

国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

2014年第1季度报告

一、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。

集合计划托管人于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标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。

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，投资者在做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2014年1月1日起至2014年3月31日止。

二、集合计划产品概况

集合计划名称:	国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划
集合计划类型:	限定性
成立日期:	2012年6月13日
成立规模:	380,793,896.52
存续期:	未约定
业绩比较基准:	30%*沪深300指数收益率+70%*一年定期存款税后利率
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:	上海浦东发展银行股份有限公司

三、主要财务指标和集合计划净值表现

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。

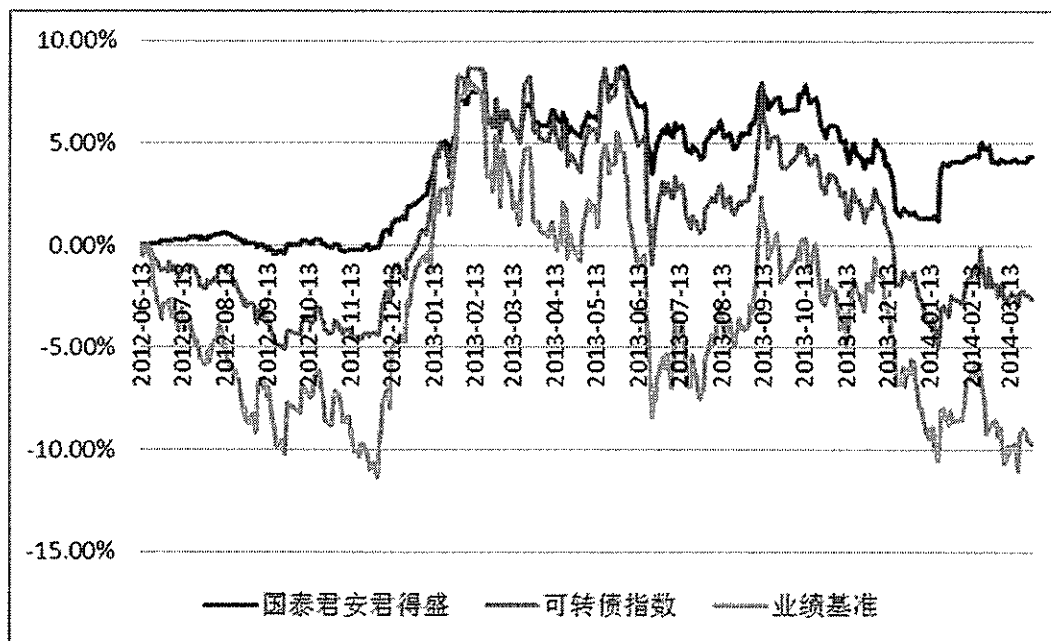
(一) 主要财务指标

单位：元

集合计划本期利润	1,973,502.29
集合计划加权平均份额本期利润	0.0261
期末集合计划资产净值	51,421,221.37
期末集合计划份额净值	1.004



(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, 并与同期业绩比较基准的变动的比较。



四、管理人报告

(一) 投资经理简介

李玉刚

13年从业经历, 北京大学经济学硕士。历任国泰君安证券研究所金融工程部研究员、新产品开发小组、衍生产品部及资产管理部量化研究总监。现任国泰君安证券资产管理公司量化投资部总经理, “君享量化” “君享超越一号” 等投资经理。

屠旭东

12年从业经历, 浙江大学计算机应用硕士。历任国泰君安证券衍生产品部可转债债券研究员, 现任上海国泰君安证券资产管理有限公司 “君得盛” 投资经理。

(二) 报告期内集合计划业绩表现

截止2014年3月31日, 本集合计划单位净值为1.004元。本期单位净值增长率为2.75%, 集合计划单位累计净值增长率为4.34%。

(三) 投资经理工作报告

2014年一季度股票市场表现继续分化, 由于新股发行及对经济下滑的担心, 大

盘指数持续下跌，代表新兴行业的创业板指数在创出新高后也出现了震荡下跌。但是，市场的结构性机会仍层出不穷，新股恢复发行带来的主体性炒作让不少基金的净值出现了大幅上涨。可转债指数在一季度出现了1.33%的下跌，因为可能会出现优先股，以及一季度仍然偏紧的货币流动性，抑制了可转债市场的反弹力度。

本产品管理团队一季度把握了新股恢复发行带来的机会，积极参与新股网下申购，同时，重视各种风险较低的绝对收益机会，持有防御品种的可转债保持在较低仓位，使产品净值在本季度实现了较高的增长，为投资者实现了绝对收益的回报。

展望二季度，我们将继续关注新股规则完善后的网下投资机会，积极参与新股投资。同时，我们也注意到，虽然经济的下滑并未结束，但市场已经提前通过持续系统性的下跌留足了安全空间。证券市场的一系列改革措施有望加速推出，国内可转债市场及股票市场有望走出长期低迷，我们将认真分析，把握其中的投资机会，为投资者实现绝对收益回报而继续努力。

五、投资组合报告

(一) 集合计划会计报告

1. 集合计划资产负债表

单位：人民币元

资产	2014年3月31日	2013年12月31日
资产：		
银行存款	14,265,763.80	1,458,502.30
结算备付金	2,815,052.80	150,021.27
存出保证金	11,083.91	6,919.16
交易性金融资产	42,909,275.10	24,532,894.65
其中：股票投资	10,244,603.40	0.00
债券投资	11,657,300.00	20,856,724.00
基金投资	21,007,371.70	3,676,170.65
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
信托投资	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	12,000,000.00
应收证券清算款	0.00	4,105,948.12
应收利息	70,920.26	120,983.24
应收股利	27,105.37	2,293.26
应收申购款	1,172,326.75	748,912.61

其他资产	0.00	0.00
资产合计	61,271,527.99	43,126,474.61

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债及持有人权益	2014年3月31日	2013年12月31日
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	4,249,346.32	0.00
应付赎回款	5,395,549.57	243,563.61
应付管理人报酬	114,365.17	36,228.97
应付托管费	13,272.60	7,245.78
应付投资咨询费	0.00	0.00
应付交易费用	17,978.78	1,265.39
应付税收	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	59,794.18	40,549.67
负债合计	9,850,306.62	328,853.42
所有者权益：		
实收基金	51,217,568.88	43,574,624.33
未分配利润	203,652.49	-777,003.14
持有人权益合计	51,421,221.37	42,797,621.19
负债及持有人权益总计	61,271,527.99	43,126,474.61

2. 集合计划经营业绩表

单位：人民币元

项目	本期金额
一、收入	2,241,967.78
1、利息收入	377,221.39
其中：存款利息收入	82,429.16
债券利息收入	47,539.29
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售证券资产收入	247,252.94
2、投资收益（损失以“-”填列）	1,182,326.00
其中：股票投资收益	1,639,547.71
债券投资收益	-335,873.74
基金投资收益	-188,593.39
权证投资收益	0.00
资产支持证券投资收益	0.00
信托投资收益	0.00
衍生工具收益	0.00
股利收益	67,245.42
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	630,831.51
4、其他收入（损失以“-”填列）	51,588.88
二、费用	268,465.49
1、管理人报酬	185,798.80

2、托管费	37,159.75
3、客户服务费	0.00
4、交易费用	25,372.24
5、利息支出	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00
6、其他费用	20,134.70
三、净利润	1,973,502.29

(二) 集合计划投资组合报告

1、报告期末集合计划资产组合情况

	金额(元)	占总资产比例
股票投资	10,244,603.40	16.72%
债券投资	11,657,300.00	19.03%
基金投资	21,007,371.70	34.29%
银行存款和清算备付金合计	17,080,816.60	27.88%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
其他资产	1,281,436.29	2.09%
合计	61,271,527.99	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。

2、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	证券代码	证券名称	数量(股)/(张)	期末市值(元)	占净值比例
1	091022	大成现金增利B	5,007,018.48	5,007,018.48	9.74%
2	003003	华夏现金增利A	5,000,000.00	5,000,000.00	9.72%
3	040039	华安日日鑫B	5,000,000.00	5,000,000.00	9.72%
4	000343	华夏财富宝	5,000,000.00	5,000,000.00	9.72%
5	110023	民生转债	48,000.00	4,248,000.00	8.26%
6	600795	国电电力	1,716,100.00	4,049,996.00	7.88%
7	601988	中国银行	1,198,360.00	3,103,752.40	6.04%
8	601398	工商银行	895,900.00	3,090,855.00	6.01%
9	110017	中海转债	30,000.00	2,736,900.00	5.32%
10	113001	中行转债	28,000.00	2,735,600.00	5.32%

(三) 投资组合报告附注

1、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。

2、集合计划的其他资产构成(单位：元)

应收证券清算款	0.00
应收利息	70,920.26
应收股利	27,105.37
存出保证金	11,083.91
应收申购款	1,172,326.75
其他应收款	0.00

合计	1,281,436.29
----	--------------

六、开放式集合计划份额变动（单位：份）

期初总份额	期间参与份额	期间退出份额	期末总份额
43,574,624.33	61,027,525.85	53,384,581.30	51,217,568.88

七、备查文件目录

（一）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、《国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划集合计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君得盛可转换债券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；

（二）存放地点

文件存放地点：上海市银城中路168号上海银行大厦24层

网址：<http://www.gtjazg.com>

信息披露电话：021-38676631

联系人：孙磊

EMAIL：sunlei@gtjas.com

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

