

# 金盛证券投资基金季度报告

## 2007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股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10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。

### 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：中国建设银行股份有限公司

#### 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、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

	2007年7-9月
1、本期利润	595,436,513.18元
2、本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	395,648,903.70元
3、基金份额本期利润	1.1909元
4、期末基金资产净值	2,165,256,627.84元
5、期末基金份额净值	4.3305元

注：（1）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。

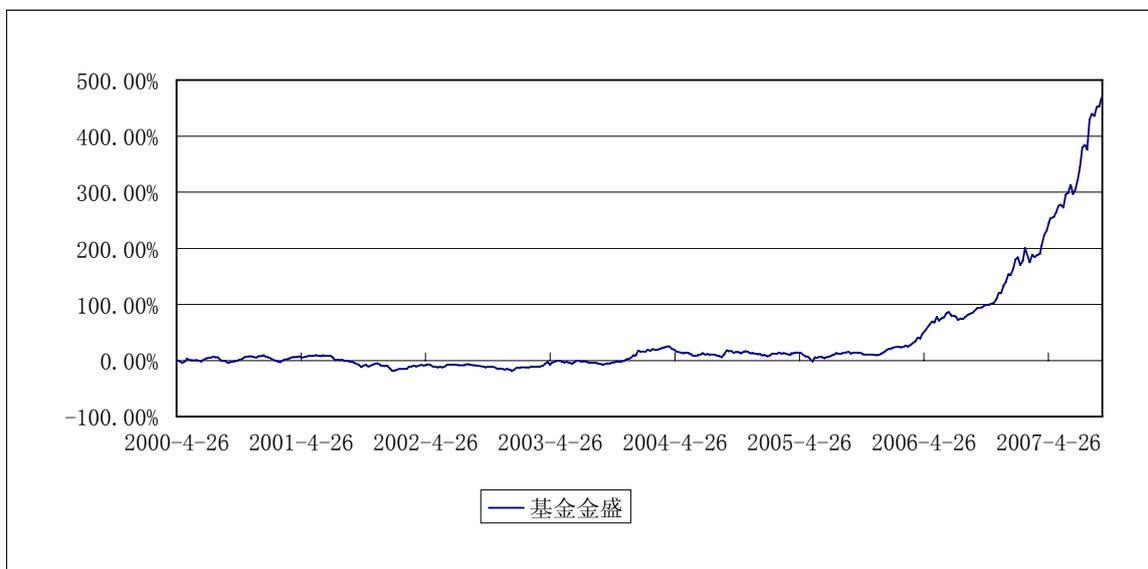
（2）2007年7月1日基金实施新会计准则后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，原“基金份额本期净收益”=第2项/（第1项/第3项）。

#### 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	37.93%	3.86%	-	-	-	-

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。报告期内本基金在个别交易日因净值波动等原因导致个别投资比例不达标，经基金托管人提示后，已及时调整达标。

### 2、基金经理介绍

周传根，男，CFA，货币银行学硕士，7年证券投资从业经历。曾任职于国家外汇管理局、法国兴业证券上海代表处，2003年1月加盟国泰基金管理有限公司，任研究开发部总监，2007年3月起兼任基金金盛的基金经理。

### 3、本基金的投资策略和业绩表现说明

#### （1）2007年第三季度证券市场与投资回顾

第三季度的市场走出了近乎单边上扬的行情，但与前两季度普涨行情不同的是，本轮行情主要是基金重仓股的上涨，从行业分析，钢铁、有色、煤炭等周期类股票受资源价格上升、人民币升值等因素影响表现强劲，涨幅居前，消费类股票由于前期累计涨幅过大而表现平平，而受累于原材料价格的上涨以及人民币加速升值，纺织、电子和金属制品行业表现居后。

本基金三季度在操作策略上主要增持了有业绩支撑的绩优股票，减持了概念性和缺乏业绩支撑的股票，同时，较大幅度增加了行业以及个股的集中度。在行业上，大比例增持了钢铁行业，并部分增持了交通运输、食品、造纸行业，在金融和地产大幅度上涨后部分进行了减持。总体而言，三季度相对集中的策略取得了一定的超额收益，业绩比二季度有了明显提升。今后将继续努力，为基金持有人获取更好回报。

#### （2）2007年第四季度证券市场及投资管理展望

我们对四季度A股市场的走势相对谨慎，第一，经过第三季度的大幅上涨，市场面临较大的估值压力。第二，宏观紧缩政策的效果可能逐步显现，但在人民币升值加速和流动性依然十分充裕的背景下，市场调整的幅度不会很大，而且市场的泡沫程度有可能超出预期。

在投资操作上将采取“相对平衡”，即防御中带有进取的投资策略。注重“防御”就是从低估值和低涨幅这两个角度去选择安全边际高的行业。而“进取”主要选择高增长公司来抵消高估值的压力，这种高增长包括内生性增长，也包括我们更为关注的外生性增长，就近期而言应该关注三季度业绩能够实现超预期增长的行业或公司。

## 五、基金投资组合报告（未经审计）

### 1、报告期末基金资产组合情况

分 类	市 值(元)	占总资产比例
股票	1,700,463,627.90	75.08%
债券	443,460,011.10	19.58%
权证	18,638,400.00	0.82%
银行存款及结算备付金	92,984,988.88	4.11%
其他资产	9,449,062.98	0.42%
合 计	2,264,996,090.86	100.00%

### 2、报告期末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	128,403.52	0.01%
2	采掘业	62,820,711.66	2.90%
3	制造业	803,216,498.45	37.10%
	其中：食品、饮料	147,640,313.75	6.82%
	造纸、印刷	27,088,422.50	1.25%
	石油、化学、塑胶、塑料	36,383,885.02	1.68%
	金属、非金属	374,309,034.46	17.29%
	机械、设备、仪表	103,701,771.55	4.79%
	医药、生物制品	114,093,071.17	5.27%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	29,641,749.34	1.37%
5	建筑业	-	-
6	交通运输、仓储业	137,039,093.35	6.33%
7	信息技术业	20,631,684.32	0.95%
8	批发和零售贸易	178,953,503.77	8.26%
9	金融、保险业	311,891,627.41	14.40%
10	房地产业	134,286,775.32	6.20%
11	社会服务业	10,437,993.45	0.48%
12	传播与文化产业	11,415,587.31	0.53%
13	综合类	-	-
	合 计	1,700,463,627.90	78.53%

### 3、报告期末按市值占基金资产净值比例的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数 量(股)	市 值(元)	占净值比例
1	002024	苏宁电器	1,966,722	134,956,463.64	6.23%
2	000898	鞍钢股份	3,205,565	115,400,340.00	5.33%
3	000001	深发展A	2,509,183	100,317,136.34	4.63%
4	600782	新华股份	4,276,708	98,193,215.68	4.53%
5	000895	双汇发展	1,625,289	82,483,416.75	3.81%
6	000002	万科A	2,459,261	74,269,682.20	3.43%

7	600030	中信证券	715,786	69,223,664.06	3.20%
8	601919	中国远洋	1,481,732	66,766,843.92	3.08%
9	000568	泸州老窖	1,040,845	65,156,897.00	3.01%
10	600062	双鹤药业	2,387,136	61,110,681.60	2.82%

#### 4、报告期末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	325,586,011.10	15.04%
2	金融债券	39,652,000.00	1.83%
3	央行票据	78,222,000.00	3.61%
	合计	443,460,011.10	20.48%

#### 5、报告期末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	20国债(4)	128,806,908.00	5.95%
2	02国债(14)	81,070,586.10	3.74%
3	20国债(10)	47,300,477.00	2.18%
4	银行间00国债12	40,048,000.00	1.85%
5	05央行票据15	20,058,000.00	0.93%

#### 6、报告附注

- (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。
- (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)
存出保证金	1,488,439.12
应收利息	7,945,500.23
待摊费用	15,123.63
合 计	9,449,062.98

- (4) 本报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。
- (5) 本报告期末本基金持有主动投资的权证明细如下：

权证代码	权证名称	数 量(份)	成 本(元)
030002	五粮YGC1	400,000	14,752,168.72
合计		400,000	14,752,168.72

- (6) 本报告期内本基金未投资资产支持证券。
- (7) 由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### 六、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14,692,806份。报告期内所持有的基金份额无变动。

## 七、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、金盛证券投资基金半年度报告、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办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

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) 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

2007 年 10 月 24 日