
国泰君安君得诚混合型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月21日复核了本报告中的主要财务指标、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2022年7月1日起至2022年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安君得诚混合
基金主代码	952035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年03月25日
报告期末基金份额总额	253,690,519.00份
投资目标	本基金利用基金管理人的研究优势，主要投资于具备持续增长能力的优秀企业，并通过宏观、市场和价值分析，捕捉价值型公司（价值公司）的投资机会。通过科学合理的资产配置和股票组合，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、 资产配置策略 2、 股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 行业配置策略 (2) 公司股票精选策略 3、 组合调整策略 4、 股指期货、 国债期货交易策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 股指期货投资策略 (2) 国债期货投资策略 5、 债券的投资策略

	(1) 利率策略 (2) 信用策略 (3) 债券选择策略 (4) 可转债的投资策略 6、 资产支持证券等品种投资策略 7、 股票期权的投资策略 8、 港股投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。
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	招商银行股份有限公司

§ 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（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
1. 本期已实现收益	12,052,255.72
2. 本期利润	-27,690,754.77
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1074
4. 期末基金资产净值	235,060,462.84
5. 期末基金份额净值	0.9266

注：1、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。

2、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。

3.2 基金净值表现

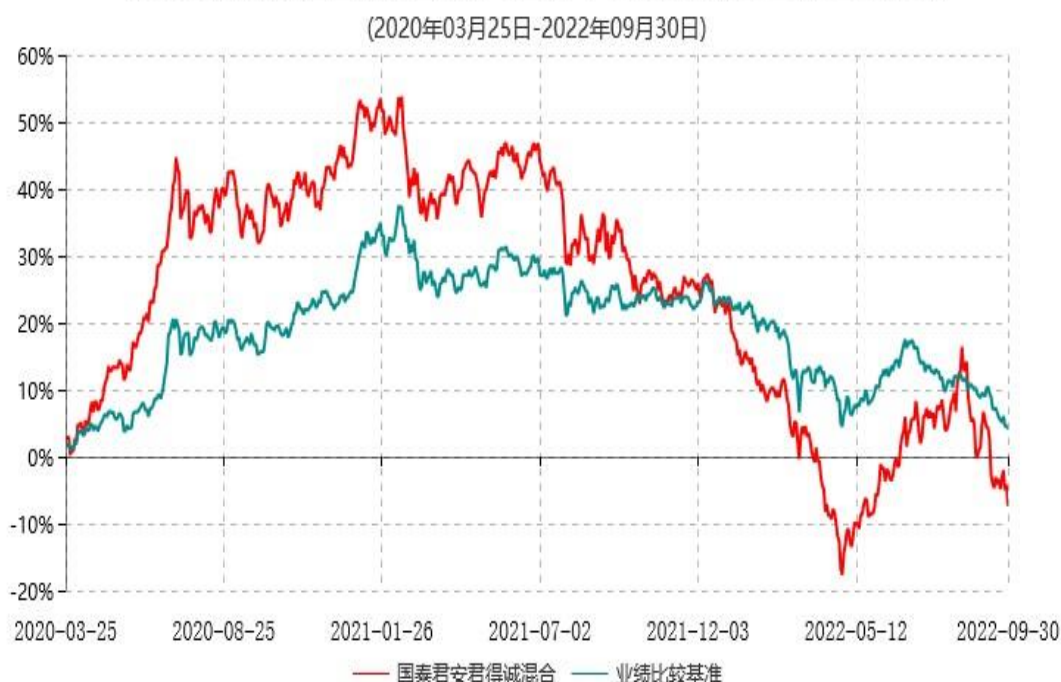
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	-10.59%	1.92%	-11.07%	0.64%	0.48%	1.28%
过去六个月	-6.69%	1.86%	-7.40%	0.83%	0.71%	1.03%
过去一年	-27.10%	1.55%	-15.17%	0.84%	-11.93%	0.71%
自基金合同生效起至今	-7.34%	1.38%	4.20%	0.84%	-11.54%	0.54%

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

国泰君安君得诚混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 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		
季鹏	本基金基金经理，现担任公募权益投资部基金经	2021-08-17	-	13年	季鹏，硕士研究生学历，拥有CFA、FRM资格。曾在

	理。				海通国际证券、光大保德信基金公司、华宝基金公司从事行业高级研究员、首席策略分析师、基金经理等工作，拥有13年证券从业经验、7年基金管理经验，先后管理华宝宝康灵活配置等多只基金产品。2021年1月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现担任公募权益投资部基金经理。自2021年8月17日至2022年2月13日担任“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”投资经理，自2022年2月14日起担任“国泰君安君得诚混合型证券投资基金”基金经理。
郑伟	本基金基金经理，国泰君安君得明混合型证券投资基金基金经理，本公司权益投资部总经理。	2022-02-21	-	12年	郑伟，经济学硕士，毕业于复旦经济学院国际金融系。于2021年9月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司公募权益投资部。从业时间超过15年，具备丰富的行业研究经验及管理基金经历。此前就职于中信保诚基金，历任研究员、基金经理、高级基金经理。自2022年2月21日起担任“国泰君安君得诚混合型证券投资基金”基金经理。自2022年3月22日起担任“国泰君安君得明混合型证券投资基金”基金经理。
葛瑾	本基金基金经理，9年证券	2022-	-	9	葛瑾洁，复旦大学硕士。

洁	从业经验, 研究功底扎实, 具备复合专业背景及产业工作经验。	02-21		年	于2021年11月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司权益研究部。9年证券从业经验, 研究功底扎实, 具备复合专业背景及产业工作经验。历任深圳华大基因研究院知识产权部专利顾问, 华润元大基金管理有限公司投资管理部高级研究员, 基金经理助理。2017年9月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任研究部高级研究员、社保基金经理助理、投资经理。自2022年2月21日起担任“国泰君安君得诚混合型证券投资基金”基金经理。
---	--------------------------------	-------	--	---	---

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及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金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，本基金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

2022年三季度，市场在国内外多重因素影响下再次回落，市场情绪较为低迷。

宏观上看，国内经济结束了疫情后的快速修复阶段，工业企业处于主动去库存阶段，疫情和地产的风险对需求持续形成抑制，下半年经济难以实现“V型”反转。M2高增，实体经济融资需求较弱，金融市场流动性处于极度充裕水平，央行也开始主动缩减逆回购数量，适当回笼流动性。仅考虑国内经济和流动性环境，A股市场处于上行、下行空间都较为有限的阶段，市场会不断挖掘新的主题投资机会。短期不确定性风险主要来自中美关系和欧美经济，全球高通胀导致的衰退环境下，是否会出现黑天鹅事件，仍需要密切关注。

传统经济偏弱，流动性充裕环境下中小市值风格相对走强，同时行业上要更多关注和经济相关性低，自身产业周期处于高景气戒断的行业。我们将紧密跟踪经济复苏以及内外部环境对政策制约情况的变化，深化个股基本面研究，重点挖掘各领域最优秀公司的投资机会，把握中国长期经济增长和产业结构升级带来的机会。

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诚混合基金份额净值为0.9266元，本报告期内，基金份额净值增长率为-10.59%，同期业绩比较基准收益率为-11.07%。

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	189,609,033.90	80.37
	其中：股票	189,609,033.90	80.37
2	基金投资	-	-
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	46,204,748.93	19.59
8	其他资产	101,272.70	0.04
9	合计	235,915,055.53	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币28.17元，占期末净值比例为0.00%；通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为0.00元，占资产净值的比例为0.00%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	187,227,461.61	79.65
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	13,018.80	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,290,380.00	0.97
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	78,145.32	0.03
N	水利、环境和公共设施管	-	-

	理业		
0	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	189,609,005.73	80.66

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
日常消费品	28.17	0.00
合计	28.17	0.00

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	300316	晶盛机电	206,140	13,939,186.80	5.93
2	002129	TCL中环	301,700	13,504,092.00	5.74
3	688596	正帆科技	330,144	12,264,849.60	5.22
4	300014	亿纬锂能	122,100	10,329,660.00	4.39
5	002011	盾安环境	678,000	9,831,000.00	4.18
6	300750	宁德时代	22,300	8,939,847.00	3.80
7	688599	天合光能	117,027	7,502,600.97	3.19
8	300724	捷佳伟创	63,100	7,270,382.00	3.09
9	000049	德赛电池	164,900	6,858,191.00	2.92
10	300916	朗特智能	131,100	6,856,530.00	2.92

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金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

本基金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 本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	98,181.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,090.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	101,272.70

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

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

报告期期初基金份额总额	263,246,281.76
报告期期间基金总申购份额	1,007,093.21
减：报告期期间基金总赎回份额	10,562,855.97
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	253,690,519.00

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 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诚混合型集合资产管理计划变更注册的批复
- 2、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得诚混合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

2022年10月26日