

国泰金龙系列证券投资基金

2009 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)

2009 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：二〇一〇年一月二十日

国泰金龙债券证券投资基金2009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 2010 年 1 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 2009 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
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	238, 241, 412. 91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	175, 449, 433. 66 份	62, 791, 979. 25 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(2009年10月1日-2009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	6, 417, 746. 70	2, 719, 925. 90
2. 本期利润	11, 391, 113. 43	4, 818, 760. 36
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0629	0. 0570
4. 期末基金资产净值	185, 748, 331. 69	66, 046, 446. 17
5. 期末基金份额净值	1. 059	1. 052

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	6. 01%	0. 25%	0. 36%	0. 04%	5. 65%	0. 21%

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	5.84%	0.25%	0.36%	0.04%	5.48%	0.21%

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 2009 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		
陈强	本基金的基金经理、国泰金鹿保本混合（二期）的基金经理	2009-3-27	-	12	硕士。曾任职于中行辽宁省分行、大连市商业银行、汉唐证券。2004 年 11 月加盟国泰基金管理有限公司，2004 年 11 月至 2006 年 10 月任国泰金象保本基金的基金经理助理，2005 年 6 月至 2006 年 10 月兼任国泰货币的基金经理助理，2006 年 11 月至 2007 年 11 月任国泰金象保本基金的基金经理。2008 年 8 月起担任国泰金鹿保本混合（二期）的基金经理。2009 年 3 月起兼担任国泰金龙债券的基金经理。

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

(1) 2009 年第四季度证券市场与投资管理回顾

四季度，迪拜世界债务违约事件引发了全球主权信用危机，希腊、西班牙、葡萄牙、墨西哥等国家，或被下调主权信用评级，或被下调展望级别，主权信用危机导致国际资本纷纷从风险资产撤出转向美元资产。同时，美国失业率等数据走坏的趋势暂时停止，美国加息预期有所提前，美元套息交易面临风险，部分资金平掉套息头寸，资金回流美国。上述几方面因素影响下，美元出现较强的反弹，全球资本市场及大宗商品价格上涨的趋势得到了一定的压制。挪威、以色列、澳大利亚已经开始加息，主动实施紧缩政策。

国内经济继续保持较强的复苏势头，中央经济工作会议确定继续保持经济刺激政策力度，但结构上有保有控。四季度 CPI 由负转正，通胀预期增强，热钱流入增加。

为防止资产泡沫，中国政策由宽松转向适度宽松，公开市场加大了回笼力度，但维持较低市场利率，银行信贷结构性调整，房地产政策全面收紧。

四季度股票市场震荡上升，债券市场相对平静，虽然经济数据不断向好，CPI 由负转正等宏观面利空，但由于银行、保险等金融机构年底资金充裕，债券资产配置需求旺盛，债券市场总体保持稳定，信用债表现较好。

四季度，本基金实施债券资产稳健防御，权益资产积极灵活的投资策略，提高组合的灵活性和进攻性，通过股票公开增发、新股申购、可转债发行上市等低风险套利机会，果断出击，取得了较好的效果。债券资产保持了低久期策略，结构上以国债及信用债为主。

(2) 2010 年第一季度证券市场及投资管理展望

虽然全球经济复苏势头确定，但美国经济复苏的过程还很漫长，因此，美联储延迟加息有利于美国经济的复苏。美元升值势头将暂时告一段落，预计将在一段时间内保持震荡。大宗商品价格始终保持强势，说明实体经济需求和通胀预期在上升。我国经济将继续保持良好势头，但通胀预期将显著增强，一季度又将是我国银行信贷集中发放时期，如果信贷增速保持合理水平，货币政策不会有大的变动，如果信贷发放过量，不排除央行加大回收流动性的力度。

总体来说，一季度实体经济和资本市场资金相对充裕，金融机构债券资产配置需求减少，权益类资产投资机会大于债券市场。因此，一季度，本基金资产配置策略仍将采取债券稳健防御，权益类资产灵活、积极的投资策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 在 2009 年四季度的净值增长率为 6.01%，同期业绩比较基准为 0.36%。

国泰金龙债券 C 在 2009 年四季度的净值增长率为 5.84%，同期业绩比较基准为 0.36%。

§ 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	21,116,975.58	5.84
	其中：股票	21,116,975.58	5.84
2	固定收益投资	219,767,478.44	60.82
	其中：债券	219,767,478.44	60.82
	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	104,453,069.96	28.91
6	其他资产	15,980,226.74	4.42
7	合计	361,317,750.72	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	6,697,791.95	2.66
C0	食品、饮料	1,248,635.10	0.50
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	1,745,980.00	0.69
C5	电子	293,777.40	0.12
C6	金属、非金属	317,592.00	0.13
C7	机械、设备、仪表	2,754,367.26	1.09

C8	医药、生物制品	337,440.19	0.13
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,319,780.56	0.52
E	建筑业	1,516,590.96	0.60
F	交通运输、仓储业	7,548,930.36	3.00
G	信息技术业	776,654.91	0.31
H	批发和零售贸易	—	—
I	金融、保险业	—	—
J	房地产业	1,963,879.68	0.78
K	社会服务业	561,338.58	0.22
L	传播与文化产业	732,008.58	0.29
M	综合类	—	—
	合计	21,116,975.58	8.39

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	600033	福建高速	953,000	6,289,800.00	2.50
2	600173	卧龙地产	146,122	1,963,879.68	0.78
3	600312	平高电气	127,284	1,961,446.44	0.78
4	600725	云维股份	79,000	1,685,070.00	0.67
5	601618	中国中冶	265,788	1,440,570.96	0.57
6	601139	深圳燃气	78,652	1,319,780.56	0.52
7	002320	海峡股份	24,602	1,259,130.36	0.50
8	002329	皇氏乳业	37,801	759,800.10	0.30
9	300027	华谊兄弟	13,206	732,008.58	0.29
10	601888	中国国旅	26,807	561,338.58	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	100,636,441.60	39.97
2	央行票据	20,058,000.00	7.97

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	88,986,728.72	35.34
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	10,086,308.12	4.01
7	其他	-	-
8	合计	219,767,478.44	87.28

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	010112	21国债(12)	421,360	43,210,468.00	17.16
2	010110	21国债(10)	312,680	31,984,037.20	12.70
3	010203	02国债(3)	251,080	25,441,936.40	10.10
4	0701016	07央行票据16	200,000	20,058,000.00	7.97
5	122974	09镇城投	200,520	19,628,902.80	7.80

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	-

3	应收股利	-
4	应收利息	3,379,392.01
5	应收申购款	12,350,816.41
6	其他应收款	18.32
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,980,226.74

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	125960	锡业转债	3,006,798.52	1.19
2	110567	山鹰转债	454,507.20	0.18

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	601139	深圳燃气	1,319,780.56	0.52	新股网下申购
2	002320	海峡股份	1,259,130.36	0.50	新股网下申购
3	002329	皇氏乳业	759,800.10	0.30	新股网下申购
4	300027	华谊兄弟	732,008.58	0.29	新股网下申购
5	601888	中国国旅	561,338.58	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
报告期期初基金份额总额	203,456,459.54	92,027,331.76
报告期期间基金总申购份额	127,797,754.12	46,074,168.47
报告期期间基金总赎回份额	155,804,780.00	75,309,520.98
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少）	-	-

以“-”填列)		
报告期期末基金份额总额	175, 449, 433. 66	62, 791, 979. 25

§ 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、上海浦东发展银行证券交易资金结算协议
- 5、国泰金龙系列证券投资基金年度报告、半年度报告及收益分配公告
- 6、国泰金龙系列证券投资基金代销协议
- 7、报告期内披露的各项公告
- 8、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

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

投资者查阅方式：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

二〇一〇年一月二十日

国泰金龙行业精选证券投资基金 2009 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 2010 年 1 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 2009 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
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	533,111,765.72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(2009年10月1日-2009年12月31日)
1. 本期已实现收益	42,845,894.71
2. 本期利润	72,037,491.98
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1340
4. 期末基金资产净值	489,022,684.01
5. 期末基金份额净值	0.917

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

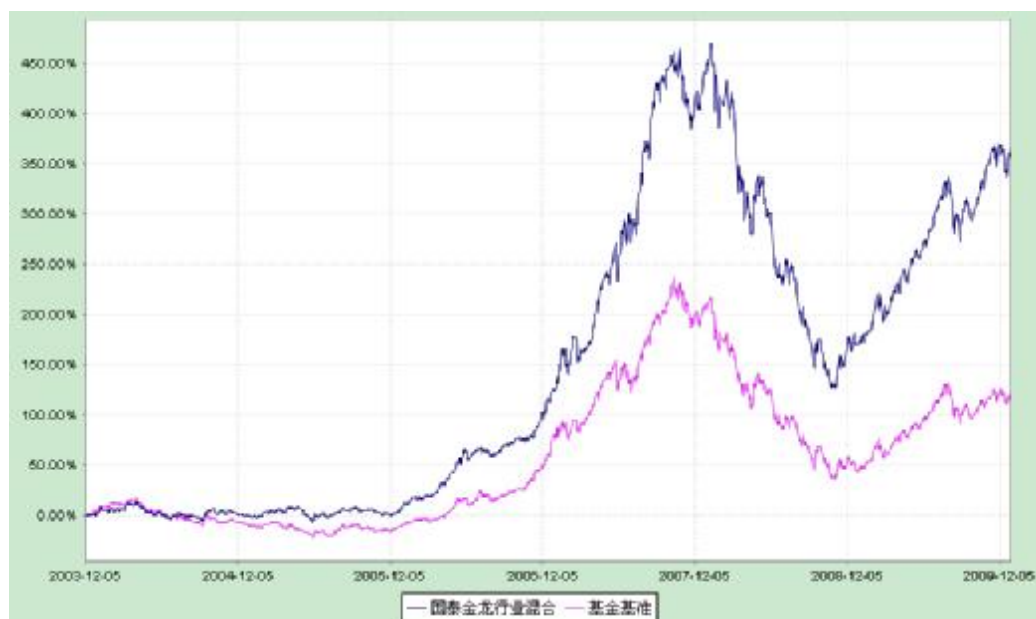
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.26%	1.24%	12.59%	1.21%	4.67%	0.03%

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 2009 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		
王航	本基金的基金经理	2008-5-17	-	12	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月起任国泰金龙行业混合的基金经理。

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

(1) 2009 年第四季度证券市场与投资管理回顾

四季度 A 股市场结束调整再度走强；国际、国内经济企稳迹象明显，随着政策重心从“保增长”逐步向“调结构”转变，以医药、食品饮料为代表的内需板块因其盈利确定性强而继续取得良好的市场表现；中小盘股相对于大盘股的超额收益进一步扩大。四季度本基金收益率 17.26%，同期沪深 300 上涨 19%。根据基金合同规定，本基金于四季度继续保持 75%以下的股票配置比例，重点配置医药、食品饮料等业绩增长确定并符合政策导向的内需板块，增加了煤炭、信息服务等行业的配置，减持了地产、钢铁等行业。

(2) 2010 年第一季度证券市场及投资管理展望

虽然在国际、国内经济向好趋势日益明确的背景下 A 股市场没有大跌的系统性风险，但对于货币、财政政策紧缩的担忧，以及针对个别过热行业的政策调控都会影响市场参与者的预期，进而限制 A 股估值水平提升；在经历 09 年市场大幅上涨后，对企业盈利增速乐观的预期已经基本反映在目前的股价中，市场整体估值处于合理水平，因此 2010 年很可能回到相对均衡期，较难出现显著的趋势性机会，行业配置和个股选择在 2010 年对组合的贡献将重于资产配置，因此本基金在 2010 年仍将保持中性的战略资产配置策略，将组合整体风险控制在较低水平；核心策略仍将围绕“调结构”即经济转型和结构升级这条主线，围绕内需相关板块寻找投资标的，并重点关注通信和信息技术、低碳经济相关投资机会。作为应对策略，对全球流动性依然充裕而导致通胀预期受益的上游资源型行业继续保持适当配置；风格特征方面，盈利模式清晰、成长性好的中小盘品种也将是我们一季度重点布局的投资方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2009 年四季度的净值增长率为 17.26%，同期业绩比较基准为 12.59%。

§ 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	364,459,429.30	71.10
	其中：股票	364,459,429.30	71.10
2	固定收益投资	112,817,952.90	22.01
	其中：债券	112,817,952.90	22.01
	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	29,127,790.54	5.68
6	其他资产	6,181,087.51	1.21
7	合计	512,586,260.25	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	47,216,407.07	9.66
C	制造业	143,269,750.49	29.30
C0	食品、饮料	32,352,213.84	6.62
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	7,197,440.87	1.47
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	38,015,339.80	7.77
C7	机械、设备、仪表	34,826,178.62	7.12
C8	医药、生物制品	30,878,577.36	6.31
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,391,957.62	2.53
F	交通运输、仓储业	1,789,717.70	0.37
G	信息技术业	50,230,994.62	10.27
H	批发和零售贸易	35,856,452.99	7.33
I	金融、保险业	64,044,693.75	13.10
J	房地产业	5,447,185.46	1.11
K	社会服务业	4,212,269.60	0.86
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	364,459,429.30	74.53

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	601318	中国平安	350,196	19,292,297.64	3.95
2	600406	国电南瑞	330,000	16,156,800.00	3.30
3	600704	中大股份	550,000	14,608,000.00	2.99
4	000983	西山煤电	361,209	14,408,627.01	2.95
5	000656	ST 东源	884,001	13,967,215.80	2.86

6	600887	*ST伊利	521,446	13,807,890.08	2.82
7	600348	国阳新能	276,232	13,361,341.84	2.73
8	600970	中材国际	333,386	12,391,957.62	2.53
9	600535	天士力	551,028	12,343,027.20	2.52
10	600993	马应龙	319,524	12,250,550.16	2.51

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	87,624,452.90	17.92
2	央行票据	9,826,000.00	2.01
3	金融债券	15,367,500.00	3.14
	其中：政策性金融债	15,367,500.00	3.14
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	—	—
7	其他	—	—
8	合计	112,817,952.90	23.07

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	010308	03国债(8)	266,650	26,862,321.00	5.49
2	010110	21国债(10)	236,390	24,180,333.10	4.94
3	010004	20国债(4)	192,820	19,436,256.00	3.97
4	080401	08农发01	150,000	15,367,500.00	3.14
5	010203	02国债(3)	108,760	11,020,650.80	2.25

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	1,840,000.00
2	应收证券清算款	938,144.80
3	应收股利	-
4	应收利息	1,744,288.73
5	应收申购款	1,649,971.67
6	其他应收款	8,682.31
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,181,087.51

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情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	531,966,222.62
报告期期间基金总申购份额	105,643,188.62
报告期期间基金总赎回份额	104,497,645.52
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	533,111,765.72

§ 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、上海浦东发展银行证券交易资金结算协议
- 5、国泰金龙系列证券投资基金年度报告、半年度报告及收益分配公告
- 6、国泰金龙系列证券投资基金代销协议
- 7、报告期内披露的各项公告
- 8、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

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

二〇一〇年一月二十日