

# 国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

## 2014年度报告

### 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3月6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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2014年1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

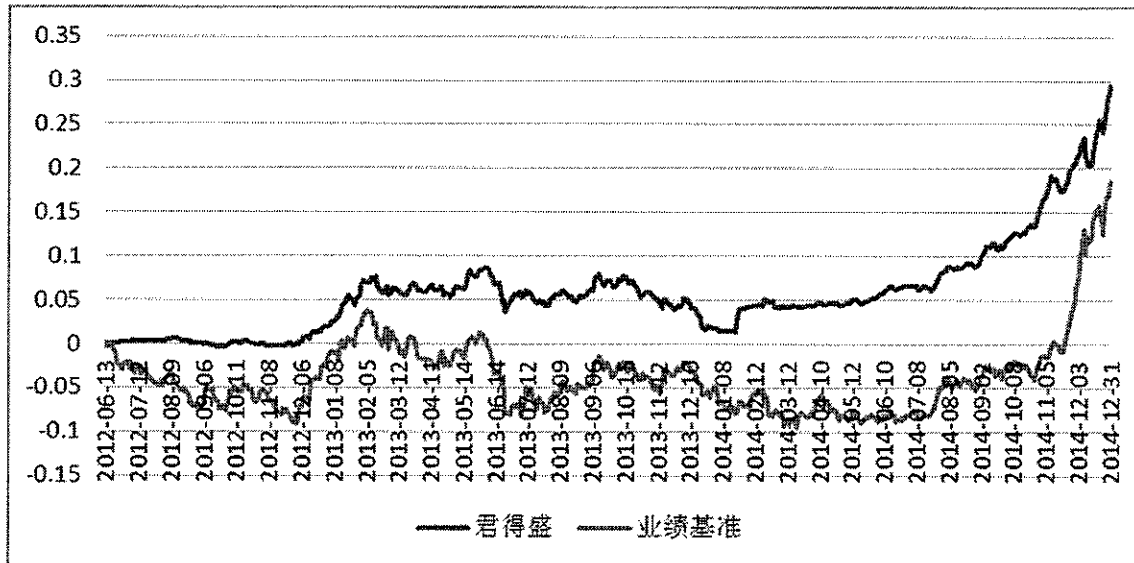
下述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

集合计划本期利润	12,106,988.40
集合计划加权平均份额本期利润	0.2385
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
期末集合计划份额累计净值	1.294

## 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28.34%,集合计划单位累计净值增长率为30.32%。

### (三) 投资经理工作报告

#### 2014年市场回顾

2014年,全年的可转债市场都如同A股市场一样走出一根长阳线;纯债券市场也是欣欣向荣;属于股债双牛的一年。本年度虽然获利机会很多;但因为普涨时期只有部分可转债能跑赢大盘,所以很多投资者还是亲历了满仓滞涨的格局。

君得盛投研团队本着以较低风险，获取稳健收益的目标，在2014年里抓住了前半年的纯债基金机会、下半年重仓低估值蓝筹股可转债，抓住了可转债牛市带来的投资机会、全年积极的参与了新发行可转债的投资、也积极的参与了新股网上投资；使得全年产品净值在低回撤的基础上实现了稳健的增长，涨幅达到28.34%。

## 2015年投资展望

君得盛投研团队认为2015年中国经济仍然在转型的过程中，经济依然会疲弱而通胀持续低位会有持续降息降准预期，因此纯债券市场仍有配置价值；因为长期利率下行，所以资本市场的牛市大概率会持续，因此可转债的行情会伴随牛市持续；国企改革与经济转型的预期可能导致股市结构化行情纵深发展；流动性的进一步放松与财富效应一起带来增量资金入场；注册制带来的新股新机会等。这些预测总结下来即是2015年获取较为确定的低风险收益机会颇多，我们投研团队会努力抓住这些机会，在2015年的投资过程中继续为获取绝对收益而努力，敬请期待。

## 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. 集计划经营业绩表

单位：人民币元

项目	本期金额
<b>一、收入</b>	<b>12,963,985.05</b>
1、利息收入	581,693.06
其中：存款利息收入	163,648.42
债券利息收入	142,515.30
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售证券资产收入	275,529.34
2、投资收益（损失以“-”填列）	6,254,409.80
其中：股票投资收益	2,309,874.48
债券投资收益	2,167,492.50
基金投资收益	1,302,918.87
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	474,123.95
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	6,025,603.70
4、其他收入（损失以“-”填列）	102,278.49
<b>二、费用</b>	<b>856,996.65</b>
1、管理人报酬	529,659.98
2、托管费	105,931.99
3、客户服务费	0.00
4、交易费用	142,720.28

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	78,684.40
三、净利润	12,106,988.40

## （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所有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、集合计划投资的所有证券中，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
43,574,624.33	104,641,788.62	109,590,958.27	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

