

国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

2017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2017年3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7月1日起至2017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

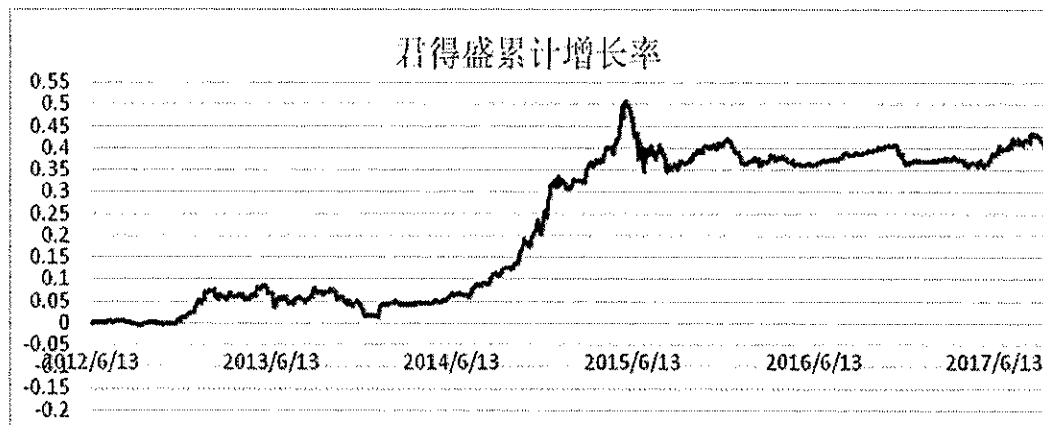
集合计划本期利润	270,221.92
集合计划加权平均份额本期利润	0.0153

期末集合计划资产净值	17,449,040.78
期末集合计划份额净值	1.054
期末集合计划份额累计净值	1.409

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。

(二) 报告期内集合计划业绩表现

截止2017年9月30日，本集合计划单位净值为1.054元。本期单位净值增长率为1.25%，集合计划单位累计净值增长率为43.52%。

(三) 投资经理工作报告

三季度股票市场整体表现较强，中小板指和中证500的涨幅分别为8.86%和7.58%，创业板指表现相对较差，涨幅2.69%。7月中旬，金融工作会议召开一度打压市场情绪，但市场很快转向上游周期品领涨的逻辑，沪深300受到支撑。9月份，市场风格出现逆转，由于8月经济数据不佳，周期品带动整体权益市场调整，食品饮料、家电等表现较好。债券市场在二季度数据超预期和周期品强势的打压下高位震荡。大宗商品在基本面小幅走弱的情况下大幅下

跌。转债市场前涨后跌，总体表现较好，涨幅4.26%。可转债使用新规下，第一只信用发行的转债东方雨虹发行，中签率仅0.003%。报告期内，君得盛的产品净值上涨1.25%。

从目前的经济数据来看，8月工业增加值延续回落，主要受以采矿业为代表的上游行业拖累，主要受环保政策影响生产放缓，而中游的设备制造、电气机械等行业仍保持增长态势，原材料库存不同于产成品库存，开始出现增长，可见经济韧性仍在。

对于债券市场，我们短期仍偏谨慎，经济数据显示基本面仍向好，认为市场没有大的趋势，但是长期来看，金融去杠杆会导致同业存单利率的下滑，估值已经处于历史低位，债券的配置需求显现，因此会考虑配置一定比例的二级债基。

权益市场，目前的风格并未全面转向中小创或成长股，继续关注以消费为核心的、业绩增长明确的蓝筹股，适当进行持仓的调整，短期重点关注3季报预计业绩增长优异的品种，对年底估值切换的行情我们也将密切关注。

对于可转债市场，虽然现在市场存量的规模还比较小，但未来可转债和可交换债的发行速度有望加快，市场可能加速扩容，对于缓解可转债市场流动性不足将有帮助，我们会积极参与可转债的申购，若新的转债上市定价不高，也会考虑替换已有的投资品种。

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9月30日	2016年12月31日
资产：		
银行存款	4,833,047.31	475,718.33
结算备付金	8,695.65	11,180.00
存出保证金	7,303.18	5,739.90
交易性金融资产	12,663,230.48	14,691,337.58
其中：股票投资	3,375,549.01	122,045.00
债券投资	4,393,242.80	5,834,879.94
基金投资	4,894,438.67	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	12,968.21	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	17,525,244.83	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9月30日	2016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	0.00	136,777.69
应付管理人报酬	14,603.53	23,490.31
应付托管费	2,920.70	4,698.06
应付投资咨询费	0.00	0.00
应付交易费用	28,761.75	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	29,918.07	40,161.31
负债合计	76,204.05	218,734.18
所有者权益：		
实收基金	16,549,802.23	26,680,995.86
未分配利润	899,238.55	366,229.36
持有人权益合计	17,449,040.78	27,047,225.22
负债及持有人权益总计	17,525,244.83	27,265,959.40

2. 损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额
一、收入	346,653.03
1、利息收入	32,074.26
其中：存款利息收入	23,507.78
债券利息收入	4,957.16
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售证券资产收入	3,609.32
2、投资收益（损失以“-”填列）	104,560.54
其中：股票投资收益	42,913.32
债券投资收益	25,458.28
基金投资收益	-31,956.62
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	68,145.56

其他收益	0.00
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	209,286.10
4、其他收入（损失以“-”填列）	732.13
二、费用	76,431.11
1、管理人报酬	47,153.41
2、托管费	9,430.65
3、客户服务费	0.00
4、交易费用	754.77
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	19,092.28
三、净利润	270,221.92

（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	113011	光大转债	15,500.00	1,726,700.00	9.90%
2	600004	白云机场	130,417.00	1,707,158.53	9.78%
3	110032	三一转债	14,310.00	1,688,293.80	9.68%
4	002241	歌尔股份	80,652.00	1,632,396.48	9.36%
5	511810	南方理财金货币ETFH	14,081.00	1,409,099.75	8.08%
6	511990	华宝兴业现金添益ETF	14,060.00	1,406,829.54	8.06%
7	511880	银华货币ETF	9,200.00	945,511.60	5.42%
8	113008	电气转债	6,200.00	659,308.00	3.78%
9	519189	万家信用恒利债券C	433,719.98	536,468.24	3.07%
10	505888	嘉实元和混合	372,600.00	409,487.40	2.35%

（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	12,968.21
应收股利	0.00
存出保证金	7,303.18
应收申购款	0.00
其他应收款	0.00
合计	20,271.39

七、资产配置情况

	金额（元）	占总资产比例
股票投资	3,375,549.01	19.26%
债券投资	4,393,242.80	25.07%
基金投资	4,894,438.67	27.93%
银行存款和清算备付金合计	4,841,742.96	27.63%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
其他资产	20,271.39	0.12%
合计	17,525,244.83	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
19,363,111.36	0.00	2,813,309.13	16,549,802.23

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：上海市浦东新区东园路111号2楼

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

2017年10月27日



目
录