

# 国泰金龙系列证券投资基金 2008 年第 4 季度报告

(本系列基金由国泰金龙债券证券投资基金  
和国泰金龙行业精选证券投资基金组成)

2008 年 12 月 31 日

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

报告送出日期：二〇〇九年一月二十一日

# 国泰金龙债券证券投资基金 2008 年第 4 季度报告

## § 1 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。

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 2009 年 01 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2008 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

1. 基金简称	
A 类基金简称:	国泰金龙债券 A 类
C 类基金简称:	国泰金龙债券 C 类
2. 交易代码	
A 类交易代码:	020002
C 类交易代码:	020012
3. 系列基金名称:	国泰金龙系列证券投资基金
4. 系列其他子基金名称:	国泰金龙行业(020003)
5. 基金运作方式:	契约型开放式
6. 基金合同生效日:	2003 年 12 月 5 日
7. 报告期末基金份额总额:	2,300,260,479.70 份
国泰金龙债券 A 类基金份额总	1,726,387,275.37 份

额:	
国泰金龙债券 C 类基金份额总 额:	573,873,204.33 份
8. 投资目标:	在保证投资组合低风险和高流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报，力求基金资产的稳定增值。
9. 投资策略:	以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。在对拟公开发行的股票的公司进行充分研究的基础上，择机参与拟公开发行的股票的申购。因申购所持有的股票资产自可上市交易之日起在 180 个自然日内卖出；因可转债转股所持有的股票资产自可上市交易之日起在 180 个自然日内卖出。
10. 业绩比较基准:	本基金以中信全债指数收益率作为衡量基金业绩的比较基准。
11. 风险收益特征:	本基金属于收益稳定、风险较低的品种。
12. 基金管理人:	国泰基金管理有限公司
13. 基金托管人:	上海浦东发展银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2008 年 10 月 1 日-2008 年 12 月 31 日）	
	国泰金龙债券 A 类基金	国泰金龙债券 C 类基金
1. 本期已实现收益	28,491,044.08	9,380,124.37
2. 本期利润	70,331,262.23	24,041,775.89
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0473	0.0422
4. 期末基金资产净值	1,855,511,674.45	615,693,390.47
5. 期末基金份额净值	1.075	1.073

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、国泰金龙债券 A 类基金：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.31%	4.41%	0.13%	1.70%	0.18%

##### 2、国泰金龙债券 C 类基金：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.02%	0.31%	4.41%	0.13%	1.61%	0.18%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金龙债券证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2003 年 12 月 5 日至 2008 年 12 月 31 日）

##### 1. 国泰金龙债券（A 类）基金



注：本基金的合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 2. 国泰金龙债券（C类）基金



注：本基金的合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林勇	本基金的基金经理	2006-11-11	-	14	硕士研究生。曾任职于江西省人民银行、江西省资金融通中心、招商银行总行、嘉实基金管理有限公司。2005 年 5 月加盟国泰基金管理有限公司，2005 年 6 月至 2007 年 2 月任国泰货币市场基金的基金经理，2006 年 11 月起任国泰金龙债券基金的基金经理。

### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》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，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生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、投资组合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，有效保障投资人的合法权益。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

从当前数据来看，中国经济未来面临通缩的风险，2008 年四季度中国经济进一步走弱，收入预期下降，消费动力不足。四季度，面对经济大幅减缓的风险，中国政府宣布实施积极的财政政策和适度宽松的货币政策以刺激经济，其中中央银行连续四次宣布下调存贷款利率共计 1.89 个百分点，三次下调法定存款准备金率 2—3 个百分点。四季度债券市场在大幅降息和流动性宽裕的环境下，总体呈现出牛市格局，10 月份收益率曲线整体大幅下移，11—12 月份市场对长期债券产生分歧，抑制了长债收益率的继续下降，收益率曲线陡峭化。

本基金四季度对宏观经济、货币政策和市场资金供求进行了仔细研究，对市场走势和收益率曲线的变动方向进行了科学预测，结合本基金的特点，采取了积极的组合久期策略，并适当参与信用债券市场行情。在遵守基金合同、控制风险的前提下，本基金四季度为投资者取得了较为稳定的收益，符合债券基金的风险收益特点。

预计 2009 年一季度保经济增长将成为货币政策的主要方向，中央银行将继续降低存贷款利率和降低法定存款准备金率。同时，预计债券市场资金供应将维持总体宽裕的局面，但必须对外汇储备下降的情况给予密切关注。同时本基金将进一步加强信用风险的关注。

本基金在宏观方面将继续加强对国内宏观经济走势、国内货币政策、国际经济环境变化情况的关注分析，在市场方面随时关注资金供求变化情况和收益率曲线变化情况，进一步根据货币政策和市场变化情况完善投资策略，控制货币政策变化所带来的风险，抓住市场存在的投资机会，精心研究和部署，力争为基金持有人创造长期稳定、良好的回报。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产
----	----	-------	--------

			的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,502,141,824.20	94.81
	其中：债券	2,502,141,824.20	94.81
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	104,095,946.85	3.94
6	其他资产	33,007,179.80	1.25
7	合计	2,639,244,950.85	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	752,290,735.40	30.44
2	央行票据	96,763,000.00	3.92
3	金融债券	1,629,715,500.00	65.95
	其中：政策性金融债	1,586,439,500.00	64.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,304,000.00	0.82
6	可转债	3,068,588.80	0.12
7	其他	-	-
8	合计	2,502,141,824.20	101.25

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	080225	08 国开 25	3,100,000	316,665,000.00	12.81
2	080208	08 国开 08	2,000,000	228,260,000.00	9.24
3	080309	08 进出 09	2,000,000	212,660,000.00	8.61
4	080219	08 国开 19	2,000,000	206,260,000.00	8.35
5	080018	08 国债 18	1,800,000	194,976,000.00	7.89

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本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。

5.8.2 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。

#### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,027,743.83
5	应收申购款	7,729,435.97
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	33,007,179.80

#### 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	110002	南山转债	1,653,046.80	0.07
2	125528	柳工转债	1,415,542.00	0.06

#### 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰金龙债券 A 类基金	国泰金龙债券 C 类基金
报告期期初基金份额总额	797,874,586.42	251,101,693.73
报告期期间基金总申购份额	1,580,112,390.01	1,108,519,311.30
报告期期间基金总赎回份额	651,599,701.06	785,747,800.70
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,726,387,275.37	573,873,204.33

### § 7 备查文件目录

#### 7.1 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、上海浦东发展银行证券交易资金结算协议

- 5、国泰金龙系列证券投资基金年度报告、半年度报告及收益分配公告
- 6、国泰金龙系列证券投资基金代销协议
- 7、报告期内披露的各项公告
- 8、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

### 7.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道100号上海环球金融中心 39 楼。

### 7.3 查阅方式

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) 38569000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 38569000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

## 国泰金龙行业精选证券投资基金 2008 年第 4 季度报告

### § 1 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。

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 2009 年 01 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2008 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:	国泰金龙行业
交易代码:	020003
系列基金名称:	国泰金龙系列证券投资基金
系列其他子基金名称:	国泰金龙债券: A 类(020002)、C 类(020012)
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2003 年 12 月 5 日
报告期末基金份额总额:	570,977,489.60 份
投资目标:	有效把握我国行业的发展趋势,精心选择具有良好行业背景的成长性企业,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略:	本基金采取定量分析与定性分析相结合的方式,通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险;通过行业精选,确定拟投资的优势行业及相应比例;通过个股选择,挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。
业绩比较基准:	本基金股票投资部分的业绩比较基准是上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均,债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。 基金整体业绩比较基准=75%×[上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均]+25%×[上证国债指数]。
风险收益特征:	承担中等风险,获取相对超额回报。
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2008 年 10 月 1 日-2008 年 12 月 31 日）
1.本期已实现收益	-81,306,518.42
2.本期利润	-10,072,010.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0165
4.期末基金资产净值	303,199,384.78
5.期末基金份额净值	0.531

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

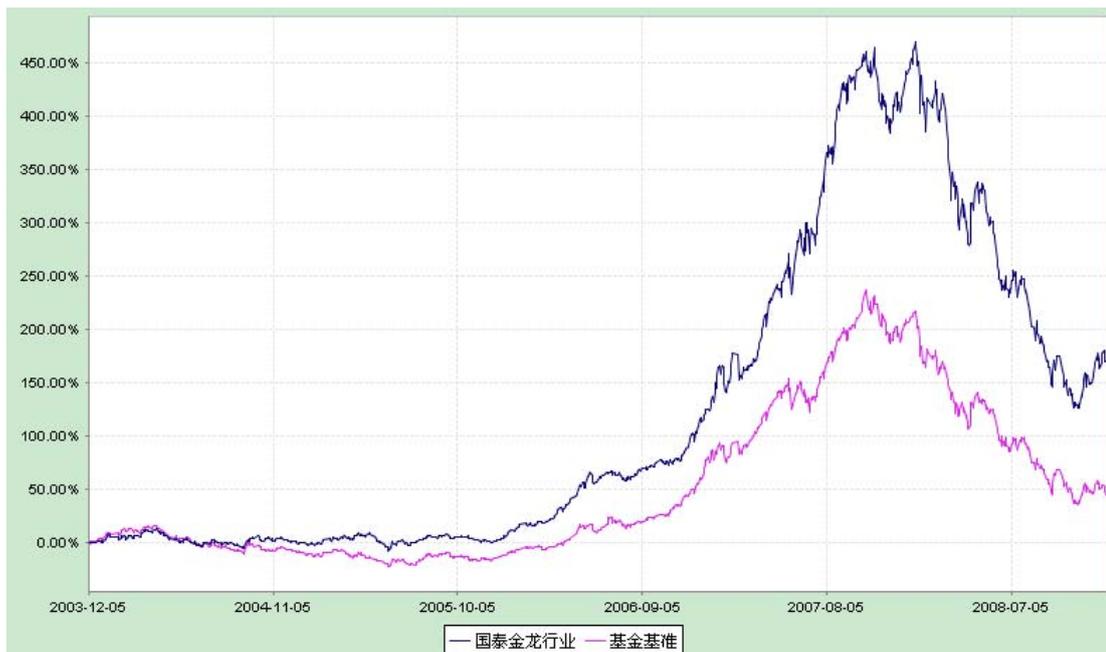
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.98%	2.07%	-15.10%	2.07%	13.12%	0.00%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金龙行业精选证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2003 年 12 月 5 日至 2008 年 12 月 31 日）



注：本基金的合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王航	本基金的基金经理	2008-5-17	-	12	硕士研究生，CFA。曾任职于南方证券有限公司。2003 年 1 月加盟国泰基金管理有限公司，历任社保 111 组合基金经理助理、国泰金鹿保本基金和国泰金象保本基金基金经理助理、国泰金马稳健回报基金经理助理、国泰金牛创新成长基金经理助理，2008 年 5 月起任国泰金龙行业精选基金的基金经理。

### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》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，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生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、投资组合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，有效保障投资人的合法权益。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金类型包括：封闭式基金、开放式基金的股票型基金、指数型股票基金、混合基金（偏股型）、债券基金（债券型）、保本基金和货币基金等，其中封闭式基金三只、股票型基金三只、混合基金（偏股型）三只。本基金与本基金管理人管理的其他同类型基金（除国泰金牛创新成长基金外）的业绩表现差异均在 5% 之内，与国泰金牛创新成长基金的业绩表现差异为 5.30%，主要由于行业配置差异所致。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2008 年四季度，尽管宏观经济基本面仍然处在下滑通道，但随着超预期政策出台以及对进一步利好政策将陆续出台的预期下，受相关受益行业的带动，A 股市场出现明显反弹，同时四季度成交量出现明显放大且月度成交量逐月增加。虽然市场心态较之前有所改善，但由于宏观经济基本面不确定性仍然很大，因此行业板块积累至一定涨幅在年底时出现较明显获利回吐。

本基金四季度在结构上采取积极灵活的战术性行业配置策略，行业配置上转向防御，重点加强了医药、电力行业的配置，并积极把握政策刺激带来的主题性投资机会，

超配了铁路、基建和电力设备等行业，12 月后加强了中小企业板块的配置，取得了较好的投资效果。

展望 2009 年，世界经济仍面临着 1929 年大萧条以来最严峻的考验。预测全球经济增长将从 2007 年的 5% 减缓至 2008 年 3.5% 和 2009 年 2%，为 2002 年以来的最慢增长。受外部需求放缓和经济周期回调压力的双重影响，中国经济预计还要经过一段时间来进行调整。未来一段时间内市场最大的关注点仍然是政府宏观经济政策的变化和具体经济刺激方案出台。虽然政府引导的投资仍是刺激经济的重要手段，但增加人民的可支配收入、扩大内需将逐步成为政策的着力点。

从 Fed 模型来看，目前 A 股的名义收益率 (E/P) 比 7 年期国债收益率高出 4%，已进入一个可长期投资的区域。对于中国经济前景，我们认为 2009 年中期很有可能是宏观经济和上市公司盈利最差的时候。随着经济的温和复苏，市场信心的逐步恢复，市场估值水平也有望得以提升，不排除股票市场先于经济一个甚至两个季度提前见底的可能。

基于以上判断，本基金在 2009 年一季度将维持市场中性的股票资产配置，仍期望通过积极灵活的行业、主题策略选择以及在符合政策导向和市场趋势的板块中精选个股来获取超额收益。行业的投资的思路主要有几个方面：1、受益于内需扩张、成长确定以及医改政策刺激的医药行业；2、受益于经济转型、产业升级的软件及互联网行业；3、受益于政府投资拉动的铁路及轨道交通建设、电网电力设备、节能环保、新能源设备行业。投资主题方面，政府投资、拉动内需、加大三农投入、价格改革、科技创新、企业重组并购等将是我们关注的主题。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	218,155,610.82	69.45
	其中：股票	218,155,610.82	69.45
2	固定收益投资	70,843,379.70	22.55
	其中：债券	70,843,379.70	22.55
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售	-	-

	金融资产		
5	银行存款和结算备付金合计	16,611,412.73	5.29
6	其他资产	8,486,380.15	2.70
7	合计	314,096,783.40	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	7,227,100.00	2.38
C	制造业	89,978,421.48	29.68
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,112,243.78	2.02
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	24,316,959.20	8.02
C7	机械、设备、仪表	5,839,600.00	1.93
C8	医药、生物制品	53,709,618.50	17.71
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	9,867,580.80	3.25
E	建筑业	7,445,531.00	2.46
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	24,217,988.80	7.99
H	批发和零售贸易	12,806,800.00	4.22
I	金融、保险业	16,829,430.00	5.55
J	房地产业	17,853,860.64	5.89
K	社会服务业	25,057,878.10	8.26
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,871,020.00	2.27
	合计	218,155,610.82	71.95

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002140	东华科技	703,177	17,790,378.10	5.87
2	600804	鹏博士	1,590,000	15,470,700.00	5.10
3	600161	天坛生物	997,150	14,478,618.00	4.78
4	600256	广汇股份	1,548,397	14,121,380.64	4.66
5	600436	片仔癀	722,753	13,638,349.11	4.50
6	002022	科华生物	460,000	10,718,000.00	3.53
7	600900	长江电力	1,342,528	9,867,580.80	3.25
8	600100	同方股份	920,000	9,135,600.00	3.01

9	600153	建发股份	1,160,000	7,400,800.00	2.44
10	002063	远光软件	505,027	7,272,388.80	2.40

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	70,843,379.70	23.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	70,843,379.70	23.37

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010004	20 国债(4)	473,230	48,312,050.70	15.93
2	010210	02 国债(10)	109,830	11,070,864.00	3.65
3	010107	21 国债(7)	60,000	6,729,600.00	2.22
4	010308	03 国债(8)	45,380	4,730,865.00	1.56
5	-	-	-	-	-

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本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。

5.8.2 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。

#### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	1,840,000.00
2	应收证券清算款	4,479,115.64
3	应收股利	-
4	应收利息	1,629,749.69
5	应收申购款	537,514.82
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,486,380.15

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	9,867,580.80	3.25	公布重大事项停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	636,143,138.05
报告期期间基金总申购份额	115,844,217.83
报告期期间基金总赎回份额	181,009,866.28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	570,977,489.60

§ 7 备查文件目录

7.1 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、上海浦东发展银行证券交易资金结算协议
- 5、国泰金龙系列证券投资基金年度报告、半年度报告及收益分配公告
- 6、国泰金龙系列证券投资基金代销协议
- 7、报告期内披露的各项公告
- 8、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

## 7.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 层。

## 7.3 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) 38569000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 38569000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇〇九年一月二十一日