

国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

2015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。

托管人对管理人编制的该产品2015年第四季度报告中的主要财务指标、投资组合报告、资产配置情况、开放式集合计划份额变动等数据，认为上述复核内容中的财务数据真实、准确和完整。

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2015年10月1日起至2015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

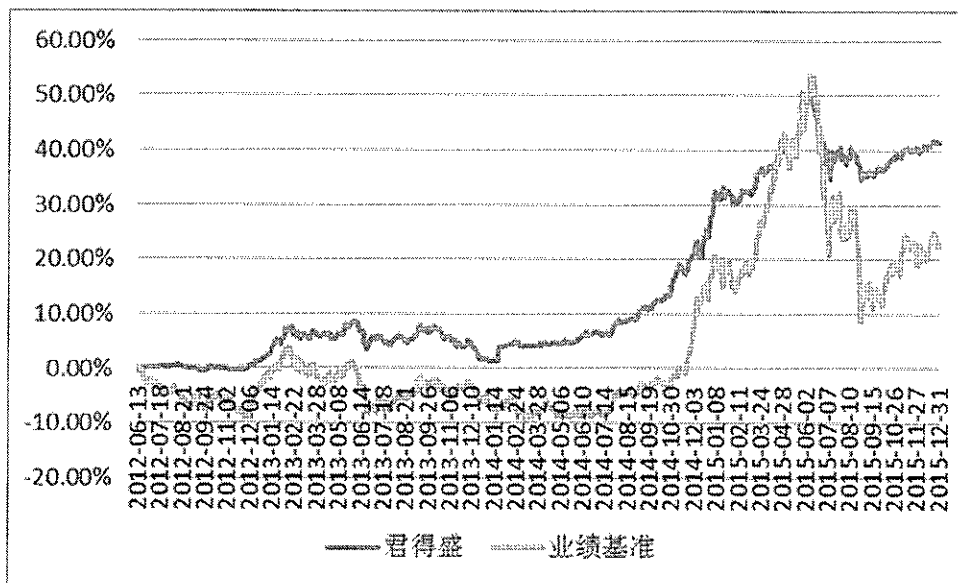
集合计划本期利润	2,387,236.39
集合计划加权平均份额本期利润	0.0523

期末集合计划资产净值	45,849,983.29
期末集合计划份额净值	1.061
期末集合计划份额累计净值	1.416

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2015年12月31日,本集合计划单位净值为1.061元。本期单位净值增长率为5.05%,集合计划单位累计净值增长率为44.47%。

(三) 投资经理工作报告

股指经历过2015年3季度的大幅下挫之后，4季度迎来一个温和的修复行情，沪深300指数在此期间上涨16.49%，其中表现最为突出的仍然是中小板，创业板。目前市场上在流通的可转债品种较少，大部分也随着大盘的修复持续了一段上涨的行情；年底不少新的可转债开始上市发行。投研团队认为，虽然可转债在最后一季度走出了修复行情，但实体经济基本面的改善尚需时日，上市公司业绩回升也无法一蹴而就，而且政策面目前尚不明朗，因此我们仍需谨慎持仓。在这种背景下，投研团队认为持仓主要以攻守兼备的二级债基为主，可转债的仓位仍然保持较低仓位，流动资金用于申购新的可转债和新股，因此君得盛本季度取得5.05%的正收益。

2016年我们认为多空双方博弈仍然激烈，行情波动会比较大，投研团队仍然会采取较为保守的策略，在保证本金安全的前提下博取绝对收益，因此配置与四季度会较为类似。

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	2015年12月31日	2014年12月31日
资产：		
银行存款	7,464,848.56	20,136,558.96
结算备付金	21,853.50	79,984.66
存出保证金	15,018.80	28,475.24
交易性金融资产	38,663,359.27	28,646,439.65
其中：股票投资	1,520,315.00	1,812,588.00
债券投资	11,376,202.41	15,752,466.08
基金投资	25,766,841.86	11,081,385.57
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	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	22,349.65	61,564.71
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	238,609.73

其他资产	0.00	0.00
资产合计	46,187,429.78	49,191,632.95

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债及持有人权益	2015年12月31日	2014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	0.00	0.00
应付赎回款	204,818.37	648,878.71
应付管理人报酬	39,579.63	49,000.29
应付托管费	7,895.17	8,014.71
应付投资咨询费	0.00	0.00
应付交易费用	4,536.51	11,444.85
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	80,616.81	41,893.80
负债合计	337,446.49	759,232.36
所有者权益：		
实收基金	43,217,460.28	38,625,454.68
未分配利润	2,632,523.01	9,806,945.91
持有人权益合计	45,849,983.29	48,432,400.59
负债及持有人权益总计	46,187,429.78	49,191,632.95

注：本期末“应付管理人报酬”项目包含“应付业绩报酬”金额为103.75元。

2. 损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额
一、收入	2,547,559.71
1、利息收入	63,109.81
其中：存款利息收入	42,153.76
债券利息收入	19,208.98
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售证券资产收入	1,747.07
2、投资收益（损失以“-”填列）	726,290.13
其中：股票投资收益	0.00
债券投资收益	338,988.99
基金投资收益	387,301.14
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	0.00

其他收益	0.00
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	1,751,459.45
4、其他收入（损失以“-”填列）	6,700.32
二、费用	160,323.32
1、管理人报酬	120,149.66
2、托管费	24,029.95
3、客户服务费	0.00
4、交易费用	5,213.98
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	10,929.73
三、净利润	2,387,236.39

（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	000639	宝盈祥瑞养老混合	3,239,334.43	4,470,281.51	9.75%
2	630103	华商收益增强债券B	3,479,776.45	4,450,634.08	9.71%
3	162299	泰达宏利集利债券C	2,895,952.56	4,431,965.80	9.67%
4	128112	国投瑞银优化增强债券C	2,818,791.95	4,349,395.98	9.49%
5	213917	宝盈增强收益债券C	3,249,767.87	4,340,064.99	9.47%
6	132002	15天集EB	21,590.00	2,482,850.00	5.42%
7	132005	15国资EB	21,320.00	2,450,520.80	5.34%
8	470078	汇添富增强收益债券C	1,751,344.09	2,187,428.77	4.77%
9	113008	电气转债	9,730.00	1,339,237.20	2.92%
10	132003	15清控EB	9,450.00	1,304,100.00	2.84%

（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	22,349.65
应收股利	0.00
存出保证金	15,018.80
应收申购款	0.00
其他应收款	0.00
合计	37,368.45

七、资产配置情况

	金额（元）	占总资产比例
股票投资	1,520,315.00	3.29%
债券投资	11,376,202.41	24.63%
基金投资	25,766,841.86	55.79%
银行存款和清算备付金合计	7,486,702.06	16.21%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
其他资产	37,368.45	0.08%
合计	46,187,429.78	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
48,207,190.77	1,716,864.77	6,706,595.26	43,217,460.28

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：李艳

EMAIL：liyan016199@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

