

国泰金龙系列证券投资基金

2013 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）

2013 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：二〇一三年四月二十二日

国泰金龙债券证券投资基金 2013 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 2013 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 2013 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	3,141,026,933.23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	2,117,044,696.88份	1,023,982,236.35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(2013年1月1日-2013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	33,801,839.32	15,876,530.20
2. 本期利润	51,117,905.40	23,884,052.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0236	0.0223
4. 期末基金资产净值	2,196,795,359.85	1,060,967,802.82
5. 期末基金份额净值	1.038	1.036

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	2.31%	0.07%	1.64%	0.03%	0.67%	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	2.20%	0.06%	1.64%	0.03%	0.56%	0.03%

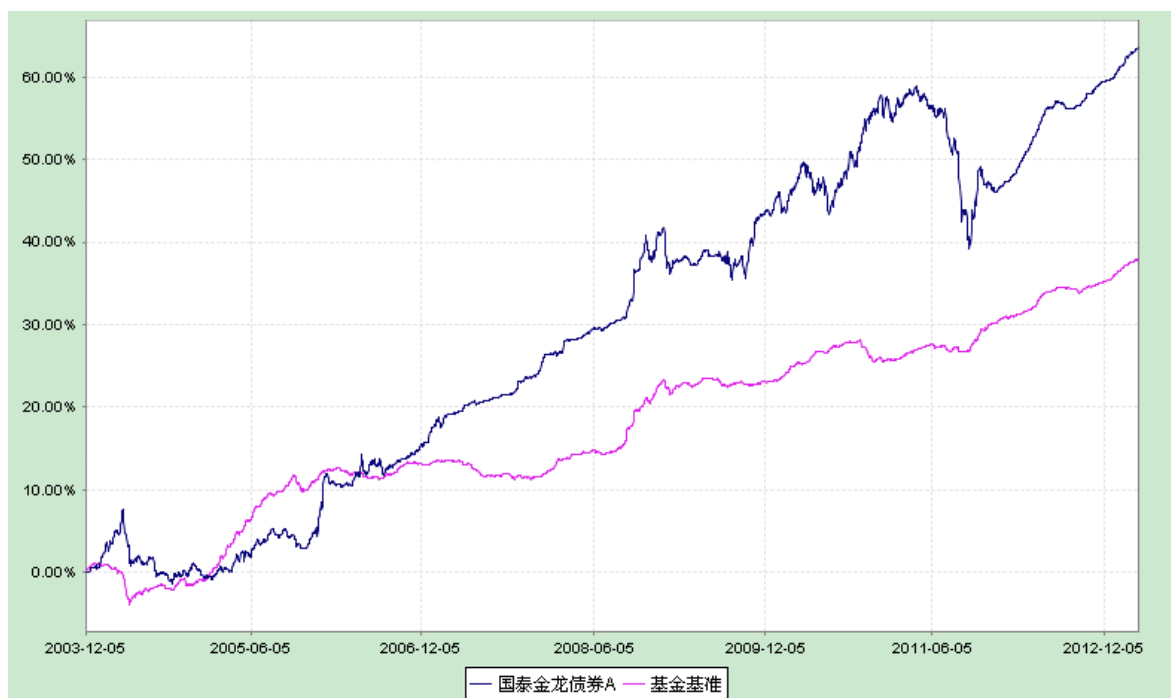
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

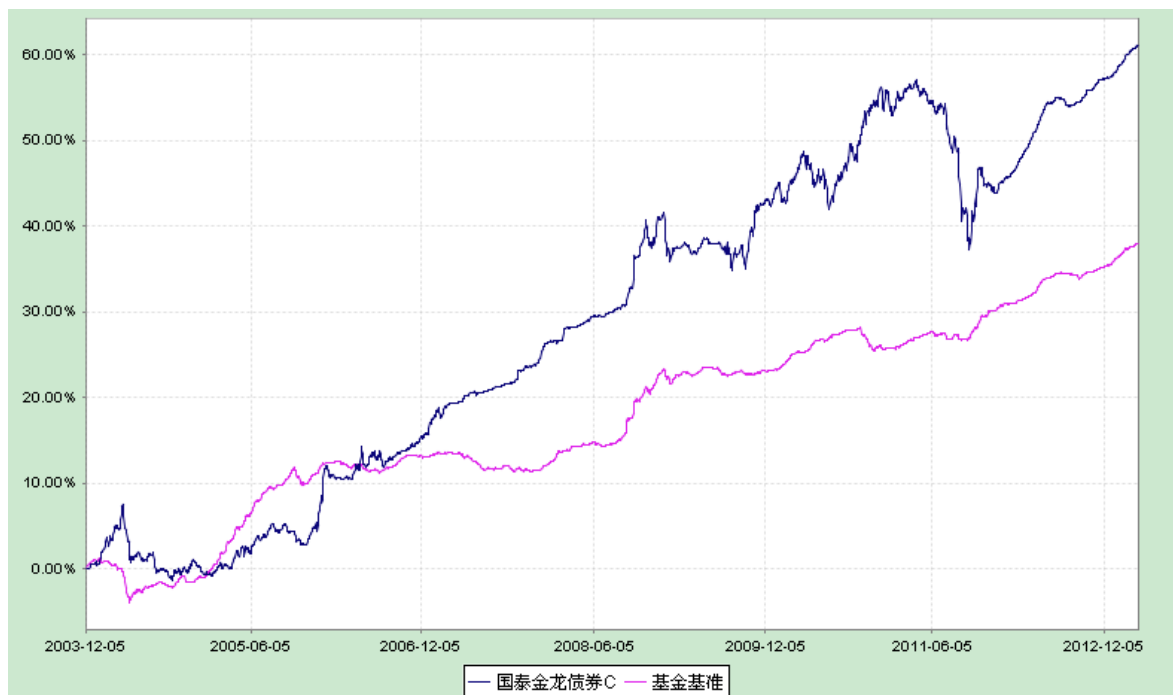
(2003 年 12 月 5 日至 2013 年 3 月 31 日)

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	-	11	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

2013 年一季度国内宏观经济形势处于弱复苏的态势，由于劳动年龄人口增长放

缓、外需疲软以及转变经济发展方式使得经济刺激政策作用有限，在当前结构性和周期性因素的综合影响下，我们认为潜在经济增速可能出现阶段性放缓。2 月份官方 PMI 回落 0.3 个百分点至 50.1%，主要因 PMI 新订单和新出口订单回落幅度较大所致，但从 PMI 季节性规律来看，2 月 PMI 回落符合季节性走势。基建投资继续发力，1-2 月份，基建投资同比增长 23.2%，较去年同期高 25 个百分点，较去年 12 月份高 8.5 个百分点，是支撑固定资产投资平稳增长的主要因素。受结构性调整打压的影响，制造业投资表现较弱，1-2 月份制造业同比增速为 17%，较去年 12 月份回落 4.8 个百分点。与此同时，今年 2 月份 CPI 同比达到 3.2% 的水平，显著超过市场一致预期，主要因非食品价格环比高于季节性涨幅，反映出劳动力成本、资源品、部分非贸易品存在趋势性上涨压力，通胀对需求扩张和政策刺激的敏感性在上升。在此背景下货币政策一改前期宽松态势偏向中性，但资金面仍然充裕。股票市场一季度大幅上涨。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四季度末下行超过 30 个 bp。

本基金在四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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 类在 2013 年第一季度的净值增长率为 2.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.64%。国泰金龙债券 C 类在 2013 年第一季度的净值增长率为 2.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.64%。

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 年二季度国内经济有望继续小幅回升，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，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。今年 1 月外汇占款增量显著超预期、国内房地产价格继续上涨、以及非食品价格超预期上涨导致的通胀预期都使得央行更有可能采取谨慎偏紧的货币政策立场。

2013 年二季度预计票息将成为债券市场主要收益来源；资金面波动和通胀预期或加大信用债调整风险，信用利差有从历史偏低水平向历史中位数恢复的需要。而且在

短期供给压力较大时，不排除利差短时冲高到中位数以上的可能。

2013 年二季度本基金我们将适当收缩组合久期，维持一定波段操作；权益类资产维持谨慎的投资策略，积极降低组合波动率，继续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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,375,565,648.78	95.20
	其中：债券	4,375,565,648.78	95.20
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	102,288,754.45	2.23
7	其他各项资产	118,236,772.04	2.57
8	合计	4,596,091,175.27	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	161,328,833.20	4.95

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,097,862,815.58	64.40
5	企业短期融资券	2,116,374,000.00	64.96
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,375,565,648.78	134.31

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	101,190,000.00	3.11
2	019219	12国债19	860,000	86,197,800.00	2.65
3	041253055	12太西煤 CP002	700,000	70,686,000.00	2.17
4	112056	11远兴债	627,400	65,870,098.60	2.02
5	122776	11新光债	601,050	63,705,289.50	1.96

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	87,221.43
2	应收证券清算款	22,627,767.13
3	应收股利	-
4	应收利息	95,051,802.70
5	应收申购款	469,980.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,236,772.04

5.9.4 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。

5.9.5 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	2,143,269,903.08	1,497,228,402.92
本报告期基金总申购份额	417,717,886.26	584,579,819.18
减：本报告期基金总赎回份额	443,943,092.46	1,057,825,985.75

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,117,044,696.88	1,023,982,236.35

§ 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

二〇一三年四月二十二日

国泰金龙行业精选证券投资基金 2013 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 2013 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 2013 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	853,760,356.52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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	26,036,873.07
2.本期利润	14,261,328.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0164
4.期末基金资产净值	385,203,391.94
5.期末基金份额净值	0.451

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

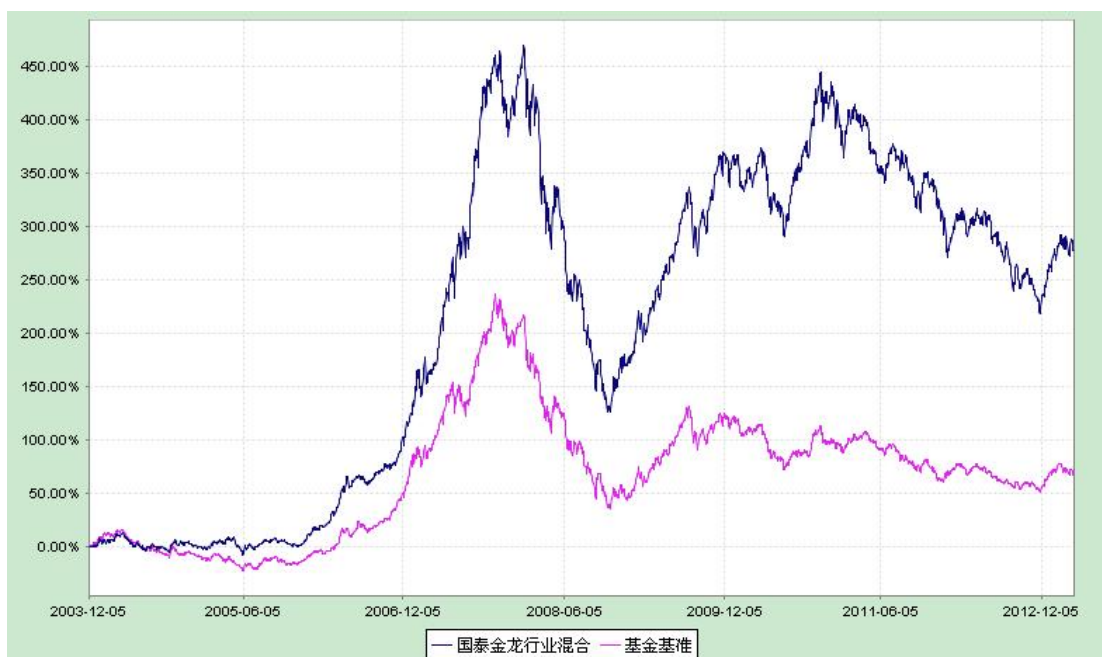
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.68%	1.17%	-0.92%	0.96%	4.60%	0.21%

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 2013 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		
周广山	本基金的 基金 经理	2012-1-19	-	9	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、国泰估值优势股票(LOF)（原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	-	19	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股票型证券投资基金（原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

2013 年一季度，中国经济持续反弹的力度出现了逐步弱化的迹象，经济弱复苏的格局似乎已得到市场的一致确认，另一方面，房地产价格的持续上涨招致了中央政府压制房价的强力措施，也导致市场对中国经济下一步增长幅度产生了担忧。一季度 A 股市场呈现出先扬后抑的走势，以医药、TMT、家电为代表的消费成长股走势强劲，而大部分周期类行业则在季度后半段出现了较大的调整。本基金在一季度逐步增持了家电、TMT、汽车和医药行业，逐步减持了钢铁等周期性行业以及装饰、零售、纺织服装等利润增速出现下降的消费成长行业，同时也因预期兑现而逐步减持了前期布局的环保和铁路相关个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2013 年第一季度的净值增长率为 3.68%，同期业绩比较基准收益率为 -0.92%。

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 年二季度，本基金认为，尽管一季度经济增长的很多数据不如期望般强劲，但企业利润增速、银行信贷增长等关键数据依然可圈可点，另一方面，新一届

政府雷厉风行，很多改革措施推动的速度和力度都超出市场预期，这将十分有利于提高市场对中国经济未来增长前景的信心。因此，本基金认为，二季度的经济形势并不值得悲观，而 A 股市场在二季度仍然有众多的投资机会值得期待，无论是继续高速增长的消费成长类行业和个股，还是业绩明显改善的周期类行业和个股，都将会有不错的表现机会。本基金在二季度将继续努力，争取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	283,489,950.16	69.56
	其中：股票	283,489,950.16	69.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	90,395,808.00	22.18
	其中：债券	90,395,808.00	22.18
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	31,897,274.54	7.83
7	其他各项资产	1,782,623.00	0.44
8	合计	407,565,655.70	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	采矿业	11,362,565.68	2.95
C	制造业	192,003,486.50	49.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	43,883,982.26	11.39
F	批发和零售业	6,799,797.76	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	18,043,645.72	4.68
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,396,472.24	2.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	283,489,950.16	73.59

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	000651	格力电器	798,975	22,826,715.75	5.93

2	601117	中国化学	2,100,771	19,495,154.88	5.06
3	002035	华帝股份	1,150,350	12,630,843.00	3.28
4	600060	海信电器	979,842	12,473,388.66	3.24
5	002140	东华科技	430,016	12,461,863.68	3.24
6	600201	金宇集团	661,298	11,843,847.18	3.07
7	000521	美菱电器	2,814,230	11,650,912.20	3.02
8	601633	长城汽车	355,479	11,538,848.34	3.00
9	002664	信质电机	499,026	11,502,549.30	2.99
10	002450	康得新	359,304	11,497,728.00	2.98

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	90,395,808.00	23.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	90,395,808.00	23.47

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	019302	13国债02	460,000	46,119,600.00	11.97
2	010308	03国债(8)	231,900	23,264,208.00	6.04
3	130002	13付息国债02	100,000	10,014,000.00	2.60
4	030002	03国债02	100,000	10,001,000.00	2.60
5	019035	10国债35	10,000	997,000.00	0.26

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	489,555.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	998,754.28
5	应收申购款	294,313.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,782,623.00

5.9.4 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。

5.9.5 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	886,189,720.72
本报告期基金总申购份额	34,206,995.59
减：本报告期基金总赎回份额	66,636,359.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	853,760,356.52

§ 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
二〇一三年四月二十二日