

# 国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

## 2017年第2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2017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2017年4月1日起至2017年6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	446,588.46
集合计划加权平均份额本期利润	0.0212

期末集合计划资产净值	20,150,478.44
期末集合计划份额净值	1.041
期末集合计划份额累计净值	1.396

#### 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2017年6月30日，本集合计划单位净值为1.041元。本期单位净值增长率为2.26%，集合计划单位累计净值增长率为41.75%。

### （三）投资经理工作报告

二季度，全球经济继续复苏，全球市场平稳度过了法国大选、特朗普遭弹劾等事件，全球主要股指多数收涨。国内方面，4月初提出雄安新区概念，引爆市场热情，核心股票多日上涨带动市场上扬。随后，监管层开始严查雄安板块，叠加一行三会多项严监管政策出台，A股开始连续回调。债券市场和商品市场在监管高压同样难以幸免。5月12日央行开展一年期MLF操作，央行态度转暖提振市场信心，股债皆有所反弹。此后监管层态度各异，债市继续震荡调整。6月上旬央行提前一周续作MLF，流动性紧张程度低于市场预期。中旬，债市再现抢跑行情。沪深300指数在A股纳入MSCI的利好刺激下继续上涨。本季度前两个月股市主要延续年初以来的结构分化行情，食品饮料、家电、汽车等低估值的大盘蓝筹持续上涨，6月份市场普涨。分级基金在新的政策指引下，成交量大幅降低，分级A总体表现不佳，平均隐含收益率4.79%。本季度公募发行三只可转债和一只可交换债，一只转债退市（歌尔转债），可转债总体在正股的影响下先跌后涨，转股溢价率仍然较高，5月下旬开始在正股和债券的双重影响下，反弹幅度较大。全季度来看，上证50上涨8.66%，沪深300上涨6.69%，中证500下跌3.73%，中证转债指数上涨2.5%。

本季度产品主要关注转债和对应正股的配置，增配了三一转债、光大转债等基本面向好，转股溢价率较低的股票，并对歌尔转债、广汽转债进行转股，二季度实现收益2.26%。

对于未来的操作，我们预计经济易上难下，企业盈利有向好的可能。股票方面，需求稳定，供给优化，企业资产负债表不断修复，看好股票的结构化机会。债券方面资金面保持宽松，监管政策稳定，收益率具有吸引力，配置机会显现。

## 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	2017年6月30日	2016年12月31日
资产：		
银行存款	7,046,753.18	475,718.33
结算备付金	7,552.74	11,180.00
存出保证金	10,769.51	5,739.90
交易性金融资产	13,251,017.20	14,691,337.58
其中：股票投资	3,432,627.90	122,045.00
债券投资	4,470,974.80	5,834,879.94
基金投资	5,347,414.50	8,734,412.64
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	11,500,000.00
应收证券清算款	0.00	502,520.83
应收利息	8,844.03	21,036.38
应收股利	0.00	58,426.38
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	20,324,936.66	27,265,959.40

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债及持有人权益	2017年6月30日	2016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	106,066.79	136,777.69
应付管理人报酬	16,918.57	23,490.31
应付托管费	3,383.74	4,698.06
应付投资咨询费	0.00	0.00
应付交易费用	28,253.33	13,606.81
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	19,835.79	40,161.31
<b>负债合计</b>	<b>174,458.22</b>	<b>218,734.18</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	19,363,111.36	26,680,995.86
未分配利润	787,367.08	366,229.36
<b>持有人权益合计</b>	<b>20,150,478.44</b>	<b>27,047,225.22</b>
<b>负债及持有人权益总计</b>	<b>20,324,936.66</b>	<b>27,265,959.40</b>

2. 损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额
<b>一、收入</b>	<b>531,567.28</b>
1、利息收入	37,895.34
其中：存款利息收入	31,162.71
债券利息收入	6,732.63
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）	-302,440.03
其中：股票投资收益	174,403.67
债券投资收益	-376,871.46
基金投资收益	-132,690.18

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	32,717.94
其他收益	0.00
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	794,628.00
4、其他收入（损失以“-”填列）	1,483.97
二、费用	84,978.82
1、管理人报酬	53,528.41
2、托管费	10,705.71
3、客户服务费	0.00
4、交易费用	10,752.01
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	9,992.69
三、净利润	446,588.46

## （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	110032	三一转债	15,310.00	1,818,215.60	9.02%
2	600004	白云机场	95,543.00	1,763,723.78	8.75%
3	113011	光大转债	16,120.00	1,693,567.20	8.40%
4	002241	歌尔股份	84,679.00	1,632,611.12	8.10%
5	511810	南方理财金货币ETFH	13,940.00	1,394,069.70	6.92%
6	511990	华宝兴业现金添益ETF A	13,926.00	1,392,669.63	6.91%
7	511880	银华货币ETF A	9,200.00	936,109.20	4.65%
8	113008	电气转债	6,200.00	643,498.00	3.19%
9	519189	万家信用恒利债券C	433,719.98	532,651.51	2.64%
10	518880	华安黄金易(ETF)	171,200.00	464,636.80	2.31%

## （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	8,844.03
应收股利	0.00
存出保证金	10,769.51
应收申购款	0.00
其他应收款	0.00
合计	19,613.54

### 七、资产配置情况

	金额（元）	占总资产比例
股票投资	3,432,627.90	16.89%
债券投资	4,470,974.80	22.00%
基金投资	5,347,414.50	26.31%
银行存款和清算备付金合计	7,054,305.92	34.71%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
其他资产	19,613.54	0.10%
合计	20,324,936.66	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
22,218,545.74	0.00	2,855,434.38	19,363,111.36

### 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

