

# 国泰金龙系列证券投资基金 2011 年第 2 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)

2011 年 6 月 30 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：二〇一一年七月十九日

# 国泰金龙债券证券投资基金2011年第2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 2011 年 7 月 15 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 2011 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰金龙债券
基金主代码	020002
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	国泰金龙行业混合(020003)
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	189,424,503.78份
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。
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。	
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。	
风险收益特征	本基金属于收益稳定、风险较低的品种。	
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	
下属两级基金的基金简称	国泰金龙债券A	国泰金龙债券C
下属两级基金的交易代码	020002	020012
报告期末下属两级基金的份额总额	145,933,740.79份	43,490,762.99份

### § 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(2011年4月1日-2011年6月30日)	
	国泰金龙债券A	国泰金龙债券C
1. 本期已实现收益	2,270,992.17	664,285.53
2. 本期利润	-1,911,517.63	-648,820.35
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0127	-0.0139
4. 期末基金资产净值	151,672,040.97	45,054,618.14
5. 期末基金份额净值	1.039	1.036

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：

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	-1.24%	0.17%	0.53%	0.04%	-1.77%	0.13%
-------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

**2、国泰金龙债券 C:**

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	-1.33%	0.17%	0.53%	0.04%	-1.86%	0.13%

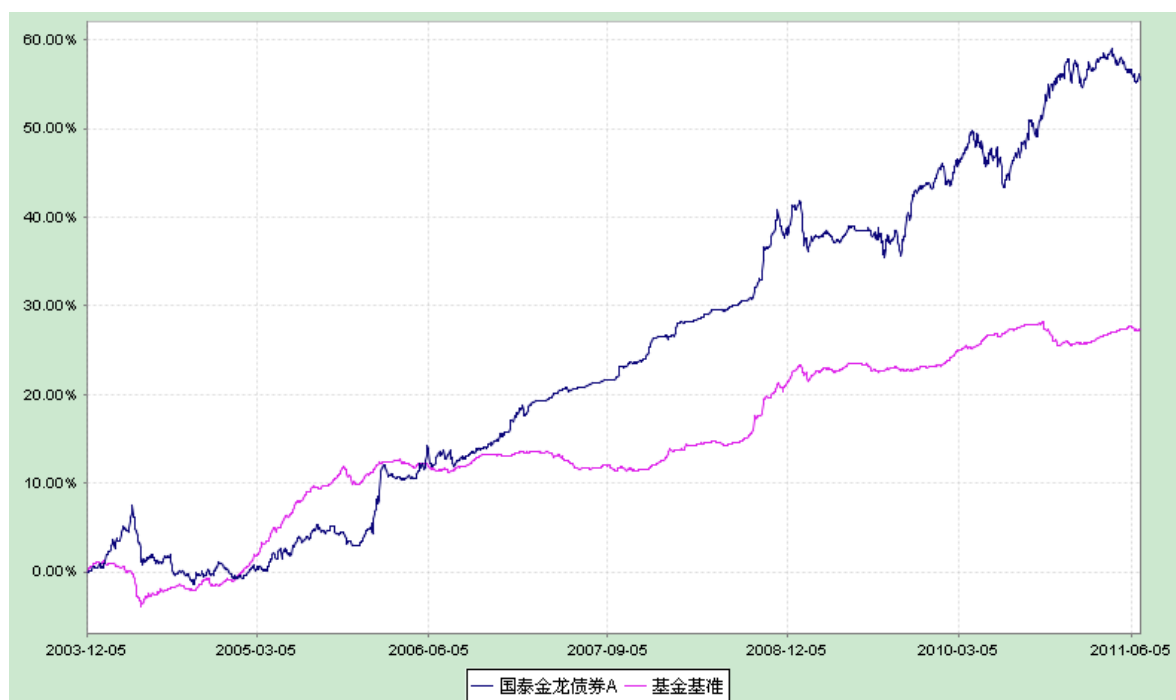
**3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

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

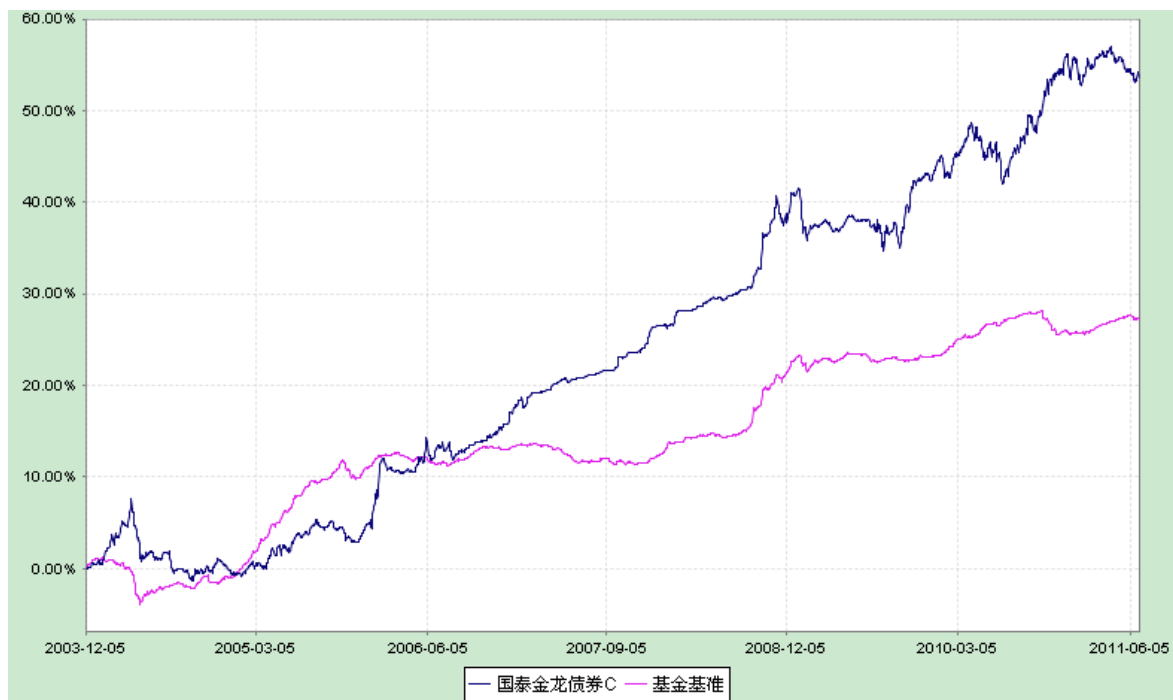
(2003 年 12 月 5 日至 2011 年 6 月 30 日)

**1. 国泰金龙债券 A:**



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:**



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		
吴晨	本基金的基金经理、国泰金鹿保本基金的基金经理	2010-4-29	-	9	硕士研究生，CFA，FRM。2001年6月加入国泰基金管理有限公司，历任股票交易员、债券交易员；2004年9月至2005年10月，英国城市大学卡斯商学院金融系学习；2005年10月至2008年3月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理；2008年4月至2009年3月在长信基金管理有限公司从事债券研究；2009年4月至2010年3月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010年4月起担任国泰金龙债券的基金经理，2010年9月起担任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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所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

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度出口、消费以及投资增速都有不同程度的下滑，宏观经济增速低于市场预期。CPI 指数持续高涨，货币紧缩政策出台维持既有频率，并没有出现投资者盼望中的适度放松。海外经济增速也同步放缓，希腊债务危机进一步扩散。这一系列因素叠加造成了二季度股票市场的大幅调整。债券市场进一步走强，尤其是信用债，4、5 月表现抢眼，信用利差大幅收窄，但 6 月下旬随着市场资金面紧张以及城投债风险逐步显现，信用利差有所扩大。转债市场受正股下跌影响持续调整，部分转债价格已经低于 1 月份的低点。

二季度本基金债券部分适当拉长了组合久期，同时对信用债进行波段操作，在

4 月初大量增持信用债，6 月初进行减持。权益类资产前期维持中性配置，在 6 月下旬加大了转债投资力度。二季度为了规避风险，本基金没有参与新股发行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 类在 2011 年二季度的净值增长率为-1.24%，同期业绩比较基准收益率为 0.53%。国泰金龙债券 C 类在 2011 年二季度的净值增长率为-1.33%，同期业绩比较基准收益率为 0.53%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计三季度经济增速将进一步下滑，受房地产调控影响，投资增速将继续下行；通胀持续高位将带来消费需求的下降；受日本核泄漏危机和欧元区主权债务危机蔓延的影响，出口形势同样不能过于乐观。但市场普遍预计通胀受基数影响将在 6 月见顶后回落，结合前期温总理“通胀可控”的表态，政策微调的预期有所增强，但这并不意味着紧缩政策的停止，公开市场操作以及加息仍然存在空间，进一步上调准备金率的可能性也不能排除。由于目前股票市场估值水平已经基本包含了经济增速下滑的悲观预期，通胀见顶以及政策可能的微调将导致市场在三季度存在反弹的可能性。债券市场虽然受货币政策调整影响更为直接，但由于已经开始逐步进入加息末期，调整空间将较为有限，收益率可能呈现先高后低的态势。信用债券预计将明显分化，城投债将面临流动性风险以及可能的违约风险，而非城投信用债券将进一步受到追捧。

本基金将采取中性债券久期，类属资产配置方面相对均衡；权益类资产维持灵活、积极的投资策略，同时注重不同风格资产配置的相对均衡。在控制风险的前提下适当参与新股发行以及公开增发等，积极降低组合波动率，寻求基金净值的平稳增长。

## § 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	6,429,958.75	2.57
	其中：股票	6,429,958.75	2.57
2	固定收益投资	234,152,164.39	93.66
	其中：债券	234,152,164.39	93.66

	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	5,477,104.89	2.19
6	其他各项资产	3,944,476.03	1.58
7	合计	250,003,704.06	100.00

注：股票市值为新股中签或可转债转股产生。

### 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	985,600.00	0.50
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,101,686.77	2.08
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	1,112,800.00	0.57
C7	机械、设备、仪表	2,988,886.77	1.52
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	369,868.24	0.19
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	119,643.74	0.06
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	853,160.00	0.43
M	综合类	-	-
	合计	6,429,958.75	3.27

### 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	601700	风范股份	65,952	1,622,419.20	0.82
2	002501	利源铝业	52,000	1,112,800.00	0.57
3	300137	先河环保	67,704	1,069,723.20	0.54
4	601118	海南橡胶	80,000	985,600.00	0.50
5	300133	华策影视	22,000	853,160.00	0.43
6	601199	江南水务	25,144	369,868.24	0.19
7	601126	四方股份	16,189	296,744.37	0.15
8	601933	永辉超市	4,946	119,643.74	0.06

### 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	50,443,620.00	25.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	110,627,020.20	56.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	73,081,524.19	37.15
8	其他	-	-
9	合计	234,152,164.39	119.02

### 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	019021	10国债21	200,000	19,984,000.00	10.16
2	113002	工行转债	142,530	16,885,529.10	8.58
3	113001	中行转债	152,710	16,123,121.80	8.20
4	110015	石化转债	145,840	15,728,844.00	8.00
5	122976	09永煤债	148,920	14,899,446.00	7.57

### 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	57,235.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,403,796.91
5	应收申购款	233,444.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,944,476.03

#### 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)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	16,885,529.10	8.58

2	113001	中行转债	16,123,121.80	8.20
3	110078	澄星转债	5,067,619.20	2.58
4	110003	新钢转债	3,933,800.00	2.00

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	国泰金龙债券 C
本报告期期初基金份额总额	152,641,497.18	47,607,520.70
本报告期基金总申购份额	49,541,388.48	14,256,755.35
减：本报告期基金总赎回份额	56,249,144.87	18,373,513.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	145,933,740.79	43,490,762.99

## § 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、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 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

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

二〇一一年七月十九日

# 国泰金龙行业精选证券投资基金 2011 年第 2 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 2011 年 7 月 15 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 2011 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰金龙行业混合
基金主代码	020003
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(020002)、国泰金龙债券C(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	910,482,253.76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(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	3,582,607.59
2.本期利润	-31,012,291.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0344
4.期末基金资产净值	503,535,340.30
5.期末基金份额净值	0.553

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

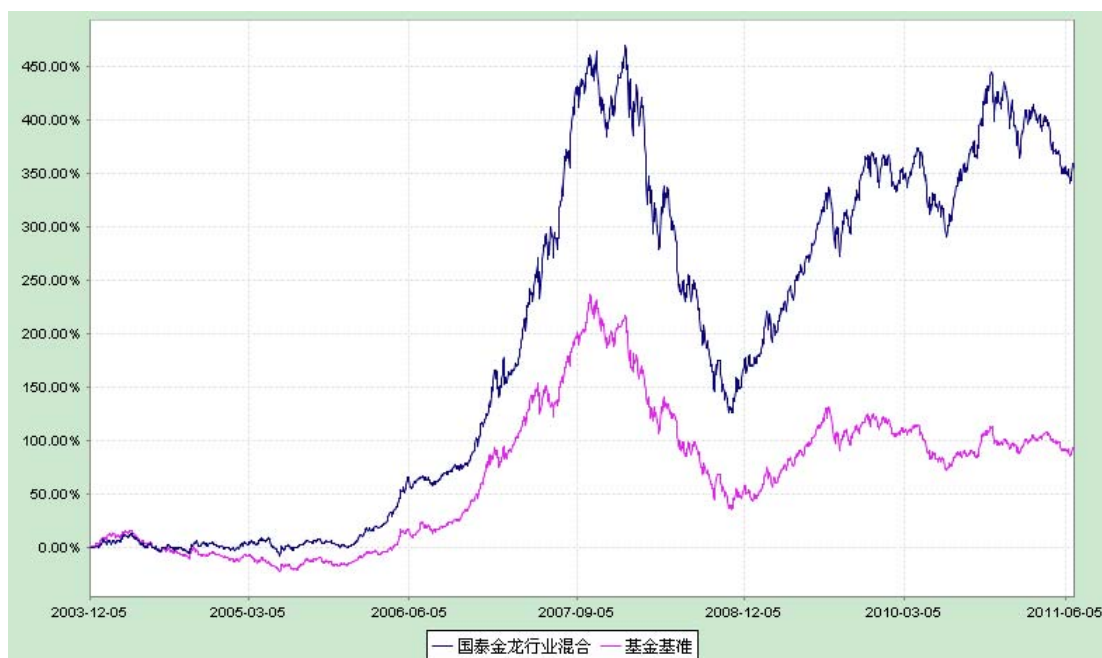
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.95%	0.84%	-4.19%	0.74%	-1.76%	0.10%

#### 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 2011 年 6 月 30 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， 国泰金鑫封闭的基金经理	2008-5-17	-	14	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混合的基金经理，2010年4月起兼任国泰金鑫封闭的基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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所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

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度 A 股市场出于对通胀和经济下滑的担忧，总体维持弱势格局，季末市场形成较乐观的政策放松预期而触底反弹，市场结构基本延续一季度的风格特征，低估值的周期品种表现较为稳定。根据对市场整体窄幅震荡的判断，本基金二季度维持中性资产配置，结构上较为均衡，风格上偏向中大盘股票。主要增持券商、房地产、食品饮料、纺织服装等行业，减持了机械和煤炭等行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2011 年二季度的净值增长率为-5.95%，同期业绩比较基准收益率为-4.19%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从三季度短期走势判断，在通胀可控、政策可能放松的预期下，反弹仍有可能持续；但是长期看，经济中的结构性矛盾尚未得到解决，通胀压力又依然存在，因此难以走出趋势性行情。本基金在三季度的操作中，将重点关注景气先导型行业的反弹机会，例如地产、汽车等，中长期仍重点关注高端装备制造，以及受益于收入分配制度改革并且估值合理、业绩增长稳定的中低端消费品。

## § 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	376,445,751.62	71.61



	其中：股票	376,445,751.62	71.61
2	固定收益投资	111,541,055.50	21.22
	其中：债券	111,541,055.50	21.22
	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	33,636,350.62	6.40
6	其他各项资产	4,082,783.55	0.78
7	合计	525,705,941.29	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	12,745,176.64	2.53
C	制造业	146,784,992.29	29.15
C0	食品、饮料	23,434,792.18	4.65
C1	纺织、服装、皮毛	12,810,321.19	2.54
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	28,810,100.31	5.72
C6	金属、非金属	8,960,000.00	1.78
C7	机械、设备、仪表	52,725,130.22	10.47
C8	医药、生物制品	20,044,648.39	3.98

C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,995,156.00	0.79
E	建筑业	38,892,573.84	7.72
F	交通运输、仓储业	7,396,544.61	1.47
G	信息技术业	31,022,862.21	6.16
H	批发和零售贸易	30,190,242.37	6.00
I	金融、保险业	68,147,820.36	13.53
J	房地产业	14,696,310.25	2.92
K	社会服务业	17,414,740.25	3.46
L	传播与文化产业	5,159,332.80	1.02
M	综合类	-	-
	合计	376,445,751.62	74.76

### 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	600030	中信证券	1,919,999	25,113,586.92	4.99
2	600036	招商银行	1,727,501	22,492,063.02	4.47
3	600089	特变电工	1,660,944	21,492,615.36	4.27
4	002236	大华股份	410,000	18,568,900.00	3.69
5	002024	苏宁电器	1,381,377	17,695,439.37	3.51
6	600763	通策医疗	1,000,000	16,730,000.00	3.32
7	600050	中国联通	2,970,755	15,596,463.75	3.10
8	600535	天士力	312,153	12,838,852.89	2.55
9	000568	泸州老窖	268,934	12,134,302.08	2.41
10	600970	中材国际	395,139	10,799,148.87	2.14

#### 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	90,563,000.00	17.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,778,000.00	3.93
	其中：政策性金融债	19,778,000.00	3.93
4	企业债券	1,059.50	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,198,996.00	0.24
8	其他	-	-
9	合计	111,541,055.50	22.15

#### 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	010110	21国债(10)	430,000	42,922,600.00	8.52
2	110011	11付息国债11	300,000	29,832,000.00	5.92
3	030201	03国开01	200,000	19,778,000.00	3.93
4	010203	02国债(3)	80,000	7,909,600.00	1.57
5	010308	03国债(8)	60,000	5,908,800.00	1.17

#### 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 其他各项资产构成

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	-
3	应收股利	305,296.79
4	应收利息	1,618,792.21
5	应收申购款	318,694.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,082,783.55

#### 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)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	1,055,800.00	0.21

#### 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

本报告期期初基金份额总额	917,837,738.05
本报告期基金总申购份额	81,535,462.80
减：本报告期基金总赎回份额	88,890,947.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	910,482,253.76

## § 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、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 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

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

二〇一一年七月十九日