

金盛证券投资基金季度报告

2004年第3季度

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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2004年10月22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。

二、基金产品概况

1、基金简介

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

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行

2、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) 风险收益特征:承担较高风险,获取较高的超额收益。

三、主要财务指标和基金净值表现(未经审计)

1、各主要财务指标

	2004年7-9月
基金本期净收益	-6,180,477.96元
基金份额本期净收益	-0.0124元
期末基金资产净值	583,992,098.07元
期末基金份额净值	1.1680元

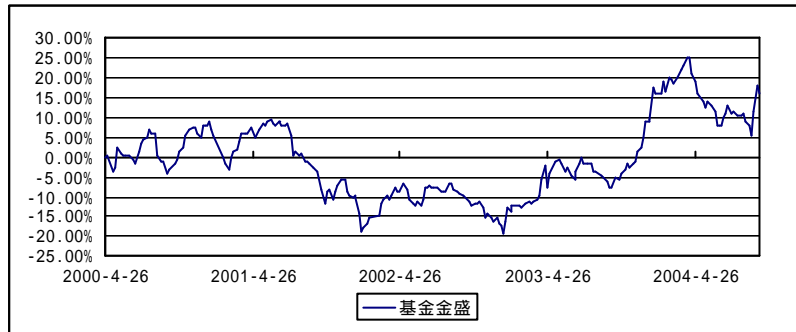
注:所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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	-	-
过去三个月	7.51%	2.58%	-	-	-	-

注:本基金根据基金合同无业绩比较基准。

3、基金金盛累计净值增长率历史走势图



四、基金管理人报告

1、基金管理合法合规性声明

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》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、最大限度保护基金份额持有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基金份额持有人谋求最大利益。

报告期内本基金未发生有损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，本基金与其他基金资产、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，并通过规范运作、精心管理、科学决策和健全内控体系，有效保障了基金份额持有人的合法权益。

2、基金经理介绍

王雄辉，基金经理，男，经济学硕士，6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。

3、市场与投资管理回顾

三季度A股市场总体上呈平盘走势，具体表现为前两个半月在二季度因宏观调控大幅下跌的基础上继续缩量阴跌，市场气氛回到对系统性风险的担忧上；而后半个月则在政策因素解除了系统性风险的担忧后，市场连续大幅上涨，又回升至季度初的水平。这期间本基金净值从6月末的1.0864元上升至9月末的1.1680元，表现好于大盘，但与同业相比表现一般。

三季度本基金操作力度不大，值得一提的有两点：一是坚定半年报的看法，清醒对待前两个半月市场表现出来的悲观气氛，坚守股票仓位；二仍然是坚定半年报的看法，在选股策略上淡化行业，选治理结构好、有长期竞争力的股票，相对集中持有，将价值投资进行到底。在这个过程中，增持的股票主要有招商银行、晨鸣纸业等，同时股票集中度有所提高。

宏观经济的走势和“国九条”的落实情况是考察四季度市场走势的两个重要因素。本基金认为四季度市场可能会延续震荡格局。本基金的投资策略不会有变化，仍将相对集中持有治理结构好、有长期竞争力的股票，适当注意波段操作。

五、基金投资组合报告

1、基金资产组合情况

分 类	市值(元)	占总资产比例
股票	413,976,718.62	65.40%
债券	131,689,363.33	20.81%
银行存款	60,790,318.46	9.60%
其他资产	26,490,833.24	4.19%
合 计	632,947,233.65	100.00%

2、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	30,939,000.00	5.30%
3	制造业	230,112,816.93	39.40%
	其中：食品、饮料	20,028,315.60	3.43%
	纺织、服装、皮毛	24,237,826.20	4.15%
	造纸、印刷	19,126,938.80	3.28%
	石油、化学、塑胶、塑料	9,270,000.00	1.59%
	电子	13,224,800.00	2.26%
	金属、非金属	61,203,138.65	10.48%
	机械、设备、仪表	46,823,307.00	8.02%
	医药、生物制品	36,198,490.68	6.20%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	26,314,000.00	4.51%
5	建筑业		
6	交通运输、仓储业	50,191,392.09	8.59%
7	信息技术业	23,442,600.00	4.01%
8	批发和零售贸易		
9	金融、保险业	25,815,909.60	4.42%
10	房地产业	25,298,000.00	4.33%
11	社会服务业		
12	传播与文化产业	1,863,000.00	0.32%
13	综合类		
	合 计	413,976,718.62	70.89%

3、占基金资产净值前十名的股票

序号	股票代码	股票名称	数量	市值(元)	占净值比例
1	000039	中集集团	1,300,000	29,458,000.00	5.04%
2	600036	招商银行	2,758,110	25,815,909.60	4.42%
3	600028	中国石化	5,100,000	23,919,000.00	4.10%
4	000063	中兴通讯	890,000	23,442,600.00	4.01%
5	600900	长江电力	2,600,000	22,698,000.00	3.89%
6	600085	同仁堂	975,000	20,055,750.00	3.43%
7	000895	双汇发展	1,710,360	20,028,315.60	3.43%
8	600009	上海机场	1,373,529	19,380,494.19	3.32%
9	600018	上港集箱	1,288,400	19,171,392.00	3.28%
10	000488	晨鸣纸业	1,819,880	19,126,938.80	3.28%

4、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	126,400,135.33	21.64%
2	可转换债券	5,289,228.00	0.91%
	合计	131,689,363.33	22.55%

5、基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	银行间00国债07	50,000,000.00	8.56%
2	银行间00国债12	41,453,333.33	7.10%
3	02国债(14)	13,551,510.00	2.32%
4	20国债(4)	7,853,192.00	1.34%
5	99国债(5)	4,926,500.00	0.84%

6、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)
买入返售证券	25,000,000.00
应收利息	1,475,750.94
待摊费用	15,082.30
合计	26,490,833.24

- (4)报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

六、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中期报告、年度报告及收益分配报告
- 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

2004 年 10 月 26 日