

国泰金龙系列证券投资基金 2012 年第 3 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 9 月 30 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：二〇一二年十月二十五日

国泰金龙债券证券投资基金 2012 年第 3 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 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 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	2,270,307,449.61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	1,431,459,188.85份	838,848,260.76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7月1日-2012年9月30日)	
	国泰金龙债券A	国泰金龙债券C
1. 本期已实现收益	30,379,225.46	12,965,501.83
2. 本期利润	5,509,458.06	1,932,198.67
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0033	0.0025
4. 期末基金资产净值	1,499,857,585.92	875,514,255.59
5. 期末基金份额净值	1.048	1.044

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	业绩比较基准标准差	①—③	②—④

				④		
过去三个月	0.48%	0.06%	0.09%	0.04%	0.39%	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	0.38%	0.05%	0.09%	0.04%	0.29%	0.01%

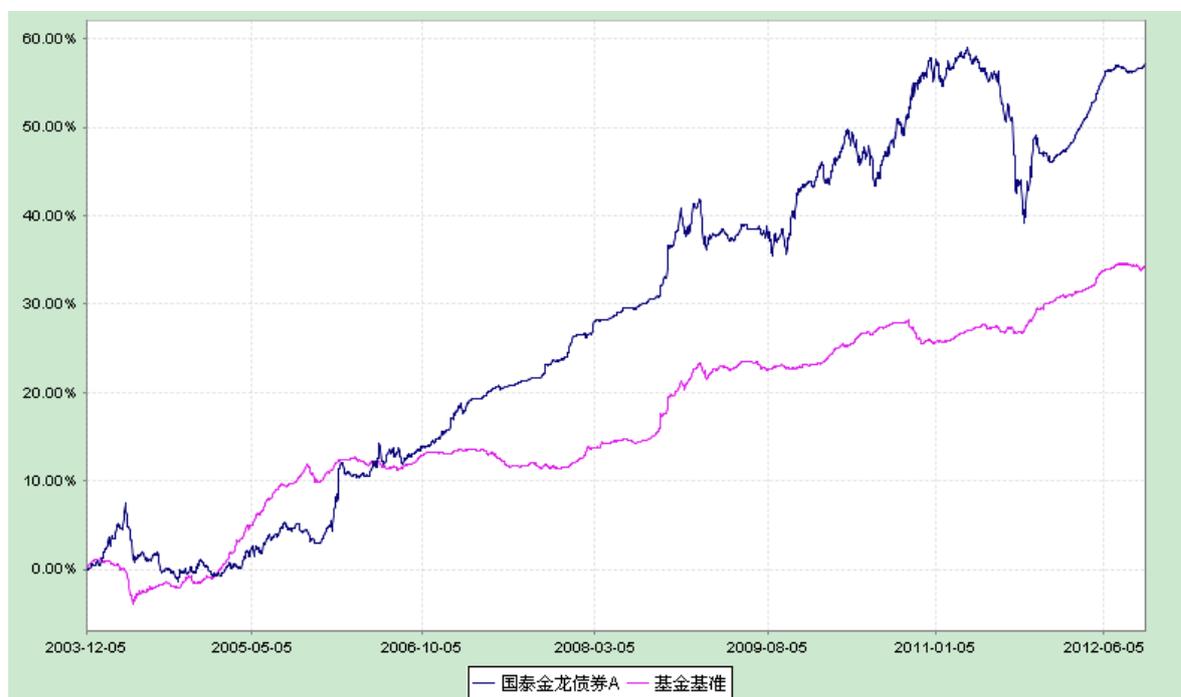
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

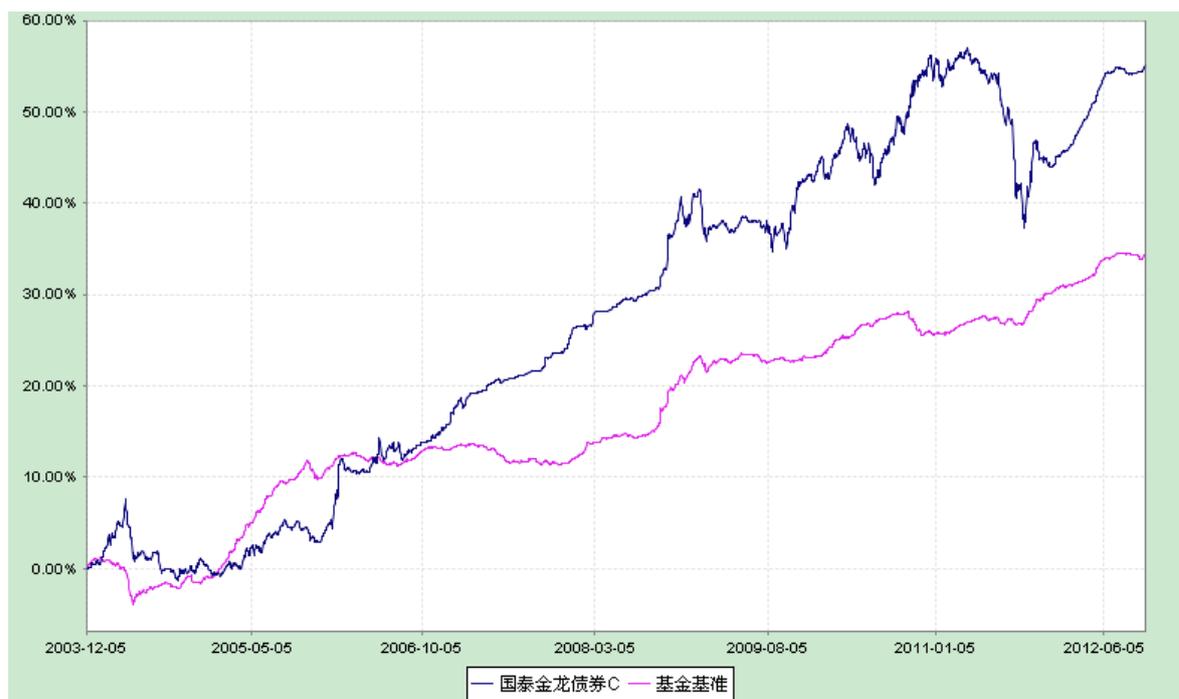
(2003 年 12 月 5 日至 2012 年 9 月 30 日)

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、国泰信用互利分级债券、国泰6个月短期理财债券的基金经理	2010-4-29	-	10	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；2012年9月起兼任国泰6个月短期理财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，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

三季度策略主要仍以防守为主，对于前期调整较大的品种，适当逢高减仓，并根据资金情况适当进行波段操作。未来策略上，“防守”+“反攻”是首选。当前利率品种收益率已经全面恢复甚至高于年初水平，但经济依然处于持续筑底阶段，从大方向上看，债市前景依然较好。但货币政策的不确定性趋于加大、资金面难以有效放松、通胀拐点已经出现、以及风险偏好的回升，这些因素均将对短期市场走势形成制约。市场是否具备趋势性机会依然有待确立。防守依然是主要策略，在此基础上，再考虑适当建立仓位博取价差收益。短久期、高评级信用品种依然还是首选。选择高票息、短久期品种既能获取较高的持有期收益，也能最大限度规避市场风险，同时受经济下行周期尚未结束的影响，经营环境的恶化也将显著加大信用利差，投资者对信用风险的关注程度应高于利率风险，考虑以高评级、短久期品种作为首选。因此，在调整的市场背景下，本基金采取了降久期和减杠杆的操作，重点配置短期融资券和高收益企业债，规避了市场调整风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 类在 2012 年第三季度的净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准收益率为 0.09%。国泰金龙债券 C 类在 2012 年第三季度的净值增长率为 0.38%，同期业绩比较基准收益率为 0.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

9 月份经济数据仍然显示出经济在软着陆过程。在物价上，市场之前比较担心的通胀高企现象可能要推后出现，预计 9 月份 CPI 和 PPI 与上个月基本持平。在增长上，工业生产环比可能继续持平，但同比还在继续回落，这将拉低投资者对未来的经济预期；固定资产投资可能大幅下滑，其中房地产投资下滑幅度最大，这与市场普遍预期产生较大背离。十八大之前政府维稳释放出积极信号的效果将有所体现，短期内有助于此前过于悲观的权益市场出现反弹，虽长期来看经济下行的局面很难改善，但短期内下行态势有所放缓。

四季度的资金面仍将有利于债市。目前经济处于收缩状态，基础货币的增长需要央行的主动调控。预计央行目前并不愿意接受资金面趋紧的状况出现。此外，通胀均值徘徊在 2.5% 以下，也为货币政策继续放松创造了一定空间，政策放松的方向仍然会维持。

宏观经济如果下行态势放缓，企业经营压力下降，加之未来货币政策还有宽松的

空间，这将对信用债产生较为积极的正面影响，而权益市场的短期上涨整体上则会对债券市场有一定的分流影响，因此我们预计短期内市场会出现一定的调整。基于对于整个四季度市场的判断，本基金将继续维持目前配置结构，等待市场调整后，逐步增加高收益品种配置的力度。

§ 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	2,605,222,041.81	82.59
	其中：债券	2,605,222,041.81	82.59
	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	433,438,160.11	13.74
6	其他各项资产	115,767,177.13	3.67
7	合计	3,154,427,379.05	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	113,239,226.00	4.77

2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,004,800.00	0.17
	其中：政策性金融债	4,004,800.00	0.17
4	企业债券	1,205,672,515.81	50.76
5	企业短期融资券	1,282,305,500.00	53.98
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,605,222,041.81	109.68

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	041261016	12浙商集 CP001	1,000,000	100,910,000.00	4.25
2	112056	11远兴债	612,486	63,392,301.00	2.67
3	041252011	12奥克斯 CP001	600,000	60,678,000.00	2.55
4	041252020	12恒力集 CP001	600,000	59,934,000.00	2.52
5	041253035	12太西煤 CP001	600,000	59,898,000.00	2.52

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	70,033,345.84
5	应收申购款	45,483,831.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	115,767,177.13

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	1,797,722,252.97	952,984,336.87
本报告期基金总申购份额	228,195,338.96	558,199,162.22
减：本报告期基金总赎回份额	594,458,403.08	672,335,238.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,431,459,188.85	838,848,260.76

§ 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

二〇一二年十月二十五日

国泰金龙行业精选证券投资基金 2012 年第 3 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10月22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7月1日起至9月30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	893, 107, 974. 12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7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-55,259,514.96
2.本期利润	-40,573,534.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0452
4.期末基金资产净值	376,782,184.78
5.期末基金份额净值	0.422

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

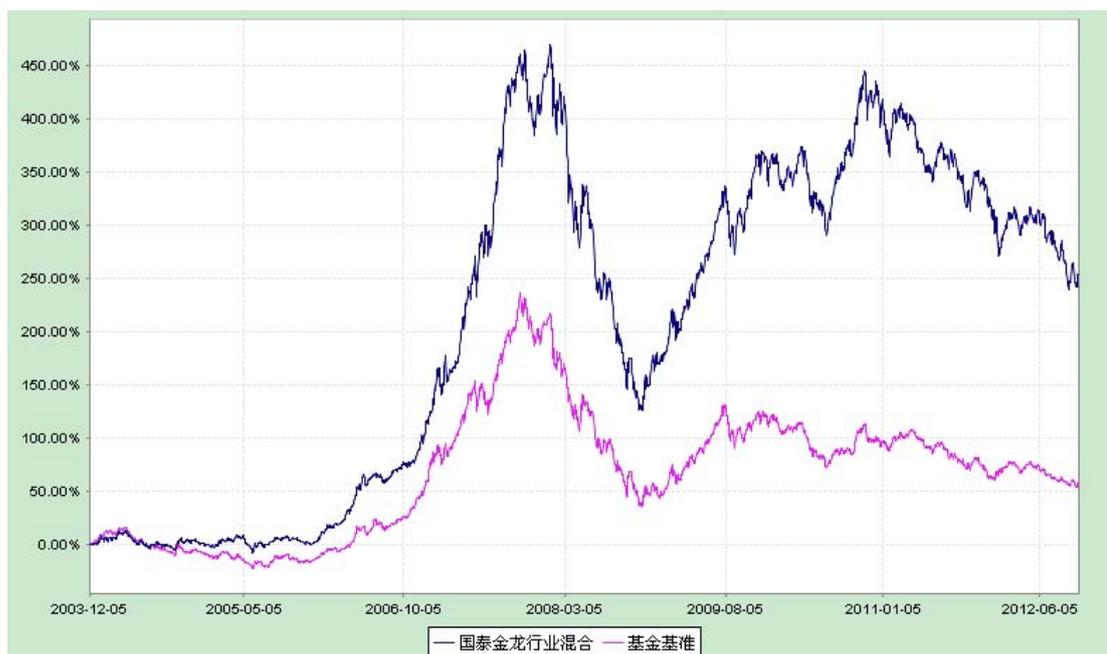
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.64%	1.20%	-4.54%	0.75%	-5.10%	0.45%

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 9 月 30 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		
周广山	本基金的基金经理	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月至2012年8月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。

刘夫	本基金的基金经理、国泰估值优势分级封闭的基金经理、公司投资副总监	2012-8-6	-	18	硕士研究生，曾就职于人民银行深圳外汇经纪中心，中创证券，平安保险集团公司，2000年12月至2005年4月任宝盈基金管理有限公司债券组合经理，2005年4月至2008年4月任嘉实基金管理有限公司基金经理。2008年4月加入国泰基金管理有限公司，2008年6月起任公司投资副总监，2008年6月至2011年1月兼任财富管理中心投资总监，2011年3月至2012年8月任金鑫证券投资基金的基金经理，2011年12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8月起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合规守信情况的说明

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所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风险管理进行有效控制，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 年三季度，A 股市场呈现出持续下跌的走势，市场对宏观政策放松预期的破灭，以及众多行业数据的急剧恶化，导致周期品行业股价出现了大幅下跌，钓鱼岛事件及对国内政治稳定性的担忧也在三季度对市场整体造成了较大的压力，而市场对下一届政府施政方向的不确定性以及由此带来的对未来经济形势的悲观情绪，则更是导致市场疲软的根本原因。三季度，本基金逐步减持了煤炭、地产、非银金融等周期性较强的行业，并逐步提高了白酒、建筑装饰、农业等消费及成长行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2012 年三季度的净值增长率为-9.64%，同期业绩比较基准收益率为-4.54%。

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 年四季度，GDP 增速将有望在三季度逐月下降之后维持在一个相对稳定的阶段，宏观经济数据可能维持在好坏参半或时好时坏的状态，而市场在对本届政府针对当前经济采取刺激政策的预期落空之后，围绕着 18 大的召开，下一阶段市场的关注点将逐步聚焦到下一届政府的施政纲领及政策导向，再从中去领会和寻找新的经济增长点和市场兴奋点。另一方面，每一次季报公布的时点，往往是众多个股走势的分水岭，而三季报作为年内公布的最后一次季报，对众多个股全年的走势将起到决定性

的作用。因此，本基金在四季度将以下届政府政策导向及三季报业绩作为个股选择和行业配置的重点方向，力争在本年度剩下不多的时间里，积极寻找投资机会，减少投资损失，努力为基金持有人创造一个稳健、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	268,827,467.02	64.33
	其中：股票	268,827,467.02	64.33
2	固定收益投资	82,334,066.70	19.70
	其中：债券	82,334,066.70	19.70
	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	64,138,334.05	15.35
6	其他各项资产	2,605,648.60	0.62
7	合计	417,905,516.37	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	6,617,653.24	1.76
B	采掘业	9,420,734.27	2.50
C	制造业	143,279,795.46	38.03

C0	食品、饮料	119,264,599.46	31.65
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	24,015,196.00	6.37
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,799,784.00	2.34
E	建筑业	40,878,017.80	10.85
F	交通运输、仓储业	18,851,324.10	5.00
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	5,596,272.50	1.49
I	金融、保险业	18,825,076.60	5.00
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	16,558,809.05	4.39
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	268,827,467.02	71.35

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	600519	贵州茅台	142,624	35,056,979.20	9.30
2	000858	五 粮 液	564,940	19,151,466.00	5.08
3	002567	唐人神	1,457,885	19,127,451.20	5.08
4	601006	大秦铁路	3,090,381	18,851,324.10	5.00
5	300197	铁汉生态	559,576	17,934,410.80	4.76
6	600967	北方创业	1,003,042	16,680,588.46	4.43
7	002375	亚厦股份	596,936	15,072,634.00	4.00
8	000799	酒 鬼 酒	221,700	12,126,990.00	3.22
9	002304	洋河股份	90,974	11,371,750.00	3.02
10	601988	中国银行	4,182,418	11,292,528.60	3.00

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	62,330,066.70	16.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,004,000.00	5.31
	其中：政策性金融债	20,004,000.00	5.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	82,334,066.70	21.85

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	010601	06国债(1)	316,530	31,649,834.70	8.40
2	030201	03国开01	200,000	20,004,000.00	5.31
3	019202	12国债02	120,000	12,030,000.00	3.19
4	010308	03国债(8)	115,760	11,657,032.00	3.09
5	019006	10国债06	60,000	5,995,200.00	1.59

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	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,245,354.28
5	应收申购款	610,294.32

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,605,648.60

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	897,939,091.90
本报告期基金总申购份额	51,872,920.89
减：本报告期基金总赎回份额	56,704,038.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	893,107,974.12

§ 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

二〇一二年十月二十五日