

国泰金龙系列证券投资基金

2010 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)

2010 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：二〇一〇年十月二十六日

国泰金龙债券证券投资基金2010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 2010 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 2010 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	181,671,888.35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	138,717,767.87份	42,954,120.48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(2010年7月1日-2010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	1,578,901.19	577,107.27
2. 本期利润	6,055,336.20	2,235,433.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0407	0.0389
4. 期末基金资产净值	145,239,426.55	44,769,085.49
5. 期末基金份额净值	1.047	1.042

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	4.08%	0.32%	0.87%	0.04%	3.21%	0.28%

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	3.89%	0.32%	0.87%	0.04%	3.02%	0.28%

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

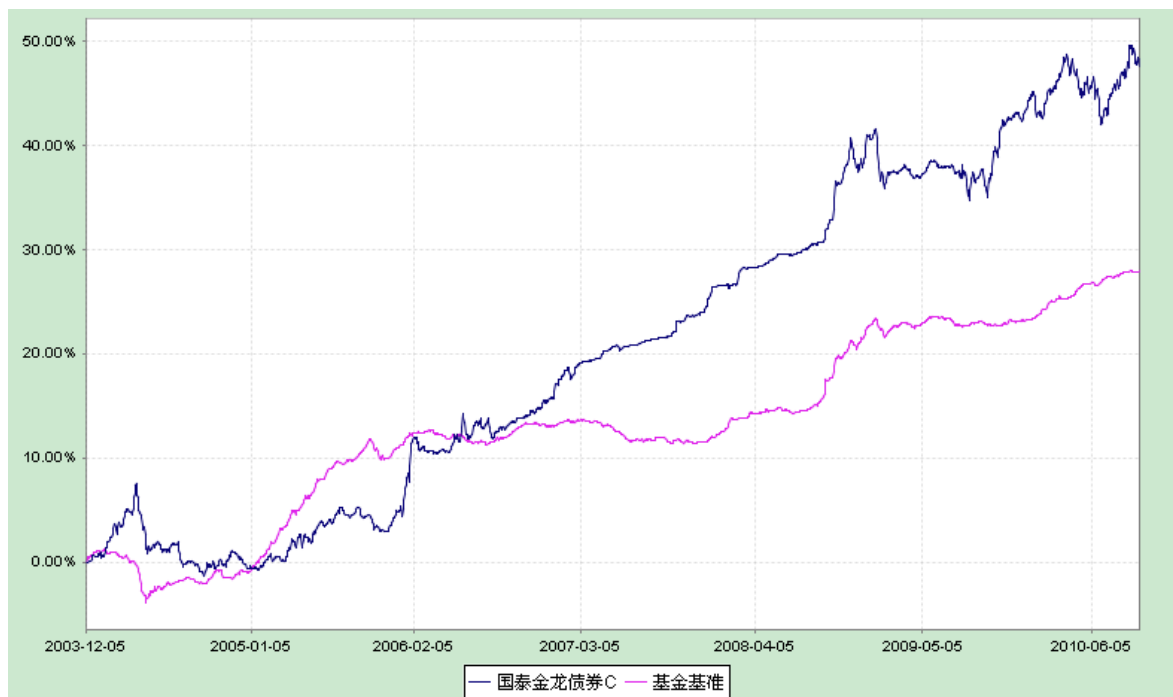
(2003 年 12 月 5 日至 2010 年 9 月 30 日)

1. 国泰金龙债券 A：



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。

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		
陈强	本基金的基金经理	2009-3-27	2010-7-23	13	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月至2010年6月担任国泰金鹿保本混合（二期）的

					基金经理。2009年3月至2010年7月担任国泰金龙债券的基金经理。
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	-	8	硕士，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

三季度宏观经济数据略有所回落，但并没有超出此前市场预期。投资者开始逐步认可在调结构的背景下经济增速在一定程度上回落。CPI 指标虽然持续走高，但市场普遍预计受基数因素影响这一趋势并不能持续，四季度开始通胀将有所回落。同时基于股票市场估值相对合理，三季度股票市场触底反弹，风格有所转换，小盘股受 11 月创业板解禁抛售预期影响表现相对落后。9 月开始市场受房地产成交量明显放大，投资者对政府出台新的房地产紧缩政策预期加强的影响而有所调整。债券市场初期高位整理，9 月后受季度末资金面紧张影响开始调整。转债随正股上涨，但由于溢价率的存在，涨幅低于正股。

三季度本基金债券部分维持中性的组合久期，类属资产配置相对均衡。权益资产持积极灵活的投资策略，提高组合的进攻性。同时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 2010 年三季度的净值增长率为 4.08%，国泰金龙债券 C 在 2010 年三季度的净值增长率为 3.89%，同期业绩比较基准为 0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计四季度国内外经济继续筑底，但进一步低于预期的可能性不大。为维持经济增速，美日继续实行数量宽松政策，“货币贬值”成为普遍采用的策略，国际流动性充裕，并将继续追逐稀有金属、稀缺资源和部分农产品。预计人民币迫于经济和政治双重压力将采取有限度可调控升值并有望持续。热钱近期出现回流新兴市场迹象。国内流动性将维持适度宽松，短期通胀压力有所显现，9 月份 CPI 预计仍然将处于高位，但加息预期不强，四季度数量工具、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。预计四季度债券市场将出现一定调整，而股票市场在利空褪尽后将进一步上攻。转债受股性引导也将有所表现。

本基金将采取债券久期稍短，权益类资产灵活、积极的投资策略，同时注重不同风格资产配置相对均衡。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	34,578,633.87	15.02
	其中：股票	34,578,633.87	15.02
2	固定收益投资	159,461,466.50	69.27
	其中：债券	159,461,466.50	69.27
	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	19,704,989.40	8.56
6	其他各项资产	16,463,734.10	7.15
7	合计	230,208,823.87	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	2,339,569.20	1.23
B	采掘业	-	-
C	制造业	28,180,099.69	14.83
C0	食品、饮料	604,005.60	0.32

C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,297,296.00	0.68
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	5,074,001.39	2.67
C6	金属、非金属	2,031,474.84	1.07
C7	机械、设备、仪表	15,831,426.38	8.33
C8	医药、生物制品	3,341,895.48	1.76
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	776,733.48	0.41
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,900,906.50	1.00
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	1,381,325.00	0.73
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	34,578,633.87	18.20

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	600815	厦工股份	1,052,483	10,903,723.88	5.74
2	600089	特变电工	281,583	4,927,702.50	2.59
3	300118	东方日升	80,109	3,715,455.42	1.96
4	002422	科伦药业	27,223	3,341,895.48	1.76
5	002443	金洲管道	89,178	2,031,474.84	1.07
6	002446	盛路通信	85,434	1,900,906.50	1.00
7	300106	西部牧业	67,014	1,437,450.30	0.76
8	300125	易世达	25,115	1,381,325.00	0.73
9	002415	海康威视	18,793	1,358,545.97	0.71

10	002117	东港股份	45,045	1,297,296.00	0.68
----	--------	------	--------	--------------	------

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	60,614,294.00	31.90
2	央行票据	10,092,000.00	5.31
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	87,261,052.30	45.92
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	1,494,120.20	0.79
7	其他	-	-
8	合计	159,461,466.50	83.92

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	010107	21国债(7)	303,380	32,546,606.40	17.13
2	126012	08上港债	200,000	19,856,000.00	10.45
3	122974	09镇城投	170,080	17,348,160.00	9.13
4	122976	09永煤债	149,000	15,049,000.00	7.92
5	010203	02国债(3)	114,820	11,646,192.60	6.13

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	13,373,240.15
3	应收股利	-
4	应收利息	2,577,460.76
5	应收申购款	263,033.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,463,734.10

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

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	300118	东方日升	3,715,455.42	1.96	新股网下申购
2	002443	金洲管道	2,031,474.84	1.07	新股网下申购
3	002446	盛路通信	1,900,906.50	1.00	新股网下申购
4	300106	西部牧业	1,437,450.30	0.76	新股网下申购
5	300125	易世达	1,381,325.00	0.73	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	156,221,189.32	58,862,271.00
本报告期基金总申购份额	53,188,373.31	22,003,292.84
减：本报告期基金总赎回份额	70,691,794.76	37,911,443.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	138,717,767.87	42,954,120.48

§ 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

二〇一〇年十月二十六日

国泰金龙行业精选证券投资基金 2010 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 2010 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 2010 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	615,132,898.59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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	4,037,202.50
2.本期利润	103,860,658.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.1658
4.期末基金资产净值	583,463,137.54
5.期末基金份额净值	0.949

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

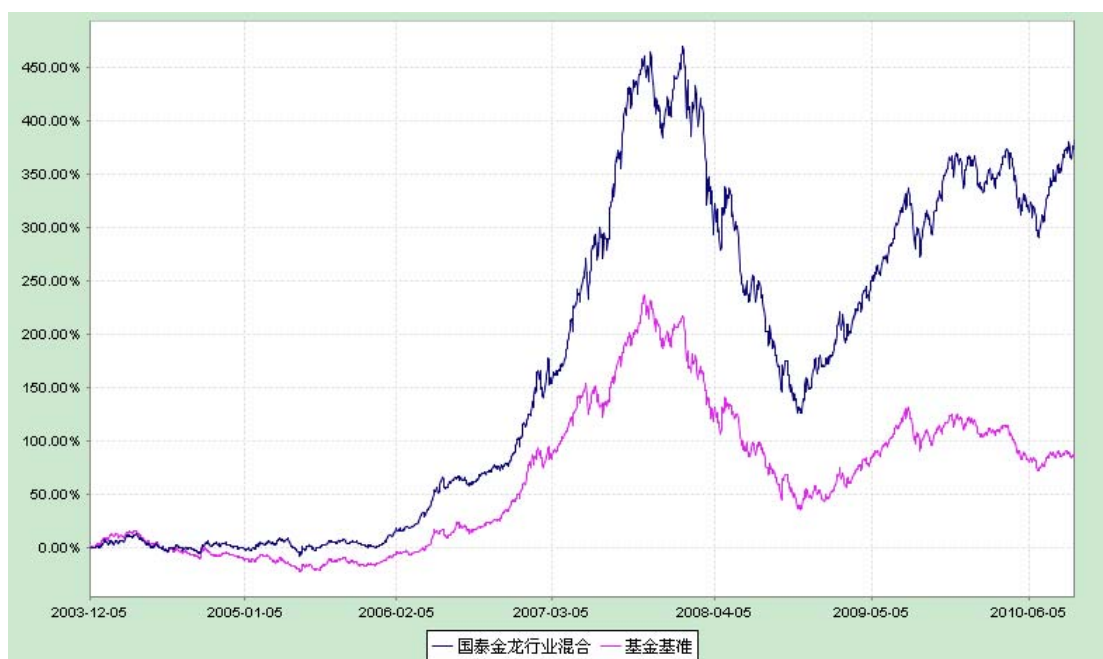
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	21.20%	1.04%	8.01%	0.88%	13.19%	0.16%

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 2010 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		
王航	本基金的基金经理，国泰金鑫封闭的基金经理	2008-5-17	-	13	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

三季度 A 股市场较大幅度反弹，上市公司中报数据普遍好于预期，指数涨幅超过 10%，防御性品种继续表现良好，大小盘风格分化进一步扩大；进入 9 月后，在美国二次量化宽松的预期下大宗商品价格普遍上涨，外围股票市场的较好表现对 A 股也有提振作用。

本基金三季度适度调高了股票配置比例，主要增持了保险、有色、工程机械和建筑建材行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2010 年三季度的净值增长率为 21.20%，同期业绩比较基准为 8.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，目前 A 股整体 20 倍以下的 PE 已是底部区域，部分行业的估值已经具有明显的安全边际，中小盘品种在经历了 09 年四季度以来相对大盘蓝筹的大幅超额收益后，受高估值、供给增加、大小非解禁三重压力下，有进一步调整可能，大小盘今年以来收益率水平有向均值收敛的趋势。虽然在结构调整的大背景下，内需型行业仍是配置的重点，但国际市场宽松的流动性推动资源品价格上涨并向中国国内传导，将在四季度利好 A 股上游资源和部分中游板块，并成为市场上涨的主力。因此四季度组合配置核心策略侧重行业选择，关注大小盘风格转换，重点关注低估值的金融和上游资源品，对中国中游行业具备一定国际竞争力的建筑建材和机械装备行业也将保持持续关注。

§ 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	435,198,005.15	67.25
	其中：股票	435,198,005.15	67.25
2	固定收益投资	143,793,832.30	22.22
	其中：债券	143,793,832.30	22.22
	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	57,124,368.98	8.83
6	其他各项资产	10,974,371.51	1.70
7	合计	647,090,577.94	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	902,118.90	0.15
B	采掘业	26,137,750.88	4.48
C	制造业	246,785,452.15	42.30
C0	食品、饮料	67,188,867.85	11.52
C1	纺织、服装、皮毛	18,346,238.33	3.14
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、	16,946,976.48	2.90

	塑料		
C5	电子	19,052,114.22	3.27
C6	金属、非金属	36,350,828.00	6.23
C7	机械、设备、仪表	47,867,178.10	8.20
C8	医药、生物制品	35,061,815.48	6.01
C99	其他制造业	5,971,433.69	1.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	27,712,060.23	4.75
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	15,203,885.93	2.61
H	批发和零售贸易	29,163,288.24	5.00
I	金融、保险业	65,472,467.84	11.22
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	12,207,210.98	2.09
L	传播与文化产业	8,379,770.00	1.44
M	综合类	3,234,000.00	0.55
	合计	435,198,005.15	74.59

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	600970	中材国际	756,681	27,005,944.89	4.63
2	601318	中国平安	501,902	26,545,596.78	4.55
3	600547	山东黄金	407,358	22,759,091.46	3.90
4	600887	伊利股份	521,446	21,864,230.78	3.75

5	000895	双汇发展	329,024	19,060,360.32	3.27
6	002236	大华股份	243,819	18,866,714.22	3.23
7	600031	三一重工	609,243	17,826,450.18	3.06
8	002099	海翔药业	593,989	17,760,271.10	3.04
9	600036	招商银行	1,100,000	14,245,000.00	2.44
10	600535	天士力	384,921	13,418,346.06	2.30

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	108,392,832.30	18.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,401,000.00	6.07
	其中：政策性金融债	35,401,000.00	6.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	143,793,832.30	24.64

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)	356,390	36,173,585.00	6.20
2	020039	10贴债13	300,000	29,720,100.00	5.09
3	010308	03国债(8)	266,650	27,403,620.50	4.70

4	030201	03国开01	200,000	20,302,000.00	3.48
5	080401	08农发01	150,000	15,099,000.00	2.59

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	1,840,000.00
2	应收证券清算款	6,892,897.10
3	应收股利	-
4	应收利息	1,237,267.94
5	应收申购款	1,004,206.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,974,371.51

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

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	000895	双汇发展	19,060,360.32	3.27	公布重大事项停牌

§ 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	628,463,466.10
本报告期基金总申购份额	69,320,908.59
减：本报告期基金总赎回份额	82,651,476.10
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	615,132,898.59

§ 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

二〇一〇年十月二十六日