

# 国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

## 2016 年第 3 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 2016 年 2 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进行了复核，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 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 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	734,213.79
集合计划加权平均份额本期利润	0.0232

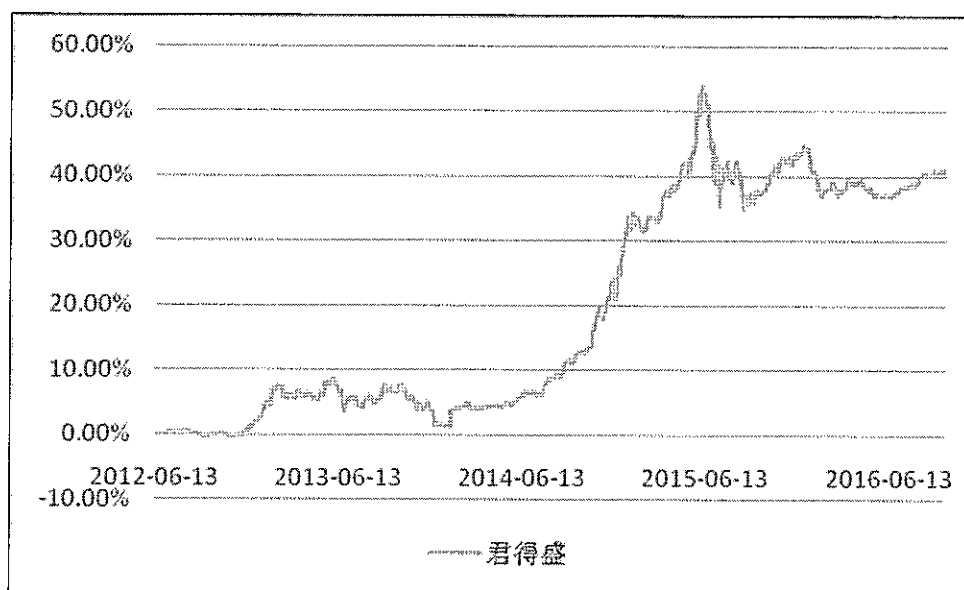


期末集合计划资产净值	31,564,676.73
期末集合计划份额净值	1.037
期末集合计划份额累计净值	1.392

#### 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。

集合计划累计份额净值增长率历史走势图



#### 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2016年9月30日，本集合计划单位净值为1.037元。本期单位净值增长率为2.37%，集合计划单位累计净值增长率为41.20%。

##### (三) 投资经理工作报告

三季度沪深300指数结束两个季度的下跌趋势，探底回升，季度涨幅为3.08%；债券市场则延续第二季度的上涨态势，本季度大部分一级债基以及分级基

金 A 保持上涨创近期新高。本季度新股发行的节奏比上季度快，基本上每周都有一批新股发行，但由于二级市场的交投并不十分活跃，避险情绪较浓，网下申购也无需占用产品的资金，导致网下中签率创历史新低，按照证监会规定的上限申报的原则，中签获取的收益率低于前几个季度；本季度没有适合我们申购的可转债上市。宏观而言，国内经济仍然疲弱，一级二级市场融资环境恶化，人民币进入持续贬值通道，内忧外患，预计短期内 A 股指数有大幅度表现也很难发生，所以与股市相关性较大的可转债市场短期内也没有亮眼表现的可能。在可转债市场持续低迷的前提下，君得盛投资团队把握纯债基金及分级 A 的投资机会，使产品净值三季度增长 2.37%。

预计未来的操作中，我们仍然会谨慎投资可转债市场，在纯债市场和一级市场寻找较为确定性的投资机会；投研团队会尽量规避可转债资产的系统性风险，获取正收益。

## 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	2016 年 9 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	2,669,485.72	7,464,848.56
结算备付金	0.00	21,853.50
存出保证金	10,243.88	15,018.80
交易性金融资产	28,969,140.32	38,663,359.27
其中：股票投资	130,405.00	1,520,315.00
债券投资	9,292,709.92	11,376,202.41
基金投资	19,546,025.40	25,766,841.86
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	42,838.66	22,349.65
应收股利	3.41	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	31,691,711.99	46,187,429.78

#### 集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债及持有人权益	2016 年 9 月 30 日	2015 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	38,874.13	204,818.37
应付管理人报酬	25,898.55	39,579.63
应付托管费	5,179.72	7,895.17
应付投资咨询费	0.00	0.00
应付交易费用	7,995.13	4,536.51
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	49,087.73	80,616.81
负债合计	127,035.26	337,446.49
所有者权益：		
实收基金	30,449,662.61	43,217,460.28
未分配利润	1,115,014.12	2,632,523.01
持有人权益合计	31,564,676.73	45,849,983.29
负债及持有人权益总计	31,691,711.99	46,187,429.78

2. 损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额
一、收入	833,723.48
1、利息收入	28,975.00
其中：存款利息收入	13,398.70
债券利息收入	15,576.30
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售证券资产收入	0.00
2、投资收益（损失以“-”填列）	65,243.49
其中：股票投资收益	0.00
债券投资收益	0.00
基金投资收益	45,332.38
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	19,911.11
其他收益	0.00
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	735,220.44
4、其他收入（损失以“-”填列）	4,284.55
二、费用	99,509.69
1、管理人报酬	81,575.61
2、托管费	16,315.13
3、客户服务费	0.00
4、交易费用	1,618.95
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	0.00
三、净利润	734,213.79

## (二) 集合计划投资组合报告

### 1、投资组合情况

(1) 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	511880	银华货币ETF	23,000.00	2,347,449.00	7.44%
2	630103	华商收益增强债券B	1,659,888.22	2,182,753.01	6.92%
3	110032	三一转债	19,270.00	2,126,829.90	6.74%
4	132002	15天集EB	15,120.00	1,650,045.60	5.23%
5	132005	15国资EB	12,150.00	1,395,306.00	4.42%
6	511810	南方理财金货币ETF	13,611.00	1,361,766.94	4.31%
7	511990	华宝兴业现金添益ETF	13,605.00	1,361,425.14	4.31%
8	213917	宝盈增强收益债券C	968,466.13	1,274,985.66	4.04%
9	113009	广汽转债	10,760.00	1,272,154.80	4.03%
10	000639	宝盈祥瑞养老混合	839,334.43	1,160,799.52	3.68%

### (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	42,838.66
应收股利	3.41
存出保证金	10,243.88
应收申购款	0.00
其他应收款	0.00
合计	53,085.95

## 七、资产配置情况

	金额(元)	占总资产比例
股票投资	130,405.00	0.41%
债券投资	9,292,709.92	29.32%
基金投资	19,546,025.40	61.68%
银行存款和清算备付金合计	2,669,485.72	8.42%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
其他资产	53,085.95	0.17%
合计	31,691,711.99	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。

## 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
35,448,874.78	630,251.56	5,629,463.73	30,449,662.61

## 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](mailto: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

