

国泰金龙系列证券投资基金

2011 年第 4 季度报告

(本系列基金由国泰金龙债券证券投资基金
和国泰金龙行业精选证券投资基金组成)

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年一月十九日

国泰金龙债券证券投资基金 2011 年第 4 季度报告

§ 1 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 1 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰金龙债券
基金主代码	020002
系列基金名称	国泰金龙系列证券投资基金
系列其他子基金名称	国泰金龙行业混合(020003)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月5日
报告期末基金份额总额	886,914,724.90份
投资目标	在保证投资组合低风险和高流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报，力求基金资产的稳定增值。
投资策略	以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。在对拟公开发行的股票的公司进行充分研究的基础上，择机参与拟公开发行的股票的申购。因申购所持有的股票资产自可上市交易之日起在180个自然日内卖出；因可转债转股所持有的股票资产自可上市交易之日起在180个自然日内卖出。

业绩比较基准	本基金以中信全债指数收益率作为衡量基金业绩的比较基准。	
风险收益特征	本基金属于收益稳定、风险较低的品种。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国泰金龙债券A	国泰金龙债券C
下属两级基金的交易代码	020002	020012
报告期末下属两级基金的份额总额	645,264,060.05份	241,650,664.85份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2011年10月1日-2011年12月31日)	
	国泰金龙债券A	国泰金龙债券C
1. 本期已实现收益	-8,568,751.36	-1,826,171.39
2. 本期利润	5,272,074.51	1,461,194.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0257	0.0376
4. 期末基金资产净值	629,411,580.31	234,509,598.48
5. 期末基金份额净值	0.975	0.970

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、国泰金龙债券 A：

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	①—③	②—④
----	--------	-----------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	4.39%	0.37%	2.72%	0.07%	1.67%	0.30%

2、国泰金龙债券 C：

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	4.19%	0.38%	2.72%	0.07%	1.47%	0.31%

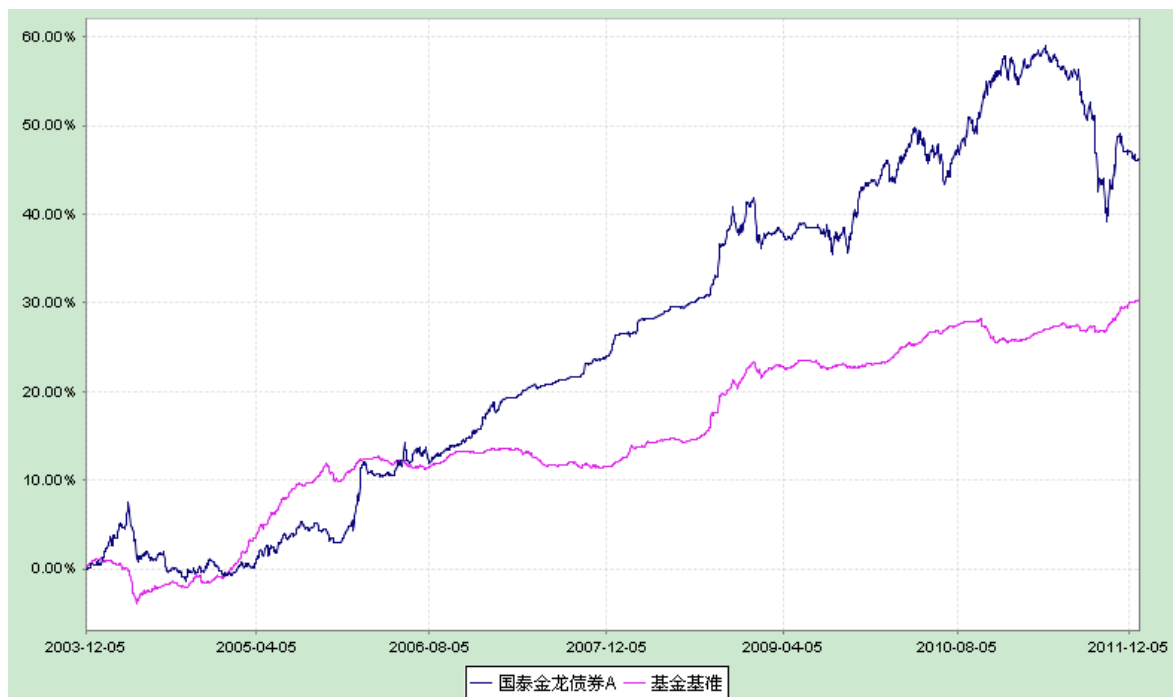
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金龙债券证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

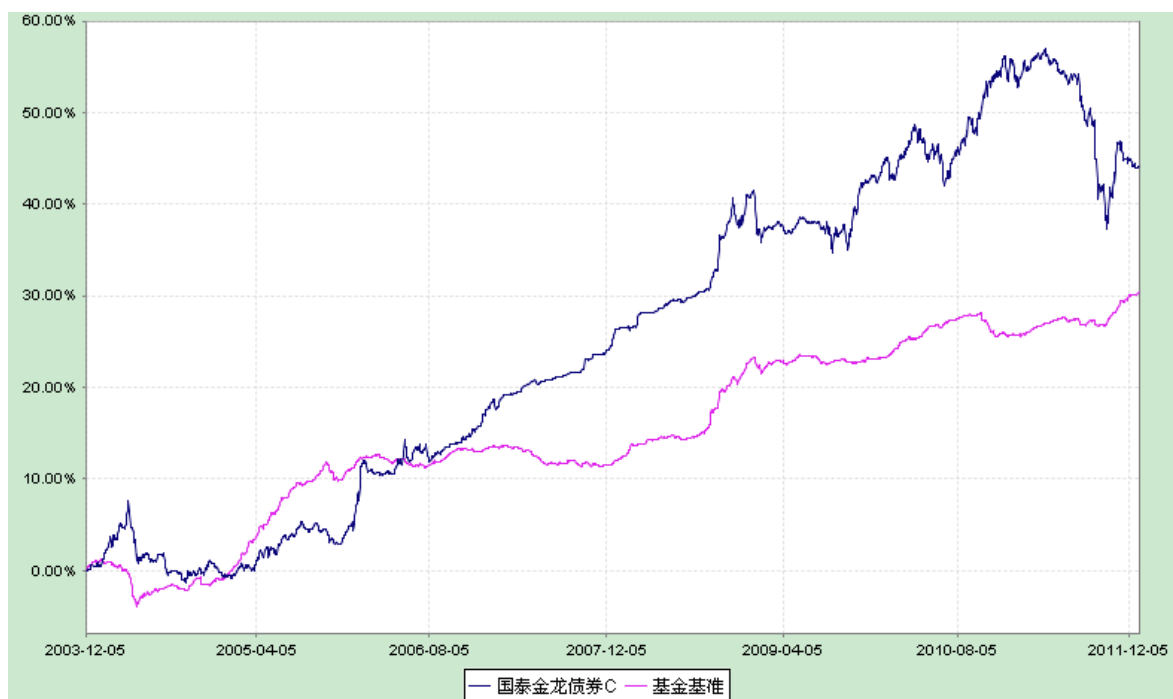
(2003 年 12 月 5 日至 2011 年 12 月 31 日)

1. 国泰金龙债券 A：



注：本基金的合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2. 国泰金龙债券 C：



注：本基金合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴晨	本基金的基金经理、 国泰金鹿保本基金的基金经理	2010-4-29	-	9	硕士研究生，CFA，FRM。2001 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，历任股票交易员、债券交易员；2004 年 9 月至 2005 年 10 月，英国城市大学卡斯商学院金融系学习；2005 年 10 月至 2008 年 3 月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理；2008 年 4 月至 2009 年 3 月在长信基金管理有限公司从事债券研究；2009 年 4 月至 2010 年 3 月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010 年 4 月起担任国泰金龙债券的基金经

					理，2010年9月至2011年11月担任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》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，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生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、投资组合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，有效保障投资人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度宏观经济增速持续下滑，出口、消费以及投资增速都有不同程度的走弱。PMI 指数连续数月低于 50 的荣枯线。与此同时，海外经济增速也同步放缓，希腊债务

违约概率大幅上升，市场悲观情绪蔓延。通胀受翘尾因素减弱以及猪肉价格涨幅放缓的影响快速下行，11 月 CPI 指数从前期 6.5% 的高点回落至 4.2%。受此影响，央行货币政策开始出现适度微调预调，存款准备金率全面下调更是确立了这一态势。债券市场四季度在一系列利好因素叠加影响下大幅走强，10 年国债下行 60 个 bp 左右，中高等级信用债同样涨幅明显，低等级信用债由于供给以及市场风险厌恶情绪的影响表现相对较差，信用利差进一步扩大。权益市场在 10 月至 11 月初受货币政策适当调整预期的引导走出一波反弹行情，但随后投资者关注点更多集中于经济持续下滑，权益市场掉头向下，并创出年内新低。

四季度本基金债券部分拉长组合久期，在对利率产品进行波段操作后增加信用债投资比例，参与转债市场反弹并在 11 月大幅进行减持。四季度为了规避风险，本基金没有参与新股发行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 类在 2011 年四季度的净值增长率为 4.39%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%。国泰金龙债券 C 类在 2011 年第三季度的净值增长率为 4.19%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 12 年一季度经济增速仍将惯性下滑，受房地产调控影响，投资增速将维持相对低位运行；消费增长相对平稳；受全球经济增速放缓以及欧元区主权债务危机蔓延的影响，出口形势在经济增长三驾马车中最为悲观。受翘尾因素快速下行影响，一季度 CPI 有望回落至 3% 附近水平。货币政策将维持前期预调微调的态势，但节奏和幅度仍然需要观察。一季度债券市场可能存在一定投资机会，利率产品以及中高等级信用产品收益率将随货币政策逐步放松而进一步下行，中低等级信用债由于前期信用利差持续扩大存在收敛的空间，预计表现将较为抢眼。股票市场一季度预计仍然是震荡筑底的过程，但也不排除市场存在估值修复的可能。

一季度本基金将适度拉长组合久期，类属资产配置方面更多偏向信用产品；权益类资产相对保守的投资策略，同时注重不同风格资产配置的相对均衡。积极降低组合波动率，寻求基金净值的平稳增长。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	758,818,391.90	87.67
	其中：债券	758,818,391.90	87.67
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	76,700,210.00	8.86
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	12,966,538.71	1.50
6	其他各项资产	17,006,167.42	1.96
7	合计	865,491,308.03	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	46,194,721.20	5.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	270,283,670.70	31.29
5	企业短期融资券	442,340,000.00	51.20
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-

9	合计	758,818,391.90	87.83
---	----	----------------	-------

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 （%）
1	1181017	11宝金属 CP01	600,000	60,420,000.00	6.99
2	1181041	11杭汽轮 CP01	500,000	50,380,000.00	5.83
3	1181084	11浙小商 CP01	500,000	50,275,000.00	5.82
4	041158013	11皖交投 CP002	500,000	50,175,000.00	5.81
5	1181047	11中航重 CP01	400,000	40,264,000.00	4.66

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,667,578.72

5	应收申购款	88,588.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,006,167.42

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C
本报告期期初基金份额总额	132,097,336.43	35,371,315.71
本报告期基金总申购份额	595,895,900.99	212,854,016.86
减：本报告期基金总赎回份额	82,729,177.37	6,574,667.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	645,264,060.05	241,650,664.85

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、关于同意设立国泰金龙系列证券投资基金的批复
- 2、国泰金龙系列证券投资基金合同
- 3、国泰金龙系列证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

7.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。

7.3 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) 38569000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 38569000

公司网址：http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司

二〇一二年一月十九日

国泰金龙行业精选证券投资基金 2011 年第 4 季度报告

§ 1 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 1 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰金龙行业混合
基金主代码	020003
交易代码	020003
系列基金名称	国泰金龙系列证券投资基金

系列其他子基金名称	国泰金龙债券A(020002)、国泰金龙债券C(020012)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月5日
报告期末基金份额总额	892,598,837.71份
投资目标	有效把握我国行业的发展趋势,精心选择具有良好行业背景的成长性企业,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取定量分析与定性分析相结合的方式,通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险;通过行业精选,确定拟投资的优势行业及相应比例;通过个股选择,挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准是上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均,债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。 基金整体业绩比较基准=75%×[上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均]+25%×[上证国债指数]。
风险收益特征	承担中等风险,获取相对超额回报。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-32,541,273.95
2.本期利润	-4,336,985.22

3.加权平均基金份额本期利润	-0.0048
4.期末基金资产净值	445,488,677.24
5.期末基金份额净值	0.499

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

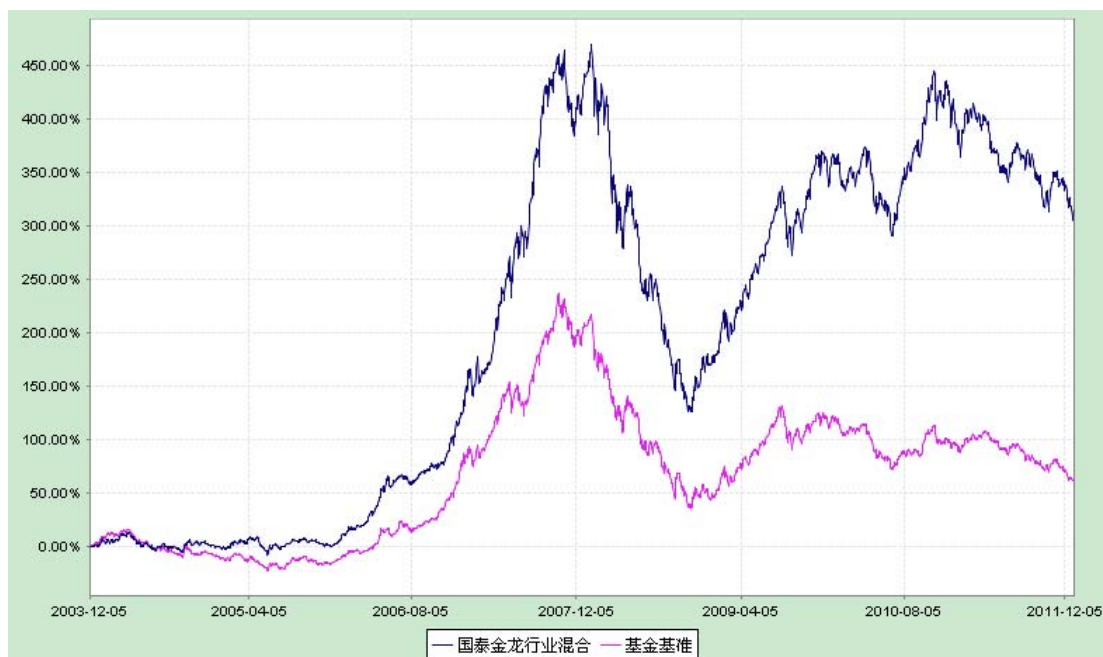
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.99%	1.04%	-4.70%	0.92%	3.71%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金龙行业精选证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2003 年 12 月 5 日至 2011 年 12 月 31 日）



注：本基金的合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
王航	本基金的基金经理，国泰金鑫封闭的基金经理、国泰事件驱动股票的基金经理	2008-5-17	-	14	硕士研究生，CFA。曾任职于南方证券有限公司。2003年1月加盟国泰基金管理有限公司，历任社保111组合基金经理助理、国泰金鹿保本基金和国泰金象保本基金经理助理、国泰金马稳健回报基金经理助理、国泰金牛创新成长基金经理助理，2008年5月起任国泰金龙行业混合的基金经理，2010年4月起兼任国泰金鑫封闭的基金经理，2011年8月起兼任国泰事件驱动股票基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》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，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生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、投资组合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，有效保障投资人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度以来，市场在 10 月份短暂反弹之后加速下跌，国内市场政策全面放松预期落空，也加大了市场的调整幅度，创出年内新低，市场成交量进一步萎缩。四季度

的结构亮点在文化传媒行业，受益于政策扶持，该行业表现抢眼，并形成较为持续的市场热点；此外金融地产以及部分周期品种表现较为抗跌。根据对市场整体震荡向下的判断，本基金四季度仍然维持中性资产配置，主要增持医疗服务、文化传媒等行业，减持了非银行金融、机械设备等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2011 年四季度的净值增长率为-0.99%，同期业绩比较基准收益率为-4.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年一季度，短期市场能否形成较大力度反弹还有赖于货币政策能否放松以及股票市场供求关系的改善，中期还要看经济能否实现稳中求进的目标，但是这些中短期因素出现立刻反转的可能性较小，市场将延续弱势震荡走势；长期看，解决中国经济的结构性矛盾仍需要经历较长时间的阵痛期，对资本市场势必造成较大的影响。2012 年 A 股的投资机会仍以结构性为主，本基金将继续关注盈利增长确定的消费类股票特别是中低端民族品牌消费品，以及受益于政策变化的医疗服务、教育和文化等行业性投资机会，并积极寻找与经济转型相适应的传统产业升级和新兴产业的中长期投资机会。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	332,787,298.61	72.61
	其中：股票	332,787,298.61	72.61
2	固定收益投资	104,890,434.00	22.89
	其中：债券	104,890,434.00	22.89
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	12,714,696.33	2.77
6	其他各项资产	7,919,787.35	1.73
7	合计	458,312,216.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值 比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	256,001,601.77	57.47
C0	食品、饮料	36,449,264.05	8.18
C1	纺织、服装、皮毛	58,979,867.40	13.24
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	20,103,725.25	4.51
C5	电子	65,151,258.80	14.62
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	53,760,213.05	12.07
C8	医药、生物制品	21,557,273.22	4.84
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,489,200.00	1.01
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-

G	信息技术业	62,400.00	0.01
H	批发和零售贸易	5,799,420.29	1.30
I	金融、保险业	18,667,903.73	4.19
J	房地产业	6,879,482.60	1.54
K	社会服务业	22,783,980.72	5.11
L	传播与文化产业	18,103,309.50	4.06
M	综合类	-	-
	合计	332,787,298.61	74.70

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 （%）
1	002236	大华股份	686,693	34,059,972.80	7.65
2	002397	梦洁家纺	1,235,144	32,360,772.80	7.26
3	002029	七匹狼	754,082	26,619,094.60	5.98
4	600763	通策医疗	1,080,834	22,783,980.72	5.11
5	600587	新华医疗	669,137	20,943,988.10	4.70
6	600315	上海家化	589,725	20,103,725.25	4.51
7	002415	海康威视	403,102	17,333,386.00	3.89
8	300027	华谊兄弟	900,000	14,229,000.00	3.19
9	600535	天士力	312,153	13,091,696.82	2.94
10	600036	招商银行	1,081,879	12,841,903.73	2.88

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净 值比例（%）
----	------	---------	------------------

1	国家债券	83,867,300.00	18.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,960,000.00	4.48
	其中：政策性金融债	19,960,000.00	4.48
4	企业债券	1,018.00	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,062,116.00	0.24
8	其他	-	-
9	合计	104,890,434.00	23.55

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	010203	02国债(3)	378,000	37,856,700.00	8.50
2	110011	11付息国债11	300,000	30,000,000.00	6.73
3	030201	03国开01	200,000	19,960,000.00	4.48
4	020001	02国债01	100,000	9,998,000.00	2.24
5	010308	03国债(8)	60,000	6,012,600.00	1.35

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,840,000.00
2	应收证券清算款	3,803,422.86
3	应收股利	-
4	应收利息	2,094,699.77
5	应收申购款	181,664.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,919,787.35

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	945,800.00	0.21
2	110013	国投转债	116,316.00	0.03

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	883,031,781.73
--------------	----------------

本报告期基金总申购份额	100,406,145.57
减：本报告期基金总赎回份额	90,839,089.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	892,598,837.71

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、关于同意设立国泰金龙系列证券投资基金的批复
- 2、国泰金龙系列证券投资基金合同
- 3、国泰金龙系列证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

7.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。

7.3 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) 38569000，400-888-8688

客户投诉电话：(021) 38569000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一二年一月十九日