

# 国泰金龙系列证券投资基金

## 2012 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)

2012 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：二〇一三年一月十九日

# 国泰金龙债券证券投资基金 2012 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 2013 年 1 月 16 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 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	3,640,498,306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	2,143,269,903.08份	1,497,228,402.92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10月1日-2012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	27,292,748.14	16,482,628.46
2. 本期利润	29,826,993.01	16,624,356.38
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0171	0.0147
4. 期末基金资产净值	2,284,091,440.33	1,588,348,560.04
5. 期末基金份额净值	1.066	1.061

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	1.72%	0.06%	1.02%	0.02%	0.70%	0.04%

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	1.63%	0.05%	1.02%	0.02%	0.61%	0.03%

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

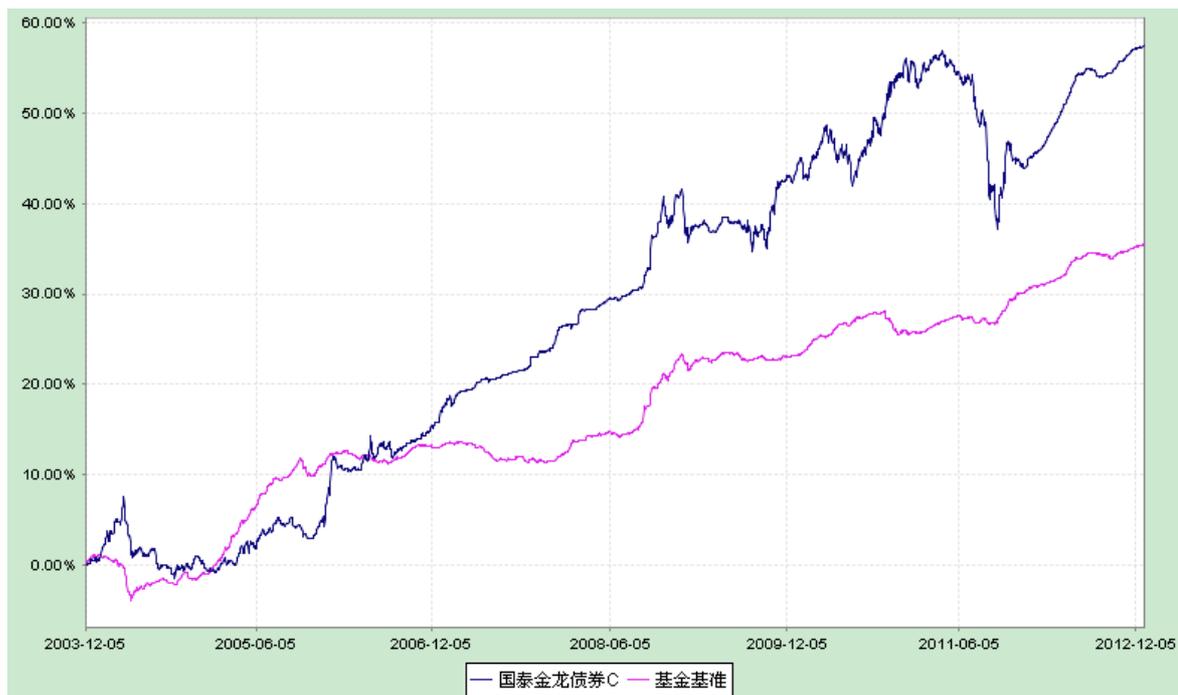
(2003 年 12 月 5 日至 2012 年 12 月 31 日)

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

2012 年四季度国内宏观经济形势处于弱复苏的态势,主要原因是中央政府主导的基建投资减缓了经济去产能、去库存下滑的幅度。1-11 月全国固定资产投资同比增长 20.7%,其中新开工项目计划投资同比增长 28.8%,加快 2.1 个百分点。PMI 原材料库存和产成品库存指数连续回升。应该说经济短周期最坏的时候已经过去。但我们也注意到需求复苏的动力主要来自于国有及国有控股单位,民间投资活力不强,房地产投资萎靡不振,外贸形势同样不容乐观,受食品价格持续下跌以及翘尾因素影响 CPI 指数维持低位,11 月 CPI 虽然有所反弹,回升至 2%的水平,但仍然低于市场普遍预期。在此背景下货币政策维持相对稳健,四季度央行通过公开市场的短期逆回购向市场注入流动性来缓解资金紧张局面,而没有采用下调基准利率或者存款准备金率等更为激进的措施。四季度整个资本市场迎来一个股债双升的阶段。股票市场筑底回升,12 月大幅上涨,上证综指当月上涨 300 点,迎来 12 年最佳的投资阶段。债券市场在前期调整后受资金面宽松推动继续上涨,信用利差进一步收窄,利率产品基本维持震荡态势,而中等级信用债收益率则较三季度末下行超过 30 个 bp。

本基金在三季度末开始适度拉长组合久期,维持高的信用债投资比例,取得一定投资收益。四季度为了规避风险,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 年四季度的净值增长率为 1.72%,同期业绩比较基准收益率为 1.02%。国泰金龙债券 C 类在 2012 年四季度的净值增长率为 1.63%,同期业绩比较基准收益率为 1.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013 年一季度国内经济有望小幅探底回升,随着年初开工旺季来临,基建投资有望继续回升,PMI 等指标或将继续反弹。受欧元区债务危机以及美国财政悬崖影响,全球金融市场仍然将处于动荡不安之中。货币政策方面,经济增长弱势复苏,潜在经济增速或出现阶段性放缓,通货膨胀回升温,也就意味着央行可以接受的经济增长中枢水平在下移,同时出于管理通胀预期的必要,我们认为央行大幅放松货币政策以刺激经济增长的可能性不大。短期内央行货币政策基调主要是适应性调整,主要着力于保持货币环境的稳定,以相对偏紧的资金价格和相对平坦的收益率曲线促使经济结

构的调整以及发挥金融配置资源的功能。预计未来 1 个季度内央行放松货币政策的可能性不大，主要通过灵活开展公开市场操作来进行流动性管理，银行间资金面维持紧平衡状态。财政政策方面，以力促结构调整为核心，扶持民生相关、新兴产业，进行结构性减税，加大转移支付力度，鼓励汽车、家电下乡，拉动消费等。

2013 年一季度债券市场将在资金配置需求和经济见底回升中进行抉择，预计将维持中性态势，股票市场一季度随经济逐步向好仍然有上攻机会。

2013 年一季度本基金将维持中性的组合久期，适当加大波段操作，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	4,105,423,708.72	91.28
	其中：债券	4,105,423,708.72	91.28
	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	107,314,446.11	2.39
6	其他各项资产	284,876,946.67	6.33
7	合计	4,497,615,101.50	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	188,979,625.80	4.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,027,904,582.92	52.37
5	企业短期融资券	1,885,327,500.00	48.69
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,212,000.00	0.08
8	其他	-	-
9	合计	4,105,423,708.72	106.02

**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	101,040,000.00	2.61
2	041253055	12太西煤 CP002	700,000	70,364,000.00	1.82
3	112056	11远兴债	632,500	65,826,805.00	1.70
4	041252011	12奥克斯 CP001	600,000	60,726,000.00	1.57
5	041252020	12恒力集 CP001	600,000	60,180,000.00	1.55

**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	94,298,605.36
5	应收申购款	190,328,341.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	284,876,946.67

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	1,431,459,188.85	838,848,260.76
本报告期基金总申购份额	812,998,215.81	1,465,533,773.36
减：本报告期基金总赎回份额	101,187,501.58	807,153,631.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,143,269,903.08	1,497,228,402.92

## § 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

二〇一三年一月十九日

# 国泰金龙行业精选证券投资基金 2012 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 2013 年 1 月 16 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 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	886, 189, 720. 72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10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-27,886,929.07
2.本期利润	11,655,524.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0131
4.期末基金资产净值	385,545,647.01
5.期末基金份额净值	0.435

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

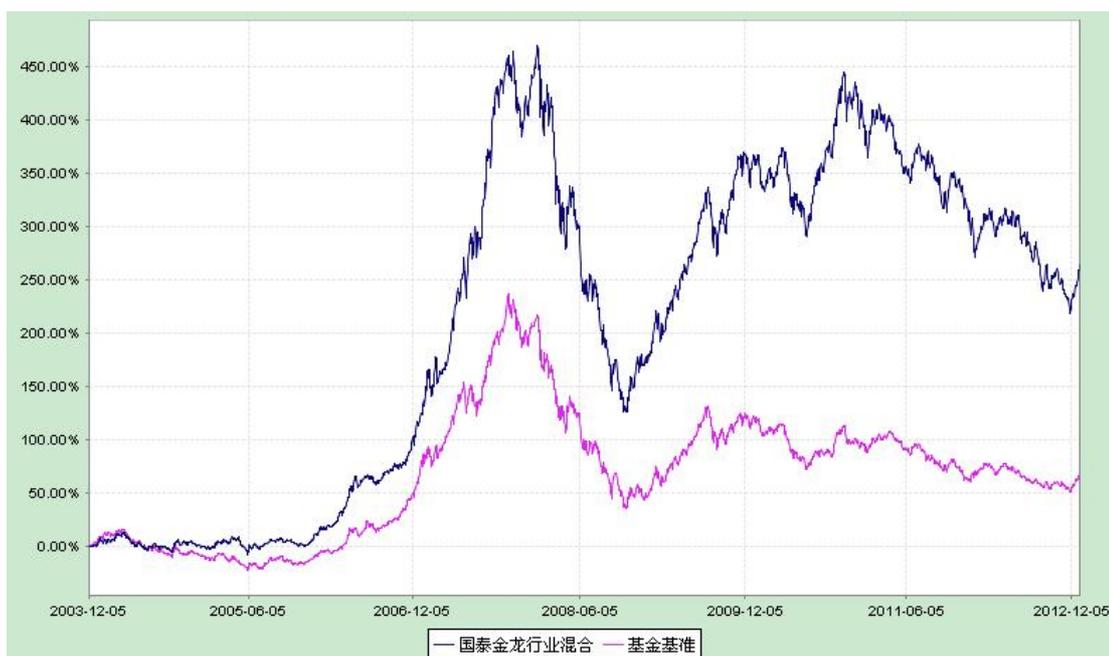
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.08%	0.89%	6.81%	0.82%	-3.73%	0.07%

#### 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 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		
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 年四季度，A 股市场呈现出先抑后扬的走势，宏观经济的逐月企稳为市场的反转埋下了伏笔，而新一届党和国家领导人的一系列宣言也极大的激发了市场对未来经济形势重归强势的美好憧憬和积极心态。四季度，本基金逐步减持了白酒等年内涨幅较大的行业及个股，并逐步提高了家电、零售、纺织服装等低估值的消费及成长行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2012 年四季度的净值增长率为 3.08%，同期业绩比较基准收益率为 6.81%。

### 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 2013 年一季度，GDP 增速将有望在四季度逐月回升之后维持在一个相对稳定的阶段，而市场在经历了去年 12 月的单边连续大涨之后，下一步的聚焦点很可能集中在两个方面：一是经济回升的持续性，是否还会再次回落；二是政府推进改革的力度与速度，是否能达到之前市场的预期。但不管一季度 A 股市场是否发生调整，本基金相信，2013 年全年的宏观经济及股票市场的整体形势将好于过去的一年，因此任何市场调整都将是把握全年行情的重要买入机会。站在新的一年的起点，本基金将高度关注经济形势发生的变化，以及新一届政府推进改革的进程，谨记过去一年犯过的错

误，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	264,181,333.62	63.54
	其中：股票	264,181,333.62	63.54
2	固定收益投资	84,849,846.20	20.41
	其中：债券	84,849,846.20	20.41
	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	63,894,211.55	15.37
6	其他各项资产	2,852,672.89	0.69
7	合计	415,778,064.26	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	13,333,024.63	3.46
C	制造业	136,477,260.11	35.40
C0	食品、饮料	14,964,339.10	3.88

C1	纺织、服装、皮毛	11,519,632.00	2.99
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	21,610,624.61	5.61
C5	电子	13,228,894.56	3.43
C6	金属、非金属	25,860,544.42	6.71
C7	机械、设备、仪表	49,293,225.42	12.79
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	27,712,143.62	7.19
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	13,799,441.12	3.58
G	信息技术业	14,605,600.70	3.79
H	批发和零售贸易	26,978,039.00	7.00
I	金融、保险业	19,736,685.00	5.12
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	11,539,139.44	2.99
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	264,181,333.62	68.52

### 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	601601	中国太保	877,186	19,736,685.00	5.12
2	002226	江南化工	1,308,925	15,929,617.25	4.13
3	600335	国机汽车	1,209,422	15,129,869.22	3.92

4	601333	广深铁路	4,725,836	13,799,441.12	3.58
5	600292	九龙电力	1,083,823	13,634,493.34	3.54
6	600060	海信电器	1,308,496	13,228,894.56	3.43
7	600011	华能国际	1,646,715	11,757,545.10	3.05
8	601117	中国化学	1,400,381	11,539,139.44	2.99
9	002029	七匹狼	610,150	11,519,632.00	2.99
10	600388	龙净环保	515,731	11,294,508.90	2.93

#### 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	64,851,846.20	16.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,998,000.00	5.19
	其中：政策性金融债	19,998,000.00	5.19
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	84,849,846.20	22.01

#### 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	8.21

2	030201	03国开01	200,000	19,998,000.00	5.19
3	019202	12国债02	138,000	13,805,520.00	3.58
4	010308	03国债(8)	123,690	12,412,291.50	3.22
5	019006	10国债06	60,000	5,986,200.00	1.55

### 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	1,858,214.88
5	应收申购款	244,458.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,852,672.89
---	----	--------------

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	893,107,974.12
本报告期基金总申购份额	41,542,539.86
减：本报告期基金总赎回份额	48,460,793.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	886,189,720.72

**§ 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

二〇一三年一月十九日