

# 金盛证券投资基金

## 2006 年半年度报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇〇六年八月二十九日

# 金盛证券投资基金 2006 年半年度报告

## 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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于2006年8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、 主要财务指标和基金净值表现 .....	3
四、 基金管理人报告 .....	5
五、 基金托管人报告 .....	6
六、 财务会计报告（未经审计） .....	7
七、 基金投资组合报告 .....	15
八、 基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	19
九、 重大事件揭示 .....	20
十、 备查文件目录 .....	21

## 二、基金简介

### (一) 基金名称：金盛证券投资基金

基金简称：基金金盛

交易代码：184703

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2000年4月26日

报告期末基金份额总额：500,000,000份

基金合同存续期：至2009年11月30日止

基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：2000年6月30日

### (二) 基金产品说明

(1) 投资目标：本基金是以涉及新兴产业的上市公司为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。

(2) 投资策略：根据国家宏观经济环境决定投资的总体策略；根据利率的走势和通货膨胀预期决定本基金的债券投资比例；根据国家的产业政策以及行业发展的状况决定行业投资战略；根据对上市公司的价值分析和其在行业中的竞争优势分析选择所要投资的股票。

本基金在行业资产配置中坚持相对集中的投资策略，挖掘具有良好发展态势的行业，将资产权重的较大部分配置到处于起步或成长阶段的行业。

(3) 业绩比较基准：无。

(4) 风险收益特征：承担较高风险，获取较高的超额收益。

### (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

邮政编码：200122

办公地址：上海市延安东路700号港泰广场22-23楼

邮政编码：200001

法定代表人：陈勇胜

信息披露负责人：丁昌海

联系电话：021-23060282

传真：021-23060283

电子邮箱：[xi nxi pi lu@gtfund.com](mailto:xi nxi pi lu@gtfund.com)

#### (四) 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司  
 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号  
 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 (100032-33)  
 邮政编码：100032  
 法定代表人：郭树清  
 信息披露负责人：尹东  
 联系电话：010-67595104  
 传真：010-66275830  
 电子邮箱：[yi ndong@ccb. cn](mailto:yi ndong@ccb. cn)

#### (五) 信息披露情况

信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》  
 登载半年度报告正文的管理人网址：<http://www.gtfund.com>  
 半年度报告置备地点：上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼  
 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼  
 (100032-33)

#### (六) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司  
 办公地址：广东省深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

### 三、 主要财务指标和基金净值表现

#### (一) 各主要财务指标

	2006年1-6月
基金本期净收益	127,396,034.78元
基金份额本期净收益	0.2548元
期末可供分配基金收益	107,304,999.74元
期末可供分配基金份额收益	0.2146元
期末基金资产净值	838,580,326.39元
期末基金份额净值	1.6772元
基金加权平均净值收益率	19.53%
本期基金份额净值增长率	59.66%
基金份额累计净值增长率	83.74%

注：所述基金业绩指标不包括持有人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。

(二) 基金金盛净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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	-	-
过去一个月	9.69%	3.60%	-	-	-	-
过去三个月	37.45%	3.39%	-	-	-	-
过去六个月	59.66%	2.63%	-	-	-	-
过去一年	72.37%	2.20%	-	-	-	-
过去三年	94.65%	2.24%	-	-	-	-
自基金成立起至今	83.74%	2.14%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

(三) 基金金盛累计净值增长率历史走势图



## 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全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京设有分公司。

截至2006年6月30日，本基金管理人共管理4只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛、基金金鼎，以及6只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰金象保本增值混合证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金。另外，本基金管理人于2004年获得社保基金委托资产管理人资格，目前受托管理社保基金投资组合。

#### 2、基金经理介绍

王雄辉，男，经济学硕士，9年证券从业经历。曾任南开大学教师，国泰基金管理有限公司研究开发部行业研究员，金泰基金基金经理助理，金泰基金基金经理，投资决策委员会秘书，理财部投资经理，现任金盛基金的基金经理。

### （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》及其他相关法律法规的规定，以及基金合同和招募说明书的约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度谋求基金份额持有人合法权益的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为基金份额持有人谋求最大利益。

报告期内本基金整体运作合法、合规，未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，没有发生违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易、操纵市场、不当关联交易、以及其他任何有损于基金投资人利益的行为。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，有效保障了基金份额持有人的合法权益。

### （三）2006上半年证券市场与投资管理回顾

2006年上半年A股市场的运行让我们似乎听到了牛市的脚步。在经历了两年的曲折后，上证指数重又回到2004年上半年1700点附近的水平，2004年和2006年的两波上涨显示了市场与2001年以来的熊市做抗争的力量，即：2004年上半年的行情是中国新一轮经济周期的启动，2006年上半年的行情在延续经过调整的经济周期之外，又多了股权分置改革这一制度变革的基础。

具体来说，一季度A股市场延续去年底的涨势一举升至1300点附近并蓄势盘整，股改持续推进带来的赚钱效应、人民币持续升值带来的地产等行业的资产升

值、国际经济和宽松货币环境下的商品价格上涨是支撑市场强势的三个最主要因素；二季度市场普涨特征明显，市场热点层出不穷，融资功能恢复和股改后首批解禁股份上市不仅没有拖累市场，反而成为新的投资机会，投资者信心恢复后的牛市思维引领指数直冲1700点，即便受海外市场大幅调整的冲击仍强势不改。

在具体投资运作上，本基金基本上坚持了2004年以来的投资理念和操作原则，坚持价值投资，在价值判断原则基础上注重企业的持续盈利能力，以及保证这种能力的发展战略、治理结构、管理水平、行业特性、政策环境等因素。就一季度来说，本基金股票组合主体基本契合了市场方向，在一些长期持有的优势企业之外，比较突出的是对于有色金属股的把握；二季度，因为考虑到国际商品价格的高波动性，对有色金属股做了减持，并大幅增持了行业前景明朗、业绩增长强劲的机械装备行业，同时保持了估值虽高但增长潜力仍在的食品零售行业的龙头企业。

在牛市行情里，要想保持基金业绩的持续增长并战胜大盘，对于个股的把握和集中度是一个重要的因素。另外，一些综合竞争力平平但发展前景大大改善、价值处于低估状态的企业也往往会有出众的市场表现。本基金上半年在这些原则的把握方面有所改善，但需要继续加强。

#### （四）2006年下半年证券市场及投资管理展望

因为制度的变化和对于中国经济发展前景的乐观看法，我们对下半年及以后的行情持相对乐观的态度。尽管三季度在创下年内新高后有调整压力，但是任何的等待都会有回报。在组合构建上，本基金的总体理念和原则不会有什么变化。与以前不同的一个思路是，在全流通环境下选择个股时，我们会更加注重公司重构带来的价值提升机会，这将会大大开拓我们的选股视野和投资机会，同时也让我们面临一个更大的挑战。我们要做的，就是更加努力，为基金持有人带来长期稳定的回报。

## 五、基金托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《金盛证券投资基金基金合同》和《金盛证券投资基金托管协议》，托管金盛证券投资基金（以下简称金盛基金）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在金盛基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人 - 国泰基金管理有限公司在金盛基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

由金盛基金管理人 - 国泰基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## 六、财务会计报告（未经审计）

### （一）基金会计报表

#### 1、资产负债表

资产负债表  
2006年6月30日

单位：元

	附注	2006年6月30日	2005年12月31日
<b>资 产</b>			
银行存款		21,519,741.12	28,919,257.70
清算备付金		1,893,034.38	356,735.62
交易保证金		428,420.38	390,741.00
应收证券清算款		2,898,369.07	2,477,363.56
应收股利		121,500.00	-
应收利息	4(1)	2,448,668.91	1,020,869.91
股票投资市值	4(2)	640,479,113.09	383,859,550.52
其中：股票投资成本		409,065,032.37	338,902,523.14
债券投资市值	4(2)	171,497,123.73	114,274,264.33
其中：债券投资成本		171,635,877.80	113,908,085.04
权证投资市值		-	-
其中：权证投资成本		-	-
资产总计		841,285,970.68	531,298,782.64
<b>负债及持有人权益</b>			
<b>负债：</b>			
应付证券清算款		-	3,982,919.25
应付管理人报酬		989,295.51	643,864.94
应付托管费		164,882.58	107,310.83
应付佣金	4(3)	510,307.46	140,210.33
应付收益		283,104.68	283,104.68
其他应付款	4(4)	549,780.98	549,200.98
预提费用	4(5)	208,273.08	360,000.00
负债合计		2,705,644.29	6,066,611.01
<b>持有人权益：</b>			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		231,275,326.65	45,323,206.67
未分配收益		107,304,999.74	-20,091,035.04
持有人权益合计		838,580,326.39	525,232,171.63
负债及持有人权益总计		841,285,970.68	531,298,782.64

## 2、经营业绩表

经营业绩表  
2006年1-6月

单位：元

项目	附注	2006年1-6月	2005年1-6月
一、收入		133,389,341.51	-23,679,437.26
1、股票差价收入	4(6)	119,410,780.09	-29,624,184.55
2、债券差价收入	4(7)	-44,405.64	-4,007.70
3、权证差价收入		6,543,601.70	-
4、债券利息收入		1,889,973.83	1,603,637.05
5、存款利息收入		108,087.61	109,211.43
6、股利收入		5,469,903.92	4,225,222.43
7、买入返售证券收入		11,400.00	-
8、其他收入	4(8)	-	10,684.08
二、费用		5,993,306.73	4,602,503.06
1、基金管理人报酬		4,832,450.40	3,738,763.39
2、基金托管费		805,408.40	623,127.18
3、卖出回购证券支出		132,038.93	16,345.20
4、其他费用	4(9)	223,409.00	224,267.29
其中：上市年费		29,752.78	29,752.78
信息披露费		148,767.52	148,767.52
审计费用		29,752.78	29,752.78
三、基金净收益		127,396,034.78	-28,281,940.32
加：未实现利得		185,952,119.98	5,866,851.63
四、基金经营业绩		313,348,154.76	-22,415,088.69

## 3、基金收益分配表

基金收益分配表  
2006年1-6月

单位：元

项目	2006年1-6月	2005年1-6月
本期基金净收益	127,396,034.78	-28,281,940.32
加：期初基金净收益	-20,091,035.04	948,066.00
加：本期损益平准金	-	-
可供分配基金净收益	107,304,999.74	-27,333,874.32
减：本期已分配基金净收益	-	899,992.32
期末基金净收益	107,304,999.74	-28,233,866.64

#### 4、基金净值变动表

基金净值变动表  
2006年1-6月

单位：元

项 目	2006年1-6月	2005年1-6月
一、期初基金净值	525,232,171.63	509,828,831.06
二、本期经营活动:		
基金净收益	127,396,034.78	-28,281,940.32
未实现利得	185,952,119.98	5,866,851.63
经营活动产生的基金净值变动数	313,348,154.76	-22,415,088.69
三、本期基金单位交易:		
基金申购款	-	-
基金赎回款	-	-
基金单位交易产生的基金净值变动数	-	-
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	-	-899,992.32
五、期末基金净值	838,580,326.39	486,513,750.05

### (二) 基金会计报表附注

#### 1、基金简介

金盛证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原广州珠江投资基金管理有限公司管理的珠江投资基金按照有关法律、法规清理规范而成。本基金管理人根据基金持有人大会授权,向中国证监会提出上市、扩募、续期申请,该申请已获批准。基金上市申请经《关于广东省原有投资基金清理规范总体方案的批复》(证监基金字[1999]41号文)、《关于同意珠江投资基金规范为珠江证券投资基金并申请上市的批复》(证监基金字[2000]39号文)和深圳证券交易所证上[2000]79号文审核同意,于2000年6月30日在深圳证券交易所挂牌交易。

经中国证券监督管理委员会(证监基金字[2000]40号文)批准,本基金于2000年9月8日基金单位总份额由233,640,000份扩募至500,000,000份,存续期延长至2009年11月30日。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。

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同的规定,本基金的投资对象为国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的金融工具。

#### 2、主要会计政策、会计估计及其变更

本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

### 3、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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
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	基金发起人、基金管理人的股东
上海爱建信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	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

注：经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司，2006年1月13日本基金管理人及时进行了公告，相关工商变更手续尚在办理之中。

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)

	2006年1-6月				2005年1-6月			
	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	280,630,870.20	24.37%	26,200,022.30	37.50%	69,733,473.02	13.86%	-	-

	2006年1-6月				2005年1-6月			
	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	60,000,000.00	37.50%	226,548.00	24.43%	5,000,000.00	20.00%	56,795.07	13.95%

注：根据本基金管理人与关联方签订的席位租赁协议，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赁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)

	2006年1-6月			2005年1-6月		
	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
建设银行	-	-	-	-	20,020,000.00	7,026.20

#### (4) 基金管理人报酬

基金管理费按前一日基金资产净值的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人报酬

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；并于次月前两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4,832,450.40元，其中已支付基金管理人3,843,154.89元，尚余989,295.51元未支付。2005年1-6月共计提管理费3,738,763.39元，已全部支付。

(5) 基金托管人报酬

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人报酬

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；并于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共805,408.40元，其中已支付基金托管人640,525.82元，尚余164,882.58元未支付。2005年1-6月共计提托管费623,127.18元，已全部支付。

(6) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于2006年6月30日保管的银行存款余额为21,519,741.12元(2005年6月30日：25,971,635.16元)。2006年1-6月由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为98,643.98元(2005年1-6月：102,905.13元)。

(7) 各关联方投资本基金情况

本基金管理人本报告期末及2006年6月30日持有本基金的情况：

	2006年6月30日		2005年6月30日	
	基金份额	占总份额比例	基金份额	占总份额比例
国泰基金管理有限公司	2,307,692份	0.46%	2,307,692份	0.46%

注：截止本报告期末，本基金管理人持有的基金份额系本基金扩募时本基金管理人作为基金发起人认购的份额。报告期内所持有的基金份额无变动。

本基金管理人主要股东及其控制的机构在本报告期末及2005年6月30日持有本基金情况：

	2006年6月30日		2005年6月30日	
	持有基金份额	占总份额比例	持有基金份额	占总份额比例
国泰君安证券股份有限公司	2,692,308份	0.54%	2,692,308份	0.54%

#### 4、重要会计报表项目说明（单位：元）

##### (1) 应收利息：

	2006年6月30日
应收银行存款利息	21,903.78
应收清算备付金利息	851.80
应收债券利息	2,425,850.03
应收权证保证金利息	63.30
合计	<u>2,448,668.91</u>

##### (2) 投资估值增值按投资类别分别列示如下：

	2006年6月30日
股票投资	231,414,080.72
债券投资	-138,754.07
合计	<u>231,275,326.65</u>

##### (3) 应付佣金：

	2006年6月30日
国泰君安证券股份有限公司	150,519.56
申银万国证券股份有限公司	126,111.84
兴业证券股份有限公司	121,776.50
海通证券股份有限公司	65,406.11
渤海证券有限责任公司	46,493.45
合计	<u>510,307.46</u>

##### (4) 其他应付款：

	2006年6月30日
应付券商佣金保证金	250,000.00
应付债券利息的税金	35,540.40
应付股利收入的税金	251,490.08
其他	12,750.50
合计	<u>549,780.98</u>

##### (5) 预提费用：

	2006年6月30日
预提审计费用	29,752.78
预提信息披露费	148,767.52
预提上市年费	29,752.78
合计	<u>208,273.08</u>

(6) 股票差价收入：

	2006年1-6月
卖出股票成交总额	605,508,525.42
减：卖出股票成本总额	485,589,524.04
应付佣金总额	508,221.29
股票差价收入	<u>119,410,780.09</u>

注：本基金于2006年1-6月获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计3,453,914.34元，已全额冲减股票投资成本。

(7) 债券差价收入：

	2006年1-6月
卖出债券成交总额	10,767,883.55
减：卖出债券成本总额	10,213,410.74
应收利息总额	598,878.45
债券差价收入	<u>-44,405.64</u>

(8) 其他收入：

本报告期无其他收入。

(9) 其他费用：

	2006年1-6月
信息披露费	148,767.52
审计费用	29,752.78
上市年费	29,752.78
债券账户服务费	9,400.00
银行费用	4,493.42
回购交易费用	1,062.50
银行间交易手续费	180.00
合计	<u>223,409.00</u>

## 5、流通转让受限制的基金资产

### (1) 流通转让受限制的股票

截至2006年6月30日止基金持有的流通转让受限制的股票资产明细如下：

#### A、因股权分置改革协商阶段或实施阶段而停牌：

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价(元)	复牌日期	复牌开盘单价(元)	数量(股)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
方案沟通协商阶段停牌：								
000042	深长城 A	06/06/19	10.55	06/07/06	11.40	798,838	8,168,563.16	8,427,740.90
600383	金地集团	06/03/27	8.70	06/07/11	9.43	600,000	4,314,426.51	5,220,000.00
合计							12,482,989.67	13,647,740.90
方案实施阶段停牌：								
000157	G 中联	06/05/29	13.84	06/07/14	10.88	400,000	4,926,345.85	5,536,000.00
000753	G 漳发展	06/06/29	4.25	06/07/14	3.09	2,600,000	6,864,474.47	11,050,000.00
000895	双汇发展	06/06/01	31.02	-	-	2,291,540	29,947,431.98	71,083,570.80
600299	G 新材料	06/03/23	17.13	06/08/03	18.45	200,000	3,037,691.81	3,426,000.00
600970	G 中材	06/06/15	27.15	06/07/06	23.80	800,000	12,549,065.56	21,720,000.00
合计							57,325,009.67	112,815,570.80

#### B、因新股配售或增发流通受限：

序	名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	备注
1	中国银行	06/06/28	06/07/05	969,000	2,984,520.00	2,984,520.00	网上申购
2	中国银行	06/06/28	06/10/09(50%) 07/01/05(50%)	188,628	580,974.24	580,974.24	网下申购
3	中工国际	06/06/02	06/09/19	77,582	574,106.80	1,366,994.84	网下申购
4	G综超	06/05/17	07/05/17	650,000	8,398,000.00	11,791,000.00	定向增发
	合计				12,537,601.04	16,723,489.08	

### 估值方法

上述A类股票已上市，但本基金持有的部分因股权分置改革协商阶段或实施阶段而停牌。在编制本报表时，根据有关规定，在2006年6月30日按“停牌前估价”进行估值。

上述B类股票中，“中国银行”为网上、网下中签未上市新股，在编制本报表时，根据有关规定，在2006年6月30日按成本价估值。“中工国际”、“G综超”为网下申购和增发新股，2只股票均已上市，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2006年6月30日按市场均价进行估值。

### 流通受限原因

上述A类股票截至2006年6月30日因股权分置改革而暂时停牌，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

上述B类股票为基金网上申购、网下申购及增发中签的新股。“中国银行”网上申购部分已于2006年7月5日上市。“中国银行”网下申购部分中

50%的受限期限为三个月，另外50%的受限期限为六个月。“中工国际”的受限期限为三个月，“G 综超”的受限期限为一年。

(2) 流通转让受限制的债券

本基金本报告末无流通转让受限制的债券。

## 七、基金投资组合报告

### (一) 基金资产组合情况

分 类	市值(元)	占总资产比例
股票	640,479,113.09	76.13%
债券	171,497,123.73	20.39%
权证	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金	23,412,775.50	2.78%
应收证券清算款	2,898,369.07	0.34%
其他资产	2,998,589.29	0.36%
合 计	841,285,970.68	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	18,140,000.00	2.16%
2	采掘业	24,733,625.00	2.95%
3	制造业	286,942,373.48	34.22%
	其中：食品、饮料	95,277,970.80	11.36%
	石油、化学、塑胶、塑料	25,652,480.00	3.06%
	金属、非金属	40,786,500.00	4.86%
	机械、设备、仪表	90,710,422.68	10.82%
	医药、生物制品	34,515,000.00	4.12%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
5	建筑业	21,720,000.00	2.59%
6	交通运输、仓储业	48,109,012.75	5.74%
7	信息技术业	65,902,341.96	7.86%
8	批发和零售贸易	71,955,000.00	8.58%
9	金融、保险业	63,335,396.00	7.55%
10	房地产业	31,555,869.06	3.76%
11	社会服务业	1,366,994.84	0.16%
12	传播与文化产业	6,718,500.00	0.80%
13	综合类	-	-
	合 计	640,479,113.09	76.38%

(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	000895	双汇发展	2,291,540	71,083,570.80	8.48%
2	600031	G三一	4,130,000	57,902,600.00	6.90%
3	600036	G招行	5,401,276	41,913,901.76	5.00%
4	600406	国电南瑞	1,462,900	39,922,541.00	4.76%
5	000538	G云白药	1,180,000	34,515,000.00	4.12%
6	000039	G中集	1,850,000	29,914,500.00	3.57%
7	600694	大商股份	700,000	28,567,000.00	3.41%
8	600519	G茅台	510,000	24,194,400.00	2.89%
9	000792	G钾肥	1,108,000	22,226,480.00	2.65%
10	600970	G中材	800,000	21,720,000.00	2.59%
11	600825	华联超市	1,700,000	18,972,000.00	2.26%
12	600386	G北巴	3,500,000	18,725,000.00	2.23%
13	600361	G综超	1,000,000	18,140,000.00	2.16%
14	600438	G通威	2,000,000	18,140,000.00	2.16%
15	600000	G浦发	1,800,000	17,856,000.00	2.13%
16	000682	东方电子	4,999,936	15,549,800.96	1.85%
17	000024	G招商局	1,309,708	13,778,128.16	1.64%
18	600592	G龙溪	1,051,299	12,783,795.84	1.52%
19	600018	G上港	700,000	11,935,000.00	1.42%
20	600497	G驰宏	317,500	11,096,625.00	1.32%
21	000753	G漳发展	2,600,000	11,050,000.00	1.32%
22	000060	G中金	800,000	10,872,000.00	1.30%
23	600028	中国石化	1,700,000	10,693,000.00	1.28%
24	600302	G标准	2,229,961	9,901,026.84	1.18%
25	000042	深长城A	798,838	8,427,740.90	1.01%
26	600037	G歌华	450,000	6,718,500.00	0.80%
27	600270	外运发展	595,257	6,399,012.75	0.76%
28	000063	G中兴	200,000	5,740,000.00	0.68%
29	000157	G中联	400,000	5,536,000.00	0.66%
30	600383	G金地	600,000	5,220,000.00	0.62%
31	600764	G中广通	700,000	4,690,000.00	0.56%
32	600066	G宇通	550,000	4,587,000.00	0.55%
33	000402	G金融街	500,000	4,130,000.00	0.49%
34	601988	中国银行	1,157,628	3,565,494.24	0.43%
35	600628	G新世界	400,000	3,516,000.00	0.42%
36	600299	G新材料	200,000	3,426,000.00	0.41%
37	600547	G鲁黄金	100,000	2,944,000.00	0.35%
38	600084	G新天	600,000	2,760,000.00	0.33%
39	002051	中工国际	77,582	1,366,994.84	0.16%

(四) 股票投资组合的重大变动

1、 累计买入价值占期初基金资产净值前二十名的股票明细

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	600031	G三一	34,647,316.39	6.60%
2	000060	G中金	29,964,548.17	5.71%
3	000039	G中集	26,781,425.15	5.10%
4	600825	华联超市	19,624,592.27	3.74%
5	600000	G浦发	18,908,570.84	3.60%
6	000024	G招商局	16,578,717.39	3.16%
7	000682	东方电子	16,308,591.48	3.11%
8	600438	G通威	16,269,366.41	3.10%
9	000792	G钾肥	15,374,835.91	2.93%
10	600592	G龙溪	15,202,521.15	2.89%
11	600361	G综超	14,613,924.29	2.78%
12	600019	G宝钢	14,398,609.60	2.74%
13	600050	G联通	12,507,460.64	2.38%
14	000951	G重汽	11,870,465.54	2.26%
15	600386	G北巴	11,544,164.96	2.20%
16	600033	G闽高速	10,546,951.98	2.01%
17	600018	G上港	9,977,368.97	1.90%
18	600764	G中广通	9,950,520.54	1.89%
19	600406	国电南瑞	9,575,108.21	1.82%
20	600302	G标准	9,321,830.83	1.77%

2、 累计卖出价值占期初基金资产净值前二十名的股票明细

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	000060	G中金	54,388,758.29	10.36%
2	600050	G联通	25,369,624.65	4.83%
3	600019	G宝钢	23,777,171.60	4.53%
4	000063	G中兴	23,089,496.39	4.40%
5	600009	G沪机场	22,865,953.73	4.35%
6	000839	G国安	22,104,029.38	4.21%
7	600328	G兰太	21,323,496.24	4.06%
8	600900	G长电	19,215,424.10	3.66%
9	600085	G同仁堂	19,163,379.58	3.65%
10	600628	G新世界	19,120,515.28	3.64%
11	600037	G歌华	18,975,293.81	3.61%
12	000951	G重汽	13,178,336.48	2.51%
13	600033	G闽高速	12,345,496.43	2.35%
14	600519	G茅台	12,160,172.12	2.32%
15	600761	G合力	12,143,077.12	2.31%

16	600533	G 栖霞	10,933,351.18	2.08%
17	600588	G 用友	10,694,947.17	2.04%
18	000869	G 张裕	10,453,559.87	1.99%
19	600547	G 鲁黄金	9,984,961.69	1.90%
20	600970	G 中材	9,905,597.47	1.89%

- 3、报告期内买入股票的成本总额：559,205,947.61元  
 报告期内卖出股票的收入总额：605,508,525.42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	151,201,123.73	18.03%
2	金融债券	20,296,000.00	2.42%
	合计	171,497,123.73	20.45%

(六) 按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	02国债(14)	54,321,810.00	6.48%
2	银行间00国债12	41,453,333.33	4.94%
3	05农发04	20,296,000.00	2.42%
4	20国债(10)	15,929,139.20	1.90%
5	20国债(4)	10,814,590.00	1.29%

(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	428,420.38
应收股利	121,500.00
应收利息	2,448,668.91
合 计	2,998,589.29

- 4、报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

5、本报告期内投资权证明细如下：

(1)本报告期内本基金未持有权证。

(2)报告期内获得的权证明细

权证代码	权证名称	获得日期	获得数量(份)	成本(元)	投资类别
580997	招行CMP1	2006/2/27	2,286,990	0.00	被动持有
580996	沪场JTP1	2006/3/2	525,000	0.00	被动持有
580990	茅台JCP1	2006/5/25	1,120,000	0.00	被动持有
038008	钾肥JTP1	2006/6/29	360,000	0.00	被动持有
合计			4,291,990	0.00	

6、本报告期内,未投资资产支持证券。

### (八) 本基金管理人运用固有资金投资本基金情况

截止本报告期末,本基金管理人运用固有资金投资本基金的基金份额为2,307,692份,系基金募集时作为发起人认购的份额,报告期内所持有的基金份额无变动。

## 八、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### (一) 持有人户数

基金份额持有人户数：9,247户

平均每户持有人基金份额：54,071.59份

### (二) 持有人结构

	持有的基金份额(份)	占总份额比例
机构投资者	341,834,482	68.37%
个人投资者	155,843,859	31.17%
未确认份额	2,321,659	0.46%
合计	500,000,000	100.00%

### (三) 前十名持有人

序号	持有人姓名	期末持有数(份)	持有比例
1	新华人寿	49,125,684	9.83%
2	人寿股份	48,111,109	9.62%
3	人寿集团	48,074,272	9.61%
4	中国太保	27,035,961	5.41%
5	泰康人寿	15,811,853	3.16%
6	信诚人寿	15,780,735	3.16%
7	社保基金一零九组合	14,301,365	2.86%
8	平安保险	13,534,618	2.71%
9	宝钢集团	11,800,000	2.36%
10	中国再保险	10,733,260	2.15%

## 九、重大事件揭示

- 1、2006年1月13日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》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》，经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司。
- 2、2006年6月14日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券投资方案的公告》，就本基金投资资产支持证券的方案等事项进行了公告。
- 3、2006年6月30日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司获配中国银行股份有限公司首次公开发行A股的公告》，就本基金通过网下发行和网上资金申购中国银行股份有限公司的获配数量进行了披露。

4、报告期内，基金租用证券公司专用席位的有关情况如下： 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
渤海证券有限责任公司	1	74,774,610.80	6.49%	3,577,611.00	5.12%
国泰君安证券股份有限公司	2	280,630,870.20	24.37%	26,200,022.30	37.50%
海通证券股份有限公司	2	242,391,573.55	21.05%	3,020,100.00	4.32%
申银万国证券股份有限公司	2	278,391,932.55	24.17%	26,690,571.04	38.20%
兴业证券股份有限公司	2	275,510,032.87	23.92%	10,377,045.31	14.85%
合计	9	1,151,699,019.97	100.00%	69,865,349.65	100.00%

券商名称	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
渤海证券有限责任公司	-	-	61,278.36	6.61%
国泰君安证券股份有限公司	60,000,000.00	37.50%	226,548.00	24.43%
海通证券股份有限公司	-	-	194,006.90	20.92%
申银万国证券股份有限公司	100,000,000.00	62.50%	227,006.94	24.48%
兴业证券股份有限公司	-	-	218,573.29	23.57%
合计	160,000,000.00	100.00%	927,413.49	100.00%

注：在本报告期内，基金无新增租用专用交易席位。

- 5、本基金在本报告期内无收益分配事项。
- 6、报告期内，未召开基金份额持有人大会；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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动；基金投资策略无改变；为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况；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、备查文件目录

- 1、关于同意设立金盛证券投资基金的批复
- 2、金盛证券投资基金合同
- 3、金盛证券投资基金托管协议
- 4、金盛证券投资基金各年度半年度报告、年度报告及收益分配公告
- 5、报告期内披露的各项公告
- 6、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——上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司基金托管部  
办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼  
( 100032-33 )

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 ) 33134688 , 400-8888-688

客户投诉电话：( 021 ) 23060279

公司网址：<http://www.gtfund.com>

**国泰基金管理有限公司**

**2006 年 8 月 29 日**