

金盛证券投资基金

2008 年半年度报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇〇八年八月二十五日

金盛证券投资基金 2008 年半年度报告

一、重要提示及目录

（一）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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于2008年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于基金的投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

（二）目录

内容	页码
一、重要提示及目录	1
二、基金简介	2
三、主要财务指标及基金净值表现	3
四、基金管理人报告	4
五、基金托管人报告	6
六、财务会计报告（未经审计）	7
七、基金投资组合报告	21
八、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人	26
九、重大事件揭示	27
十、备查文件目录	28

二、基金简介

（一）基金名称：金盛证券投资基金

基金简称：基金金盛

交易代码：184703

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2000年4月26日

报告期末基金份额总额：500,000,000份

基金合同存续期：至2009年11月30日止

基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：2000年6月30日

（二）基金产品说明

（1）投资目标：本基金是以涉及新兴产业的上市公司为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。

（2）投资策略：根据国家宏观经济环境决定投资的总体策略；根据利率的走势和通货膨胀预期决定本基金的债券投资比例；根据国家的产业政策以及行业发展的状况决定行业投资战略；根据对上市公司的价值分析和其在行业中的竞争优势分析选择所要投资的股票。

本基金在行业资产配置中坚持相对集中的投资策略，挖掘具有良好发展态势的行业，将资产权重的大部分配置到处于起步或成长阶段的行业。

（3）业绩比较基准：无。

（4）风险收益特征：承担较高风险，获取较高的超额收益。

（三）基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路91弄98号201A

邮政编码：200127

办公地址：上海市延安东路700号港泰广场22-23楼

邮政编码：200001

法定代表人：陈勇胜

总经理：金旭

信息披露负责人：丁昌海

联系电话：021-23060288 转

传真：021-23060283

电子邮箱：xinxipilu@gtfund.com

（四）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司
 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号
 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
 邮政编码：100032
 法定代表人：郭树清
 信息披露负责人：尹东
 联系电话：010-67595003
 传真：010-66275853
 电子邮箱：yindong@ccb.cn

（五）信息披露情况

信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
 登载半年度报告正文的管理人网址：<http://www.gtfund.com>
 半年度报告置备地点：上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼
 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

（六）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
 办公地址：广东省深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

三、主要财务指标及基金净值表现

（一）主要财务指标

	2008年1-6月
本期利润	-444,056,955.52元
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-170,909,041.66元
加权平均份额本期利润	-0.8881元
期末可供分配利润	113,846,816.09元
期末可供分配份额利润	0.2277元
期末基金资产净值	613,846,816.09元
期末基金份额净值	1.2277元
加权平均净值利润率	-39.92%
本期份额净值增长率	-34.88%
份额累计净值增长率	267.91%

注：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。

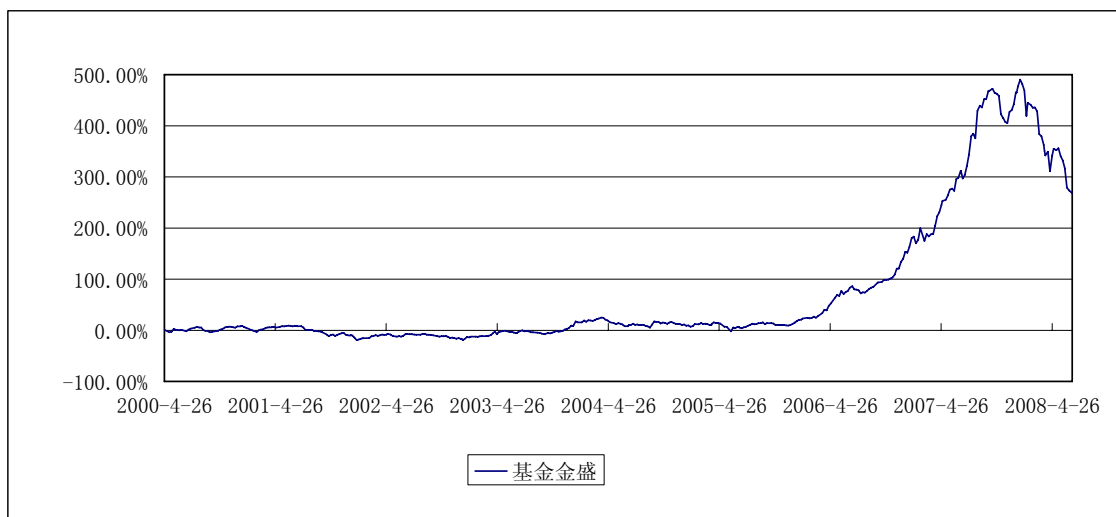
（二）基金净值表现

1、基金金盛净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
过去一个月	-14.87%	3.52%	-	-	-	-
过去三个月	-18.36%	4.25%	-	-	-	-
过去六个月	-34.88%	3.91%	-	-	-	-
过去一年	-10.62%	3.89%	-	-	-	-
过去三年	245.33%	3.18%	-	-	-	-
自基金成立起至今	267.91%	2.59%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

2、基金金盛累计净值增长率历史走势图



四、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理介绍

1、基金管理人介绍及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日，是经中国证监会证监基字[1998]5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京设有分公司。

截至2008年6月30日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛，以及9只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二

期)、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(由基金金鼎转型而来)、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金(由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来)。另外,本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格,目前受托管理全国社保基金2个投资组合。

2007年11月19日,本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月18日,本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务(专户理财)的基金公司之一,并于4月1日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者(QDII)资格,成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一,囊括了社保、年金、专户理财和QDII在内的管理业务资格。

2、基金经理介绍

吴战峰,男,硕士研究生,13年证券基金从业经历。1995年2月至1996年8月在深圳中大投资基金管理公司投资部任投资经理;1996年8月至2000年10月在平安证券公司资产管理部任投资经理;2000年10月至2004年8月在招商证券公司研究开发中心任行业部经理、高级分析师;2004年8月至2005年4月在国信证券公司任行业首席分析师;2006年2月至2007年9月在中国投瑞银基金管理有限公司任高级组合经理;2007年10月加盟国泰基金管理有限公司,2008年4月起任基金金盛的基金经理。

周传根,男,硕士研究生,CFA,7年证券基金从业经历。曾任职于国家外汇管理局、法国兴业证券上海代表处,2003年1月加盟国泰基金管理有限公司,任研究开发部总监,2007年3月至2008年3月兼任基金金盛的基金经理。

(二) 基金管理合规性声明

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。

截至本报告期末,本基金管理人管理的基金类型包括:封闭式基金、开放式基金的股票型基金、指数型股票基金、混合基金(偏股型)、债券基金(债券型)、保本基金和货币基金等,其中封闭式基金三只、股票型基金三只、混合基金(偏股型)三只。本基金管理人管理的各类型基金大类资产配置仓位相当,同类型基金的业绩表现差异均在5%之内。

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。

(三) 2008年上半年证券市场与投资管理回顾

2008年上半年,在投资者担忧全球经济放缓、国内高通胀对经济的负面影响、上市公司大规模再融资以及大小“非”减持的影响下,国内证券市场整体呈

现持续大幅的下跌，虽然4月底政府出台降低印花税以提振市场，但市场在短暂的上升后又继续回落，市场投资气氛持续低迷。

本基金在08年年初，由于对市场及部分行业持谨慎的态度，较少配置了金融、地产、公用事业等行业并保持较低的股票投资比例。在08年二季度，随着市场的大幅下跌，部分行业的投资价值逐步显现，本基金增加了对金融、医药、能源的投资比例。从本基金08年上半年的整体投资情况看，对行业配置以及个股的选择方面成绩较好，不足之处主要在于对市场持续、大幅下跌的状况估计不充分，没有持续保持较低的股票投资比例。

（四）2008年下半年证券市场与投资管理展望

我们对2008年下半年证券市场持谨慎态度，证券市场仍可能呈现大幅震荡的格局，一方面，中国经济的长期增长潜力巨大，一些企业在国内外的竞争力日趋突出，上半年的股市持续大幅下跌使一些公司的投资价值显现；另一方面，中国经济增长也面临高通胀、全球经济放缓的压力，这些因素将对部分行业的景气状况产生重要的影响，也使得投资者对这些行业和企业的估值产生较大分歧。2008年下半年，我们将重点关注宏观经济变化的新趋势及其对行业的影响，看好能源、金融、医药、基建等行业的投资机会，我们将坚持自下而上选择投资目标，并以研究为基础，对公司进行理性的价值评估，合理地进行行业配置，为基金持有人争取更好的回报。

五、基金托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《金盛证券投资基金基金合同》和《金盛证券投资基金托管协议》，托管金盛证券投资基金（以下简称基金金盛）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在基金金盛的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人—国泰基金管理有限公司在基金金盛投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

由基金金盛管理人—国泰基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

六、财务会计报告（未经审计）

（一）财务报表

1、2008年6月30日资产负债表

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

项 目	附注	2008年6月30日	2007年12月31日
资产：			
银行存款		33,439,536.21	198,613,489.99
结算备付金		3,543,770.37	2,197,166.52
存出保证金		1,137,218.63	1,466,921.04
交易性金融资产	8(a)	572,784,858.41	1,406,009,664.21
其中：股票投资		374,466,352.51	1,096,023,204.41
债券投资		198,318,505.90	309,986,459.80
衍生金融资产	8(b)	647,529.12	20,945,320.00
应收证券清算款		3,108,126.64	494,424.93
应收利息	8(c)	3,357,689.45	5,084,001.45
应收股利		65,243.04	—
其他资产		915,768.85	—
资产总计		618,999,740.72	1,634,810,988.14
负债：			
卖出回购金融资产款		—	139,995,850.00
应付证券清算款		2,140,223.53	16,911,366.15
应付管理人报酬		802,258.54	1,770,995.08
应付托管费		134,291.09	295,165.85
应付交易费用	8(d)	1,005,158.27	2,307,477.13
应交税费		287,030.48	287,030.48
应付利息	8(e)	—	1,134,059.64
应付利润	8(f)	283,104.68	283,104.68
其他负债	8(g)	500,858.04	422,170.50
负债合计		5,152,924.63	163,407,219.51
所有者权益：			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未分配利润		113,846,816.09	971,403,768.63
所有者权益合计		613,846,816.09	1,471,403,768.63
负债和所有者权益总计		618,999,740.72	1,634,810,988.14

附注：基金份额净值1.2277元，基金份额总额500,000,000.00份。

2、2008年1-6月利润表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

项目	附注	2008年1-6月	2007年1-6月
一、收入		-421,804,799.40	648,688,268.55
1. 利息收入		4,497,197.57	4,175,106.33
其中: 存款利息收入		396,068.86	303,616.83
债券利息收入		3,974,674.71	3,871,489.50
买入返售金融资产收入		126,454.00	-
2. 投资收益		-153,154,083.11	718,749,364.25
其中: 股票投资收益	8(h)	-155,964,483.96	683,541,203.51
债券投资收益	8(i)	504,951.85	-187,289.14
衍生工具收益	8(j)	105,832.34	29,089,630.06
股利收益		2,199,616.66	6,305,819.82
3. 公允价值变动收益	8(k)	-273,147,913.86	-74,236,202.03
4. 其他收入		-	-
二、费用		22,252,156.12	24,183,186.80
1. 管理人报酬		8,311,030.40	9,554,975.84
2. 托管费		1,386,340.06	1,592,496.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	8(l)	11,149,378.71	10,695,052.96
5. 利息支出		830,939.92	1,599,922.53
其中: 卖出回购金融资产支出		830,939.92	1,599,922.53
6. 其他费用	8(m)	574,467.03	740,739.46
三、利润总额		-444,056,955.52	624,505,081.75

3、2008年1-6月所有者权益(基金净值)变动表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

项 目	2008年1-6月		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	971,403,768.63	1,471,403,768.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-444,056,955.52	-444,056,955.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中: 1、基金申购款	-	-	-
2、基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-413,499,997.02	-413,499,997.02
五、期末所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	113,846,816.09	613,846,816.09

项 目	2007年1-6月		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	605,315,032.91	1,105,315,032.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	624,505,081.75	624,505,081.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1、基金申购款	-	-	-
2、基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-160,000,000.00	-160,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	1,069,820,114.66	1,569,820,114.66

（二）财务报表附注

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

1、基金基本情况

金盛证券投资基金(以下简称“本基金”)的前身是珠江投资基金(以下简称“珠江基金”)。经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2000]39号文及中国证监会证监基金字[2000]40号文批准，珠江投资基金进行了规范清理，并于2000年4月26日办理了基金资产移交手续，并正式更名为金盛证券投资基金。本基金由国泰君安证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司两家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《金盛证券投资基金基金契约》(后更名为《金盛证券投资基金基金合同》)发起，于1994年12月1日募集成立。本基金为契约型封闭式，存续期为10年，发行规模为233,640,000份基金份额。

本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2000]79号文审核同意，于2000年6月30日在深交所挂牌交易。

本基金于2000年9月8日将基金份额总额由原有的233,640,000份基金份额扩募至5亿份基金份额，存续期限延长5年至2009年11月30日，扩募部分基金份额于2000年9月21日上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会证监基金字[2000]40号文的有关规定，本基金的投资范围为良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其中股票投资部分重点投资于沪深两市涉及新兴产业的上市公司。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于2008年8月22日批准报出。

2、财务报表的编制基础

本基金原以2006年2月15日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》(以下合称“原会计准则和制度”)、《金盛证券投资基金基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自2007年7月1日起,本基金开始执行财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。

在编制2008年半年度财务报表时, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整,涉及的主要内容包括:将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产;以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值,且将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

3、遵循企业会计准则的声明

本基金2008年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2008年6月30日的财务状况以及2008年1月1日至2008年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

4、重要会计政策和会计估计

本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

5、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、2008年4月23日发布的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应

纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

- (d) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日前按照 0.3%的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起按 0.1%的税率缴纳。
- (e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6、本报告期重大会计差错的内容和更正金额：无。

7、重大关联方关系及关联交易

(a) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司（“国泰基金”）	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金发起人
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2008年1-6月	
	成交量	占本期成交量的比例
国泰君安		
买卖股票	1, 119, 244, 029. 94	35. 14%
买卖债券	14, 806, 279. 50	2. 74%
买卖权证	18, 534, 941. 01	96. 44%
债券回购	140, 000, 000. 00	14. 14%
	<hr/>	
	佣金	占本期佣金总量的比例
国泰君安	933, 392. 38	34. 93%
	<hr/>	
	2007年1-6月	
	成交量	占本期成交量的比例
国泰君安		
买卖股票	738, 099, 018. 98	15. 92%

买卖债券	32,632,339.60	14.61%
债券回购	90,000,000.00	8.11%
<hr/>		
	佣金	占本期佣金总量的比例
国泰君安	601,942.18	16.12%
<hr/>		

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(c) 本报告期内及 2007 年 1-6 月未与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易。

(d) 基金管理人报酬

支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

本基金在本报告期内需支付基金管理人报酬8,311,030.40元(2007年1-6月：9,554,975.84元)。

(e) 基金托管费

支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

本基金在本报告期内需支付基金托管费1,386,340.06元(2007年1-6月：1,592,496.01元)。

鉴于对2008年4月28日基金收益分配实施中有关公允价值变动问题存在不同理解，本基金管理人和托管人决定对上述公允价值变动自2008年4月28日起暂停计提基金管理费和基金托管费。

(f) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于2008年6月30日保管的银行存款余额为33,439,536.21元(2007年6月30日：87,556,717.35元)。本半年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入

为354,727.00元(2007年1-6月: 251,496.03元)。

(g) 关联方持有的基金份额

	2008年6月30日			2007年6月30日		
	基金份额	净值	占基金总份 额的比例	基金份额	净值	占基金总份 额的比例
国泰基金	22,267,084	27,337,299.03	4.45%	14,692,806	46,129,533.72	2.94%
国泰君安	2,692,308	3,305,346.53	0.54%	2,692,308	8,452,770.20	0.54%

8、财务报表重要项目说明(单位:元)

(a) 交易性金融资产

	2008年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值/(减值)
股票投资	462,356,681.35	374,466,352.51	-87,890,328.84
债券投资	198,145,467.77	198,318,505.90	173,038.13
—交易所市场	178,450,187.77	178,448,505.90	-1,681.87
—银行间同业市场	19,695,280.00	19,870,000.00	174,720.00
	660,502,149.12	572,784,858.41	-87,717,290.71

(b) 衍生金融资产

	2008年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值/(减值)
权证投资	761,791.32	647,529.12	-114,262.20

(c) 应收利息

	2008年6月30日
应收债券利息	3,346,251.11
应收银行存款利息	9,780.34
应收结算备付金利息	1,594.70
应收存出保证金利息	63.30
	3,357,689.45

(d) 应付交易费用

2008年6月30日

应付交易所市场交易佣金	1,004,958.27
应付银行间同业市场交易费用	200.00
	<u>1,005,158.27</u>

(e) 应付利息

于2008年6月30日，应付利息无余额。

(f) 应付利润

应付利润为部分原珠江基金的持有人在珠江基金清理改造过程中未注册登记，造成本基金无法向该部分基金持有人发放红利而形成的应付利润余额。

(g) 其他负债

2008年6月30日

应付券商席位保证金	250,000.00
预提费用	238,687.54
其他应付款	12,170.50
	<u>500,858.04</u>

(h) 股票投资收益

2008年1-6月

卖出股票成交金额	1,746,448,881.79
减：卖出股票成本总额	1,902,413,365.75
	<u>-155,964,483.96</u>

(i) 债券投资收益

2008年1-6月

卖出及到期兑付债券结算金额	382,305,651.10
减：卖出及到期兑付债券成本总额	375,790,142.17
减：应收利息总额	6,010,557.08
	<u>504,951.85</u>

(j) 衍生工具收益

	2008年1-6月
卖出权证成交金额	19,218,498.20
减：卖出权证成本总额	19,112,665.86
	<u>105,832.34</u>

(k) 公允价值变动收益

	2008年1-6月
交易性金融资产	
— 股票投资	-267,180,281.81
— 债券投资	-3,387,185.21
衍生工具	
— 权证投资	-2,580,446.84
	<u>-273,147,913.86</u>

(l) 交易费用

	2008年1-6月
交易所市场交易费用	11,149,178.71
银行间同业市场交易费用	200.00
	<u>11,149,378.71</u>

(m) 其他费用

	2008年1-6月
红利手续费	318,528.64
信息披露费	179,017.02
审计费用	29,835.26
上市年费	29,835.26
债券托管账户维护费	9,000.00
银行费用	8,250.85
	<u>574,467.03</u>

(n) 收益分配

	登记日	分红率	发放现金红利合计
2007年度年终分红	08/04/25	每10份基金份额8.27元	413,499,997.02
			413,499,997.02

9、 流通受限制不能自由转让的基金资产

(a) 流通受限制不能自由转让的股票

(i) 基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

本基金截至2008年6月30日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	流通受限类型	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
600100	同方股份	2007-8-3	2008-8-1	定向增发	23.20	18.13	400,000	9,280,000.00	7,252,000.00
002223	鱼跃医疗	2008-4-10	2008-7-18	新股网下申购	9.48	20.00	14,670	139,071.60	293,400.00
002251	步步高	2008-6-11	2008-9-19	新股网下申购	26.08	48.55	15,816	412,481.28	767,866.80
合 计								9,831,552.88	8,313,266.80

注：1、上述股票在编制本报表时，根据有关规定，在2008年6月30日按市场收盘价进行估值。

2、上述股票中“同方股份”为基金网下定向增发申购非公开发行的新股，受限期限为一年。其余股票为网下申购的新股，截止本报告期末均已上市，但本基金持有部分未流通，受限期限均为三个月。

(ii) 截至2008年6月30日止，本基金持有以下因将公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	停牌原因	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
600900	长江电力	2008-5-8	14.65	公布重大事项	未知	未知	510,000	6,826,732.00	7,471,500.00
000425	徐工科技	2008-6-13	14.59	公布重大事项	2008-7-25	15.98	92,398	1,617,153.49	1,348,086.82
合 计								8,443,885.49	8,819,586.82

(b) 本基金截至2008年6月30日止投资的流通受限制的债券情况如下：

债券代码	债券名称	成功申购日期	可流通日期	流通受限类型	成本单价	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
126016	08宝钢债	2008-6-20	2008-7-4	老股东送配	76.27	75.08	3,290	250,933.08	247,013.20
126016	08宝钢债	2008-6-25	2008-7-4	网下申购	77.60	75.08	30,520	2,368,275.60	2,291,441.60
合 计								2,619,208.68	2,538,454.80

注：1、上述债券在编制本报表时，根据有关规定，在2008年6月30日根据中国证券业协会的报价所计算的净价进行估值。

2、上述债券为基金作为所持有的“宝钢股份”的老股东配售以及网下申购新发分离交易可转债所获得，从债券获配日至债券上市日之间不能自由转让。

(c) 本基金截至2008年6月30日止投资的流通受限制的权证情况如下：

权证代码	权证名称	成功申购日期	可流通日期	流通受限类型	成本单价	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
580024	宝钢CWB1	2008-6-20	2008-7-4	老股东送配	1.48	1.1970	52,640	78,066.92	63,010.08
580024	宝钢CWB1	2008-6-25	2008-7-4	买债送配	1.40	1.1970	488,320	683,724.40	584,519.04
合 计								761,791.32	647,529.12

注：1、上述权证在编制本报表时，根据有关规定，在2008年6月30日按中国证券业协会的报价进行估值。

2、上述权证为基金作为所持有的“宝钢股份”的老股东配售及网下申购新发分离交易可转债时同时获得，从权证获配日至权证上市日之间不能自由转让。

10、风险管理

(a) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全员参与、全过程管控的全面风险管理原则，在经营管理层设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司总体风险管理职责由监察稽核部负责组织、协调，并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、信用风险等风险类别的管理。

(b) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基

金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

(c) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注9中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

(d) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(i) 市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。于2008年6月30日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

	2008年6月30日		2007年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值的比例	公允价值	占基金资产 净值的比例
交易性金融资产				
- 股票投资	374,466,352.51	61.00%	1,096,023,204.41	74.49%

- 债券投资	198,318,505.90	32.31%	309,986,459.80	21.07%
衍生金融资产				
- 权证投资	647,529.12	0.11%	20,945,320.00	1.42%
	573,432,387.53	93.42%	1,426,954,984.21	96.98%

本基金以沪深300指数为基础衡量市场价格风险。于2008年6月30日，若沪深300指数上升5%，且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约2,041.19万元（2007年12月31日：4,918万元）；反之，若沪深300指数下降5%，且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约2,041.19万元（2007年12月31日：4,918万元）。

(ii) 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2008年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	33,439,536.21	-	-	-	33,439,536.21
结算备付金	3,543,770.37	-	-	-	3,543,770.37
存出保证金	140,741.00	-	-	996,477.63	1,137,218.63
交易性金融资产	111,411,028.10	84,369,023.00	2,538,454.80	374,466,352.51	572,784,858.41
衍生金融资产	-	-	-	647,529.12	647,529.12
应收证券清算款	-	-	-	3,108,126.64	3,108,126.64
应收利息	-	-	-	3,357,689.45	3,357,689.45
应收股利	-	-	-	65,243.04	65,243.04
其他资产	-	-	-	915,768.85	915,768.85
资产总计	148,535,075.68	84,369,023.00	2,538,454.80	383,557,187.24	618,999,740.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,140,223.53	2,140,223.53
应付管理人报酬	-	-	-	802,258.54	802,258.54
应付托管费	-	-	-	134,291.09	134,291.09
应付交易费用	-	-	-	1,005,158.27	1,005,158.27
应交税费	-	-	-	287,030.48	287,030.48
应付利润	-	-	-	283,104.68	283,104.68
其他负债	-	-	-	500,858.04	500,858.04
负债总计	-	-	-	5,152,924.63	5,152,924.63
利率敏感度缺口	148,535,075.68	84,369,023.00	2,538,454.80	378,404,262.61	613,846,816.09

2007年12月31日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	198,613,489.99	-	-	-	198,613,489.99
结算备付金	2,197,166.52	-	-	-	2,197,166.52
存出保证金	140,741.00	-	-	1,326,180.04	1,466,921.04
交易性金融资产	230,360,008.00	54,353,032.80	25,273,419.00	1,096,023,204.41	1,406,009,664.21
衍生金融资产	-	-	-	20,945,320.00	20,945,320.00
应收证券清算款	-	-	-	494,424.93	494,424.93
应收利息	-	-	-	5,084,001.45	5,084,001.45
资产总计	431,311,405.51	54,353,032.80	25,273,419.00	1,123,873,130.83	1,634,810,988.14
负债					
卖出回购金融资产					
款	139,995,850.00	-	-	-	139,995,850.00
应付证券清算款	-	-	-	16,911,366.15	16,911,366.15
应付管理人报酬	-	-	-	1,770,995.08	1,770,995.08
应付托管费	-	-	-	295,165.85	295,165.85
应付交易费用	-	-	-	2,307,477.13	2,307,477.13
应交税费	-	-	-	287,030.48	287,030.48
应付利息	-	-	-	1,134,059.64	1,134,059.64
应付利润	-	-	-	283,104.68	283,104.68
其他负债	-	-	-	422,170.50	422,170.50
负债总计	139,995,850.00	-	-	23,411,369.51	163,407,219.51
利率敏感度缺口	291,315,555.51	54,353,032.80	25,273,419.00	1,100,461,761.32	1,471,403,768.63

于2008年6月30日，若银行间市场即期利率水平上升25bp且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应下降约58.34万元（2007年12月31日：39万元）；反之，若银行间市场即期利率水平下降25bp且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应增加约58.34万元（2007年12月31日：39万元）。

（iii）外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

11、首次执行企业会计准则

如附注2所述，本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的半年度财务报表。和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，所有报表项目已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的2007年6月30日的所有者权益，以及2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下：

	2007年1月1日至 2007年6月30日止 期间净损益 (未经审计)	2007年6月30日 所有者权益 (未经审计)
按原会计准则和制度列报 的金额	1,105,315,032.91	698,741,283.78
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资 产(附注2)	-	-74,236,202.03
按企业会计准则列报的金 额	1,105,315,032.91	624,505,081.75
		1,569,820,114.66

根据上述追溯调整，按原会计准则和制度直接记入所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的“公允价值变动收益/(损失)”科目中核算。于会计期末，按原会计准则和制度列示于所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目中的全部余额，现按企业会计准则包含于“未分配利润/(累计亏损)”科目中。

七、基金投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

分 类	市值(元)	占总资产比例
股票	374,466,352.51	60.50%
债券	198,318,505.90	32.04%
权证	647,529.12	0.10%
银行存款及结算备付金	36,983,306.58	5.97%
其他资产	8,584,046.61	1.39%
合 计	618,999,740.72	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市 值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采掘业	50,714,952.39	8.26%
3	制造业	110,908,547.51	18.07%
	其中：食品、饮料	5,271,339.76	0.86%
	石油、化学、塑胶、塑料	23,404,340.08	3.81%
	金属、非金属	52,319,987.53	8.52%
	机械、设备、仪表	14,114,702.64	2.30%
	医药、生物制品	15,790,852.50	2.57%
	其他制造业	7,325.00	0.00%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	26,904,630.64	4.38%

5	建筑业	9,190,940.20	1.50%
6	交通运输、仓储业	18,155,871.41	2.96%
7	信息技术业	31,104,565.25	5.07%
8	批发和零售贸易	28,127,316.46	4.58%
9	金融、保险业	81,620,362.17	13.30%
10	房地产业	17,739,166.48	2.89%
11	社会服务业	-	-
12	传播与文化产业	-	-
13	综合类	-	-
	合 计	374,466,352.51	61.00%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	600000	浦发银行	802,428	17,653,416.00	2.88%
2	601169	北京银行	1,233,773	16,964,378.75	2.76%
3	601628	中国人寿	560,931	13,417,469.52	2.19%
4	600036	招商银行	561,720	13,155,482.40	2.14%
5	600188	兖州煤业	633,686	12,559,656.52	2.05%
6	600030	中信证券	490,000	11,720,800.00	1.91%
7	000063	中兴通讯	172,355	10,789,423.00	1.76%
8	601001	大同煤业	499,875	10,567,357.50	1.72%
9	002251	步步高	186,316	9,045,641.80	1.47%
10	601006	大秦铁路	654,510	8,907,881.10	1.45%
11	601898	中煤能源	549,942	8,788,073.16	1.43%
12	601601	中国太保	452,406	8,708,815.50	1.42%
13	600674	川投能源	384,519	8,370,978.63	1.36%
14	600309	烟台万华	446,395	8,360,978.35	1.36%
15	002024	苏宁电器	188,572	7,788,023.60	1.27%
16	600804	鹏博士	647,777	7,715,024.07	1.26%
17	000987	广州友谊	285,709	7,657,001.20	1.25%
18	000522	白云山A	836,448	7,477,845.12	1.22%
19	600900	长江电力	510,000	7,471,500.00	1.22%
20	000012	南玻A	497,040	7,361,162.40	1.20%
21	600100	同方股份	400,000	7,252,000.00	1.18%
22	000002	万科A	800,000	7,208,000.00	1.17%
23	600585	海螺水泥	164,287	6,569,837.13	1.07%
24	000960	锡业股份	257,492	6,398,676.20	1.04%
25	000422	湖北宜化	370,563	6,358,861.08	1.04%
26	000932	华菱管线	937,459	5,924,740.88	0.97%
27	600588	用友软件	192,290	5,378,351.30	0.88%
28	601857	中国石油	357,944	5,347,683.36	0.87%
29	600809	山西汾酒	405,176	5,271,339.76	0.86%

30	600001	邯郸钢铁	1,129,282	5,183,404.38	0.84%
31	600009	上海机场	325,000	5,141,500.00	0.84%
32	600050	中国联通	732,510	4,885,841.70	0.80%
33	000825	太钢不锈	428,919	4,645,192.77	0.76%
34	600423	柳化股份	304,929	4,589,181.45	0.75%
35	600886	国投电力	623,740	4,222,719.80	0.69%
36	600004	白云机场	399,853	4,106,490.31	0.67%
37	600970	中材国际	69,940	4,008,261.40	0.65%
38	000877	天山股份	529,018	3,983,505.54	0.65%
39	601088	中国神华	105,325	3,957,060.25	0.64%
40	600642	申能股份	428,308	3,867,621.24	0.63%
41	600028	中国石化	368,544	3,740,721.60	0.61%
42	601390	中国中铁	712,233	3,703,611.60	0.60%
43	600058	五矿发展	155,346	3,636,649.86	0.59%
44	000800	一汽轿车	449,990	3,572,920.60	0.58%
45	000983	西山煤电	69,978	3,498,900.00	0.57%
46	002022	科华生物	150,000	3,330,000.00	0.54%
47	002169	智光电气	256,308	3,180,782.28	0.52%
48	000024	招商地产	199,951	2,987,267.94	0.49%
49	600795	国电电力	462,179	2,971,810.97	0.48%
50	600005	武钢股份	300,000	2,928,000.00	0.48%
51	600406	国电南瑞	141,005	2,798,949.25	0.46%
52	600383	金地集团	299,902	2,720,111.14	0.44%
53	600048	保利地产	200,000	2,698,000.00	0.44%
54	600299	蓝星新材	150,000	2,394,000.00	0.39%
55	600348	国阳新能	50,000	2,255,500.00	0.37%
56	600550	天威保变	69,993	2,157,184.26	0.35%
57	600276	恒瑞医药	61,770	2,155,773.00	0.35%
58	600325	华发股份	199,980	2,125,787.40	0.35%
59	600367	红星发展	199,920	1,701,319.20	0.28%
60	002038	双鹭药业	70,000	1,666,000.00	0.27%
61	002202	金风科技	40,692	1,628,900.76	0.27%
62	600019	宝钢股份	184,896	1,610,444.16	0.26%
63	601186	中国铁建	158,020	1,479,067.20	0.24%
64	000425	徐工科技	92,398	1,348,086.82	0.22%
65	600690	青岛海尔	116,338	1,028,427.92	0.17%
66	600312	平高电气	100,000	905,000.00	0.15%
67	000538	云南白药	20,782	562,984.38	0.09%
68	600436	片仔癀	23,500	560,945.00	0.09%
69	002223	鱼跃医疗	14,670	293,400.00	0.05%
70	002252	上海莱士	1,500	37,305.00	0.01%
71	002247	帝龙新材	500	7,325.00	0.00%

(四) 股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初净值比例
1	000932	华菱管线	89,850,306.84	6.11%
2	601628	中国人寿	63,066,502.05	4.29%
3	601088	中国神华	62,549,153.58	4.25%
4	600036	招商银行	58,638,480.40	3.99%
5	600030	中信证券	52,052,835.79	3.54%
6	600028	中国石化	46,101,132.72	3.13%
7	601169	北京银行	46,100,661.50	3.13%
8	600188	兖州煤业	43,787,686.86	2.98%
9	600000	浦发银行	40,564,521.12	2.76%
10	000001	深发展A	40,273,880.33	2.74%
11	601601	中国太保	39,682,907.72	2.70%
12	000825	太钢不锈	39,533,320.72	2.69%
13	600019	宝钢股份	34,640,914.62	2.35%
14	600050	中国联通	33,077,238.69	2.25%
15	000063	中兴通讯	31,049,077.68	2.11%
16	000002	万科A	30,832,360.84	2.10%
17	600005	武钢股份	29,658,026.83	2.02%
18	601166	兴业银行	27,548,243.30	1.87%
19	600001	邯郸钢铁	23,323,200.90	1.59%
20	000012	南玻A	22,964,542.69	1.56%

2、报告期内累计卖出价值前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初净值比例
1	600036	招商银行	106,087,815.96	7.21%
2	600782	新钢股份	60,440,692.13	4.11%
3	000002	万科A	59,605,539.22	4.05%
4	600000	浦发银行	52,535,825.12	3.57%
5	000932	华菱管线	50,015,602.10	3.40%
6	600030	中信证券	47,747,556.52	3.25%
7	600062	双鹤药业	47,023,980.44	3.20%
8	601088	中国神华	44,063,893.25	2.99%
9	601628	中国人寿	42,772,195.74	2.91%
10	600028	中国石化	38,595,950.06	2.62%
11	000905	厦门港务	37,577,513.89	2.55%
12	000001	深发展A	37,040,443.66	2.52%
13	600153	建发股份	33,264,006.43	2.26%
14	600900	长江电力	33,020,650.27	2.24%
15	600050	中国联通	32,725,729.23	2.22%
16	600019	宝钢股份	30,236,911.74	2.05%

17	600150	中国船舶	30,124,670.15	2.05%
18	601006	大秦铁路	28,597,108.55	1.94%
19	601166	兴业银行	27,394,799.47	1.86%
20	600188	兖州煤业	25,390,435.95	1.73%

3、报告期内买入股票的成本总额：1,448,036,795.66元

报告期内卖出股票的收入总额：1,746,448,881.79元

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国家债券	175,910,051.10	28.66%
2	金融债券	19,870,000.00	3.24%
3	企业债券	2,538,454.80	0.41%
	合 计	198,318,505.90	32.31%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	99国债(8)	65,386,693.20	10.65%
2	21国债(15)	49,828,073.50	8.12%
3	20国债(4)	41,712,954.60	6.80%
4	05农发14	19,870,000.00	3.24%
5	02国债(10)	18,982,329.80	3.09%

(七) 报告附注

- 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。
- 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。
- 3、其他资产的构成如下：

分 类	市 值(元)
存出保证金	1,137,218.63
应收证券清算款	3,108,126.64
应收利息	3,357,689.45
应收股利	65,243.04
待摊费用	915,768.85
合 计	8,584,046.61

- 4、报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。
- 5、本报告期投资权证明细如下：

(1) 本报告期末本基金持有的权证明细如下：

权证代码	权证名称	数量(份)	成本(元)
580024	宝钢CWB1	540,960	761,791.32
合计		540,960	761,791.32

(2) 报告期内本基金获得的权证明细如下:

权证代码	权证名称	获得数量(份)	成本(元)	投资类别
580017	赣粤CWB1	51,888	270,346.68	老股东送配
580019	石化CWB1	68,074	193,583.91	老股东送配
031006	中兴ZXC1	16,880	169,599.91	老股东送配
580024	宝钢CWB1	52,640	78,066.92	老股东送配
580024	宝钢CWB1	488,320	683,724.40	买债送配
合计		677,802	1,395,321.82	

6、本报告期内本基金未投资资产支持证券。

7、由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

(八) 本基金管理人运用固有资金投资本基金情况

截止本报告期末,本基金管理人运用固有资金投资本基金的基金份额为22,267,084份。报告期内所持有的基金份额无变动。

八、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一) 持有人户数

基金份额持有人户数: 14,204户

平均每户持有人基金份额: 35,201.35份

(二) 持有人结构

	持有的基金份额(份)	占总份额比例
机构投资者	329,101,583	65.82%
个人投资者	170,898,417	34.18%
合计	500,000,000	100.00%

(三) 前十名持有人

序号	持有人姓名	期末持有数(份)	持有比例
1	人寿集团	31,933,991	6.39%
2	人寿保险	31,738,923	6.35%
3	新华人寿	28,678,056	5.74%
4	UBS AG	28,330,006	5.67%
5	荷兰银行	23,368,871	4.67%
6	国泰基金	22,267,084	4.45%
7	保险产品	18,568,093	3.71%
8	阳光财险	16,602,309	3.32%
9	太平洋保险	14,612,422	2.92%
10	宝钢集团	13,976,700	2.80%

注: 1、UBS AG 即申银万国—花旗—UBS AG

2、保险产品即阳光财产保险股份有限公司—投资型保险产品

- 3、以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的基金持有人名册编制。

九、重大事件揭示

- 1、2008年3月24日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《金盛证券投资基金2008年第一次利润分配公告》，以截至2007年12月31日本基金期末可分配利润为准，向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利8.27元，共派发现金红利413,500,000.00元。权益登记日为2008年4月25日，除息日为2008年4月28日。
- 2、2008年4月3日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于调整基金经理的公告》，聘任吴战峰为本基金的基金经理，周传根不再兼任本基金的基金经理。
- 3、2008年5月28日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司北京分公司迁址公告》，对本基金管理人北京分公司的迁址事宜进行了公告。
- 4、2008年6月7日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于公司副总经理变动的公告》，经本基金管理人董事会审议通过，同意陈甦女士因个人原因辞去公司副总经理职务。陈坚先生因已到法定退休年龄，不再担任公司副总经理。
- 5、基金托管人重大事件：
 - (1)2008年5月6日，因工作变动，赵林先生辞去本行董事、副行长的职务；
 - (2)2008年5月19日，本行第二届董事会第十次会议决议聘任朱小黄先生为本行副行长；
 - (3)2008年5月27日，本行发布关于美国银行公司行使认购期权的公告，美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于2005年6月17日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权；
 - (4)2008年6月12日，本行股东大会选举辛树森女士为本行执行董事并经中国银行业监督管理委员会核准同意任职资格，于2008年7月21日起任职；
 - (5)2008年6月13日，中国证券监督管理委员会核准本行投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。
- 6、基金租用席位的选择标准是：
 - (1)资力雄厚，信誉良好；
 - (2)财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
 - (3)经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
 - (4)内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
 - (5)公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

7、报告期内，基金租用证券公司专用席位的有关情况如下： 单位：元

券商名称	席位数量	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例
渤海证券有限责任公司	1	1,063,915,440.40	33.40%	421,363,668.20	78.06%
国泰君安证券股份有限公司	2	1,119,244,029.94	35.14%	14,806,279.50	2.74%
海通证券股份有限公司	2	347,733,156.30	10.92%	93,567,972.92	17.33%
申银万国证券股份有限公司	1	141,805,140.53	4.45%	0.00	0.00%
兴业证券股份有限公司	2	512,245,523.61	16.08%	10,039,999.00	1.86%
合计	8	3,184,943,290.78	100.00%	539,777,919.62	100.00%

券商名称	权证成交金额	比例	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
渤海证券有限责任公司	0.00	0.00%	570,000,000.00	57.58%	904,317.56	33.84%
国泰君安证券股份有限公司	18,534,941.01	96.44%	140,000,000.00	14.14%	933,392.38	34.93%
海通证券股份有限公司	473,232.39	2.46%	140,000,000.00	14.14%	288,792.94	10.81%
申银万国证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	120,533.89	4.51%
兴业证券股份有限公司	210,324.80	1.09%	140,000,000.00	14.14%	425,319.48	15.92%
合计	19,218,498.20	100.00%	990,000,000.00	100.00%	2,672,356.25	100.00%

注：报告期内，基金无新增租用专用交易席位。各席位均符合证监会规定的有关交易比例。

8、报告期内，未召开基金份额持有人大会；无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项；为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况；基金投资策略无改变；基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

十、备查文件目录

- 1、关于同意设立金盛证券投资基金的批复
- 2、金盛证券投资基金合同
- 3、金盛证券投资基金托管协议
- 4、金盛证券投资基金半年度报告、年度报告及收益分配公告
- 5、报告期内披露的各项公告
- 6、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

备查文件存放地点：本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市延安东路700号港泰广场22-23楼。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司投资托管服务部办公地点——北京市西城区闹市口大街1号院1号楼。

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) 33134688, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 23060280

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2008年8月25日