

金盛证券投资基金 2009 年第 3 季度报告

2009 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇〇九年十月二十八日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰金盛封闭
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
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。
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。
业绩比较基准	无
风险收益特征	承担较高风险，获取较高的超额收益。
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

§ 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7月1日-2009年9月30日)
1. 本期已实现收益	133,693,857.77
2. 本期利润	28,727,976.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0575
4. 期末基金资产净值	539,145,921.06
5. 期末基金份额净值	1.0783

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	3.43%	1.51%	-	-	-	-

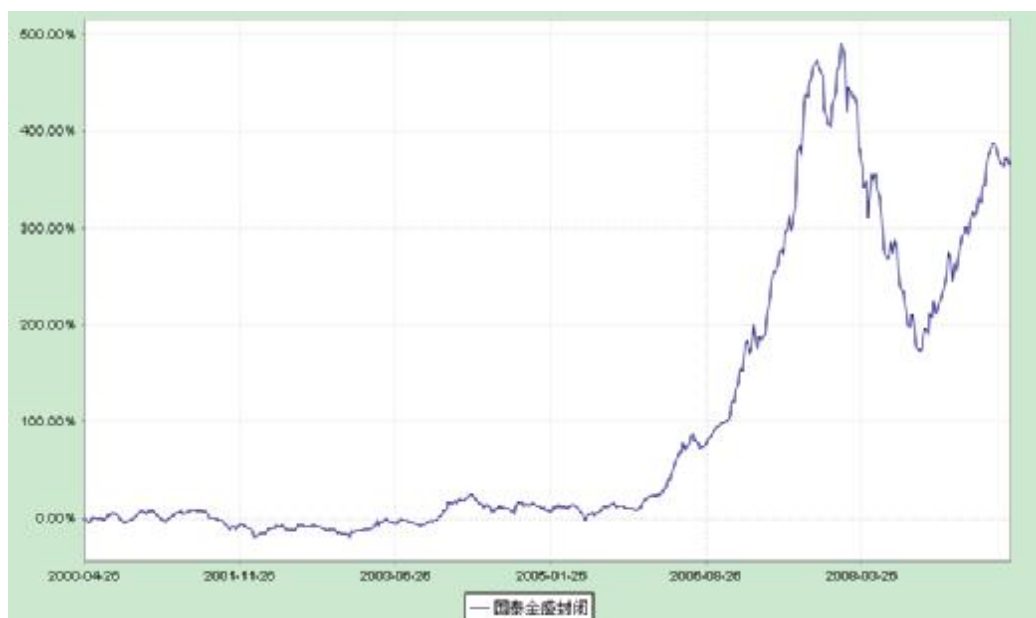
注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

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

金盛证券投资基金

累计份额净值增长率历史走势图

(2000 年 4 月 26 日至 2009 年 9 月 30 日)



注：本基金由原珠江投资基金按照有关法律法规清理规范扩募而成，本基金的合同生效日为 2000 年 4 月 26 日。根据基金合同，本基金资产存在一定的调整期，调整期为自移交基准日起的六个月，自调整期结束后，本基金各项资产配置比例

符合法律法规和基金合同的规定。

§ 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		
吴战峰	本基金的基金经理	2008-4-3	2009-8-27	14	硕士研究生。曾任职于深圳中大投资基金管理公司、平安证券公司、招商证券公司、国信证券公司、国投瑞银基金管理有限公司。2007年10月加盟国泰基金管理有限公司，2008年4月至2009年8月任国泰金盛封闭的基金经理。
张玮	本基金的基金经理、国泰金鹰增长股票的基金经理	2009-4-22	-	9	硕士研究生。2000年11月至2004年6月就职于申银万国证券研究所，任行业研究员。2004年7月至2007年3月就职于银河基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理。2007年3月加入国泰基金

					管理有限公司，任国泰金鹰增长股票的基金经理助理，2008年5月起担任国泰金鹰增长股票的基金经理，2009年4月起兼任国泰金盛封闭的基金经理。
--	--	--	--	--	--

4.2 报告期内本基金运作遵守信情况说明

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

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）、债券基金（偏债型）、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。本基金和本基金管理人管理的其他同类型基金的业绩表现差异均在 5%之内。

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

（1）2009 年第三季度证券市场与投资管理回顾

在货币政策有所调整、信贷规模增长放缓的背景下，加之短期宏观数据不如预期，去年 11 月以来流动性驱动的单边上涨行情在三季度出现了冲高回落，季度跌幅达到 6%。医药生物、食品饮料等防御性行业涨幅居前，而上半年表现突出、与流动性关系密切的房地产、金融服务等行业跌幅最多。

本基金在三季度的市场高点降低了股票资产比例，减持了房地产、金融、钢铁、交通运输等板块，增持了食品饮料等防御性板块。

（2）2009 年第四季度证券市场及投资管理展望

金融危机之后的中国经济正处于温和复苏阶段，货币政策的微调、宏观数据的短期反复很难逆转这种复苏的趋势。对于中国经济的中长期走势，我们保持乐观判断。短期而言，大量流动性释放催生的经济快速反弹不会成为常态，经济恢复将进入正常的曲线略缓的轨道，前期过快上涨的证券市场出现回调来等待真实的业绩表现也很正常。判断四季度的行情可能先维持震荡走势，后期随着时间的推移和企业业绩回升的预期兑现而逐渐上涨。

经过持有人大会表决同意并报中国证监会核准，四季度本基金将转型为国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）。在这一阶段，我们将着眼于明年的布局，寻找引领或受益于经济全面复苏的重点行业中优秀的中小企业，在信息技术、机械制造、医药生物、食品饮料、化工等领域中挖掘一批值得长期持有的优质中小盘成长股。

§ 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	166,306,366.57	30.71
	其中：股票	166,306,366.57	30.71
2	固定收益投资	339,257,900.00	62.65
	其中：债券	339,257,900.00	62.65
	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	29,086,601.45	5.37
6	其他资产	6,870,652.03	1.27
7	合计	541,521,520.05	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	5,103,283.40	0.95
C	制造业	84,478,605.82	15.67
C0	食品、饮料	13,797,300.00	2.56
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑料、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	28,850,672.86	5.35
C7	机械、设备、仪表	37,502,993.02	6.96
C8	医药、生物制品	4,327,639.94	0.80
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,169,880.50	1.52
F	交通运输、仓储业	1,713,798.00	0.32
G	信息技术业	6,732,864.75	1.25
H	批发和零售贸易	12,477,630.64	2.31
I	金融、保险业	12,452,300.00	2.31
J	房地产业	17,095,739.00	3.17
K	社会服务业	18,082,264.46	3.35
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	166,306,366.57	30.85

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	002140	东华科技	622,882	18,082,264.46	3.35

2	600660	福耀玻璃	1,732,602	17,689,866.42	3.28
3	002073	青岛软控	900,000	13,968,000.00	2.59
4	000338	潍柴动力	256,360	12,869,272.00	2.39
5	600704	中大股份	700,000	10,045,000.00	1.86
6	600887	*ST伊利	450,000	8,851,500.00	1.64
7	000656	ST 东 源	669,002	8,844,206.44	1.64
8	000024	招商地产	300,000	7,500,000.00	1.39
9	000541	佛山照明	860,000	7,000,400.00	1.30
10	600406	国电南瑞	179,975	6,732,864.75	1.25

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	41,583,900.00	7.71
2	央行票据	227,527,000.00	42.20
3	金融债券	70,147,000.00	13.01
	其中：政策性金融债	70,147,000.00	13.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	339,257,900.00	62.93

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	040216	04国开16	700,000	70,147,000.00	13.01
2	0901043	09央行票据 43	500,000	49,835,000.00	9.24
	0901047	09央行票据 47	500,000	49,835,000.00	9.24
4	0901035	09央行票据 35	400,000	39,868,000.00	7.39
5	0801119	08央票119	400,000	39,168,000.00	7.26

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 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	890,741.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	63,192.29
4	应收利息	5,283,379.62
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	633,339.12
8	其他	-
9	合计	6,870,652.03

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无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 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	22,267,084
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	22,267,084
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总额比例（%）	4.45

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《金盛证券投资基金基金合同》（原《珠江证券投资基金基金合同》）的有关规定，金盛证券投资基金（以下简称“本基金”或“国泰金盛封闭”）自 2009 年 7 月 21 日 0 时起至 2009 年 8 月 20 日 17 时止以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于金盛证券投资基金转型有关事项的议案》。

本基金管理人于 2009 年 8 月 22 日发布了《关于金盛证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，并向中国证监会申请持有人大会决议生效。经中国证监会《关于核准金盛证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》（证监许可〔2009〕925 号）核准，本基金管理人于 2009 年 9 月

16 日发布了《金盛证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，并向深交所申请提前终止国泰金盛封闭的上市交易，获得深交所《关于同意金盛证券投资基金终止上市的批复》（深证复[2009] 35 号）同意。

本基金管理人分别于 2009 年 10 月 13 日和 2009 年 10 月 16 日发布了《金盛证券投资基金终止上市公告》和《金盛证券投资基金终止上市的提示性公告》，本基金终止上市权利登记日为 2009 年 10 月 16 日，即在 2009 年 10 月 16 日下午深交所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的全体国泰金盛封闭基金份额持有人享有国泰金盛封闭终止上市后的相关权利。

自本基金终止上市之日即 2009 年 10 月 19 日起，本基金转型成为上市契约型开放式基金。基金名称更改为“国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”，基金简称为“国泰中小盘成长股票（LOF）”，基金代码为“160211”，《金盛证券投资基金基金合同》修订为《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》，原《金盛证券投资基金基金合同》失效，《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于同一日生效。自该日起，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》为准。

在国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）集中申购期结束后的第五个工作日前，原国泰金盛封闭基金份额在深交所系统和中国结算深圳分公司证券登记结算系统中仍使用原名称及代码，简称为“国泰金盛封闭”，场内简称为“基金金盛”，代码为“184703”。国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）集中申购期结束后的第五个工作日起，原国泰金盛封闭名称变更为：“国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”，简称为“国泰中小盘成长股票（LOF）”，场内简称为“国泰小盘”，代码为“160211”。

在集中申购期，投资人可以通过深交所 LOF 平台办理国泰中小盘成长股票（LOF）的集中申购业务，在国泰中小盘成长股票（LOF）开放申购赎回并上市后亦可通过深交所 LOF 平台办理国泰中小盘成长股票（LOF）份额的日常申购、赎回及二级市场交易业务。

§ 8 备查文件目录

8.1 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报告
- 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

8.2 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。

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

8.3 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

二〇〇九年十月二十八日