

国泰金龙系列证券投资基金

2011 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）

2011 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：二〇一一年四月二十二日

国泰金龙债券证券投资基金2011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 2011 年 4 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 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	200,249,017.88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	152,641,497.18份	47,607,520.70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1月1日-2011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	3,763,190.96	983,017.11
2. 本期利润	1,512,328.11	273,665.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0090	0.0062
4. 期末基金资产净值	160,610,973.16	49,976,958.31
5. 期末基金份额净值	1.052	1.050

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	业绩比较基准	业绩比较基准	①—③	②—④
----	--------	--------	--------	--------	-----	-----

		准差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三个月	0.72%	0.23%	0.79%	0.04%	-0.07%	0.19%

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	0.62%	0.23%	0.79%	0.04%	-0.17%	0.19%

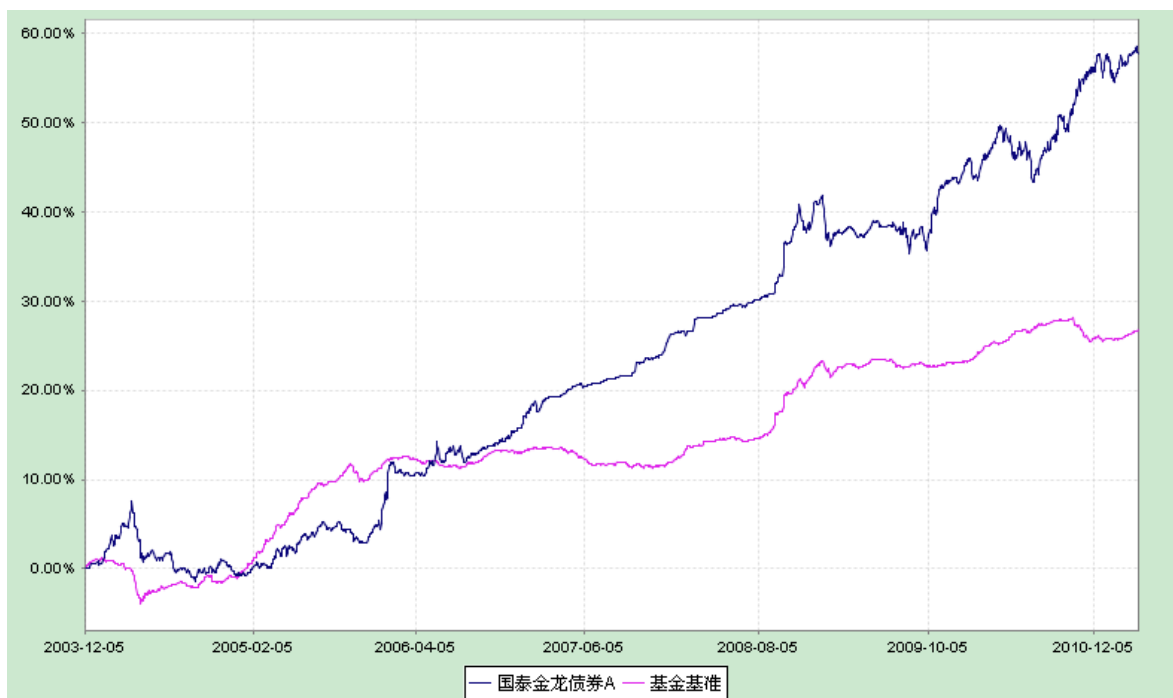
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

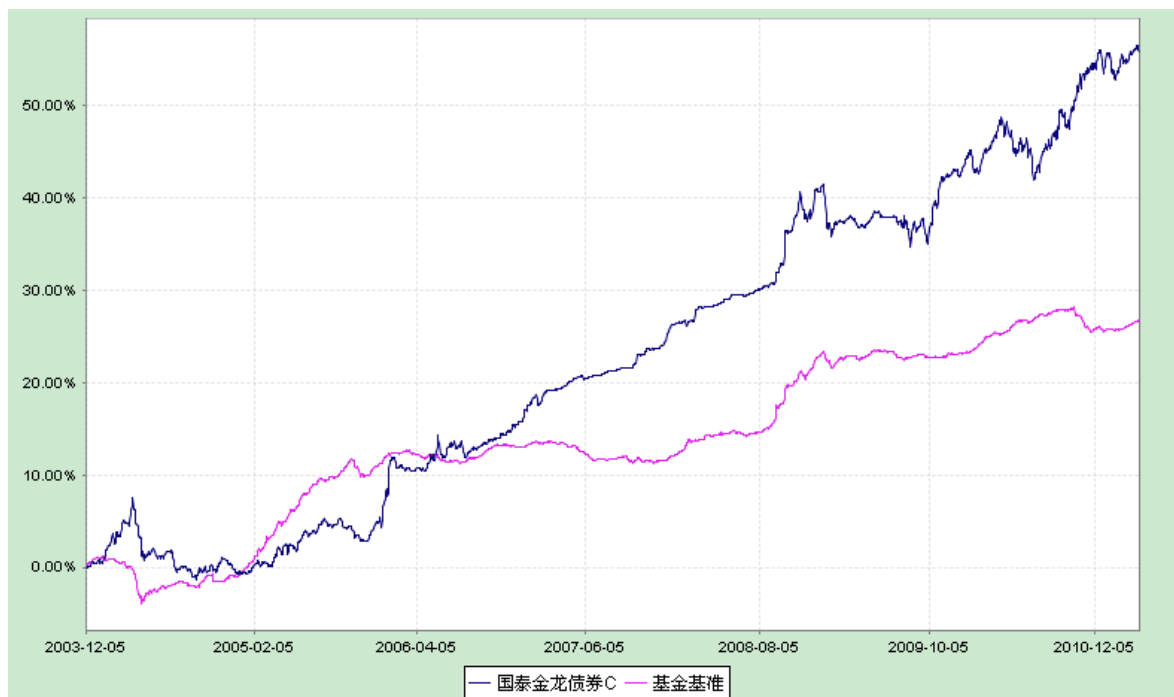
(2003 年 12 月 5 日至 2011 年 3 月 31 日)

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月起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

一季度宏观经济增速有所下滑，出口、消费以及投资增速都有不同程度的下滑。CPI 以及与之相伴的货币紧缩预期成为左右一季度资本市场走势的最主要因素。由于一季度恰逢 CPI 权重调整，CPI 数据出乎市场大多数投资者的预期，股票市场随之大

幅波动，市场风格显著转换，去年表现较佳的小盘股大幅下挫，而大盘股表现抢眼。债券市场在经历了初期的小幅下跌后企稳反弹，10 年期国债收益率下行 10 个 bp 左右。转债市场前期受中石化转债发行，转债市场扩容压制持续下跌，后期随以银行为主的大盘正股的上涨而有所反弹。

一季度本基金债券部分适当拉长了组合久期，增大信用债投资力度。权益类资产仓位变动相对较大，在 1 月初进行了较大幅度的减仓操作，较好地规避了 1 月中旬开始的小盘股大幅调整。同时我们在严控风险的前提下有选择地适度参与新股申购以及公开增发，提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 在 2011 年一季度的净值增长率为 0.72%，国泰金龙债券 C 在 2011 年一季度的净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计二季度经济增速将进一步下滑，受房地产调控影响，投资增速将继续下行；通胀持续高位将带来消费需求的下降；受日本核泄漏危机和欧元区主权债务危机蔓延的影响，出口形势同样不能过于乐观。食品价格维持高位，中东局势乱象进一步推高原油价格都使得二季度通胀难以有明显下降。市场将在经济增速放缓和与之相应的紧缩货币政策放松的预期的博弈中前行。货币政策二季度进一步紧缩仍然是大概率事件，分歧在于政策出台的力道以及频率。数量工具、存款准备金率调整和针对新上项目的行政性手段仍然将是政府应对投资过热风险和平抑居民通胀预期的主要手段。加息也仍然存在空间。预计二季度股票市场将震荡整理，而债券市场虽然受货币政策调整影响更为直接，但由于已经开始逐步进入加息末期，调整空间将较为有限，信用债券由于绝对收益较高可能会有较好表现。

本基金将采取中性债券久期，类属资产配置方面适当增加信用产品的配置力度；权益类资产维持灵活、积极的投资策略，同时注重不同风格资产配置的相对均衡。在控制风险的前提下适当参与新股发行以及公开增发等，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	15,577,341.03	7.16
	其中：股票	15,577,341.03	7.16
2	固定收益投资	170,927,220.24	78.51
	其中：债券	170,927,220.24	78.51
	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	26,787,722.83	12.30
6	其他各项资产	4,408,177.29	2.02
7	合计	217,700,461.39	100.00

注：股票市值为新股中签或可转债转股产生。

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	2,842,264.13	1.35
B	采掘业	-	-
C	制造业	10,321,965.54	4.90
C0	食品、饮料	935,244.20	0.44
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	4,370,138.08	2.08
C6	金属、非金属	1,347,320.00	0.64
C7	机械、设备、仪表	3,669,263.26	1.74
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	461,140.96	0.22
E	建筑业	797,192.40	0.38
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	138,488.00	0.07
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	1,016,290.00	0.48
M	综合类	-	-
	合计	15,577,341.03	7.40

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	300118	东方日升	134,218	4,370,138.08	2.08
2	601118	海南橡胶	153,943	1,901,196.05	0.90
3	601700	风范股份	65,952	1,869,079.68	0.89
4	300137	先河环保	52,080	1,427,512.80	0.68
5	002501	利源铝业	26,000	1,347,320.00	0.64
6	300133	华策影视	11,000	1,016,290.00	0.48
7	002477	雏鹰农牧	17,466	941,068.08	0.45
8	002481	双塔食品	30,140	935,244.20	0.44
9	002482	广田股份	11,758	797,192.40	0.38
10	601199	江南水务	25,144	461,140.96	0.22

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	78,524,014.80	37.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	65,273,885.60	31.00
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	27,129,319.84	12.88
7	其他	-	-
8	合计	170,927,220.24	81.17

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	010110	21国债(10)	277,030	27,714,081.20	13.16
2	019021	10国债21	200,000	19,984,000.00	9.49
3	010112	21国债(12)	123,000	12,309,840.00	5.85
4	113001	中行转债	102,000	10,920,120.00	5.19
5	122863	10榆城投	100,000	10,500,000.00	4.99

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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	476,303.40
3	应收股利	-
4	应收利息	2,223,578.60

5	应收申购款	1,458,295.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,408,177.29

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	10,920,120.00	5.19
2	113002	工行转债	8,566,432.80	4.07
3	128233	塔牌转债	4,295,370.00	2.04

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601118	海南橡胶	1,901,196.05	0.90	新股网下申购
2	601700	风范股份	1,869,079.68	0.89	新股网下申购
3	601199	江南水务	461,140.96	0.22	新股网下申购

§ 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	151,544,378.15	43,934,699.62
本报告期基金总申购份额	86,197,546.20	26,180,812.74
减：本报告期基金总赎回份额	85,100,427.17	22,507,991.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	152,641,497.18	47,607,520.70

§ 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

二〇一一年四月二十二日

国泰金龙行业精选证券投资基金 2011 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 2011 年 4 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 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	917,837,738.05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1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	24,534,307.15
2.本期利润	-35,071,645.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0412
4.期末基金资产净值	539,749,436.28
5.期末基金份额净值	0.588

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

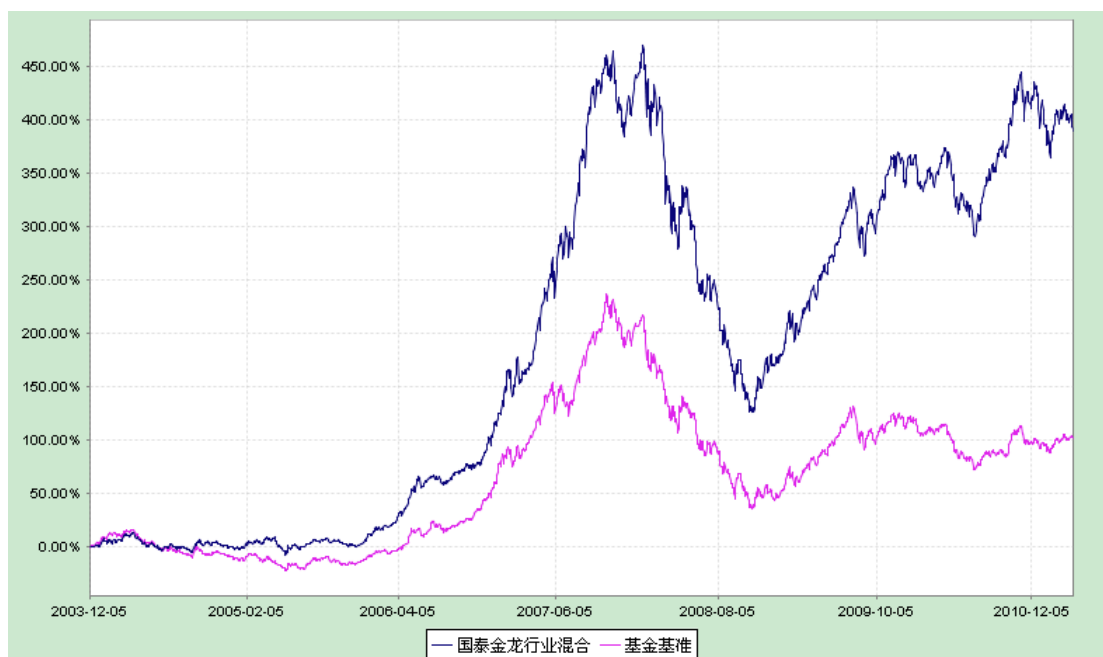
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.46%	1.13%	3.16%	0.87%	-7.62%	0.26%

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 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	本基金的基金经理， 国泰金	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

	鑫封闭 的基金 经理				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。
--	------------------	--	--	--	---

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

2011 年一季度年 A 股市场总体走势平稳，结构差异较大，低估值的周期类品种表现较好，医药、食品饮料等消费品跌幅较大，与 2010 年的风格特征迥异，今年以来中小市值股票普遍走弱。一季度本基金积极进行了结构调整，方向主要是增持了低估值的机械、金融和地产行业，降低了医药、食品饮料和 TMT 等行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2011 年一季度的净值增长率为-4.46%，同期业绩比较基准收益率为 3.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，世界经济继续改善，主要经济体可能逐步推出宽松的货币政策；国内经济方面，全年对投资决策影响最大的因素就是通胀以及政府所采取的应对政策，现在由主要担心通胀转为担心“滞胀”，因此市场形成政策适度放松的预期，暂时对市场形成一定支撑，政策走向仍是相机抉择，对股票市场的方向指引仍有待观察。

我们判断 2011 年投资机会更多来自于盈利超预期而非估值提升，市场偏好由追捧成长性转向看重估值。基于上述判断，本基金将在二季度维持中性的股票配置，选取低估值的品种构建组合，行业选择重点关注具有国际竞争优势及符合国家战略的海外工程建设、先进装备制造业；此外，在调结构的背景下，符合经济结构转型政策方向的大消费仍然是本基金重点关注的领域。

§ 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	399,766,925.61	71.80
	其中：股票	399,766,925.61	71.80
2	固定收益投资	120,272,900.00	21.60
	其中：债券	120,272,900.00	21.60
	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	11,603,514.85	2.08
6	其他各项资产	25,140,127.10	4.52
7	合计	556,783,467.56	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	42,021,040.99	7.79
C	制造业	165,747,779.02	30.71
C0	食品、饮料	11,883,500.00	2.20
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	9,774,989.72	1.81
C5	电子	8,580,000.00	1.59
C6	金属、非金属	18,823,639.25	3.49
C7	机械、设备、仪表	105,092,967.87	19.47
C8	医药、生物制品	11,592,682.18	2.15
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,650,792.63	1.42

E	建筑业	44,136,398.22	8.18
F	交通运输、仓储业	11,089,520.76	2.05
G	信息技术业	19,118,052.04	3.54
H	批发和零售贸易	20,644,483.57	3.82
I	金融、保险业	52,060,255.72	9.65
J	房地产业	8,026,640.16	1.49
K	社会服务业	18,650,000.00	3.46
L	传播与文化产业	4,612,598.50	0.85
M	综合类	6,009,364.00	1.11
	合计	399,766,925.61	74.07

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	600031	三一重工	881,120	24,600,870.40	4.56
2	600970	中材国际	561,394	24,538,531.74	4.55
3	600089	特变电工	1,121,074	22,690,537.76	4.20
4	002024	苏宁电器	1,609,079	20,644,483.57	3.82
5	600763	通策医疗	1,000,000	18,650,000.00	3.46
6	600036	招商银行	1,208,522	17,028,074.98	3.15
7	600030	中信证券	1,192,187	16,654,852.39	3.09
8	601166	兴业银行	552,885	15,873,328.35	2.94
9	600535	天士力	321,038	11,592,682.18	2.15
10	600348	国阳新能	444,304	11,574,119.20	2.14

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	100,223,200.00	18.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,906,000.00	3.69
	其中：政策性金融债	19,906,000.00	3.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	143,700.00	0.03
7	其他	-	-
8	合计	120,272,900.00	22.28

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	020042	10贴债16	600,000	59,280,000.00	10.98
2	010110	21国债(10)	230,000	23,009,200.00	4.26
3	030201	03国开01	200,000	19,906,000.00	3.69
4	010203	02国债(3)	80,000	7,953,600.00	1.47
5	010308	03国债(8)	60,000	5,977,200.00	1.11

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	2,249,922.99
2	应收证券清算款	15,885,132.47
3	应收股利	-
4	应收利息	1,233,667.51
5	应收申购款	5,771,404.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,140,127.10

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	652,393,111.62
本报告期基金总申购份额	490,119,639.50

减：本报告期基金总赎回份额	224,675,013.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	917,837,738.05

§ 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

二〇一一年四月二十二日