

金盛证券投资基金季度报告

2006 年第 2 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 2006 年 7 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

	2006年4-6月
基金本期净收益	103,743,678.97 元
基金份额本期净收益	0.2075 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

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	37.45%	3.39%	-	-	-	-

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，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。

3、本基金的投资策略和业绩表现说明

（1）2006年第二季度证券市场与投资管理回顾

二季度A股市场普涨特征明显，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。

延续一季度的思路，本基金在二季度的工作主要在两方面：一是在优势企业的投资方面，高位减持了部分有色金属股（源于金属价格的高波动性），基本保持了食品零售等行业的仓位（估值虽高、增长不改），大幅增持了机械装备行业的持仓（业绩增长强劲、行业前景明朗、企业持续发展能力增强）；二是对竞争力不太出众但在全流通环境下发展前景大大改善、价值处于低估状态的企业的研究储备和投资，这些公司行业特性不明显、价值评估不确定性大，目前在组合中比例较低但取得了不错的收益。因为上述策略和投资理念，对二季度如火如荼的滨海新区概念、军工概念、新能源概念等投资主题，本基金基本没有参与。

（2）2006年第三季度市场及投资管理展望

对于下半年的行情本基金基本上持相对乐观的态度，尽管股指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。本基金组合构建的总体思路不会有大的变化，但在个股选择上将会做更多的研究工作，尤其是在优势企业以外的个股选择上。

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	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%

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	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%

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	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%

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	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%

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	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%

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	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：

a、因股权分置改革被动持有

权证代码	权证名称	配售日期	配售数量(份)	成本(元)
580990	茅台JCP1	2006/5/25	1,120,000	0.00
038008	钾肥JTP1	2006/6/29	360,000	0.00
合计			1,480,000	0.00

b、本报告期内无主动投资的权证。

(6) 本报告期内未投资资产支持证券。

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 2,307,692 份，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。

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

2006 年 7 月 21 日