

# 国泰君安君得盛可转换债券集合资产管理计划

## 2018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。

集合计划托管人于2018年10月19日复核了本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内容，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7月1日起至2018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
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	79,273.59
集合计划加权平均份额本期利润	0.0070
期末集合计划资产净值	11,604,505.51
期末集合计划份额净值	1.034
期末集合计划份额累计净值	1.389

### 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，并与同期业绩比较基准的变动的比较。





集合计划累计份额净值增长率与业绩基准收益率的历史走势对比图

## 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9月30日，本集合计划单位净值为1.034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40.80%。

### (三) 投资经理工作报告

三季度我们对组合持仓进行了调整，转债方面虽然估值依然不高，但由于市场系统性下跌，我们处于控制波动的目的还是对转债进行了减持，尤其是股性偏强的转债。债券方面，继续增加了利率债的配置。整体做出了一些大类资产配置的转换。但由于转债整体下跌，整个组合没有实现绝对收益。

展望下一季看，货币政策已经正式转向，债券市场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、投资组合及资产配置情况

	金额（元）	占总资产比例
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	10,241,076.44	87.02%
基金投资	945,100.03	8.03%
买入返售金融资产	300,000.00	2.55%
银行存款和清算备付金合计	159,456.17	1.35%
存出保证金	18,512.74	0.16%
应收证券清算款	0.00	0.00%
应收股利	0.00	0.00%
应收利息	104,422.21	0.89%
应收申购款	0.00	0.00%
其他资产	0.00	0.00%
合计	11,768,567.59	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。

## 七、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
11,497,777.17	47,973.36	324,348.15	11,221,402.38

## 八、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](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

2018年10月26日

