

2012年10月25日 星期四

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:二〇一二年十月二十五日
1.1 重要提示
基金管理人的董事及董事会成员所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质的完整性、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有限公司根据本基合同有关规定，于2012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2012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	2,270,307,449.61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长期资本增值。
投资策略	
以长期利率走势分析为基础，结合中期的经济周期、宏观经济政策方向及收益率曲线分析，通过价值重置和收益曲率匹配的方法，实施资产配置和资金管理，在对拟公开发行股票的行业进行深入研究的基础上，选择拟公开发行股票的申购。因申购所得的股票将在公司上市交易之日起在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	
下属两级基金的交易代码	
020002	
报告期末下属两级基金的份额总额	
1,431,459,188.85份	
报告期末下属两级基金的份额总额	
838,848,260.76份	

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标						
单位:人民币元						
	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)			基期(2003年12月5日)		
1.本期已实现收益	30,379,225.46		12,965,501.83			
2.本期利润	5,509,456.06		1,932,198.67			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0033		0.0025			
4.期末基金资产净值	1,499,857,585.92		875,514,255.59			
5.期末基金份额净值	1.048		1.044			
注:①本公司已实现收益指本基金利息收入、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 本基金份额净值增长率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A:						
阶段	净值增长率①	净值增长基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差额④	①-③	②-④
过去三个月	0.48%	0.06%	0.09%	0.04%	0.39%	0.02%
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率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						
阶段	净值增长率①	净值增长基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差额④	①-③	②-④
过去三个月	0.38%	0.05%	0.09%	0.04%	0.29%	0.01%

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会成员所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质的完整性、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合同有关规定，于2012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2012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(020002)
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	893,107,974.12份
投资目标	
有效地把握行业的发展趋势，精心选择具有良好行业背景的成长型企业，寻求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	
本基金采取定量化分析相结合的方式，通过资产配置有效提高资金市场的整体风险管理，通过行业选择、动态配置的优势行业及相对比例，通过个股选择，挖掘具有突出成长潜力且当前市场地位的上市公司。	
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。	
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

主要财务指标						
单位:人民币元						
	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)			基期(2003年12月5日)		
1.本期已实现收益	-55,259,514.96					
2.本期利润	-40,573,534.94					
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0452					
4.期末基金资产净值	376,782,184.78					
5.期末基金份额净值	0.422					
注:①本公司已实现收益指本基金利息收入、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 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较						
国泰金龙行业混合A:						
阶段	净值增长率①	净值增长基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差额④	①-③	②-④
过去三个月	-9.64%	1.20%	-4.54%	0.75%	-5.10%	0.45%
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率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						
阶段	净值增长率①	净值增长基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差额④	①-③	②-④
过去三个月	-1.37%	0.24%	-0.72%	0.12%	-0.65%	0.12%

注:①本期已实现收益指本基金利息收入、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。

3.2.1 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金龙行业混合A:

基金简称	国泰金龙债券A
基金代码	020002
基金合同期限	2009年3月11日至2010年3月10日
投资目标	
通过主要投资于固定收益类品种，在严格控制风险和保持基金资产流动性的情况下，力争为基金份额持有人创造稳定的收益。	
投资策略	
本基金将采取定量化分析相结合的方式，通过资产配置有效提高收益，严格控制不同投资品种之间的风险差异，从而达到降低风险、分散收益的目的。	
业绩比较基准	
本基金业绩比较基准为90%×上证红利指数+10%×深证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均。	
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	