

国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划

2021年第2季度报告

2021年06月30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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月21日

§ 1 重要提示

集合计划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。

集合计划托管人根据本集合计划合同规定，于2021年7月16日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年4月1日起至2021年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国君资管君得盈债券
基金主代码	952020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年01月28日
报告期末基金份额总额	483,602,468.95份
投资目标	本集合计划以固定收益品种为主要投资对象，在以资产安全性为优先考虑的前提下，力争获取风险控制下更高的稳健收益。
投资策略	1、 资产配置策略 2、 固定收益品种投资策略 3、 杠杆投资策略 4、 国债期货投资策略 5、 股票投资策略
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深300指数收益率×10%
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。
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	中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	国君资管君得盈债券A	国君资管君得盈债券C
下属分级基金的交易代码	952020	952320
报告期末下属分级基金的份额总额	343,328,051.13份	140,274,417.82份

§ 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(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	国君资管君得盈债券A	国君资管君得盈债券C
1. 本期已实现收益	2,071,769.15	1,158,809.16
2. 本期利润	5,150,570.78	2,941,898.33
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0171	0.0155
4. 期末基金资产净值	350,936,718.71	143,213,594.51
5. 期末基金份额净值	1.0222	1.0210

注：1. 所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。

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。

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

国君资管君得盈债券A净值表现

阶段	净值增长率①	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	1.75%	0.11%	1.31%	0.10%	0.44%	0.01%
自基金合同生效起	1.91%	0.09%	0.88%	0.13%	1.03%	-0.04%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日。

国君资管君得盈债券C净值表现

阶段	净值增长率①	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	1.65%	0.11%	1.31%	0.10%	0.34%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.84%	0.10%	1.57%	0.11%	0.27%	-0.01%

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，国君资管君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

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

国君资管君得盈债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年01月28日-2021年06月30日)



注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日。

国君资管君得盈债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月09日-2021年06月30日)



注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 28 日，国君资管君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 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		
杜浩然	本产品的投资经理，国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利一号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得惠债券集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利	2021-01-28	-	6年	复旦大学金融硕士。2014年7月至2020年5月任国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部助理投资经理、投资经理。2017年9月起任国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划投资经理。2018年6月起任国泰君安君得利一号货币增强集合资产管理计划投

	<p>二号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安现金管家货币集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得金债券分级专项资产管理计划投资经理，国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划投资经理。</p>			<p>资经理，国泰君安君得惠债券集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得利二号货币增强集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划投资经理。2018年11月起任国泰君安现金管家货币集合资产管理计划投资经理，国泰君安君得金债券分级专项资产管理计划投资经理。2018年12月起任国泰君安君得稳一号投资经理（于2020年03月25日更名为国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划）。2020年9月28日起任国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划投资经理。2021年1月28日起任国泰君安君得盈（原国泰君安君得惠二号）投资经理。</p>
<p>周晨</p>	<p>本产品的投资经理，国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划、国泰君安君得明混合型集合资产管理计划、国泰君安君得鑫两年持有期混合型集合资产管理计划、国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划的投资经理。</p>	<p>2021-01-28</p>	<p>-</p>	<p>10年 北京大学金融学硕士，2010年8月至2018年6月任国泰君安证券资产管理公司研究发展部研究员、高级研究员、资深研究员。2018年8月起任国泰君安君得鑫投资经理。2019年2月起任国泰君安君得明（原明星价值）投资经理。2019年6月起任国泰君安君得诚（原君得稳一号）投资经理。2020年6月起任国泰君安君得盛投资经理。2020年4月21日至20</p>

					20年6月6日、2020年6月23日起任国泰君安君得惠二号投资经理。2021年1月28日起任国泰君安君得盈（原国泰君安君得惠二号）投资经理。
杨坤	本产品的投资经理，国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划的投资经理。	2021-04-13	-	8年	浙江大学数学系本科，英国华威大学金融硕士。2010年12月至2012年9月曾任职于工银安盛人寿（原金盛人寿保险）资产管理部，从事投连险账户和分红险账户固定收益投资工作；2012年9月至2014年9月任职于国泰君安证券研究所债券团队；2014年9月至2017年4月任职平安养老固定收益部债券研究主管、投资经理；2017年4月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部资深投资经理、多策略团队负责人。具有10年债券投资研究从业经验。

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。

4.2 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、相关规定以及集合计划合同、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集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同、招募说明书约定的行为，无侵害计划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，本集合计划与本管理人所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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2季度基本面继续复苏，但动能环比1季度有一定下滑。经济同比数据受基数效应影响比较明显，也是重要的原因。货币政策层面，“中性适度”原则下，流动性依然保持充裕。国内债券市场走势平稳，市场利率稳中向下。美债利率在6月议息会议之后震荡向下，基本处于2月利率上行以来的最低位置。2季度国内层面比较重要的变化在于大宗商品的大幅波动。一方面，今年以来国内“碳中和”政策和海外供给不畅是重要因素；另一方面，实体需求趋稳，补库存也支持。此外，也有宽裕货币环境的因素。商品的上涨引发了市场的滞涨预期，但在监管平抑措施之后，市场开始回归平静。随着利率的企稳走低，权益市场开始进入反弹模式，叠加5月美元指数走低，2季度权益市场有不错的收益表现。值得关注的是，进入6月之后，市场预期年内基本面数据逐步见顶，后续价格数据和利率水平将逐步走低，权益市场风格逐步向科技成长类转移。

本报告期内，本集合计划规模增加，我们在初期选择稳扎稳打，逐步提升仓位，目前整体仓位处于适宜水平。对于2021年权益市场，我们依然认为是震荡市，没有趋势性机会，但可以抓住结构性机会。仓位变动必要性低于自下而上的机会把握。2季度在市场反弹的过程中，我们不断优化持仓泛权益资产的结构，降低顺周期品种的比例，加大了未来1年内景气度向上行业的参与力度。尤其关注高端制造业中增速较快且与估值相对匹配的标的，同时更看重组合构建的均衡性。对于债券市场而言，我们判断短期基本面没有太大的上行风险，维持中性仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国君资管君得盈债券A基金份额净值为1.0222元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.75%，同期业绩比较基准收益率为1.31%；截至报告期末国君资管君得盈债券C基金份额净值为1.0210元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.65%，同期业绩比较基准收益率为1.31%。

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集合计划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集合计划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	73,439,095.00	11.74
	其中：股票	73,439,095.00	11.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	515,842,165.66	82.44
	其中：债券	515,842,165.66	82.44
	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	27,657,497.16	4.42
8	其他资产	8,791,713.41	1.41
9	合计	625,730,471.23	100.00

5.2 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	787,476.00	0.16
B	采矿业	1,464,000.00	0.30
C	制造业	48,137,357.40	9.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,800,730.60	0.57
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	7,983,311.00	1.62

J	金融业	12,151,418.00	2.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	114,802.00	0.02
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	73,439,095.00	14.86

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	601398	工商银行	1,020,900	5,278,053.00	1.07
2	603583	捷昌驱动	54,860	2,777,013.20	0.56
3	300253	卫宁健康	157,400	2,560,898.00	0.52
4	002439	启明星辰	80,800	2,344,008.00	0.47
5	601233	桐昆股份	91,600	2,206,644.00	0.45
6	603027	千禾味业	80,960	2,128,438.40	0.43
7	600887	伊利股份	54,900	2,021,967.00	0.41
8	002048	宁波华翔	100,000	1,950,000.00	0.39
9	002415	海康威视	30,000	1,935,000.00	0.39
10	603501	韦尔股份	6,000	1,932,000.00	0.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,727,000.00	10.06

	其中：政策性金融债	49,727,000.00	10.06
4	企业债券	112,591,650.00	22.78
5	企业短期融资券	10,007,000.00	2.03
6	中期票据	298,400,500.00	60.39
7	可转债（可交换债）	45,116,015.66	9.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	515,842,165.66	104.39

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	102000621	20中油股MTN001	300,000	29,649,000.00	6.00
2	101800883	18江岸国资MTN001	200,000	20,868,000.00	4.22
3	143580	18穗发01	200,000	20,180,000.00	4.08
4	101900834	19南电MTN005	200,000	20,138,000.00	4.08
5	101901410	19光明MTN001	200,000	20,078,000.00	4.06

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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,348.64
2	应收证券清算款	120,790.36
3	应收股利	-
4	应收利息	7,979,958.44
5	应收申购款	673,615.97
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,791,713.41

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113044	大秦转债	5,144,500.00	1.04
2	132018	G三峡EB1	4,612,608.00	0.93
3	113024	核建转债	3,072,600.00	0.62
4	128046	利尔转债	2,087,244.02	0.42
5	128097	奥佳转债	2,079,709.60	0.42
6	113025	明泰转债	1,873,900.00	0.38
7	113602	景20转债	1,780,500.00	0.36
8	128032	双环转债	1,722,380.00	0.35
9	113611	福20转债	1,720,600.00	0.35
10	128113	比音转债	1,719,190.00	0.35
11	113012	骆驼转债	1,629,420.00	0.33
12	113037	紫银转债	1,546,950.00	0.31
13	128101	联创转债	1,345,883.00	0.27
14	128119	龙大转债	1,200,390.00	0.24

15	123083	朗新转债	981,550.51	0.20
16	128083	新北转债	929,925.00	0.19
17	127024	盈峰转债	911,285.99	0.18
18	113615	金诚转债	877,200.00	0.18
19	128078	太极转债	829,584.00	0.17
20	127012	招路转债	813,207.60	0.16
21	113021	中信转债	801,572.00	0.16
22	113011	光大转债	739,072.00	0.15
23	127022	恒逸转债	687,506.40	0.14
24	113534	鼎胜转债	401,460.00	0.08

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划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

	国君资管君得盈债券A	国君资管君得盈债券C
报告期期初基金份额总额	210,135,935.91	272,057,652.28
报告期期间基金总申购份额	214,213,999.84	68,581,878.28
减：报告期期间基金总赎回份额	81,021,884.62	200,365,112.74
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	343,328,051.13	140,274,417.82

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

§ 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

本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划合同（现为国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划）变更的回函；
- 2、《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得盈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。

9.2 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>。

9.3 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
2021年07月21日