

# 国泰君安君得盛债券型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金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基金的招募说明书。

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。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安君得盛债券
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
报告期末基金份额总额	67,713,029.69份
投资目标	本基金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>本基金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>本基金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”的方法将基金资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。</p> <p>本基金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</p>

	<p>时机力争为基金资产获取增强型回报。</p> <p>2、固定收益品种投资策略 本基金将采取利率策略、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 本基金将密切关注国内外经济运行情况、国内财政政策和产业政策等政策取向，深入分析国民经济各行业的发展现状及政策影响，并结合行业景气分析，对具有良好发展前景特别是国家重点扶植的行业进行重点配置。</p>	
业绩比较基准	中债综合指数收益率×100%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	国泰君安君得盛债券 A	国泰君安君得盛债券 C
下属分级基金的交易代码	952024	015603
报告期末下属分级基金的份额总额	67,616,368.25 份	96,661.44 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(2023年07月01日-2023年09月30日)	
	国泰君安君得盛债券 A	国泰君安君得盛债券 C
1. 本期已实现收益	-280,628.09	-489.63
2. 本期利润	-2,088,750.52	-3,197.35
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0299	-0.0304
4. 期末基金资产净值	77,611,847.81	110,463.90
5. 期末基金份额净值	1.1478	1.1428

注：1. 所述基金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. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

##### 国泰君安君得盛债券 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	-2.52%	0.21%	0.68%	0.04%	-3.20%	0.17%
过去六个月	-1.96%	0.22%	2.36%	0.04%	-4.32%	0.18%
过去一年	-0.89%	0.26%	3.31%	0.05%	-4.20%	0.21%
过去三年	2.17%	0.35%	13.60%	0.05%	-11.43%	0.30%
自基金合同 生效起至今	4.35%	0.31%	17.03%	0.06%	-12.68%	0.25%

##### 国泰君安君得盛债券 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	-2.59%	0.21%	0.68%	0.04%	-3.27%	0.17%
过去六个月	-2.11%	0.22%	2.36%	0.04%	-4.47%	0.18%
过去一年	-1.18%	0.26%	3.31%	0.05%	-4.49%	0.21%
自基金合同 生效起至今	-1.97%	0.27%	5.18%	0.05%	-7.15%	0.22%

注：国泰君安君得盛债券 C 类份额首次确认日为 2022 年 5 月 13 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

国泰君安君得盛债券 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  
(2019年09月25日-2023年09月30日)



国泰君安君得盛债券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  
(2022年05月13日-2023年09月30日)



注：国泰君安君得盛债券 C 类份额首次确认日为 2022 年 5 月 13 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		
王海军	国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金经理，国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理。现任公募权益投资部基金经理。	2023-02-13	-	15年	王海军，厦门大学工商管理硕士，具备证券业、基金业从业资格。历任中国中投证券有限公司研究所分析师；富国基金管理有限公司权益研究部高级研究员、权益投资部高级基金经理；长安基金管理有限公司研究部总监、投决会成员、基金经理；2021年9月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司私募权益投资部担任投资经理，现任公募权益投资部基金经理。

朱莹	国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，国泰君安安平一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君增利 60 天滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安安裕纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。现任固定收益投资部（公募）基金经理。	2023-05-17	-	4 年	朱莹，上海财经大学经济学学士、国际商务硕士、北卡罗莱纳大学夏洛特分校数理金融硕士、FRM。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益投资部（公募）基金经理，历任固定收益部研究员、投资经理助理；东证期货衍生品研究院高级金融工程分析师。主要从事债券投资研究。
----	---	------------	---	-----	--

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 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、相关规定以及基金合同、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基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、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，因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 16 次。本报告期内，未发现本基金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

三季度债券收益率呈“V”型走势，波动较上季度增大。宏观基本面整体呈现弱修复的态势，制造业 PMI 连续三个月回升，9 月回升至扩张区间。货币政策取向宽松，央行分别在 8 月和 9 月进行了降息和降准的操作。外部环境相对缓和一些，国内资本市场第三季度里整体调整，行业分化较大。美国国债收益率处于高位，未来进一步走高的概率在降低，对国内资本市场的边际影响随着时间的推移在逐渐降低。

本报告期内，泛权益方面本基金依然从现金流质量、财务报表稳健、估值性价比等方面综合判断，行业配置采取均衡价值和成长的策略，兼顾科技和经济复苏布局。债券方面主要配置中短久期利率债，并择机参与利率债波段交易。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安君得盛债券 A 基金份额净值为 1.1478 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.52%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%；截至报告期末国泰君安君得盛债券 C 基金份额净值为 1.1428 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.59%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%。

#### 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	13,623,322.81	13.65
	其中：股票	13,623,322.81	13.65
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	83,414,819.27	83.55
	其中：债券	83,414,819.27	83.55
	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	1,957,691.76	1.96
8	其他资产	840,575.32	0.84
9	合计	99,836,409.16	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,845,982.81	16.53
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	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	398,080.00	0.51
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	379,260.00	0.49
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,623,322.81	17.53



### 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	002847	盐津铺子	7,900	587,444.00	0.76
2	300856	科思股份	8,400	579,600.00	0.75
3	601882	海天精工	18,800	563,624.00	0.73
4	600587	新华医疗	21,600	553,608.00	0.71
5	603309	维力医疗	43,200	552,096.00	0.71
6	688558	国盛智科	16,862	529,972.66	0.68
7	688697	纽威数控	23,357	519,226.11	0.67
8	603027	千禾味业	29,400	509,502.00	0.66
9	002991	甘源食品	6,700	470,608.00	0.61
10	002050	三花智控	15,300	454,410.00	0.58

### 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	6,087,493.97	7.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,658,435.33	92.20
	其中：政策性金融债	71,658,435.33	92.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,668,889.97	7.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	83,414,819.27	107.32

### 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	200212	20 国开 12	200,000	20,480,185.79	26.35
2	210207	21 国开 07	200,000	20,279,770.49	26.09
3	210203	21 国开 03	100,000	10,402,147.54	13.38
4	230203	23 国开 03	100,000	10,265,709.59	13.21
5	230202	23 国开 02	100,000	10,230,621.92	13.16

## 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

本基金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

本基金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

本基金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

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金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	11,680.84
2	应收证券清算款	828,735.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	159.26
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	840,575.32

### 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	110081	闻泰转债	807,718.05	1.04
2	123108	乐普转 2	673,862.88	0.87
3	128136	立讯转债	611,607.16	0.79
4	113060	浙 22 转债	462,801.78	0.60
5	113024	核建转债	378,537.58	0.49
6	123035	利德转债	332,374.49	0.43
7	113053	隆 22 转债	212,119.67	0.27
8	110073	国投转债	168,077.98	0.22
9	123107	温氏转债	161,436.17	0.21

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金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

	国泰君安君得盛债券 A	国泰君安君得盛债券 C
报告期期初基金份额总额	71,751,579.18	131,123.09
报告期期间基金总申购份额	90,146.54	5,782.65
减：报告期期间基金总赎回份额	4,225,357.47	40,244.30
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	67,616,368.25	96,661.44

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额且无份额变动情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未发生本基金交易情况。

## § 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金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、关于准予国泰君安君得盛债券型集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得盛债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得盛债券型证券投资基金招募说明书》；

- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金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

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.gtjazg.com>。

## 9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金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  
二〇二三年十月二十五日