

国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

2016 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。

托管人对管理人编制的该产品 2016 年年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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 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 | -1,915,655.72 |
| 集合计划加权平均份额本期利润 | -0.0552 |

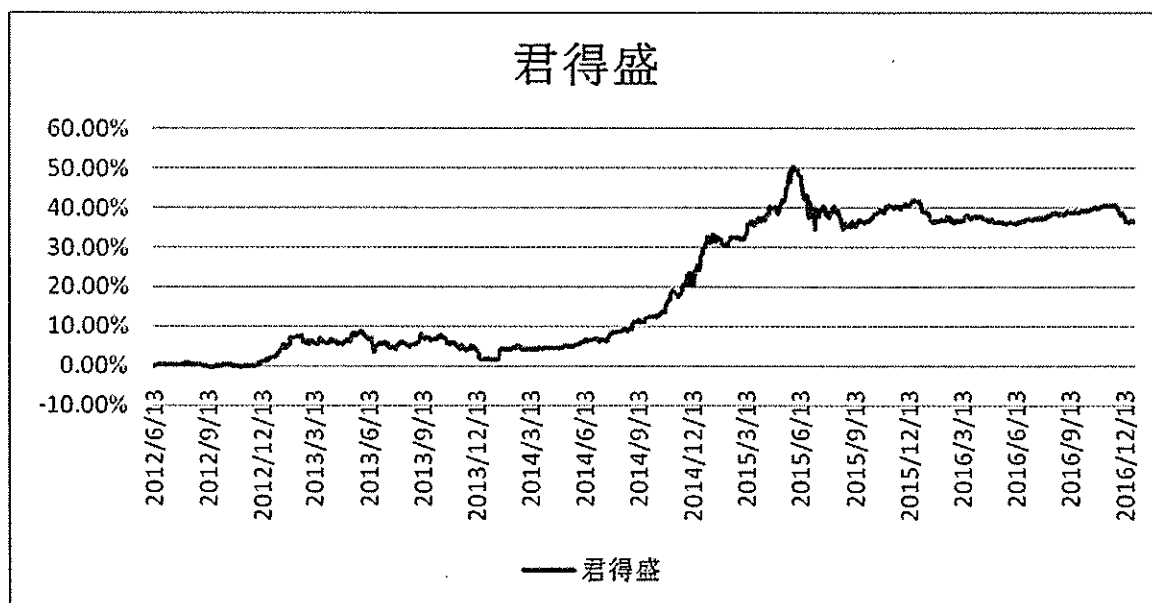


| | |
|--------------|---------------|
| 期末集合计划资产净值 | 27,047,225.22 |
| 期末集合计划份额净值 | 1.014 |
| 期末集合计划份额累计净值 | 1.369 |

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

陈蓉

复旦大学金融学硕士；16年证券从业经验；历任国泰君安证券资产管理有限公司高级研究员、高级投资经理等职；现任“君享精品”、“君得益二号”、“君得盛”、“君享新利”系列、“君享得益”系列等产品投资经理。

陈静思

上海交通大学交通运输与管理系硕士；9年证券从业经验；历任国泰君安证券资产管理总部研究员、国泰君安证券资产管理有限公司高级研究员、高级投资经理等职；现任“君享新利”系列、“君享得益”系列、“君享精品”、“君得益”、“君得盛”等产品投资经理。

(二) 报告期内集合计划业绩表现

截止2016年12月31日,本集合计划单位净值为1.014元。本期单位净值增长率为-4.43%,集合计划单位累计净值增长率为38.07%。

(三) 投资经理工作报告

2016年伊始,新推出的股市熔断机制引发了A股暴跌,短短四天就熔断了两次,不得不被紧急叫停,但股灾的大底到了2月底才真正形成。年中英国公投脱欧和11月份特朗普爆冷当选为美国下一届总统,都加剧了全球和国内市场的波动。2016年最后一个月国内市场资金面偏紧,回购利率大幅上扬,国债期货也历史性地出现了跌停,股债双杀。与全年股票、债券市场的大幅波动和下滑相对应,全年的转债市场也表现很差。面对剧烈的市场波动,我们积极应对,年初股灾之后增持了分红率高、业绩稳定增长的价值白马股,并在市场高位时分别对可转债和股票进行了减仓,但由于产品合同约定可转债的持有比例不得低于20%,所以产品的净值在2017年仍然下降了4.43%。

预计未来的操作中,债券市场:在货币政策收紧,美国加息,通胀上行的背景下,债市风险犹存,我们对2017年债券市场保持适当谨慎;可转债市场:等待下跌后吸引力上升,再重点观察考虑相关债性品种的投资机会;类固收市场:关注与我们产品久期匹配的短期债券、银行定期存款等,在下跌过程中将加大投资的力度,适度参与转债发行和分级A二级市场投资;股票市场:受外部环境影响大,短期面临估值和流动性的双重压力,关注十九大召开前后对股市的影响,从基本面看经济有见底回升的企稳迹象,对股市构成利好,短期内股市有回暖迹象,我们将密切关注政策面和基本面的变化,把握权益类品种的投资机会。

总之,我们将综合把握各类资产的投资机会,同时严控风险,严格控制产品回撤,使产品净值稳定增长。

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 | 2016年12月31日 | 2015年12月31日 |
|----------|---------------|---------------|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 475,718.33 | 7,464,848.56 |
| 结算备付金 | 11,180.00 | 21,853.50 |
| 存出保证金 | 5,739.90 | 15,018.80 |
| 交易性金融资产 | 14,691,337.58 | 38,663,359.27 |
| 其中:股票投资 | 122,045.00 | 1,520,315.00 |
| 债券投资 | 5,834,879.94 | 11,376,202.41 |
| 基金投资 | 8,734,412.64 | 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 | 11,500,000.00 | 0.00 |

| | | |
|---------|---------------|---------------|
| 应收证券清算款 | 502,520.83 | 0.00 |
| 应收利息 | 21,036.38 | 22,349.65 |
| 应收股利 | 58,426.38 | 0.00 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | 0.00 | 0.00 |
| 资产合计 | 27,265,959.40 | 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12月31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 | 136,777.69 | 204,818.37 |
| 应付管理人报酬 | 23,490.31 | 39,579.63 |
| 应付托管费 | 4,698.06 | 7,895.17 |
| 应付投资咨询费 | 0.00 | 0.00 |
| 应付交易费用 | 13,606.81 | 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 | 40,161.31 | 80,616.81 |
| 负债合计 | 218,734.18 | 337,446.49 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 26,680,995.86 | 43,217,460.28 |
| 未分配利润 | 366,229.36 | 2,632,523.01 |
| 持有人权益合计 | 27,047,225.22 | 45,849,983.29 |
| 负债及持有人权益总计 | 27,265,959.40 | 46,187,429.78 |

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 | -1,404,568.95 |
| 1、利息收入 | 224,535.33 |
| 其中：存款利息收入 | 135,443.44 |
| 债券利息收入 | 66,137.82 |
| 资产支持证券利息收入 | 0.00 |
| 买入返售证券资产收入 | 22,954.07 |
| 2、投资收益（损失以“-”填列） | 227,455.88 |
| 其中：股票投资收益 | -83,703.34 |
| 债券投资收益 | -780,211.37 |
| 基金投资收益 | 728,671.24 |
| 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 | 362,699.35 |
| 其他收益 | 0.00 |

| | |
|----------------------|---------------|
| 3、公允价值变动收益（损失以“-”填列） | -1,871,605.61 |
| 4、其他收入（损失以“-”填列） | 15,045.45 |
| 二、费用 | 511,086.77 |
| 1、管理人报酬 | 356,957.31 |
| 2、托管费 | 71,391.55 |
| 3、客户服务费 | 0.00 |
| 4、交易费用 | 26,659.91 |
| 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 | 56,078.00 |
| 三、净利润 | -1,915,655.72 |

（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 | 2,305,244.00 | 8.52% |
| 2 | 511810 | 南方理财金货币ETF | 13,698.00 | 1,369,964.38 | 5.07% |
| 3 | 511990 | 华宝兴业现金添益ETF | 13,687.00 | 1,369,096.92 | 5.06% |
| 4 | 113009 | 广汽转债 | 10,760.00 | 1,249,020.80 | 4.62% |
| 5 | 110032 | 三一转债 | 10,670.00 | 1,178,821.60 | 4.36% |
| 6 | 000639 | 宝盈祥瑞养老混合 | 839,334.43 | 1,033,220.68 | 3.82% |
| 7 | 519189 | 万家信用恒利债券C | 833,719.98 | 1,027,309.76 | 3.80% |
| 8 | 518880 | 华安黄金易(ETF) | 342,500.00 | 902,830.00 | 3.34% |
| 9 | 132002 | 15天集EB | 8,370.00 | 888,140.70 | 3.28% |
| 10 | 132005 | 15国资EB | 6,730.00 | 747,030.00 | 2.76% |

（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 | 502,520.83 |
| 应收利息 | 21,036.38 |
| 应收股利 | 58,426.38 |
| 存出保证金 | 5,739.90 |
| 应收申购款 | 0.00 |
| 其他应收款 | 0.00 |
| 合计 | 587,723.49 |

七、资产配置情况

| | 金额（元） | 占总资产比例 |
|--------------|---------------|---------|
| 股票投资 | 122,045.00 | 0.45% |
| 债券投资 | 5,834,879.94 | 21.40% |
| 基金投资 | 8,734,412.64 | 32.03% |
| 银行存款和清算备付金合计 | 486,898.33 | 1.79% |
| 买入返售金融资产 | 11,500,000.00 | 42.18% |
| 其他资产 | 587,723.49 | 2.16% |
| 合计 | 27,265,959.40 | 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 |
|---------------|--------------|---------------|---------------|
| 43,217,460.28 | 2,221,613.02 | 18,758,077.44 | 26,680,995.86 |

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

