

# 国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

## 2014年第4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2015年1月19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10月1日起至2014年12月31日止。

### 二、集合计划产品概况

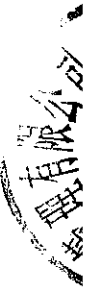
集合计划名称:	国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划
集合计划类型:	限定性
成立日期:	2012年6月13日
成立规模:	380,793,896.52
存续期:	未约定
业绩比较基准:	30%*沪深300指数收益率+70%*一年定期存款税后利率
集合计划管理人:	上海国泰君安证券资产管理有限公司
集合计划托管人:	上海浦东发展银行股份有限公司

### 三、主要财务指标

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。

单位：元

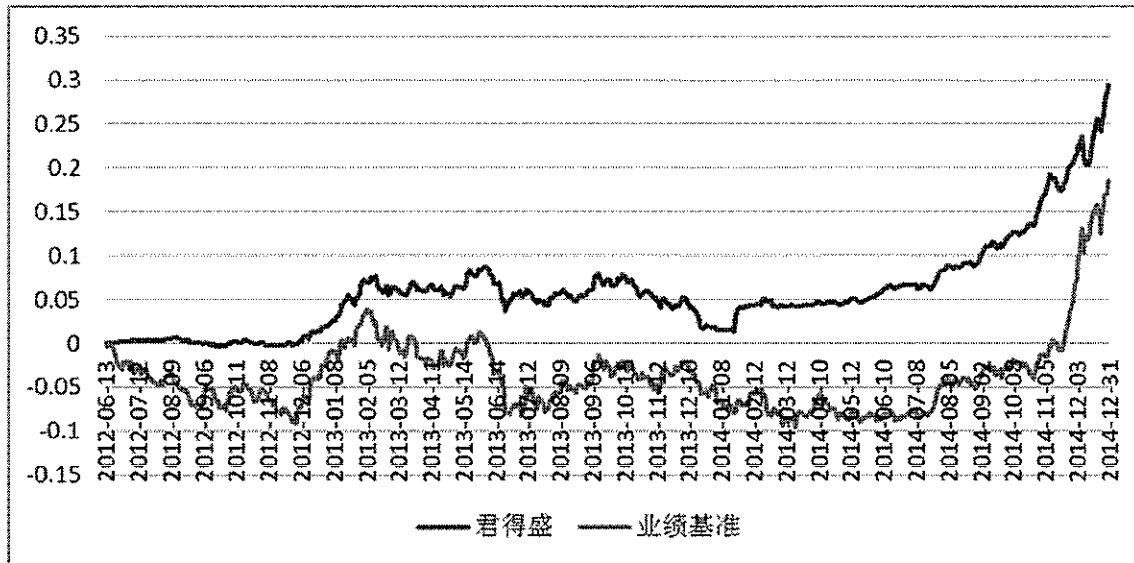
集合计划本期利润	6,715,347.87
集合计划加权平均份额本期利润	0.1689
期末集合计划资产净值	48,432,400.59
期末集合计划份额净值	1.254



#### 四、价值变动情况

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。

集合计划累计份额净值增长率与业绩基准收益率的历史走势对比图



#### 五、报告期内资产运作情况

##### (一) 投资经理简介

钟玉聪

中国科学院数学与系统科学研究院概率论与数理统计博士；8年证券从业经验；历任国泰君安证券研究所衍生产品部研究员、国泰君安证券资产管理总部研究员等职，现任“上证央企”、“君享套利”投资经理。

##### (二) 报告期内集合计划业绩表现

截止2014年12月31日，本集合计划单位净值为1.254元。本期单位净值增长率为15.68%，集合计划单位累计净值增长率为30.31%。

##### (三) 投资经理工作报告

四季度股票市场在券商、银行等权重股的带领下涨幅高达44.76%，指数大涨、气势如虹，但是创业板指数却逆势下跌了4.48%；可以说大涨的背后蕴含着风险，持仓的品种错误可能导致“牛市不涨”甚至“牛市亏损”。四季度板块轮动也很快，上涨的品种并不广泛，常常上演天量的二八行情，即：只有20%的股票上涨指数大涨成交量巨大的行情，让很多投资者感受到市场的变幻和威力。可转债市

场则在各正股的轮番上涨带动下140元以下的转债品种已经基本消失了，很多可转债触发了回购条款已经陆续开始被发行公司回购。在国泰君安投研团队看来，本次牛市基于流动性宽松、市场无风险利率下降、GDP接近底部企稳等多个因素，市场活跃为我们带来的更多更好的绝对收益机会，可转债也会伴随股票牛市的到来创出新一轮的上涨行情，本季度君得盛净值涨幅达到15.68%。

我们的持有品种以低估值高分红业绩持续稳健增长的蓝筹类股票的转债为主，本期参与的可转债投资，区间涨幅也非常可观，为产品贡献了不少净值涨幅。参与申购新可转债及所持有的债券型基金也为产品净值增长有不少正贡献。

我们认为，2015年市场面临的流动性环境依然宽松，随着国企改革的推进和注册制推出，将会出现很多投资机会，2015年将是获取绝对收益的好年份，我们将择优选择可转债，优化资产配置，积极参与各类绝对收益品种机会，致力于产品业绩的稳定增长。

## 六、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12月31日	2013年12月31日
资产：		
银行存款	20,136,558.96	1,458,502.30
结算备付金	79,984.66	150,021.27
存出保证金	28,475.24	6,919.16
交易性金融资产	28,646,439.65	24,532,894.65
其中：股票投资	1,812,588.00	0.00
债券投资	15,752,466.08	20,856,724.00
基金投资	11,081,385.57	3,676,170.65
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	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	61,564.71	120,983.24
应收股利	0.00	2,293.26
应收申购款	238,609.73	748,912.61
其他资产	0.00	0.00
资产合计	49,191,632.95	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12月31日	2013年12月31日
<b>负债：</b>		
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	0.00	0.00
应付赎回款	648,878.71	243,563.61
应付管理人报酬	49,000.29	36,228.97
应付托管费	8,014.71	7,245.78
应付投资咨询费	0.00	0.00
应付交易费用	11,444.85	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	41,893.80	40,549.67
<b>负债合计</b>	<b>759,232.36</b>	<b>328,853.42</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	38,625,454.68	43,574,624.33
未分配利润	9,806,945.91	-777,003.14
<b>持有人权益合计</b>	<b>48,432,400.59</b>	<b>42,797,621.19</b>
<b>负债及持有人权益总计</b>	<b>49,191,632.95</b>	<b>43,126,474.61</b>

注：本期末“应付管理人报酬”项目包含“应付业绩报酬”金额为8,926.68元。

## 2. 损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额
<b>一、收入</b>	<b>6,908,567.01</b>
1、利息收入	67,675.31
其中：存款利息收入	38,071.41
债券利息收入	27,048.34
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售证券资产收入	2,555.56
2、投资收益（损失以“-”填列）	4,076,670.05
其中：股票投资收益	174,748.37
债券投资收益	2,337,594.31
基金投资收益	1,353,400.17
权证投资收益	0.00
资产支持证券投资收益	0.00
衍生工具收益	0.00
股利收益	210,927.20
其他收益	0.00
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	2,744,323.26
4、其他收入（损失以“-”填列）	19,898.39
<b>二、费用</b>	<b>193,219.14</b>
1、管理人报酬	113,852.34
2、托管费	22,770.46
3、客户服务费	0.00
4、交易费用	37,001.61

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	19,594.73
三、净利润	6,715,347.87

## (二) 集合计划投资组合报告

### 1、投资组合情况

#### (一) 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）	期末市值（元）	占净值比例
1	217008	招商安本增利债券	3,293,702.69	4,677,387.19	9.66%
2	163812	中银双利债券B	3,279,746.32	4,263,670.22	8.80%
3	110023	民生转债	26,800.00	3,702,956.00	7.65%
4	132001	14宝钢EB	25,400.00	3,387,852.00	7.00%
5	162299	泰达宏利集利债券C	1,687,423.65	2,140,328.16	4.42%
6	601318	中国平安	23,800.00	1,778,098.00	3.67%
7	113002	工行转债	11,720.00	1,747,452.00	3.61%
8	113001	中行转债	11,040.00	1,726,545.60	3.56%
9	110015	石化转债	12,100.00	1,629,870.00	3.37%
10	110018	国电转债	5,210.00	1,073,260.00	2.22%

### (三) 投资组合报告附注

1、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的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、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。

#### 3、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	61,564.71
应收股利	0.00
存出保证金	28,475.24
应收申购款	238,609.73
其他应收款	0.00
合计	328,649.68

## 七、资产配置情况

	金额（元）	占总资产比例
股票投资	1,812,588.00	3.68%
债券投资	15,752,466.08	32.02%
基金投资	11,081,385.57	22.53%

银行存款和清算备付金合计	20,216,543.62	41.10%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
其他资产	328,649.68	0.67%
合计	49,191,632.95	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。

## 八、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
38,287,397.70	20,714,303.78	20,376,246.80	38,625,454.68

## 九、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

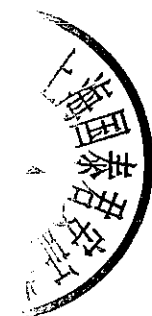
网址：<http://www.gtjazg.com>

信息披露电话：021-38676631

联系人：孙磊

EMAIL：[sunlei@gtjas.com](mailto: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

