

# 金盛证券投资基金季度报告

## 2006年第4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1月17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

	2006年10-12月
基金本期净收益	71,029,413.34 元
基金份额本期净收益	0.1421 元
期末基金资产净值	1,105,315,032.91 元
期末基金份额净值	2.2106 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	30.92%	2.22%	-	-	-	-

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。

### 2、基金经理介绍

王雄辉，男，经济学硕士，10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。

### 3、本基金的投资策略和业绩表现说明

#### (1) 2006年第四季度证券市场与投资管理回顾

2006年第四季度行情的主要特征是以工商银行、中国银行为代表的大盘蓝筹股上涨并推动指数创出历史新高。本基金自工商银行十月份上市首日买入该股，使得银行股比例占到基金净值的15%左右，同时本季度还增加了证券类上市公司的比重，使其也占到基金净值的一定比例，但总的金融股比例距离市场基准比例仍有差距，这是本基金净值在十一、十二月份未能跑赢大盘的最主要原因。另外，本基金在钢铁股上的低配置也是净值未能跑赢大盘的另一个原因。

在将有越来越多的大盘蓝筹股上市和A股牛市持续的背景下，四季度的行情特征给我们的启示是：要想战胜大盘，把握市场权重股的运行特征是至关重要的前提条件。

#### (2) 2007年第一季度市场及投资管理展望

对于2007年市场的走势，我们仍然抱以乐观的预期。影响中国经济这一轮上升周期的因素并没有消失，而政府的宏观调控也不希望经济出现大的波动，国际经济环境依然良好，2007年中国经济也许会重复这几年经济运行超预期的历史。行业选择上本基金继续看好：扩大内需相关的消费服务类行业，包括金融、食品饮料、旅游和信息传媒行业；“十一五规划”相关的装备制造业；受益人民币升值的房地产行业等。

## 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	865,894,966.67	69.63%
债券	227,516,733.13	18.29%
权证	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金	147,521,570.23	11.86%
其他资产	2,688,009.47	0.22%
合 计	1,243,621,279.50	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	20,874,012.40	1.89%
2	采掘业	1,334,618.56	0.12%
3	制造业	342,287,982.89	30.97%
	其中：食品、饮料	108,837,570.80	9.85%
	造纸、印刷	10,887,406.44	0.99%
	石油、化学、塑胶、塑料	19,128,000.00	1.73%
	金属、非金属	16,680,421.15	1.51%
	机械、设备、仪表	118,888,715.21	10.76%
	医药、生物制品	66,847,500.00	6.05%
	其他制造业	1,018,369.29	0.09%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	22,230,000.00	2.01%
5	建筑业	26,969,251.68	2.44%
6	交通运输、仓储业	83,357,123.40	7.54%
7	信息技术业	74,525,972.32	6.74%
8	批发和零售贸易	39,154,800.00	3.54%
9	金融、保险业	179,249,958.78	16.22%
10	房地产业	75,911,246.64	6.87%
11	社会服务业	-	-
12	传播与文化产业	-	-
13	综合类	-	-
	合 计	865,894,966.67	78.34%

### 3、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	600036	招商银行	6,300,000	102,249,000.00	9.25%
2	600031	三一重工	2,880,000	92,937,600.00	8.41%
3	000895	S 双汇	2,291,540	71,083,570.80	6.43%
4	000024	招商地产	2,090,000	58,457,300.00	5.29%
5	600406	国电南瑞	1,781,800	40,197,408.00	3.64%
6	601398	工商银行	6,620,000	39,918,600.00	3.61%
7	600519	贵州茅台	430,000	37,754,000.00	3.42%
8	000623	吉林敖东	1,110,000	36,907,500.00	3.34%
9	600030	中信证券	1,250,000	34,087,500.00	3.08%
10	601006	大秦铁路	4,180,000	33,816,200.00	3.06%

### 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	207,220,733.13	18.75%
2	金融债券	20,296,000.00	1.84%
	合计	227,516,733.13	20.58%

### 5、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)	63,546,303.00	5.75%
2	02国债(14)	50,370,540.00	4.56%
3	银行间00国债12	41,453,333.33	3.75%
4	20国债(10)	21,034,801.60	1.90%
5	05农发04	20,296,000.00	1.84%

### 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)
交易保证金	390,741.00
应收利息	2,297,268.47
合 计	2,688,009.47

- (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，未投资权证。
- (6) 本报告期内，未投资资产支持证券。
- (7) 由于四舍五入原因，分项之合与合计可能有尾差。

## 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9,227,806份，较上季度末增持了6,920,114份。

## 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、金盛证券投资基金各年度半年度报告、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1月19日