

国泰金龙系列证券投资基金

2012 年第 1 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）

2012 年 3 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：二〇一二年四月二十一日

国泰金龙债券证券投资基金 2012 年第 1 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 4 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 3 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	958,087,979.94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。在对拟公开发行股票的公司进行充分研究的基础上，择机参与拟公开发行股票申购。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	915,831,432.28份	42,256,547.66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(2012年1月1日-2012年3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	10,047,009.76	600,180.71
2. 本期利润	22,676,544.43	1,477,494.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0296	0.0316
4. 期末基金资产净值	919,534,356.51	42,334,344.06
5. 期末基金份额净值	1.004	1.002

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④	①－③	②－④
过去三个月	2.97%	0.06%	0.88%	0.04%	2.09%	0.02%

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	3.30%	0.08%	0.88%	0.04%	2.42%	0.04%

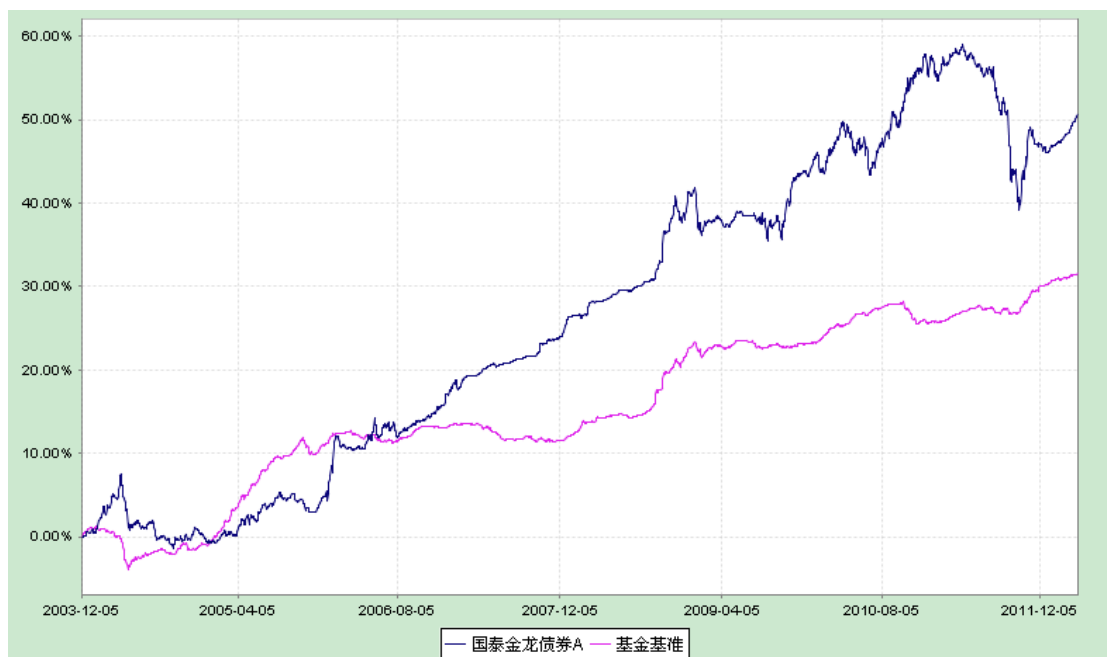
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

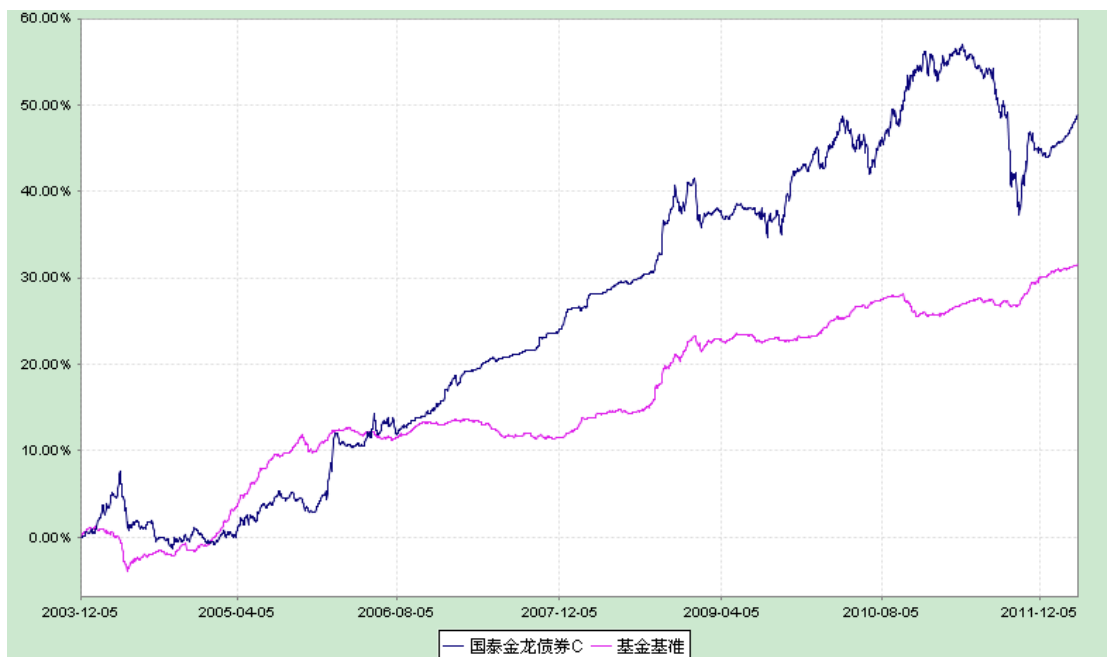
(2003 年 12 月 5 日至 2012 年 3 月 31 日)

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		
吴晨	本基金的基金经理、 国泰金鹿保本基金、 国泰信用互利分级债券的基金经理	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证券投资基金的基金经理；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；2011年12月起任国泰信用互利分级债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

2012 年一季度我国宏观经济增长持续回落，但仍然处于市场预期之内，软着陆态势较为明显，并没有出现硬着陆迹象。受翘尾因素影响 CPI 指数显著回落，2 月 CPI 同比涨幅仅为 3.2%，为近一年半以来最低水平。货币政策依然维持稳健，仅在 2 月下调了一次存款准备金率，市场预期中的政策大幅放松落空。一季度股票市场震荡整理，前期受政策放松预期影响而走强，两会后由于预期落空而大幅下挫。债券市场走势分化明显，利率产品以及高等级信用债由于前期涨幅过大普遍调整，而中低等级信用产品收益率大幅下行，尤其是收益率曲线短端下行普遍达到 100 多个 bp。信用利差显著收窄。城投债热度明显提升，一级市场供给大增依然受到追捧。转债市场迎来估值修复，表现较佳。

2012 年一季度本基金适当拉长组合久期，大幅度增加信用债投资比例，尤其是中等级信用债的配置力度，取得较好收益。一季度为了规避风险，本基金没有参与新股发行等任何偏权益类资产投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 类在 2012 年一季度的净值增长率为 2.97%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。国泰金龙债券 C 类在 2012 年一季度的净值增长率为 3.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度预计经济仍将惯性放缓，但幅度相对温和。通胀增速将沿惯性下降，同比

低点出现在年中。受欧元区债务危机影响，全球金融市场仍然将处于动荡不安之中。预计货币政策继续维持中性，以稳为主，适时而动，营造流动性宽松环境以稳定信贷增速和货币增量，存准率有下调空间，基准利率预计保持稳定；财政政策转向积极，扶持民生相关、新兴产业，结构减税，加大转移支付力度，鼓励消费。

二季度债券市场仍然存在较为明确的投资机会，利率产品和高等级信用债有反弹需求，中低等级信用产品由于绝对收益较高仍然是较好的配置品种，但信用风险仍然是二季度需要密切关注的重点，不排除有违约情况发生。股票市场上半年预计仍然是震荡筑底的过程，其间不排除市场存在估值修复的可能。

二季度本基金将适度拉长组合久期，类属资产配置方面继续保持信用产品配置力度；权益类资产维持谨慎的投资策略，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	1,203,177,196.10	95.49
	其中：债券	1,203,177,196.10	95.49
	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	22,027,946.00	1.75
6	其他各项资产	34,817,553.15	2.76
7	合计	1,260,022,695.25	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	49,029,700.00	5.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	819,256,496.10	85.17
5	企业短期融资券	334,891,000.00	34.82
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,203,177,196.10	125.09

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	1180202	11宁海城投债	500,000	50,990,000.00	5.30
2	041158013	11皖交投 CP002	500,000	50,790,000.00	5.28
	041152007	11红豆 CP002	500,000	50,790,000.00	5.28
4	041265004	12瑞水泥 CP001	500,000	50,735,000.00	5.27
5	1280052	12伊旗城投债	500,000	50,285,000.00	5.23

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	15,423,528.95

3	应收股利	-
4	应收利息	18,478,993.81
5	应收申购款	665,030.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,817,553.15

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	645,264,060.05	241,650,664.85
本报告期基金总申购份额	331,541,709.86	24,050,217.32
减：本报告期基金总赎回份额	60,974,337.63	223,444,334.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	915,831,432.28	42,256,547.66

§ 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

二〇一二年四月二十一日

国泰金龙行业精选证券投资基金 2012 年第 1 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 4 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 3 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	917,538,877.64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(2012年1月1日-2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-18,134,129.42
2.本期利润	-25,335,918.02
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0279
4.期末基金资产净值	428,676,197.07
5.期末基金份额净值	0.467

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

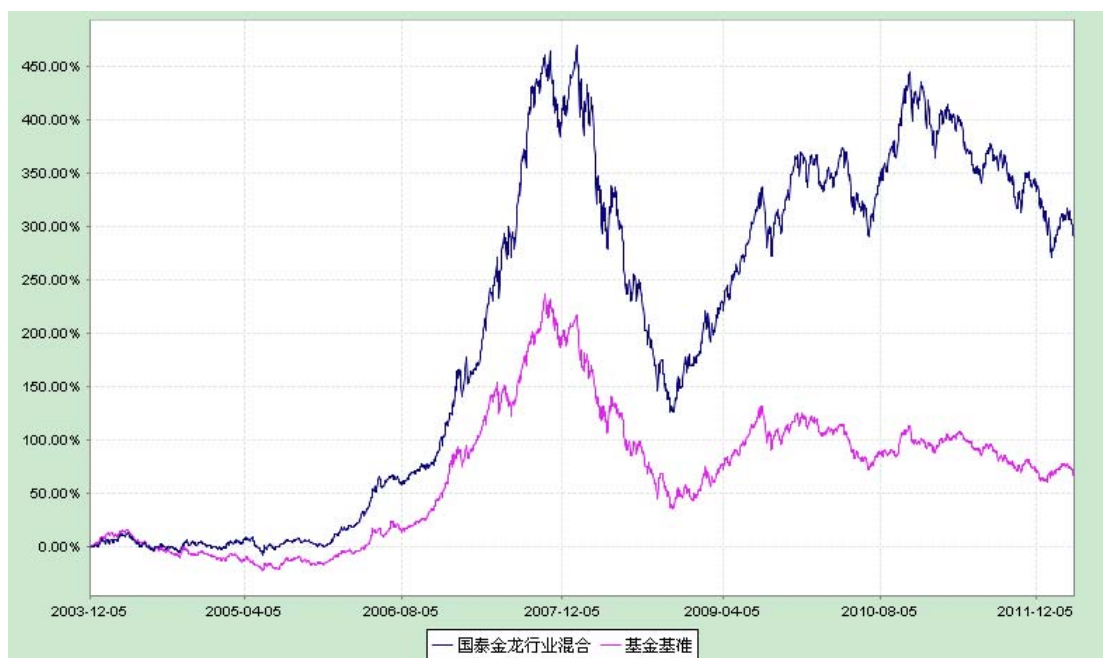
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.72%	1.27%	2.36%	0.95%	-8.08%	0.32%

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 2012 年 3 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	2008-5-17	2012-1-19	11	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

	经理、 国泰金 鑫封 闭、国 泰事件 驱动股 票的基 金经理				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、国泰金马稳健混合的基金经理助理、国泰金牛创新股票的基金经理助理；2008年5月至2012年1月任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理；2010年4月起兼任金鑫证券投资基金的基金经理；2011年8月起兼任国泰事件驱动策略股票型证券投资基金的基金经理。
周广山	本基金的基金 经理、 国泰估 值优势 分级封 闭的基 金经理	2012-1-19	-	8	硕士研究生，长江商学院MBA；2005年12月至2007年3月在凯基证券大陆研究所任行业研究员；2007年4月加入国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理；2011年4月起任国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的基金经理；2012年1月19日起兼任国泰金龙行业混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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》、《基金管理人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，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

2012 年一季度，受到央企大股东持续增持 A 股支持，同时国内宏观调控政策放松的预期影响，市场在 2132 点阶段性底部后展开持续反弹，1 月份强周期行业有色率先上涨，2 月份市场进入普涨，地产和消费行业表现突出，3 月份在政策维持对房地产行业坚决调控表态下，出现阶段回落。从风格上看，2011 年四季度调整较深的中小盘股票反弹力度较大，以银行为代表的大盘蓝筹股则涨幅较小。

本基金更换基金经理后，根据宏观经济环境的变化对原有投资组合做了调整，投资标的注重上市公司的中长期投资价值和股权文化，对公司治理结构完善、管理层专业进取的上市公司做了重点布局。结构上，重点配置消费行业中的绩优成长股，并增加早周期行业房地产和汽车的配置，同时对部分有资源优势的有色企业也做了布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2012 年一季度的净值增长率为-5.72%，同期业绩比较基准收益率为 2.36%。

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 年二季度，国内经济超储大量货币有所改善，GDP 增速将逐步回落，CPI 有所回落但物价仍将运行在一个较高的水平，政府调控手段将有所调整，早周期行业会表现更敏感。预计上市公司运营在一季度存在较大困难，一季报结果将会对市场有一定冲击，而二季度宏观政策调整将是市场短期阶段性上涨的动力。经历连续下跌后，A 股市场具备良好成长性的上市公司已经纳入长期投资价值区域，可为我们提供较大的选择空间，我们将重点把握政策放松带来的投资机会，中长期关注人口老龄化催生

的医疗保健行业和劳动生产率改善带来的机会，努力为基金持有人创建一个稳健、持续的投资回报。

§ 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	278,141,646.22	63.70
	其中：股票	278,141,646.22	63.70
2	固定收益投资	101,667,093.00	23.28
	其中：债券	101,667,093.00	23.28
	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	54,671,617.13	12.52
6	其他各项资产	2,179,270.58	0.50
7	合计	436,659,626.93	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	21,206,428.10	4.95
C	制造业	176,665,083.01	41.21
C0	食品、饮料	53,552,872.78	12.49
C1	纺织、服装、皮毛	24,132,144.00	5.63
C2	木材、家具	-	-

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,369,500.00	3.35
C5	电子	17,933,840.00	4.18
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	38,812,393.00	9.05
C8	医药、生物制品	27,864,333.23	6.50
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,556,883.80	1.30
E	建筑业	23,709,387.50	5.53
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	39,077,695.81	9.12
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	11,926,168.00	2.78
M	综合类	-	-
	合计	278,141,646.22	64.88

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	000001	深发展 A	1,200,040	18,852,628.40	4.40
2	002236	大华股份	373,000	17,933,840.00	4.18
3	600587	新华医疗	615,314	17,690,277.50	4.13
4	002557	洽洽食品	516,950	13,823,243.00	3.22
5	002327	富安娜	305,056	13,041,144.00	3.04
6	002310	东方园林	136,875	12,430,987.50	2.90

7	000869	张 裕 A	129,910	12,240,120.20	2.86
8	300058	蓝色光标	440,080	11,926,168.00	2.78
9	600036	招商银行	1,000,000	11,900,000.00	2.78
10	002099	海翔药业	607,171	11,439,101.64	2.67

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	80,619,825.00	18.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,982,000.00	4.66
	其中：政策性金融债	19,982,000.00	4.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,065,268.00	0.25
8	其他	-	-
9	合计	101,667,093.00	23.72

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	019202	12国债02	300,000	30,009,000.00	7.00
2	110011	11付息国债 11	300,000	30,006,000.00	7.00
3	030201	03国开01	200,000	19,982,000.00	4.66
4	010601	06国债(1)	76,500	7,623,225.00	1.78
5	010308	03国债(8)	60,000	6,025,200.00	1.41

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	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,114,216.78
5	应收申购款	565,053.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,179,270.58

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	947,200.00	0.22
2	110013	国投转债	118,068.00	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	892,598,837.71
本报告期基金总申购份额	122,994,924.77
减：本报告期基金总赎回份额	98,054,884.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	917,538,877.64

§ 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

二〇一二年四月二十一日