

国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

2018年第1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2018年1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2018年1月1日起至2018年3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。

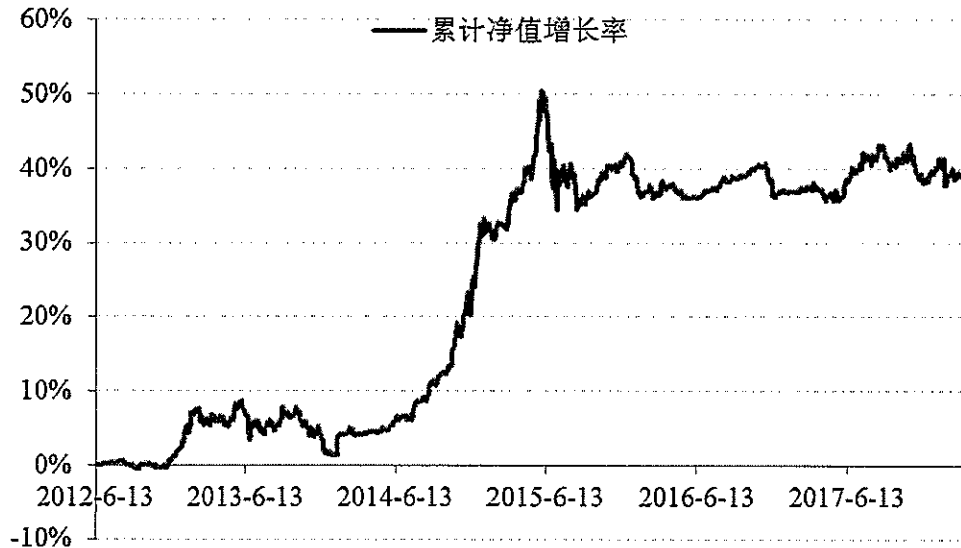
单位：元

集合计划本期利润	101,179.87
集合计划加权平均份额本期利润	0.0078
期末集合计划资产净值	12,793,042.57
期末集合计划份额净值	1.038

期末集合计划份额累计净值	1.393
--------------	-------

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

孙驰

复旦大学经济学硕士，先后担任万家基金固定收益部总监，汇添富基金专户投资决策委员会委员。投资风格稳健，擅长大类资产配置，曾多次获得基金业金牛奖。

(二) 报告期内集合计划业绩表现

截止2018年3月31日，本集合计划单位净值为1.038元。本期单位净值增长率为0.68%，集合计划单位累计净值增长率为41.34%。

(三) 投资经理工作报告

一季度，资本市场意外走出债强股弱的走势，超出年初多数投资者预期。债券市场方面，一月份走势继续低迷，情绪非常悲观，但春节后在基本面预期偏弱、资金面宽松等因素推动下，债券市场逐步回暖，季末大宗商品大幅回落，同时中美贸易摩擦引发基本面担忧后，债券收益率迎来了快速下行。股票市场走势也比较戏剧性，年初蓝筹股用一个月时间演绎了一年的预期。但随后市场受美股暴跌影响也出现了大幅调整，并迎来了风格转换，创业板创近一年新高，蓝筹白马持续低迷。转债市场走势受股市影响，也出现了风格分化。

一季度我们对组合持仓进行了调整，减持了周期类的权益资产，增加了公司债的配置，同时由于整个转债市场的估值依然不高，我们系统增加了转债资产的配置。整体上看，为持有人获得了绝对收益。

展望下一季看，债券市场已经走出了非常悲观的环境，接下来会关注融资需求及货币政策是否转向，整体而言还是机会大于风险。权益和转债市场上还是着眼于结构性机会，尤其目前转债整体估值从历史上看依然不高，展望未来看供给依然很大，面临机会不少，我们会重点挑选转股溢价率不高、基本面优异的品种关注，尤其是对新发转债进行择机配置。

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	2018年3月31日	2017年12月31日
资产：		
银行存款	25,866.31	4,245,465.38
结算备付金	11,083.51	620.75
存出保证金	1,899.72	2,366.49
交易性金融资产	11,674,568.23	9,487,220.60
其中：股票投资	137,940.00	1,693,717.80
债券投资	10,478,301.84	3,026,562.20
基金投资	1,058,326.39	4,766,940.60
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	1,100,000.00	0.00
应收证券清算款	103,547.65	0.00
应收利息	71,632.90	11,402.00
应收股利	0.00	32,917.60
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	12,988,598.32	13,779,992.82

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债及持有人权益	2018年3月31日	2017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	101,870.80	0.00
应付管理人报酬	11,148.79	11,812.93

应付托管费	2,229.75	2,362.57
应付投资咨询费	0.00	0.00
应付交易费用	35,120.22	31,519.20
应付税收	178.61	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	45,007.58	40,000.00
负债合计	195,555.75	85,694.70
所有者权益：		
实收基金	12,318,833.95	13,279,135.55
未分配利润	474,208.62	415,162.57
持有人权益合计	12,793,042.57	13,694,298.12
负债及持有人权益总计	12,988,598.32	13,779,992.82

2. 损益状况

单位：人民币元

项目	本期金额
一、收入	162,082.08
1、利息收入	21,642.05
其中：存款利息收入	10,860.64
债券利息收入	10,205.56
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售证券资产收入	575.85
2、投资收益（损失以“-”填列）	209,583.69
其中：股票投资收益	3,809.50
债券投资收益	242,079.93
基金投资收益	-69,388.27
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	33,831.92
其他收益	-749.39
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-69,310.39
4、其他收入（损失以“-”填列）	166.73
二、费用	60,902.21
1、管理人报酬	33,226.04
2、托管费	6,645.18
3、客户服务费	0.00
4、交易费用	6,320.30
5、利息支出	604.60
其中：卖出回购金融资产支出	604.60
6、其他费用	14,106.09
三、净利润	101,179.87

（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	112232	14长证债	10,000.00	1,000,000.00	7.82%
2	136501	16天风01	10,000.00	977,500.00	7.64%
3	132011	17浙报EB	9,000.00	796,410.00	6.23%
4	132007	16凤凰EB	8,000.00	734,640.00	5.74%
5	136865	16新燃01	7,000.00	684,950.00	5.35%
6	132015	18中油EB	6,830.00	661,348.90	5.17%
7	511810	南方理财金货币ETFH	6,511.00	651,106.51	5.09%
8	113014	林洋转债	6,000.00	629,880.00	4.92%
9	128018	时达转债	6,547.00	627,732.91	4.91%
10	128035	大族转债	4,000.00	468,284.00	3.66%

（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	103,547.65
应收利息	71,632.90
应收股利	0.00
存出保证金	1,899.72
应收申购款	0.00
其他应收款	0.00
合计	177,080.27

七、资产配置情况

	金额（元）	占总资产比例
股票投资	137,940.00	1.06%
债券投资	10,478,301.84	80.67%
基金投资	1,058,326.39	8.15%
银行存款和清算备付金合计	36,949.82	0.28%
买入返售金融资产	1,100,000.00	8.47%
其他资产	177,080.27	1.36%
合计	12,988,598.32	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
13,279,135.55	46,974.86	1,007,276.46	12,318,833.95

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

2018年4月23日

