚德雄	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区东园路111号2楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年9月25日（集合计划合同变更生效日）至2019年12月31日
本期已实现收益	3,317,750.56
本期利润	11,723,032.44
加权平均基金份额本期利润	0.0172
本期加权平均净值利润率	1.56%
本期基金份额净值增长率	0.93%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末
期末可供分配利润	84,260,395.43
期末可供分配基金份额利润	0.0550
期末基金资产净值	1,702,056,725.49
期末基金份额净值	1.1102

3.1.3 累计期末指标	2019年末
基金份额累计净值增长率	0.93%

注：(1)所述集合计划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。

(2)本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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及暂估税金及附加。

(3)本集合资产管理计划资产管理合同变更生效日为2019年9月25日，截止至2019年12月31日成立运作未满一年。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.94%	0.04%	1.30%	0.04%	-0.36%	0.00%
自集合计划合同变更生效起至今	0.93%	0.04%	1.30%	0.04%	-0.37%	0.00%

3.2.2 自基金转型以来基金份额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

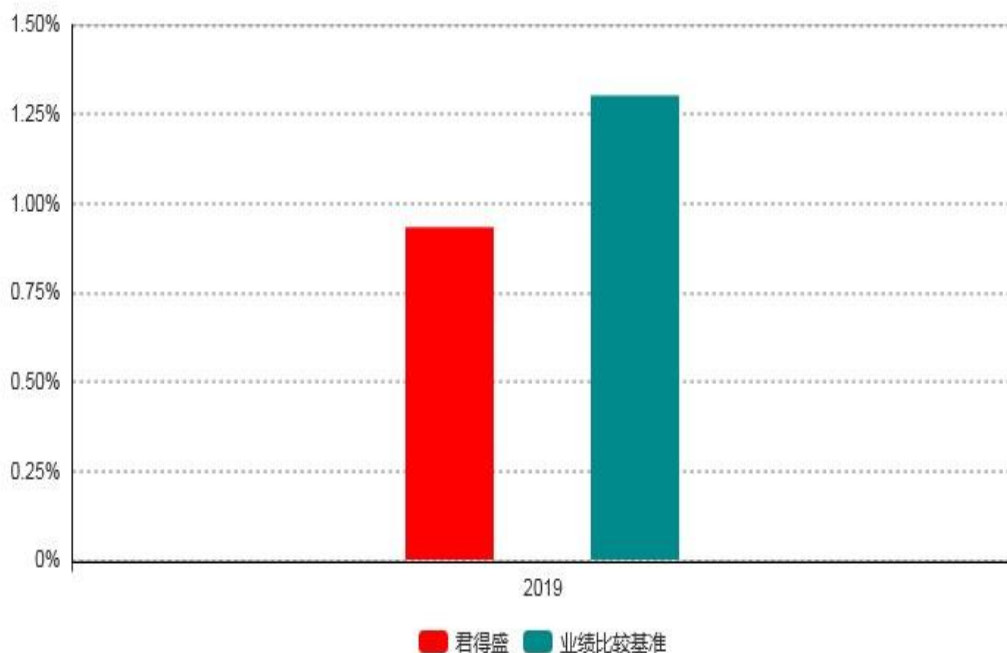
国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年09月25日-2019年12月31日)



注：本集合计划合同变更于2019年9月25日生效，建仓期6个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合集合计划合同约定，目前本集合计划还在建仓期内。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2019年计算期间为本集合计划的合同变更生效日2019年9月25日至2019年12月31日，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

截止本报告期末，根据本集合资产管理计划资产管理合同和相关法律法规的规定，本集合计划无应分配但尚未实施的利润。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于2010年10月18日，经中国证监会证监许可【2010】631号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金20亿元，注册地上海。

截至2019年12月31日，本集合计划管理人共管理了2只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：国泰君安君得明混合型集合资产管理计划、国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙驰	本产品投资经理	2019-09-25	-	13	复旦大学经济学硕士。曾任万家基金管理有限公司固定收益部总监、汇添富基金专户投资决策委员会委员，曾管理万家增强收益债券基金、万家强化收益债券基金、万家岁得利债券基金、万家双利债券基金、万家日日薪货币基金、万家现金宝货币基金、

					万家货币基金等。2017年8月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，2018年2月28日起至今，担任国泰君安君得盛投资经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、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，本集合计划管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和集合计划管理合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制投资风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益，没有损害集合计划份额持有人利益的行为。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为，本集合计划投资组合符合有关法律法规和合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本集合计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》的规定。

本集合计划管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,各大类资产均出现了较大波动。全年来看,中美贸易战是2019年影响各类资产走势的主要矛盾。一季度债弱股强。在各种经济及货币政策不断出台的背景下,市场预期发生了改变,风险资产出现上涨,而债券弱势调整。二季度,中美贸易摩擦再起,叠加包商银行事件,改变了市场的风险偏好,也改变了政策风向,债券重回上涨趋势,而权益市场陷入了调整。这种趋势一直持续到年末,随着中美贸易谈判达成协议,风险因素消除,同时经济呈现弱复苏加通胀的态势,权益市场出现了反弹。货币政策未受通胀制约,一直保持宽松,债券收益率也震荡下行。

本报告期内,本集合计划规模出现了较大增长,我们还是根据绝对收益的思路,不断从大类资产配置的角度对组合资产进行调整。主要基于稳健的操作特点,在每一类资产出现安全边际的时候,加大该资产的配置力度,最终也为持有人实现了绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末君得盛集合计划份额净值为1.1102元,本报告期内,集合计划份额净值增长率为0.93%,同期业绩比较基准收益率为1.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一期看,新冠疫情可能会成为影响上半年各类资产走势的主要因素。这次疫情虽然致死率不高,但是传染力较强,预计对经济的影响会比03年非典更为严重,因此后续国家应该会出台各项政策来对冲疫情影响。这些政策的出台,对我们进行资产配置有很重要的指导意义。长远来看,疫情总会结束,我们会争取把握这次疫情带来的投资机会,为持有人实现绝对收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本集合计划管理人从维护集合计划份额持有人利益、保障集合计划合规运作角度出发,在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作,不断深化员工的合规意识,推动公司合规文化和内部控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会对公司依法管理的资管产品的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定资管产品估值业务的操作流程和风险控制，确保资管产品估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值委员会由营运管理部分管领导、协管领导（若有）、投资部门负责人、研究发展部门负责人、营运管理部负责人、法律合规部门负责人、风险管理部负责人及市场部门负责人组成。具体参会的投资部门负责人依据待决议事项对应的资管产品确定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同、托管协议的规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同、托管协议的规定，对国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划的投资运作进行了监督，对集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算以及集合计划费用开支等方面进行了认真的复核，未发现集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。该集合计划本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由上海国泰君安证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2020)审字第61438993_B02号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划全体份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>我们审计了国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划的财务报表，包括2019年12月31日的资产负债表，2019年9月25日（集合计划合同变更生效日）至2019年12月31日止会计期间的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划2019年12月31日的财务状况以及2019年9月25日（集合计划合同变更生效日）至2019年12月31日止会计期间的经营成果和净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息</p>

	<p>存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	李斐	丁鹏飞
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2020-03-27	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	2,257,461.92

结算备付金		4,926,276.58
存出保证金		73,023.40
交易性金融资产	7.4.7.2	1,675,717,859.71
其中：股票投资		133,427,572.63
基金投资		-
债券投资		1,542,290,287.08
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		5,217,657.07
应收利息	7.4.7.3	19,939,128.69
应收股利		-
应收申购款		13,335,399.04
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		1,721,466,806.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		11,500,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		5,879,995.83
应付管理人报酬		974,721.55
应付托管费		278,491.84
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.4	305,315.08
应交税费		400,062.89

应付利息		4,734.24
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.5	66,759.49
负债合计		19,410,080.92
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.6	1,533,063,851.81
未分配利润	7.4.7.7	168,992,873.68
所有者权益合计		1,702,056,725.49
负债和所有者权益总计		1,721,466,806.41

注：（1）报告截止日2019年12月31日，集合计划份额净值1.1102元，集合计划份额总额1,533,063,851.81份。

（2）本财务报表的实际编制期间为2019年9月25日（集合计划合同变更生效日）至2019年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划

本报告期：2019年09月25日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年09月25日至2019年12月31日
一、收入		13,899,666.59
1. 利息收入		5,220,337.30
其中：存款利息收入	7.4.7.8	66,930.58
债券利息收入		5,099,386.09
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		54,020.63
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		144,884.70
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-88,728.93
基金投资收益		-

债券投资收益	7.4.7.10	233,613.63
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.11	8,405,281.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	129,162.71
减：二、费用		2,176,634.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,334,275.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	381,221.43
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.13	301,924.85
5. 利息支出		96,109.09
其中：卖出回购金融资产支出		96,109.09
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.14	63,103.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,723,032.44
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,723,032.44

注：本集合计划合同变更生效日为2019年9月25日，因此无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划

本报告期：2019年09月25日至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2019年09月25日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	82,827,927.78	8,251,678.61	91,079,606.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,723,032.44	11,723,032.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,450,235,924.03	149,018,162.63	1,599,254,086.66
其中：1. 基金申购款	1,519,461,150.09	156,311,681.62	1,675,772,831.71
2. 基金赎回款	-69,225,226.06	-7,293,518.99	-76,518,745.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,533,063,851.81	168,992,873.68	1,702,056,725.49

注：本集合计划合同变更生效日为2019年9月25日，因此无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

龚德雄

陶耿

茹建江

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，于2012年1月30日经中国证监会证监许可[2012]127号

文核准设立，自2012年5月7日起开始募集，于2012年6月7日结束募集工作，并于2012年6月13日正式成立。

根据中国证监会于2018年11月30日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，自2019年9月25日起，《国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式，本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过三年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。本集合计划的管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券、可交换债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%；保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划业绩比较基准为：中债综合指数收益率×100%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投

基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于2019年12月31日的财务状况以及2019年9月25日（集合计划合同变更生效日）至2019年12月31日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2019年9月25日（集合计划合同变更生效日）至2019年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。本集合计划采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《集合计划合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一集合计划份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

1. 增值税

根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，通知自2018年1月1日起施行。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	2,257,461.92
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	2,257,461.92

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		126,219,210.02	133,427,572.63	7,208,362.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	789,116,850.36	791,006,287.08	1,889,436.72
	银行间市场	750,547,196.11	751,284,000.00	736,803.89
	合计	1,539,664,046.47	1,542,290,287.08	2,626,240.61

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,665,883,256.49	1,675,717,859.71	9,834,603.22

7.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	2,129.33
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,438.59
应收债券利息	19,935,326.33
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-801.64
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	36.08
合计	19,939,128.69

7.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	300,090.08
银行间市场应付交易费用	5,225.00
合计	305,315.08

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17,459.49
应付证券出借违约金	-
预提费用	49,300.00
合计	66,759.49

7.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年09月25日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
本期初	82,827,927.78	82,827,927.78
本期申购	1,519,461,150.09	1,519,461,150.09
本期赎回（以“-”号填列）	-69,225,226.06	-69,225,226.06
本期末	1,533,063,851.81	1,533,063,851.81

7.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	4,138,055.37	4,113,623.24	8,251,678.61
本期利润	3,317,750.56	8,405,281.88	11,723,032.44
本期基金份额交易产生的变动数	76,804,589.50	72,213,573.13	149,018,162.63
其中：基金申购款	80,533,569.15	75,778,112.47	156,311,681.62
基金赎回款	-3,728,979.65	-3,564,539.34	-7,293,518.99
本期已分配利润	-	-	0.00
本期末	84,260,395.43	84,732,478.25	168,992,873.68

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年09月25日至2019年12月31日
----	---------------------------

活期存款利息收入	59,819.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,111.20
其他	-
合计	66,930.58

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月25日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	51,090,092.65
减：卖出股票成本总额	51,178,821.58
买卖股票差价收入	-88,728.93

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月25日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	233,613.63
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	233,613.63

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月25日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	319,346,637.33

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	316,071,044.10
减：应收利息总额	3,041,979.60
买卖债券差价收入	233,613.63

7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年09月25日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	8,688,810.94
——股票投资	7,227,662.61
——债券投资	1,461,148.33
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	283,529.06
合计	8,405,281.88

7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年09月25日至2019年12月31日
基金赎回费收入	129,162.71
合计	129,162.71

7.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月25日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	296,699.85
银行间市场交易费用	5,225.00
合计	301,924.85

7.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月25日至2019年12月31日
审计费用	5,371.07
信息披露费	30,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,831.50
帐户维护费	10,462.50
差价收入增值税抵减	4,219.94
增值税金及附加税	11,218.50
合计	63,103.51

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰君安证券资产管理有限公司（以下简称“国泰君安资管”）	集合计划管理人
国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安证券”）	集合计划管理人的母 公司

上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）

集合计划托管人

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年09月25日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
国泰君安证券	227,405,024.25	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年09月25日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
国泰君安证券	1,137,817,151.95	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年09月25日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
国泰君安证券	1,269,700,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年09月25日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	222,415.82	100.00%	300,090.08	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月25日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,334,275.27
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付集合计划管理人国泰君安资管的管理人报酬按前一日集合计划资产净值0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日集合计划资产净值*0.70%/365

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月25日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	381,221.43

注：支付集合计划托管人浦发银行的托管费按前一日集合计划资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日集合计划资产净值*0.20%/365

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2019年09月25日至2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	7,750,968.99
报告期内申购/买入总份额	-
报告期内因拆分变动份额	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	7,750,968.99
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5056%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本集合计划本报告期末无除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2019年09月25日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	2,257,461.92	59,819.38

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期无其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本集合计划无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币11,500,000.00元，其中人民币10,000,000.00元，于2020年1月8日到期，人民币1,500,000.00元，于2020年1月14日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险管理委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门的四级风险管理体系。风险管理部门主要包括风险管理部、法律合规部等专职履行风险管理职责的部门，营运管理部和综合管理部等其他部门。监事承担全面风险管理的监督责任。

7.4.13.2 信用风险

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年12月31日
A-1	180,052,000.00
A-1以下	-
未评级	430,357,320.00
合计	610,409,320.00

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日
AAA	879,786,875.90
AAA以下	27,621,030.80
未评级	24,473,060.38
合计	931,880,967.08

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的集合计划管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全集合计划流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的集合计划管理人采用监控集合计划组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中7个工

作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的集合计划管理人在集合计划合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 7.4.12 中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过集合计划资产净值的 15%。

本集合计划本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,257,461.92	-	-	-	-	-	2,257,461.92
结算备付金	4,926,276.58	-	-	-	-	-	4,926,276.58
存出保证金	73,023.40	-	-	-	-	-	73,023.40
交易性金融资产	-	379,852,000.00	382,786,228.88	698,228,338.20	81,423,720.00	133,427,572.63	1,675,717,859.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,217,657.07	5,217,657.07
应收利息	-	-	-	-	-	19,939,128.69	19,939,128.69
应收申	-	-	-	-	-	13,335,399.0	13,335,399.04

购款						4	
资产总计	7,256,761.90	379,852,000.00	382,786,228.88	698,228,338.20	81,423,720.00	171,919,757.43	1,721,466,806.41
负债							
卖出回购金融资产款	11,500,000.00	-	-	-	-	-	11,500,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,879,995.83	5,879,995.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	974,721.55	974,721.55
应付托管费	-	-	-	-	-	278,491.84	278,491.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	305,315.08	305,315.08
应交税费	-	-	-	-	-	400,062.89	400,062.89
应付利息	-	-	-	-	-	4,734.24	4,734.24
其他负债	-	-	-	-	-	66,759.49	66,759.49
负债总计	11,500,000.00	-	-	-	-	7,910,080.92	19,410,080.92
利率敏感度缺口	-4,243,238.10	379,852,000.00	382,786,228.88	698,228,338.20	81,423,720.00	164,009,676.51	1,702,056,725.49

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；	
假设	利率变动范围合理。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2019年12月31日

	基准点利率增加0.1%	-1,005,243.68
	基准点利率减少0.1%	1,007,377.68

7.4.13.4.2 外汇风险

本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本集合计划其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	133,427,572.63	7.84
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,542,290,287.08	90.61
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,675,717,859.71	98.45

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位： 人民币元）
		本期末 2019年12月31日
	权益投资公允价值增加 5%	6,671,378.63
	权益投资公允价值减少 5%	-6,671,378.63

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(c) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为373,726,409.63元，属于第二层次的余额为1,301,991,450.08元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本集合计划本期未持有第三层次的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。

(2) 承诺事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的承诺事项。

(3) 其他事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的其他重要事项。

(4) 财务报表的批准

本财务报表已于2020年3月27日经本集合计划的集合计划管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	133,427,572.63	7.75
	其中：股票	133,427,572.63	7.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,542,290,287.08	89.59
	其中：债券	1,542,290,287.08	89.59
	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	7,183,738.50	0.42
8	其他各项资产	38,565,208.20	2.24
9	合计	1,721,466,806.41	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	45,426,988.19	2.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,432,916.00	0.38
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	52,927,468.44	3.11
K	房地产业	28,640,200.00	1.68
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	133,427,572.63	7.84

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	000002	万科A	890,000	28,640,200.00	1.68
2	600837	海通证券	749,900	11,593,454.00	0.68
3	601166	兴业银行	537,461	10,641,727.80	0.63

4	600352	浙江龙盛	687,277	9,944,898.19	0.58
5	002142	宁波银行	300,000	8,445,000.00	0.50
6	002179	中航光电	200,000	7,812,000.00	0.46
7	601633	长城汽车	803,400	7,110,090.00	0.42
8	601117	中国化学	998,900	6,432,916.00	0.38
9	002008	大族激光	150,000	6,000,000.00	0.35
10	601601	中国太保	152,571	5,773,286.64	0.34
11	601336	新华保险	100,000	4,915,000.00	0.29
12	000333	美的集团	80,000	4,660,000.00	0.27
13	601318	中国平安	50,000	4,273,000.00	0.25
14	600196	复星医药	150,000	3,990,000.00	0.23
15	600036	招商银行	100,000	3,758,000.00	0.22
16	601818	光大银行	800,000	3,528,000.00	0.21
17	000651	格力电器	50,000	3,279,000.00	0.19
18	002271	东方雨虹	100,000	2,631,000.00	0.15

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	25,235,208.00	1.48
2	601117	中国化学	14,250,000.00	0.84
3	600837	海通证券	13,986,758.00	0.82
4	601166	兴业银行	10,507,048.32	0.62
5	600048	保利地产	9,424,871.00	0.55
6	600352	浙江龙盛	9,187,874.24	0.54
7	002142	宁波银行	8,322,953.00	0.49
8	002179	中航光电	7,882,473.00	0.46
9	601318	中国平安	7,197,193.73	0.42
10	601633	长城汽车	7,066,886.00	0.42

11	601336	新华保险	6,749,650.00	0.40
12	002008	大族激光	5,939,239.00	0.35
13	601398	工商银行	5,770,000.00	0.34
14	000651	格力电器	5,373,156.40	0.32
15	601601	中国太保	5,290,696.99	0.31
16	600104	上汽集团	4,823,778.00	0.28
17	601998	中信银行	4,575,000.00	0.27
18	000333	美的集团	4,415,284.92	0.26
19	600196	复星医药	3,759,000.00	0.22
20	600036	招商银行	3,630,000.00	0.21

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	9,465,417.00	0.56
2	601117	中国化学	7,615,095.00	0.45
3	601398	工商银行	5,740,000.00	0.34
4	600104	上汽集团	4,785,226.00	0.28
5	601998	中信银行	4,570,000.00	0.27
6	600837	海通证券	3,684,940.00	0.22
7	601318	中国平安	2,965,106.00	0.17
8	601238	广汽集团	2,802,000.00	0.16
9	000651	格力电器	2,226,943.00	0.13
10	002078	太阳纸业	2,082,312.65	0.12
11	601336	新华保险	1,857,044.00	0.11
12	000001	平安银行	1,546,134.00	0.09
13	601601	中国太保	1,066,875.00	0.06
14	601111	中国国航	358,000.00	0.02
15	600426	华鲁恒升	325,000.00	0.02

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	176,314,931.60
卖出股票收入（成交）总额	51,090,092.65

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	105,305,380.38	6.19
	其中：政策性金融债	105,305,380.38	6.19
4	企业债券	445,402,069.70	26.17
5	企业短期融资券	529,577,000.00	31.11
6	中期票据	221,707,000.00	13.03
7	可转债(可交换债)	240,298,837.00	14.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,542,290,287.08	90.61

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	011902168	19南电SCP018	1,000,000	99,890,000.00	5.87

2	011902725	19张江集SCP001	1,000,000	99,770,000.00	5.86
3	132004	15国盛EB	984,600	97,879,086.00	5.75
4	018061	进出1911	808,000	80,832,320.00	4.75
5	101801418	18长电MTN001	800,000	80,824,000.00	4.75

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内，本集合计划未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内，本集合计划未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 根据2019年12月16日公开信息显示，中国人民银行长春中心支行近日公布的行政处罚信息公示表(长银罚字〔2019〕3号)显示，中国进出口银行吉林省分行未按照规定报送大额交易报告，长春中心支行对其罚款25万元。该状况发生后，本集合计划管理人就上述公司受处罚事件进行了及时充分的研究和分析，认为上述公司存在违规问题对公司经营成果和现金流量未产生巨大实质性影响，对投资价值无实质影响。本集合计划管理人将继续对该证券进行跟踪研究。

8.12.2 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。

8.12.3 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	73,023.40
2	应收证券清算款	5,217,657.07
3	应收股利	-
4	应收利息	19,939,128.69
5	应收申购款	13,335,399.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,565,208.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132004	15国盛EB	97,879,086.00	5.75
2	132013	17宝武EB	44,993,080.80	2.64
3	132009	17中油EB	44,795,221.20	2.63
4	132015	18中油EB	34,392,654.40	2.02
5	132006	16皖新EB	8,904,770.00	0.52
6	132011	17浙报EB	4,830,000.00	0.28
7	113008	电气转债	1,726,950.00	0.10
8	127012	招路转债	1,145,720.00	0.07
9	113014	林洋转债	918,644.80	0.05
10	132008	17山高EB	467,721.00	0.03
11	132012	17巨化EB	40,252.00	-

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
17,934	85,483.65	41,035,871.82	2.68%	1,492,027,979.99	97.32%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
集合计划管理人所有从业人员持有本集合计划	792,046.74	0.05%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本集合计划	10~50
本集合计划投资经理持有本集合计划	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

集合计划合同变更生效日(2019年09月25日)集合计划份额总额	82,827,927.78
本报告期期初集合计划份额总额	82,827,927.78
本报告期集合计划总申购份额	1,519,461,150.09
减：本报告期集合计划总赎回份额	69,225,226.06
本报告期集合计划拆分变动份额	-
本报告期期末集合计划份额总额	1,533,063,851.81

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本集合计划管理人重大人事变动如下：

2019年9月28日，本集合计划管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，庄严先生新任本集合计划管理人的总裁助理，朱晓力先生新任本集合计划管理人的首席信息官。

2、本报告期内，本集合计划托管人的专门托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊合伙）的报酬为2万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为1年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，集合计划管理人、集合计划托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

	数量		额的比例		比例	
国泰君安	2	227,405,024.25	100.00%	166,300.75	100.00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	1,137,817,151.95	100.00%	1,269,700,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	君得盛招募说明书	公司官网、证监会指定网站	2019-09-20
2	君得盛管理合同	公司官网、证监会指定网站	2019-09-20
3	君得盛托管协议	公司官网、证监会指定网站	2019-09-20
4	国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划资产管理合同及招募说明书提示性公告	《证券时报》	2019-09-20
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告	《证券时报》、证监会指定网站、公司官网	2019-09-26
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	《证券时报》、证监会指定网站、公司官网	2019-09-28
7	国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	《证券时报》、证监会指定网站、公司官网	2019-10-29

8	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划增加国泰君安证券股份有限公司为代销机构的公告	《证券时报》、证监会指定网站、公司官网	2019-11-08
9	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划增加部分代销机构的公告	《证券时报》、证监会指定网站、公司官网	2019-12-05
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划季度报告提示性公告	《证券时报》	2020-01-20
11	国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划2019年第4季度报告	公司官网、证监会指定网站	2020-01-20

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于同意国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划合同变更的函；
- 2、《国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、集合计划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。

12.2 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>。

12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二〇年三月三十日