

# 国泰金龙系列证券投资基金

## 2004 年年度报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇〇五年三月三十日

# 国泰金龙系列证券投资基金 2004 年年度报告

## 一、重要提示及目录

### (一) 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2005年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### (二) 目录

内容	页码
一、 重要提示及目录 .....	1
二、 基金简介 .....	2
三、 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况 .....	4
四、 基金管理人报告 .....	7
五、 基金托管人报告 .....	12
六、 审计报告 .....	13
七、 财务会计报告 .....	15
八、 基金投资组合报告 .....	32
九、 基金份额持有人户数、持有人结构 .....	38
十、 开放式基金份额变动情况 .....	38
十一、 重大事件揭示 .....	38
十二、 备查文件目录 .....	41



### (三) 基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司  
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31 楼  
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31-32 楼  
邮政编码：200122  
法定代表人：陈勇胜  
信息披露负责人：丁昌海  
联系电话：021-58319999  
传真：021-50816885  
电子信箱：[xi nxi pi lu@gtfund.com](mailto:xi nxi pi lu@gtfund.com)

### (四) 基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司  
注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号  
办公地址：上海市中山东一路 12 号  
邮政编码：200120  
法定代表人：张广生  
信息披露负责人：刘婷  
联系电话：021-38784833  
传真：021-68881836  
电子信箱：[liut2@spdb.com.cn](mailto:liut2@spdb.com.cn)

### (五) 信息披露情况

基金选定的信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》  
登载年度报告正文的管理人互联网网址：<http://www.gtfund.com>  
年度报告置备地点：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31-32 楼

### (六) 会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司  
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心8楼

### (七) 注册登记机构

名称：国泰基金管理有限公司登记注册中心  
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31-32 楼

### 三、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

#### (一) 各主要财务指标

##### 国泰金龙债券

单位：元

	2004年	2003年
基金本期净收益	18,981,157.46	3,134,100.28
加权平均单位基金本期净收益	0.0554	0.0018
期末可供分配基金收益	-2,871,853.80	2,423,553.86
期末可供分配基金份额收益	-0.0336	0.0023
期末基金资产净值	82,580,548.84	1,068,554,819.62
期末基金份额净值	0.966	1.005
基金加权平均净值收益率	5.53%	0.18%
本期基金份额净值增长率	-1.07%	0.50%
基金份额累计净值增长率	-0.58%	0.50%

##### 国泰金龙行业

单位：元

	2004年	2003年
基金本期净收益	6,343,979.09	756,850.64
加权平均单位基金本期净收益	0.0107	0.0011
期末可供分配基金收益	-13,670,707.31	827,154.84
期末可供分配基金份额收益	-0.0264	0.0012
期末基金资产净值	504,719,441.49	689,553,514.96
期末基金份额净值	0.974	1.008
基金加权平均净值收益率	1.09%	0.11%
本期基金份额净值增长率	-0.47%	0.80%
基金份额累计净值增长率	0.33%	0.80%

注(1)：2003年指标的计算期间为基金合同生效日2003年12月5日至2003年12月31日。

(2)：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用实际收益水平要低于所列数字。

## (二) 基金净值表现

### 1、基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

#### 国泰金龙债券

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	-0.21%	0.17%	0.58%	0.09%	-0.79%	0.08%
过去六个月	-1.93%	0.19%	1.36%	0.08%	-3.29%	0.11%
过去一年	-1.07%	0.27%	-1.95%	0.13%	0.88%	0.14%
自基金成立起至今	-0.58%	0.26%	-0.88%	0.12%	0.30%	0.14%

#### 国泰金龙行业

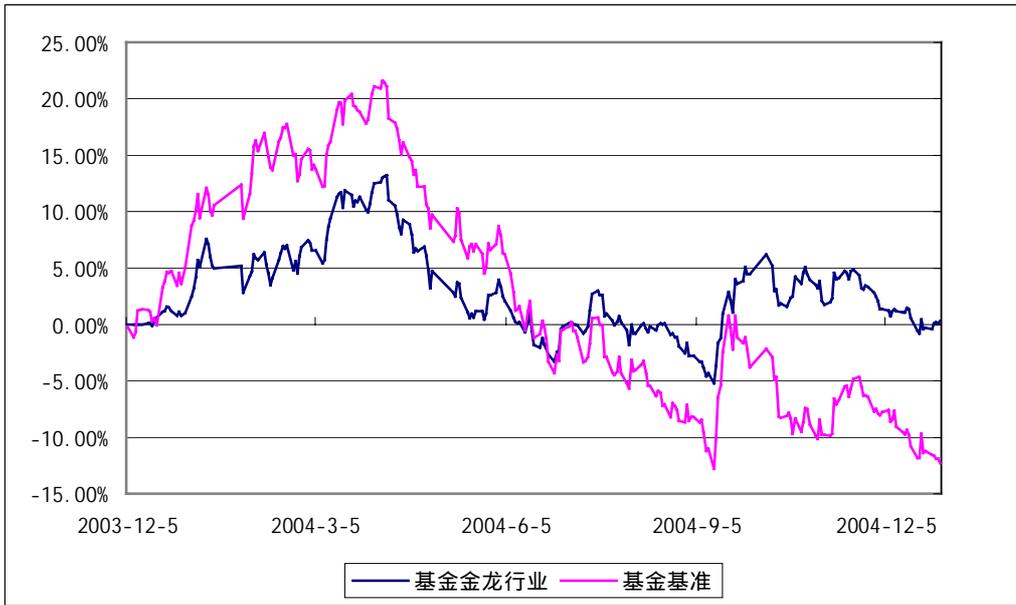
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	-3.94%	0.74%	-8.81%	1.13%	4.87%	-0.39%
过去六个月	2.63%	0.84%	-9.35%	1.31%	11.98%	-0.47%
过去一年	-0.47%	0.88%	-15.33%	1.29%	14.86%	-0.41%
自基金成立起至今	0.33%	0.85%	-12.14%	1.27%	12.47%	-0.42%

### 2、基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

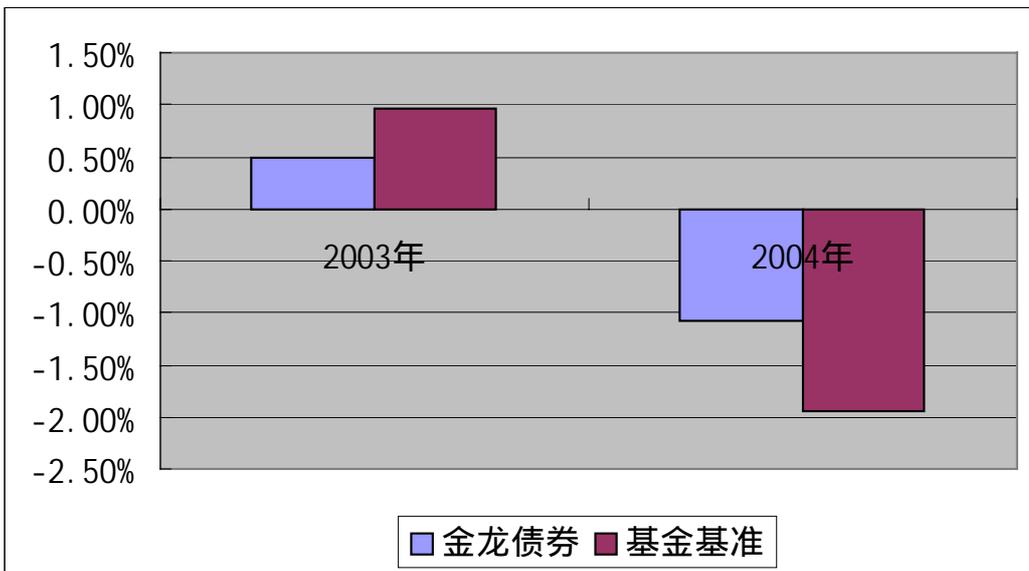
#### 国泰金龙债券



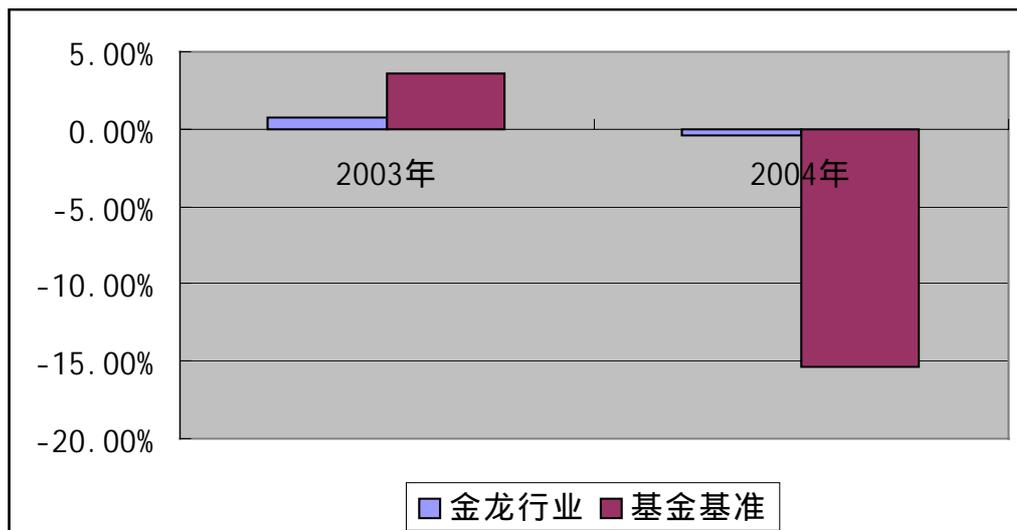
### 国泰金龙行业



### 3、基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图 国泰金龙债券



国泰金龙行业



注：2003年图示的指标计算期间为基金合同生效日2003年12月5日至2003年12月31日。

(三) 收益分配情况

国泰金龙债券

年度	每10份基金份额分红数	备注
2004年	0.300元	分红两次
2003年	-	
2002年	-	
合计	0.300元	

国泰金龙行业

年度	每10份基金份额分红数	备注
2004年	0.320元	分红两次
2003年	-	
2002年	-	
合计	0.320元	

四、基金管理人报告

(一)基金管理人及基金经理介绍

1、基金管理人介绍

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日，是经中国证监会证监基字[1998]5号文批准的首批规范的基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币。目前本基金管理人共管理四只封闭式基金，四只开放式基金，其中一只为系列基金（包括两只

子基金)，其基本情况如下：

封闭式基金	成立日期	基金份额总额	托管银行
金泰基金	1998年3月27日	20亿份	中国工商银行
金鑫基金	1999年10月21日	30亿份	中国建设银行
金盛基金	2000年4月26日	5亿份	中国建设银行
金鼎基金	2000年5月16日	5亿份	中国建设银行

开放式基金	基金成立日期	基金份额总额 (2004年12月31日)	托管银行
金鹰增长基金	2002年5月8日	916,115,497.69	交通银行
金龙债券基金	2003年12月5日	85,452,402.64	上海浦东发展银行
金龙行业精选基金	2003年12月5日	518,390,148.80	上海浦东发展银行
金马稳健回报基金	2004年6月18日	977,345,001.33	中国建设银行
金象保本增值基金	2004年11月10日	656,041,649.47	中国银行

## 2、基金经理介绍

### (1) 国泰金龙债券

何旻，基金经理，男，英国伦敦政治经济学院(LSE)金融经济学硕士(MSc in Finance and Economics)。6年证券从业经历。1998年7月加入国泰基金管理公司，先后担任研究开发部行业研究员、综合研究小组(包括债券研究)负责人，基金管理部、固定收益部基金经理助理。

### (2) 国泰金龙行业

崔海峰，基金经理，男，经济学硕士，6年证券从业经历。1999年加盟国泰基金管理有限公司，先后任研究开发部副经理、金鑫基金经理助理、金盛基金基金经理，现任国泰金龙行业基金基金经理。

张则斌，基金经理助理，男，管理学博士，5年证券从业经历。曾就职于申银万国证券研究所有限公司，2001年加盟国泰基金管理有限公司，任研究开发部经理。

## (二) 基金管理合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其实施准则等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

报告期内本基金未发生任何损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障了投资人的合法权益。

## （三）证券市场与投资管理回顾

### 1、国泰金龙债券

#### （1）2004年债券市场与投资管理回顾

2004年的债券市场走势可以分为三个阶段：第一阶段是4月份以前，市场从缓慢下跌发展到恐慌性快速下跌，显示了宏观调控、货币供应量趋紧、加息预期增强对市场的巨大影响；第二阶段是5月-7月份的报复性反弹；第三阶段是从8月开始，市场在对加息的预期变化中起起伏伏，波动幅度逐渐收窄。

本基金2004年累计净值在1.075元至0.988元之间波动，全年的国债组合久期在2左右，国债与可转债的比例基本保持在5：4。本基金超过Benchmark中信全债指数118个基点，超过上证国债指数267个基点，超额收益主要来自于正确的选时判断。2004年值得总结的是对转债市场流动性的把握，由于组合中转债流动性的缺失使得基金净值在部分时段内低于同期基准增长率，管理人将在今后的投资中对此予以重视。

#### （2）2005年债券市场展望

预计2005年的宏观经济将呈现总体增速回落、通胀压力减轻的特点。通过对生产价格指数对消费物价指数的传导性、国内外各种物品消费价格指数以及宏观调控目标的分析，我们认为2005年的CPI将是一个前高后低的走势，上半年较高，下半年会有所回落，全年的CPI涨幅在3%左右。2005年的宏观财政和货币政策调控将转向稳健。货币政策将坚持偏紧的取向，仍然是以防止经济过热为主，注重贷款的结构调整；稳健的财政政策将会降低国债的发行规模。在2005年市场对加息和人民币升值的预期将有所减弱，但仍然不排除央行加息的可能，加息幅度在25-50个基点，时间最有可能在年中或者年末。由于宏观经济指标对债券市场的负面影响将大大减弱，2004年结构性的局部通胀将不会在2005年得以延续，因此我们对2005年的国债市场持乐观预期。整体趋势将好于2004年，波动幅度减小，运行平稳，稳健的财政政策将使一级市场的发行压力减小，有利于资金向国债二级市场流动。

2005年的债券投资总体策略是投资组合以中期国债和短期金融债为主，转债为辅，注意阶段性风险。预计2005年国债市场收益率曲线将呈现平坦化和凸度下降的变化，投资热点将集中在3-7年的中期国债和金融债以及1年期以下央行票据两大板块之上，因此我们在2005年的投资组合中将以上两种券种为主要品种。为了给予投资者低风险的稳定回报和保持组合的流动性，2005年资产组合中的转债比例将不会过高，在个券选择上以分析发行公司基本面为主，兼顾转债的条款设计和市场价格区域。全年的投资目标是为持有人获取高于同期银行定期存款利率的回报。

### 2、国泰金龙行业

#### （1）2004年证券市场回顾

随着中国证券市场的发展，中国的股票市场表现了明显的宏观经济晴雨表特性，2004年国内A股市场受宏观调控影响，整体呈现冲高回落的走势。在一季度，受中国经济持续快速增长预期的影响，市场整体表现为延续2003年11月1300点触底反弹以来的振荡上行态势，市场相当活跃，沪市成交量一直维持在100亿元以上，强势特征明显。但同期固定资产投资高达43%的同比增长速度也引起了中央对经济过热的担心，并在4月份相继出台了包括上调存款准备金率0.5个百分点等一系列经济和非经济的宏观调控措施，受此影响，股票市场出现了持续回调，尤其是受宏观调控影响较大的周期性品种（如有色金属、石化、钢铁、水泥等个股）遭到市场的抛弃。直到9月份，基于政策回暖预期，市场出现逼空式大幅反弹。对于这次反弹，分歧依旧存在，经济的不明朗预

期依旧难以摆脱。在随后的四季度，央行首次提高基准利率，面对固定资产投资仍在高位徘徊的现实，货币政策仍然维持偏紧的基调，市场预期宏观调控政策还将进一步深化，由此导致A股市场继续向下调整寻底的走势，上证指数年终收于全年最低收盘1266.5点。

### (2) 2004年基金投资管理回顾

2004年本基金的净值增长率为-0.47%，同期业绩比较基准的收益率为-15.33%，基金净值增长率高于业绩比较基准14.86%。

2004年本基金坚持了精选行业、挖掘个股的投资策略。在年初，由于本基金尚处于建仓期，仓位较轻，在年初的上涨行情中相对落后，我们及时加快了建仓速度，避免了更大地被动。由于延续了2003年的投资思路，本基金一季度在一线蓝筹品种保持了较大的比重，由于这类品种已有了较大的涨幅，之后表现相对于大盘缺乏超额收益率。到二季度，由于受国家宏观调控的影响，股市出现大幅下跌，本基金对此预期不足，整体仓位没有显著的下降，导致净值损失较大，但在本次下跌过程中，本基金充分发挥本公司整体研究实力，结合本基金在行业选择的相对优势，挖掘个股，及时调整持仓结构，开始采取防御策略，在板块配置上主要在基础服务类行业、消费类行业以及周期类行业中的优势企业进行配置。重仓的上海机场、中集集团等个股表现相对较为理想。9月份，市场基于政策回暖预期而出现逼空式大幅反弹。本基金仓位一直维持在较高位置，有所受益。本基金认为，市场经过大幅下跌，整体的估值水平已大幅度下降，风险得到较为充分的释放，部分上市公司即使在国际视野下也具备了绝对投资价值。本基金在4季度一直保持了较高的股票仓位，尽管采取了一定防御策略，基金净值还是在市场下跌中受到了损失。

### (3) 2005年证券市场展望

本基金对2005年国内A股市场持谨慎乐观的态度。从好的方面来看，中国经济仍然处在上升周期中，宏观经济有望实现软着陆，经济增长的势头好于预期，上市公司业绩仍可保持10%的增速，股市不规范现象的减少，股市泡沫的降低，保险资金、社保资金和企业年金等规范资金逐步入市，管理层已关注到中国证券市场的深层次矛盾，正着手逐步解决，各项利好政策的效应也会在2005年逐渐显现，A股市场的投资价值将不断提升。

当然，也有一些负面因素会对市场的走势形成压制，2005年宏观经济增速将放缓，物价上涨压力较大，加息可能性较大，由公司治理结构不完善导致的投资风险还在继续释放，部分股票将继续面临估值与国际接轨的压力，新股IPO的恢复，庞大的新股扩容规模对二级市场走势的压制，整个市场重心较2004年进一步下移。

整体看，2005年将存在以下几个趋势：

经济处于平稳调整阶段。经济处于中长期增长周期的短期调整阶段。投资拉动型产业继续存在盈利能力下降的担忧，由此产生股价的波动。而消费型产业也并不是都有超额的收益预期。

市场制度建设还将继续深入。这些制度建设有助于证券市场中长期发展，但是既然是解决历史遗留问题，很多需要现有的投资者承担由此带来的阵痛。

股价结构调整和机构博弈继续加强。基于估值的模糊性，对于估值的探讨和尝试，继续加大机构博弈，由此伴随股价结构的继续调整。尤其在询价制度逐步演进下，增量的全流通尝试已经实质性地进行了。这对股价结构的调整将是导向性的。

不过，我们还是认为，经过近四年的调整，A股市场将在经历最后的痛苦后逐步走向复苏。

基于上面的分析，我们认为，宏观经济减速（包含通胀和加息因素）和人民币汇率调整（人民币升值）会构成2005年的投资主线条，同时增量资产（询价发行制度下

的IPO)、并购、金融创新品种、3G、税制改革、国有股减持试点等都将是重要的阶段性投资主题。

从行业精选的角度来看，投资产业内有内生增长的优势企业或投资垄断性（资源垄断、历史垄断、技术垄断、渠道垄断）行业，仍然是当前较为合适的取向。具体而言，具有资源垄断的交通运输板块仍具增长潜力；下游的食品饮料、纺织服装、医药等传统消费类上市公司，有品牌持续竞争力的公司值得关注；经济增长的结构变化给商业、银行、旅游等服务类行业带来了新的发展机遇；同时，我们也关注股价经过充分调整且企业具有内生增长优势的周期行业龙头企业。

总之，2005年，我们将继续勤勉尽责，精选行业，挖掘个股，力争给基金份额持有人带来可持续的回报。

#### （四）内部监察报告

本报告期内，本系列基金管理人在完善内部控制制度和流程体系的同时，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、开展对公司各项业务的日常监察业务，对公司内部不当业务行为和风险隐患做到及时发现、及时查处，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等其他业务领域的稳健合规。

2、进一步优化公司内控体系，更新完善内控制度和业务流程，推动全员自我风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习月活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

2005年本系列基金管理人承诺将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，并在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

## 五、基金托管人报告

上海浦东发展银行股份有限公司依据《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》与《国泰金龙系列证券投资基金托管协议》，托管国泰金龙系列证券投资基金。

2004年，在对国泰金龙系列证券投资基金的托管过程中，上海浦东发展银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同、托管协议的规定，安全保管了基金的全部资产，对国泰金龙系列证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督。我行遵循笃守诚信、勤勉尽责、严格自律、追求卓越的工作精神，履行了托管人的义务，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

2004年，上海浦东发展银行股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国泰金龙系列证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值、基金份额申购和赎回价格、基金费用开支等重要方面的运作进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

经上海浦东发展银行股份有限公司基金托管部复核，由国泰基金管理有限公司编制的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

上海浦东发展银行股份有限公司基金托管部  
2005年3月25日

## 六、 审计报告

### (一) 国泰金龙债券

国泰金龙系列证券投资基金下设的国泰金龙债券证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国泰金龙系列证券投资基金下设的国泰金龙债券证券投资基金(以下简称“国泰金龙债券基金”)2004年12月31日的资产负债表以及2004年度的经营业绩表和基金净值变动表。这些会计报表的编制是国泰金龙债券基金的基金管理人国泰基金管理有限公司的责任，我们的责任是在实施审计工作的基础上对这些会计报表发表意见。

我们按照中国注册会计师独立审计准则计划和实施审计工作，以合理确信会计报表是否不存在重大错报。审计工作包括在抽查的基础上检查支持会计报表金额和披露的证据，评价基金管理人在编制会计报表时采用的会计政策和作出的重大会计估计，以及评价会计报表的整体反映。我们相信，我们的审计工作为发表意见提供了合理的基础。

我们认为，上述会计报表符合国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定，在所有重大方面公允反映了国泰金龙债券基金2004年12月31日的财务状况以及2004年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司

注册会计师：汪棣

中国 上海市

2005年2月4日

注册会计师：薛竞

## (二) 国泰金龙行业

国泰金龙系列证券投资基金下设的国泰金龙行业精选证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国泰金龙系列证券投资基金下设的国泰金龙行业精选证券投资基金(以下简称“国泰金龙行业精选基金”)2004年12月31日的资产负债表以及2004年度的经营业绩表和基金净值变动表。这些会计报表的编制是国泰金龙行业精选基金的基金管理人国泰基金管理有限公司的责任，我们的责任是在实施审计工作的基础上对这些会计报表发表意见。

我们按照中国注册会计师独立审计准则计划和实施审计工作，以合理确信会计报表是否不存在重大错报。审计工作包括在抽查的基础上检查支持会计报表金额和披露的证据，评价基金管理人在编制会计报表时采用的会计政策和作出的重大会计估计，以及评价会计报表的整体反映。我们相信，我们的审计工作为发表意见提供了合理的基础。

我们认为，上述会计报表符合国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定，在所有重大方面公允反映了国泰金龙行业精选基金2004年12月31日的财务状况以及2004年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司

注册会计师：汪棣

中国 上海市

2005年2月4日

注册会计师：薛竞

## 七、 财务会计报告

### (一) 基金会计报表

#### 1、 资产负债表

##### 国泰金龙债券

资产负债表  
2004年12月31日

单位：元

	附注	2004年12月31日	2003年12月31日
<b>资 产</b>			
银行存款		12,392,570.27	126,642,060.91
交易保证金		250,000.00	250,000.00
应收证券清算款		59,567.32	25,683,466.85
应收利息	5(1)	564,577.42	2,579,529.35
应收申购款		-	11,880.00
债券投资市值	5(2)	72,955,150.89	839,001,059.55
其中：债券投资成本		73,838,628.15	832,173,069.62
买入返售证券		-	175,000,000.00
待摊费用	5(3)	-	316,296.63
资产总计		86,221,865.90	1,169,484,293.29
<b>负债及持有人权益</b>			
<b>负债：</b>			
应付证券清算款		2,203,504.14	-
应付赎回款		501,695.54	99,542,094.55
应付赎回费		56,555.43	174,449.30
应付管理人报酬		33,780.60	737,583.53
应付托管费		18,968.53	245,861.20
应付佣金	5(4)	-1,485.32	-21,517.94
其他应付款	5(5)	478,298.14	251,003.03
预提费用	5(6)	350,000.00	-
负债合计		3,641,317.06	100,929,473.67
<b>持有人权益：</b>			
实收基金	5(7)	85,452,402.64	1,063,395,722.26
未实现利得	5(8)	-1,848,702.12	2,735,543.50
未分配收益		-1,023,151.68	2,423,553.86
持有人权益合计		82,580,548.84	1,068,554,819.62
负债及持有人权益总计		86,221,865.90	1,169,484,293.29

国泰金龙行业

资产负债表  
2004年12月31日

单位：元

	附注	2004年12月31日	2003年12月31日
<b>资 产</b>			
银行存款		26,075,380.29	330,017,332.96
交易保证金		500,000.00	250,000.00
应收证券清算款		226,987.55	-
应收利息	5(1)	1,727,696.84	249,516.94
应收申购款		22,727.29	53,567,076.80
股票投资市值	5(2)	351,004,659.61	199,694,332.52
其中：股票投资成本		339,423,205.09	195,484,347.96
债券投资市值	5(2)	127,172,181.30	52,355,616.00
其中：债券投资成本		127,023,221.60	51,852,662.67
买入返售证券		-	70,000,000.00
待摊费用	5(3)	-	258,579.24
资产总计		506,729,632.88	706,392,454.46
<b>负债及持有人权益</b>			
<b>负债：</b>			
应付证券清算款		150,876.28	9,948,524.88
应付赎回款		-	5,582,755.57
应付赎回费		1,376.00	13,333.22
应付管理人报酬		652,098.63	721,793.17
应付托管费		108,683.10	120,298.84
应付佣金	5(4)	245,069.38	202,233.82
其他应付款	5(5)	502,088.00	250,000.00
预提费用	5(6)	350,000.00	-
负债合计		2,010,191.39	16,838,939.50
<b>持有人权益：</b>			
实收基金	5(7)	518,390,148.80	684,200,828.25
未实现利得	5(8)	-152,943.61	4,525,531.87
未分配收益		-13,517,763.70	827,154.84
持有人权益合计		504,719,441.49	689,553,514.96
负债及持有人权益总计		506,729,632.88	706,392,454.46

## 2、经营业绩表

### 国泰金龙债券

#### 经营业绩表

2004年度

单位：元

项目	附注	2004年度	2003年度
一、收入		22,623,608.24	4,130,901.48
1、股票差价收入	5(9)	1,908,162.62	-
2、债券差价收入	5(10)	12,908,343.84	1,606,778.14
3、债券利息收入		6,346,344.26	459,677.63
4、存款利息收入		992,490.15	1,420,661.04
5、买入返售证券收入		317,861.33	643,784.67
6、其他收入	5(11)	150,406.04	-
二、费用		3,642,450.78	996,801.20
1、基金管理人报酬		1,948,341.96	737,583.53
2、基金托管费		719,314.55	245,861.20
3、卖出回购证券支出		331,151.14	-
4、其他费用	5(12)	643,643.13	13,356.47
其中：信息披露费		429,289.16	1,420.76
审计费用		50,000.00	-
三、基金净收益		18,981,157.46	3,134,100.28
加：未实现利得	5(8)	-7,711,467.19	6,827,989.93
四、基金经营业绩		11,269,690.27	9,962,090.21

国泰金龙行业

经营业绩表  
2004年度

单位：元

项目	附注	2004年度	2003年度
一、收入		17,484,355.88	1,603,576.18
1、股票差价收入	5(9)	6,002,485.65	821,638.47
2、债券差价收入	5(10)	1,961,493.73	-
3、债券利息收入		2,764,536.60	5,715.70
4、存款利息收入		1,278,864.34	624,775.90
5、股利收入		5,266,443.30	-
6、买入返售证券收入		71,585.72	137,096.28
7、其他收入	5(11)	138,946.54	14,349.83
二、费用		11,140,376.79	846,725.54
1、基金管理人报酬		8,990,727.14	721,793.17
2、基金托管费		1,498,454.49	120,298.84
3、卖出回购证券支出		153,469.56	-
4、其他费用	5(12)	497,725.60	4,633.53
其中：信息披露费		429,289.16	1,420.76
审计费用		50,000.00	-
三、基金净收益		6,343,979.09	756,850.64
加：未实现利得	5(8)	7,017,476.33	4,712,937.89
四、基金经营业绩		13,361,455.42	5,469,788.53

3、基金收益分配表

国泰金龙债券

基金收益分配表  
2004年度

单位：元

项目	附注	2004年度	2003年度
本期基金净收益		18,981,157.46	3,134,100.28
加：期初基金净收益		2,423,553.86	-
加：本期损益平准金		-6,702,833.56	-710,546.42
可供分配基金净收益		14,701,877.76	2,423,553.86
减：本期已分配基金净收益	5(13)	15,725,029.44	-
期末基金净收益		-1,023,151.68	2,423,553.86

国泰金龙行业

基金收益分配表  
2004年度

单位：元

项目	附注	2004年度	2003年度
本期基金净收益		6,343,979.09	756,850.64
加：期初基金净收益		827,154.84	-
加：本期损益平准金		-1,109,778.91	70,304.20
可供分配基金净收益		6,061,355.02	827,154.84
减：本期已分配基金净收益	5(13)	19,579,118.72	-
期末基金净收益		-13,517,763.70	827,154.84

4、基金净值变动表

国泰金龙债券

基金净值变动表  
2004年度

单位：元

项目	2004年度	2003年度
一、期初基金净值	1,068,554,819.62	1,887,374,602.86
二、本期经营活动：		
基金净收益	18,981,157.46	3,134,100.28
未实现利得	-7,711,467.19	6,827,989.93
经营活动产生的基金净值变动数	11,269,690.27	9,962,090.21
三、本期基金单位交易：		
基金申购款	41,168,432.42	122,030.00
基金赎回款	-1,022,687,364.03	-828,903,903.45
基金单位交易产生的基金净值变动数	-981,518,931.61	-828,781,873.45
四、本期向持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-15,725,029.44	-
五、期末基金净值	82,580,548.84	1,068,554,819.62

国泰金龙行业

基金净值变动表  
2004年度

单位：元

项 目	2004年度	2003年度
一、期初基金净值	689,553,514.96	684,348,868.87
二、本期经营活动:		
基金净收益	6,343,979.09	756,850.64
未实现利得	7,017,476.33	4,712,937.89
经营活动产生的基金净值变动数	13,361,455.42	5,469,788.53
三、本期基金单位交易:		
基金申购款	412,413,071.29	64,855,267.64
基金赎回款	-591,029,481.46	-65,120,410.08
基金单位交易产生的基金净值变动数	-178,616,410.17	-265,142.44
四、本期向持有人分配收益:		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-19,579,118.72	-
五、期末基金净值	504,719,441.49	689,553,514.96

(二) 基金会计报表附注

1、基金简介

国泰金龙系列证券投资基金（以下简称“本系列基金”）由国泰基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》及其他有关规定和基金合同发起，经中国证券监督管理委员会《关于同意国泰金龙系列证券投资基金设立的批复》（证监基字[2003]114号文）批准，于2003年12月5日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期为不定期，基金合同生效日（2003年12月5日）基金总份额国泰金龙债券和国泰金龙行业分别为1,886,120,977.36份和684,100,738.03份基金单位。本系列基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。有关基金设立等文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。

本系列基金募集情况如下：基金的募集期间为2003年10月24日至2003年12月2日。国泰基金管理有限公司聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本系列基金的验资机构。截止2003年12月5日，国泰金龙债券和国泰金龙行业发行募集资金总额分别为1,886,120,977.36元和684,100,738.03元，募集资金的银行存款利息分别为1,253,625.50元和248,130.84元。

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的规定，国泰金龙债券的投资对象为国内依法公开发行的各种固定收益类金融工具和一级市场股票；国泰金龙行业的投资对象为国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证券监督管理委员会批准的允许基金投资的金融工具。

## 2、主要会计政策及估计

### (1) 会计报表编制基础：

本基金的会计报表按照中华人民共和国财政部颁布的《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的、2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》及中国证券监督管理委员会允许的如主要会计政策所述的基金行业的实务操作约定而编制。

(2) 会计年度：为公历每年1月1日至12月31日。本报告期为2004年1月1日至2004年12月31日。

(3) 记账本位币：以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

(4) 记账基础和计价原则：本基金的会计核算以权责发生制为记账基础，股票投资、交易所债券投资按市值计价，银行间债券采用不含息成本与市价孰低法估值或采用最能反映公允价值的价格估值，所有报表项目均以历史成本计价。

### (5) 基金资产的估值原则：

任何上市流通的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价估值。

未上市的股票应区分以下情况处理：

a. 送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

b. 首次公开发行的股票，按成本估值。

配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按市价高于配股价的差额估值；如果市价等于或低于配股价，则估值额为零。

证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价计算得到的净价估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理公司应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

### (6) 证券投资的成本计价方法：

证券投资按取得时的实际成本计价，出售成本按移动加权平均法计算。

股票投资：买入股票按成交日应支付的全部价款（包括成交总额和相关费用）入账，卖出股票时采用移动加权平均法逐日结转成本；

债券投资：买入债券按成交日应支付的全部价款入账，应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。卖出债券的成本采用移动加权平均法逐日结转。买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

### (7) 待摊费用的摊销方法和摊销期限：

待摊费用核算已经发生的、影响基金单位净值小数点后第五位，应分摊计入本期和以后各期的费用。在实际受益期间（一年内）按直线法摊销，并以实际支出减去累计摊销后的净额列示。

## (8)收入确认和计量：

股票差价收入：于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

债券差价收入：卖出上市债券，应于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；卖出非上市债券，应于实际收到价款时确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

债券利息收入：按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入：按本金与适用的利率逐日计提的利息确认，计提对象为银行存款和清算备付金。

股利收入：在除息日确认股利收入，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

买入返售证券收入：在证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。

其他收入：在实际收到时确认。

## (9)费用的确认和计量：

基金管理人报酬：根据《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》，国泰金龙债券按前一日基金资产净值的0.6%的年费率计提入账。基金成立日起半年(含半年)后，经基金托管人核对，如当日本基金的基金单位累计净值低于1.00元时，基金管理人将从下一日起暂停收取管理费，在当日累计基金单位资产净值低于基金单位面值期间，如遇法定节假日，同样暂停收取基金管理费，直至本基金累计净值高于1.00元(含1.00元)后，基金管理人恢复收取基金管理费。；国泰金龙行业按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提入账。

基金托管费：根据《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》，国泰金龙债券按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提入账；国泰金龙行业按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提入账。

卖出回购证券支出：在该证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。

其他费用：发生的其他费用如果影响基金单位净值小数点后第五位的，即发生的其他费用大于基金净值十万分之一，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。发生的其他费用如果不影响基金单位净值小数点后第五位的，即发生的其他费用小于基金净值十万分之一，应于发生时直接计入基金损益。

## (10)基金的收益分配政策：

本系列基金的收益分配由各基金分别、独立进行，同一基金的每份基金单位享有同等分配权；

基金当期收益先弥补上期亏损后，才进行当期收益分配；

如果基金投资当期亏损，则不进行收益分配；

基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值；

全年合计的基金收益分配比例不得低于该基金年度净收益的90%；

在符合有关基金分红条件的前提下，本系列基金收益每年至少分配一次，每年最多分配四次，全年合计的基金收益分配比例不低于本基金年度已实现净

收益的90%。但若成立不满3个月可不进行当期收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的3个月内完成；

基金持有人可以选择取得现金或将所获得红利再投资于本基金，选择采取红利再投资形式的，分红资金按权益登记日的基金单位资产净值转成相应的基金单位。基金份额持有人未做选择的，则现金分红方式为其默认的收益分配方式；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 3、主要税项

#### 印花税

基金管理人运用基金买卖股票按照0.2%的税率征收印花税。

#### 营业税

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55号文、财税字[2001]61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》以及财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税；自2004年1月1日起，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税。

#### 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55号文《关于证券投资基金税收问题的通知》以及财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》，基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；自2004年1月1日起，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

### 4、关联方关系及关联方交易

#### (1) 关联方关系

关联方名称	关联关系
国泰基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
上海国有资产经营有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海爱建信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
浙江省国际信托投资有限公司	基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
上海仪电控股（集团）公司	基金管理人的股东(2004年6月23日起)
宏源证券股份有限公司	基金管理人的原股东(2004年6月23日之前)

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易(单位：元)

国泰金龙债券

	2004年				2003年			
	股票投资		债券投资		股票投资		债券投资	
	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例
国泰君安	4,375,047.72	100.00%	421,882,258.32	16.16%	-	-	2,379,284.10	0.32%

	2004年				2003年			
	债券回购		交易佣金		债券回购		交易佣金	
	成交金额	比例	金额	比例	成交金额	比例	金额	比例
国泰君安	-	-	3,423.54	-19.85%	-	-	-	-

国泰金龙行业

	2004年				2003年			
	股票投资		债券投资		股票投资		债券投资	
	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例
国泰君安	419,082,770.31	18.83%	51,684,124.93	15.39%	-	-	-	-

	2004年				2003年			
	债券回购		交易佣金		债券回购		交易佣金	
	成交金额	比例	金额	比例	成交金额	比例	金额	比例
国泰君安	20,000,000.00	9.76%	343,178.24	19.14%	-	-	-	-

注：根据本基金管理人与关联方签订的席位租用协议，对关联方席位发生的交易佣金计算方式等同于其他证券公司，该佣金比例达到了关联方在席位租用期内为本基金提供证券综合研究和信息服务相对应的水平。

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易(单位：元)

国泰金龙债券

本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易。

国泰金龙行业

	2004年			2003年		
	债券投资	债券回购		债券投资	债券回购	
	成交金额	成交金额	利息支出	成交金额	成交金额	利息支出
国泰君安	99,460,000.00	-	-	-	-	-

(4) 基金管理人报酬

国泰金龙债券

基金管理费按前一日的基金资产净值的0.6%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金成立日起半年(含半年)后,经基金托管人核对,如当日本基金的基金单位累计净值低于1.00元时,基金管理人将从下一日起暂停收取管理费,在当日累计基金单位资产净值低于基金单位面值期间,如遇法定节假日,同样暂停收取基金管理费,直至本基金累计净值高于1.00元(含1.00元)后,基金管理人恢复收取基金管理费。

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

在本报告期内,基金应支付基金管理人管理费共1,948,341.96元,其中已支付基金管理人1,914,561.36元,尚余33,780.60元未支付。2003年共计提管理费737,583.53元,已全部支付。

国泰金龙行业

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

在本报告期内,基金应支付基金管理人管理费共8,990,727.14元,其中已支付基金管理人8,338,628.51元,尚余652,098.63元未支付。2003年共计提管理费721,793.17元,已全部支付。

(5) 基金托管费

国泰金龙债券

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

在本报告期内,基金应支付基金托管人托管费共719,314.55元,其中已支付基金托管人700,346.02元,尚余18,968.53元未支付。2003年共计提托管费245,861.20元,已全部支付。

国泰金龙行业

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

在本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共1,498,454.49元，其中已支付基金托管人1,389,771.39元，尚余108,683.10元未支付。2003年共计提托管费120,298.84元，已全部支付。

## 5、重要会计报表项目说明(单位：元)

### (1) 应收利息：

#### 国泰金龙债券

	2004年12月31日	2003年12月31日
应收银行存款利息	10,223.20	317,372.71
应收债券利息	554,354.22	2,262,156.64
合计	564,577.42	2,579,529.35

#### 国泰金龙行业

	2004年12月31日	2003年12月31日
应收银行存款利息	13,725.26	196,415.55
应收债券利息	1,713,971.58	53,101.39
合计	1,727,696.84	249,516.94

### (2) 投资估值增值按投资类别分别列示如下：

#### 国泰金龙债券

	2004年12月31日	2003年12月31日
债券投资	-883,477.26	6,827,989.93
合计	-883,477.26	6,827,989.93

#### 国泰金龙行业

	2004年12月31日	2003年12月31日
股票投资	11,581,454.52	4,209,984.56
债券投资	148,959.70	502,953.33
合计	11,730,414.22	4,712,937.89

### (3) 待摊费用：

#### 国泰金龙债券

	2004年12月31日	2003年12月31日
信息披露费	-	258,579.24
其他	-	57,717.39
合计	-	316,296.63

国泰金龙行业

	2004年12月31日	2003年12月31日
信息披露费	-	258,579.24
合计	-	258,579.24

(4) 应付佣金：

国泰金龙债券

	2004年12月31日	2003年12月31日
申银万国证券股份有限公司	-1,485.32	-21,517.94
合计	-1,485.32	-21,517.94

注：由于国泰金龙债券基金为纯债券投资基金，因此根据我公司与申银万国证券股份有限公司签订的席位租用协议中提到“债券现货及债券回购不计交易佣金，国泰基金管理公司承担买卖经手费、买卖证管费、国债、回购风险结算基金。”由此，在申银万国证券股份有限公司席位上产生的佣金负数实际为国债、回购风险结算基金。

国泰金龙行业

	2004年12月31日	2003年12月31日
国泰君安证券股份有限公司	64,711.27	-
华夏证券股份有限公司	41,176.76	-
海通证券股份有限公司	35,250.73	47,882.27
上海证券有限责任公司	36,267.41	51,704.89
东吴证券有限责任公司	34,897.83	102,646.66
华泰证券有限责任公司	32,765.38	-
合计	245,069.38	202,233.82

(5) 其他应付款：

国泰金龙债券

	2004年12月31日	2003年12月31日
应付基金转换手续费	616.96	1,003.03
应付债券利息的税金	227,681.18	-
应付深交所席位保证金	250,000.00	250,000.00
合计	478,298.14	251,003.03

国泰金龙行业

	2004年12月31日	2003年12月31日
应付基金转换手续费	-	-
应付债券利息的税金	2,088.00	-
应付深交所席位保证金	500,000.00	250,000.00
合计	502,088.00	250,000.00

(6) 预提费用：

国泰金龙债券

	2004年12月31日	2003年12月31日
预提审计费用	50,000.00	-
预提信息披露费	300,000.00	-
合计	350,000.00	-

国泰金龙行业

	2004年12月31日	2003年12月31日
预提审计费用	50,000.00	-
预提信息披露费	300,000.00	-
合计	350,000.00	-

(7) 实收基金：

国泰金龙债券

	2004年	2003年
期初数	1,063,395,722.26	-
本期认购	-	1,887,374,602.86
加：本期因申购的增加数	40,910,372.91	121,322.79
减：本期因赎回的减少数	1,018,853,692.53	824,100,203.39
期末数	85,452,402.64	1,063,395,722.26

国泰金龙行业

	2004年	2003年
期初数	684,200,828.25	-
本期认购	-	684,348,868.87
加：本期因申购的增加数	398,648,061.89	64,122,041.48
减：本期因赎回的减少数	564,458,741.34	64,270,082.10
期末数	518,390,148.80	684,200,828.25

(8) 未实现利得：

国泰金龙债券

2003年	投资估值增值	未实现利得平准金	合计
期初数	-	-	-
本期净变动数	6,827,989.93	-	6,827,989.93
加：本期申购	-	612.11	612.11
减：本期赎回	-	4,093,058.54	4,093,058.54
期末数	6,827,989.93	-4,092,446.43	2,735,543.50

2004年	投资估值增值	未实现利得平准金	合计
期初数	6,827,989.93	-4,092,446.43	2,735,543.50
本期净变动数	-7,711,467.19	-	-7,711,467.19
加：本期申购	-	85,456.98	85,456.98
减：本期赎回	-	-3,041,764.59	-3,041,764.59
期末数	-883,477.26	-965,224.86	-1,848,702.12

国泰金龙行业			
2003年	投资估值增值	未实现利得平准金	合计
期初数	-	-	-
本期净变动数	4,712,937.89	-	4,712,937.89
加：本期申购	-	656,248.53	656,248.53
减：本期赎回	-	843,654.55	843,654.55
期末数	4,712,937.89	-187,406.02	4,525,531.87

2004年			
	投资估值增值	未实现利得平准金	合计
期初数	4,712,937.89	-187,406.02	4,525,531.87
本期净变动数	7,017,476.33	-	7,017,476.33
加：本期申购	-	10,237,834.69	10,237,834.69
减：本期赎回	-	21,933,786.50	21,933,786.50
期末数	11,730,414.22	-11,883,357.83	-152,943.61

(9) 股票差价收入：

国泰金龙债券

	2004年	2003年
卖出股票成交总额	4365,477.41	-
减：卖出股票成本总额	2,453,760.00	-
应付佣金总额	3,554.79	-
股票差价收入	1,908,162.62	-

国泰金龙行业

	2004年	2003年
卖出股票成交总额	1,057,004,696.50	32,685,234.87
减：卖出股票成本总额	1,050,114,294.23	31,835,955.86
应付佣金总额	887,916.62	27,640.54
股票差价收入	6,002,485.65	821,638.47

(10) 债券差价收入：

国泰金龙债券

	2004年	2003年
卖出债券成交总额	2,195,414,238.16	224,831,043.57
减：卖出债券成本总额	2,165,038,539.61	222,107,190.76
应收利息总额	17,467,354.71	1,117,074.67
债券差价收入	12,908,343.84	1,606,778.14

国泰金龙行业

	2004年	2003年
卖出债券成交总额	281,195,119.17	-
减：卖出债券成本总额	277,119,672.49	-
应收利息总额	2,113,952.95	-
债券差价收入	1,961,493.73	-

(11) 其他收入：

国泰金龙债券

	2004年	2003年
赎回费收入	141,817.88	-
新股中签手续费返还	8,588.16	-
配股手续费返还	-	-
配转债手续费返还	-	-
合计	150,406.04	-

国泰金龙行业

	2004年	2003年
赎回费收入	42,181.78	-
新股中签手续费返还	65,680.43	14,349.83
配股手续费返还	6,966.67	-
配转债手续费返还	24,117.66	-
合计	138,946.54	14,349.83

(12) 其他费用：

国泰金龙债券

	2004年	2003年
信息披露费	429,289.16	1,420.76
审计费用	50,000.00	-
债券账户维护费	13,950.00	-
交易费用	7,687.72	11,035.71
交易所风险金	40,702.31	-
席位使用年费	100,000.00	-
银行费用	2,013.94	-
开户费	-	900.00
合计	643,643.13	13,356.47

国泰金龙行业

	2004年	2003年
信息披露费	429,289.16	1,420.76
审计费用	50,000.00	-
债券账户维护费	13,500.00	-
交易费用	2,458.93	2,312.77
银行费用	1,885.70	-
开户费	-	900.00
过户费	591.81	-
合计	497,725.60	4,633.53

(13) 本期已分配基金净收益：

国泰金龙债券

	2004年	2003年
第一次收益分配金额	6,685,192.04	-
第二次收益分配金额	9,039,837.40	-
累计收益分配金额	15,725,029.44	-

国泰金龙行业

	2004年	2003年
第一次收益分配金额	8,747,100.20	-
第二次收益分配金额	10,832,018.52	-
累计收益分配金额	19,579,118.72	-

6、流通转让受限制的基金资产

(1) 截至2004年12月31日止基金持有的流通转让受限制的基金资产明细如下：

国泰金龙行业

序号	名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)
1	振华港机	2004-12-22	2005-1-31	30,000	262,500.00	275,400.00
	合计			30,000	262,500.00	275,400.00

(2) 估值方法

上述“振华港机”已上市，但本基金持有部分未流通。在编制本报表时，根据有关规定，在2004年12月31日按照收盘价估值。

(3) 流通受限原因

根据中国证监会的政策规定，2000年5月18日起新股发行时不再单独向基金配售新股。基金可比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外，根据中国证监会证监发行字[2002]54号文《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》及其配套规定，自2002年5月20日起，恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股市值参与配售，但累计申购总额不得超过基金按规定可申购的总额。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

(4) 受限期限

上述“振华港机”受限期限为1个月。

## 八、基金投资组合报告

### 国泰金龙债券

#### (一) 基金资产组合情况

分 类	市 值(元)	占总资产比例
债券	72,955,150.89	84.61%
银行存款和清算备付金	12,392,570.27	14.37%
应收证券清算款	59,567.32	0.07%
其他资产	814,577.42	0.94%
合 计	86,221,865.90	100.00%

#### (二) 按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市 值(元)	占净值比例
1	国家债券	28,163,725.80	34.10%
2	金融债券	9,997,000.00	12.11%
3	可转换债券	25,138,425.09	30.44%
4	央行票据	9,656,000.00	11.69%
	合 计	72,955,150.89	88.34%

#### (三) 基金投资前五名债券明细(按市值占基金资产净值比例排序)

序号	债券名称	市 值(元)	占净值比例
1	04国开17	9,997,000.00	12.11%
2	04央行票据81	9,656,000.00	11.69%
3	04国债(1)	7,814,400.00	9.46%
4	04国债(5)	6,111,300.00	7.40%
5	20国债(10)	5,812,200.00	7.04%

#### (四) 报告附注

- 1、报告期内基金投资的前五名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

其他资产的构成如下：

分 类	市 值(元)
交易保证金	250,000.00
应收利息	564,577.42
合 计	814,577.42

#### 2、处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市 值(元)	占净值比例
100096	云化转债	2,939,706.00	3.56%
100196	复星转债	4,370,822.00	5.29%

110001	邯钢转债	1,985,602.80	2.40%
110037	歌华转债	1,816,018.20	2.20%
110418	江淮转债	2,052,256.90	2.49%
125930	丰原转债	3,890,934.30	4.71%
126301	丝绸转债2	2,717,163.99	3.29%

### 国泰金龙行业

#### (一) 基金资产组合情况

分 类	市值(元)	占总资产比例
股票	351,004,659.61	69.27%
债券	127,172,181.30	25.10%
银行存款和清算备付金	26,075,380.29	5.15%
应收证券清算款	226,987.55	0.04%
其他资产	2,250,424.13	0.44%
合 计	506,729,632.88	100.00%

#### (二) 按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市 值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采掘业	36,005,103.85	7.13%
3	制造业	153,218,937.87	30.36%
	其中：食品、饮料	29,303,676.00	5.81%
	纺织、服装、皮毛	7,691,119.40	1.52%
	造纸、印刷	18,151,783.86	3.60%
	石油、化学、塑胶、塑料	33,415,649.42	6.62%
	金属、非金属	35,508,356.70	7.04%
	机械、设备、仪表	15,260,715.90	3.02%
	医药、生物制品	13,887,636.59	2.75%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	32,245,987.67	6.39%
5	建筑业	-	-
6	交通运输、仓储业	70,891,390.04	14.05%
7	信息技术业	24,891,626.44	4.93%
8	批发和零售贸易	12,782,774.85	2.53%
9	金融、保险业	12,001,630.35	2.38%
10	房地产业	6,499,408.54	1.29%
11	社会服务业	-	-
12	传播与文化产业	-	-
13	综合类	2,467,800.00	0.49%
	合 计	351,004,659.61	69.55%

(三) 基金投资的所有股票明细(按市值占基金资产净值比例排序)

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	600009	上海机场	1,947,743	29,644,648.46	5.87%
2	600900	长江电力	2,686,293	23,612,515.47	4.68%
3	000063	中兴通讯	729,092	19,459,465.48	3.86%
4	600019	宝钢股份	3,039,230	18,235,380.00	3.61%
5	600028	中国石化	3,601,320	15,701,755.20	3.11%
6	600519	贵州茅台	416,727	15,268,877.28	3.03%
7	000488	晨鸣纸业	1,349,544	14,467,111.68	2.87%
8	600096	云天化	1,360,513	14,258,176.24	2.83%
9	000895	双汇发展	1,130,016	14,034,798.72	2.78%
10	600036	招商银行	1,437,321	12,001,630.35	2.38%
11	600018	上港集箱	750,718	11,440,942.32	2.27%
12	000039	中集集团	500,000	11,155,000.00	2.21%
13	000022	深赤湾A	456,170	10,797,543.90	2.14%
14	000983	西山煤电	652,780	9,706,838.60	1.92%
15	600085	同仁堂	433,703	9,146,796.27	1.81%
16	000400	许继电气	1,035,506	8,957,126.90	1.77%
17	600591	上海航空	1,299,966	8,748,771.18	1.73%
18	600694	大商股份	807,395	8,582,608.85	1.70%
19	600026	中海发展	840,822	7,727,154.18	1.53%
20	600309	烟台万华	600,000	7,674,000.00	1.52%
21	000726	鲁泰A	798,430	7,648,959.40	1.52%
22	000002	万科A	1,235,629	6,499,408.54	1.29%
23	600642	申能股份	900,966	6,036,472.20	1.20%
24	600005	武钢股份	1,490,414	6,036,176.70	1.20%
25	000937	金牛能源	455,705	5,655,299.05	1.12%
26	600050	中国联通	1,775,216	5,432,160.96	1.08%
27	000422	湖北宜化	613,719	5,142,965.22	1.02%
28	600089	特变电工	415,700	5,050,755.00	1.00%
29	600123	兰花科创	449,201	4,941,211.00	0.98%
30	600267	海正药业	435,739	4,740,840.32	0.94%
31	002024	苏宁电器	90,000	4,158,000.00	0.82%
32	600963	岳阳纸业	518,238	3,684,672.18	0.73%
33	000731	四川美丰	338,960	3,650,599.20	0.72%
34	600002	齐鲁石化	380,468	2,689,908.76	0.53%
35	600886	国投电力	350,000	2,597,000.00	0.51%
36	600770	综艺股份	180,000	2,467,800.00	0.49%
37	600033	福建高速	250,000	1,845,000.00	0.37%
38	600320	振华港机	131,300	1,205,334.00	0.24%
39	600115	东方航空	150,000	664,500.00	0.13%
40	600585	海螺水泥	10,000	81,800.00	0.02%

41	600104	上海汽车	10,000	47,500.00	0.01%
42	600177	雅戈尔	8,000	42,160.00	0.01%
43	600415	小商品城	1,000	30,000.00	0.01%
44	000088	盐田港 A	1,000	12,170.00	0.00%
45	600386	北京巴士	1,000	9,850.00	0.00%
46	600825	华联超市	800	6,496.00	0.00%
47	600729	重庆百货	1,000	5,670.00	0.00%
48	600125	铁龙物流	100	810.00	0.00%

#### (四) 股票投资组合的重大变动

##### 1、累计买入价值超出期初基金资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初净值比例
1	600019	宝钢股份	47,842,433.74	6.94%
2	600900	长江电力	40,679,846.96	5.90%
3	000063	中兴通讯	40,625,514.38	5.89%
4	600104	上海汽车	39,454,069.73	5.72%
5	600005	武钢股份	37,791,646.19	5.48%
6	600028	中国石化	35,971,875.28	5.22%
7	600050	中国联通	35,136,811.76	5.10%
8	600036	招商银行	33,248,937.01	4.82%
9	600018	上港集箱	30,053,963.70	4.36%
10	600002	齐鲁石化	29,678,060.43	4.30%
11	000488	晨鸣纸业	28,243,660.86	4.10%
12	000866	扬子石化	25,259,288.74	3.66%
13	600519	贵州茅台	24,904,553.53	3.61%
14	600009	上海机场	24,572,620.32	3.56%
15	600500	中化国际	23,435,994.02	3.40%
16	000726	鲁泰 A	22,742,671.92	3.30%
17	600660	福耀玻璃	22,569,352.85	3.27%
18	600585	海螺水泥	22,473,878.47	3.26%
19	000002	万科 A	21,713,235.29	3.15%
20	600886	国投电力	21,215,813.20	3.08%
21	600011	华能国际	19,999,715.36	2.90%
22	000100	TCL 集团	19,912,505.76	2.89%
23	000088	盐田港 A	19,878,427.75	2.88%
24	000717	韶钢松山	19,311,967.34	2.80%
25	000039	中集集团	18,845,410.45	2.73%
26	600123	兰花科创	18,295,113.83	2.65%
27	000731	四川美丰	15,614,898.24	2.26%
28	600360	华微电子	15,230,081.06	2.21%
29	000825	太钢不锈	15,076,977.95	2.19%
30	600096	云天化	14,694,101.18	2.13%

31	000895	双汇发展	14,427,554.94	2.09%
32	600418	江淮汽车	14,425,802.91	2.09%
33	600188	兖州煤业	14,419,398.82	2.09%
34	000037	深南电 A	14,261,671.42	2.07%

2、累计卖出价值超出期初基金资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初净值比例
1	600019	宝钢股份	45,301,517.08	6.57%
2	600104	上海汽车	44,119,457.05	6.40%
3	600585	海螺水泥	38,382,943.88	5.57%
4	600005	武钢股份	36,899,967.66	5.35%
5	000088	盐田港 A	34,615,936.08	5.02%
6	000866	扬子石化	33,604,096.52	4.87%
7	600002	齐鲁石化	33,263,800.20	4.82%
8	600011	华能国际	32,097,781.99	4.65%
9	000039	中集集团	31,364,893.17	4.55%
10	600205	山东铝业	30,766,332.22	4.46%
11	600036	招商银行	30,511,911.65	4.42%
12	000063	中兴通讯	29,846,672.49	4.33%
13	600050	中国联通	26,623,655.98	3.86%
14	600009	上海机场	24,399,375.11	3.54%
15	600500	中化国际	24,393,983.12	3.54%
16	600660	福耀玻璃	21,321,326.32	3.09%
17	000100	TCL 集团	20,714,757.17	3.00%
18	600031	三一重工	20,158,890.49	2.92%
19	600018	上港集箱	18,625,478.26	2.70%
20	000717	韶钢松山	17,969,384.52	2.61%
21	000027	深能源 A	17,591,327.80	2.55%
22	600886	国投电力	17,572,225.11	2.55%
23	600519	贵州茅台	17,514,257.92	2.54%
24	600710	常林股份	17,323,047.34	2.51%
25	600028	中国石化	17,220,202.43	2.50%
26	000825	太钢不锈	16,203,154.58	2.35%
27	000726	鲁 泰 A	15,017,935.07	2.18%
28	000002	万 科 A	15,009,917.62	2.18%
29	600900	长江电力	14,941,721.16	2.17%
30	000541	佛山照明	14,384,684.42	2.09%
31	600210	紫江企业	14,111,374.27	2.05%
32	000037	深南电 A	13,877,233.97	2.01%

3、报告期内买入股票的成本总额：1,194,053,151.36元

4、报告期内卖出股票的收入总额：1,057,004,696.50元

(五) 按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国家债券	84,201,600.00	16.68%
2	金融债券	29,991,000.00	5.94%
3	可转换债券	12,979,581.30	2.57%
	合计	127,172,181.30	25.20%

(六) 基金投资前五名债券明细(按市值占基金资产净值比例排序)

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	04国债(5)	45,129,600.00	8.94%
2	04国债(1)	39,072,000.00	7.74%
3	04国开17	29,991,000.00	5.94%
4	招行转债	4,024,428.80	0.80%
5	金牛转债	3,374,887.50	0.67%

(七) 报告附注

- 1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。
- 2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。
- 3、其他资产的构成如下：

分 类	市值(元)
交易保证金	500,000.00
应收利息	1,727,696.84
应收申购款	22,727.29
合 计	2,250,424.13

4、处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市值(元)	占净值比例
110317	营港转债	2,602,142.40	0.52%

## 九、基金份额持有人户数、持有人结构

### (一) 持有人户数

	国泰金龙债券	国泰金龙行业
基金份额持有人户数	1,551	1,677
平均每户持有的基金份额	55,095.04 份	309,117.56 份

### (二) 持有人结构

#### 国泰金龙债券

	持有的基金份额(份)	占总份额比例
机构投资者	42,165,510.58	49.34%
个人投资者	43,286,892.06	50.66%
合计	85,452,402.64	100.00%

#### 国泰金龙行业

	持有的基金份额(份)	占总份额比例
机构投资者	477,372,764.23	92.09%
个人投资者	41,017,384.57	7.91%
合计	518,390,148.80	100.00%

## 十、开放式基金份额变动情况

	国泰金龙债券 份额(份)	国泰金龙行业 份额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	1,887,374,602.86	684,348,868.87
报告期初基金份额总额	1,063,395,722.26	684,200,828.25
报告期间基金总申购份额	40,910,372.91	398,648,061.89
报告期间基金总赎回份额	-1,018,853,692.53	-564,458,741.34
报告期末基金份额总额	85,452,402.64	518,390,148.80

## 十一、重大事件揭示

- 1、2004年2月11日根据《国泰金龙债券证券投资基金分红公告》，国泰金龙债券基金以2004年2月5日已实现的可分配收益为基准向全体基金持有人按每10份基金单位派发红利0.1元。
- 2、2004年2月17日根据《国泰金龙行业精选证券投资基金分红公告》，国泰金龙行业基金以2004年2月10日已实现的可分配收益为基准向全体基金持有人按每10份

基金单位派发红利0.12元。

- 3、2004年4月12日根据《国泰金龙系列证券投资基金2004年第二次分红公告》，本基金以2004年3月30日已实现的可分配收益为基准，国泰金龙行业基金、国泰金龙债券基金分别向基金持有人按每10份基金单位派发红利0.2元。
- 4、2004年4月29日本公司刊登《国泰基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司为基金代销机构的公告》，增加招商银行股份有限公司为国泰金龙系列证券投资基金的代理销售机构。
- 5、2004年4月30日本公司刊登《国泰基金管理有限公司关于重要岗位人员变更的公告》。经国泰基金管理有限公司董事会审议通过，并报经中国证监会审核批准：选举周志平、张和之同志为公司董事，罗新泉、沈强、周栋同志不再担任公司董事职务；选举黄明达、李芝樑同志为公司监事，李予瑾、翁新孟同志不再担任公司监事职务；聘任何斌、陈甦同志为公司副总经理。
- 6、2004年5月27日本公司刊登《国泰基金管理有限公司关于增加基金代销机构的公告》，增加中国银河证券有限责任公司为国泰金龙系列证券投资基金的代理销售机构。
- 7、2004年6月23日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司关于公司股东股权转让的公告》。经本基金管理人股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字[2003]154号文批准，本公司股东宏源证券股份有限公司将其所持有的本公司20%股权分别转让给现有股东国泰君安证券股份有限公司15%和上海国有资产经营有限公司5%；国泰君安证券股份有限公司将所持有的本公司2%股权转让给上海仪电控股（集团）公司。本次股权转让后，本公司股东及出资比例为：上海国有资产经营有限公司24%，国泰君安证券股份有限公司24%，上海爱建信托投资有限责任公司20%，浙江省国际信托投资有限责任公司20%，中国电力财务有限公司10%，上海仪电控股（集团）公司2%。
- 8、2004年7月16日，本基金管理人刊登了《国泰金龙系列证券投资基金更新招募说明书2004年第一号》。依照《证券投资基金销售管理办法》，本基金管理人决定自2004年7月1日起将本基金赎回费的25%归入基金资产。相关信息披露费用已按中国证监会相关规定执行。
- 9、基金租用席位的选择标准是：
  - (1) 资力雄厚，信誉良好；
  - (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
  - (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
  - (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
  - (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），经公司同意并报董事会批准。

10、报告期内，基金租用证券公司专用席位的有关情况如下：

国泰金龙债券

单位：元

券商名称	席位数量	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例
国泰君安证券股份有限公司	1	4,375,047.72	100.00%	421,882,258.32	16.16%
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	2,188,673,561.77	83.84%
合计	2	4,375,047.72	100.00%	2,610,555,820.09	100.00%

券商名称	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	3,423.54	-19.85%
申银万国证券股份有限公司	626,000,000.00	100.00%	-20,669.69	119.85%
合计	626,000,000.00	100.00%	-17,246.15	100.00%

注：由于国泰金龙债券基金为纯债券投资基金，因此根据我公司与申银万国证券股份有限公司签订的席位租用协议中提到“债券现货及债券回购不计交易佣金，国泰基金管理公司承担买卖经手费、买卖证管费、国债、回购风险结算基金。”

由此，在申银万国证券股份有限公司席位上产生的佣金负数实际为国债、回购风险结算基金。

国泰金龙行业

单位：元

券商名称	席位数量	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例
国泰君安证券股份有限公司	1	419,082,770.31	18.83%	51,684,124.93	15.39%
华夏证券股份有限公司	1	257,441,593.89	11.57%	4,129,531.23	1.23%
海通证券股份有限公司	1	453,506,711.73	20.38%	15,630,165.92	4.65%
上海证券有限责任公司	1	372,165,587.14	16.73%	45,939,464.13	13.68%
东吴证券有限责任公司	1	373,974,228.25	16.81%	142,158,194.01	42.33%
华泰证券有限责任公司	1	348,887,037.92	15.68%	76,269,291.32	22.71%
合计	6	2,225,057,929.24	100.00%	335,810,771.54	100.00%

券商名称	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
国泰君安证券股份有限公司	20,000,000.00	9.76%	343,178.24	19.14%
华夏证券股份有限公司	-	-	201,449.48	11.23%
海通证券股份有限公司	-	-	354,873.59	19.79%
上海证券有限责任公司	95,000,000.00	46.34%	303,814.88	16.94%
东吴证券有限责任公司	10,000,000.00	4.88%	305,219.01	17.02%
华泰证券有限责任公司	80,000,000.00	39.02%	284,869.58	15.88%
合计	205,000,000.00	100.00%	1,793,404.78	100.00%

在本报告期内，基金新增租用华夏证券有限责任公司一个专用交易席位。

11、2004年9月4日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登关于增加东方证券股份有限公司为金龙系列证券投资基金代销机构的公告。

- 12、2004年10月15日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《国泰基金管理有限公司关于修改开放式基金基金合同的公告》，就国泰金龙系列证券投资基金修改基金合同的内容进行了公告。
- 13、2004年10月28日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登更换基金经理的公告，顾伟勇先生不再担任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理，由何旻先生担任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理。
- 14、报告期内，为本系列基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬为10万元，目前的审计机构已提供审计服务的年限为2年。
- 15、报告期内，未召开基金份额持有人大会；基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动；无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项；基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

## 十二、 备查文件目录

- 1、关于同意设立国泰金龙系列证券投资基金的批复
- 2、国泰金龙系列证券投资基金合同
- 3、国泰金龙系列证券投资基金托管协议
- 4、国泰金龙系列证券投资基金半年度报告、收益分配公告
- 5、国泰金龙系列证券投资基金代销协议
- 6、报告期内披露的各项公告
- 7、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

备查文件存放地点：本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市浦东新区世纪大道1600号浦项商务广场31-32楼。

投资者查阅方式：可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 68674688，400-8888-688

客户投诉电话：(021) 50819801

公司网址：<http://www.gtfund.com>

**国泰基金管理有限公司**

**2005年3月30日**