

金盛证券投资基金季度报告

2006 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 2006 年 10 月 23 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7-9月
基金本期净收益	43,313,112.22 元
基金份额本期净收益	0.0866 元
期末基金资产净值	883,254,713.85 元
期末基金份额净值	1.7665 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	5.32%	1.86%	-	-	-	-

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。

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年第三季度证券市场与投资回顾

三季度A股市场的走势特征表现为7月回调整理、8月和9月恢复上涨的态势，在7月初中国银行A股上市后市场经历一个月约10%幅度的下跌，而后用两个月时间重又上升到前期年内高点的位置。这期间，二季度相对较为沉寂的银行、地产股成为了市场上涨的主要推动力量，与之对应的是上半年表现突出的食品饮料板块则出现了下跌。

虽然市场强势特征依然存在，但不同板块在不同阶段的轮动较为明显。本基金在第三季度没能踩上这样精巧的节奏，没能做到二季度重心放在食品饮料行业而三季度转到银行地产行业，但好在本基金在这两大类资产上都做了重点配置，从基金十大重仓股票也可以看出，招商银行、招商地产占两席，双汇发展、贵州茅台占两席，它们分别在过去两个季度对基金净值作出了贡献。从更细微一点的投资操作上看，三季度贵州茅台的比例略有降低，而在7月初招商银行的比例有大幅度上升，这也给净值增长带来了正面的作用。

基于一贯的策略，本基金股票组合在三季度总体稳定、小有变化。如中报所述，下半年要更加注重公司重构带来价值提升的机会，三季度末重仓股中就出现了北京巴士这样的品种，当然从某种角度双汇发展、三一重工等重点股票也有一定的重构特点。事实上在全流通背景下，非常多的公司都存在资产、股权、管理等各方面重构的冲动和机会。

(2) 2006年第四季度市场及投资管理展望

本基金认为四季度市场将会延续三季度的走势，调整压力依然存在，但从着重个股的角度出发，即使有超出预期的调整也不足为惧。新股会成为市场的活跃成分。本基金将坚持价值投资策略，战术上尽量少犯错误，精心选择个股，力争取得好成绩。

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	662,246,114.20	69.74%
债券	181,976,323.73	19.16%
权证	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金	101,026,580.15	10.64%
应收证券清算款	469,317.02	0.05%
其他资产	3,911,001.01	0.41%
合 计	949,629,336.11	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	12,114,840.00	1.37%
2	采掘业	-	-
3	制造业	283,457,406.00	32.09%
	其中：食品、饮料	93,342,770.80	10.57%
	石油、化学、塑胶、塑料	28,195,400.00	3.19%
	电子	93,403.20	0.01%
	金属、非金属	19,110,860.00	2.16%
	机械、设备、仪表	99,027,556.00	11.21%
	医药、生物制品	43,687,416.00	4.95%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	1,959,000.00	0.22%
5	建筑业	22,221,000.00	2.52%
6	交通运输、仓储业	103,743,634.00	11.75%
7	信息技术业	63,716,993.28	7.21%
8	批发和零售贸易	52,062,997.00	5.89%
9	金融、保险业	81,851,617.52	9.27%
10	房地产业	41,118,626.40	4.66%
11	社会服务业	-	-
12	传播与文化产业	-	-
13	综合类	-	-
	合 计	662,246,114.20	74.98%

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	G 招 行	7,620,000	75,285,600.00	8.52%
2	000895	双汇发展	2,291,540	71,083,570.80	8.05%
3	600031	G 三 一	4,080,000	66,300,000.00	7.51%
4	600406	国电南瑞	1,460,000	37,916,200.00	4.29%
5	000024	G 招商局	2,090,000	32,499,500.00	3.68%
6	600386	G 北 巴	3,860,000	32,269,600.00	3.65%
7	000538	G 云白药	1,720,000	31,665,200.00	3.59%
8	600519	G 茅 台	470,000	22,259,200.00	2.52%
9	600970	G 中 材	900,000	22,221,000.00	2.52%
10	601006	大秦铁路	3,350,000	21,138,500.00	2.39%

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	161,680,323.73	18.30%
2	金融债券	20,296,000.00	2.30%
	合 计	181,976,323.73	20.60%

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)	43,250,850.00	4.90%
2	银行间00国债12	41,453,333.33	4.69%
3	20国债(4)	30,192,750.00	3.42%
4	05农发04	20,296,000.00	2.30%
5	20国债(10)	15,954,534.40	1.81%

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	518,432.44
应收利息	3,377,445.04
待摊费用	15,123.53
合 计	3,911,001.01

- (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。

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10月26日