

(上接D055版)

国泰金龙行业精选证券投资基金管理有限公司
2008年度报告摘要

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事长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法律责任。本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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年3月21日复核了本报告的财务数据、净值表现、利润分配情况、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。投资人投资于基金前应仔细阅读本系列基金的基金合同、基金招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

§ 2 基本简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰金龙行业
交易代码	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	570,977,489.60份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

有效把握我行业的发展趋势，精心选择具有行业背景的成长性企业，谋求基金资产的长期稳定增值。

本基金采取定量分析与定性分析相结合的方式，通过行业分析、行业投资的系统性风险；通过行业精选，寻找投资的优势行业及相对比例，通过个股精选，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。

4.6 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制定了相关制度及流程。

估值委员会主要负责基金估值相关的工作的决策、执行和监督，确保基金估值的公平与合理。报告期内相关估值政策由托管银行复核，并报证监会备案。

公司估值委员会由主管运营的副总经理负责，成员包括基金经理、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析经验，会计算该证券基金从业经验及专业能力。

基金经理认为估值方法有被曲解或有失公允的可能，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况

上海浦东发展银行股份有限公司依据《国泰金龙系列证券投资基金管理合同》与《国泰金龙系列证券投资基金管理协议》，托管过程中，上海浦东发展银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，安全保管了基金的全部资产，对国泰金龙行业精选证券投资基金管理的运作进行了全面的会计核算和有效的监督，履行了托管人的义务，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配情况的说明

2008年，上海浦东发展银行股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对基金净值计算、和分红政策中基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支进行了认真的复核，恪守尽责、严格自律、追求卓越的工作精神，履行了托管人的义务，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本基金年度报告中财务信息的真实、准确和完整发表意见

经上海浦东发展银行股份有限公司资产托管部复核，由基金管理有限公司编制的本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

5.4 审计报告

本基金2008年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，会计师事务所签出了无保留意见的审计报告。投资人可通过登录于本管理人网站的年度报告报告正文查看审计报告全文。

§ 6 审计报告

本基金2008年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，会计师事务所签出了无保留意见的审计报告。投资人可通过登录于本管理人网站的年度报告报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报告

7.1 资产负债表

会计主体：国泰金龙行业精选证券投资基金管理有限公司

报告截止日：2008年12月31日

单位：人民币元

资产 本期末 2008年12月31日 上年度末 2007年12月31日

负债 本期末 2008年12月31日 上年度末 2007年12月31日

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。7.4.3.6 本基金在承销期间内参与承销的承销的情况

报告期内，本基金未购买或未卖出关联方所承销证券。7.4.3.7 本基金持有的流通受限证券

7.4.4 因申购新股而获得的证券及于期间持有的流通受限证券

截至2008年12月31日止，本基金未持有因认购新股而获得的证券及于期间持有的流通受限证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

截至2008年12月31日止，本基金持有以下因将公布的重大会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公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

7.4.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.5.3 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：卖出股票按卖出成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：买入股票的成本、卖出股票收入均按买入成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：按月计提公允价值变动损益的债券

8.4.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 010004 02国债(4) 473,230 15.93

2 010210 02国债(10) 109,830 3.65

3 010107 21国债(7) 60,000 2.22

4 010308 03国债(8) 45,380 1.56

5 000001 000001 537,154.82

6 可转债

7 其他

8 合计 70,843,379.70 23.37

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 600900 长江电力 2,481,206,660.67

2 4,217,119,442.98

注：买入股票的成本、卖出股票收入均按买入成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前20名的股票明细

序号 股票代码 股票名称 本期累计卖出金额(元) 占期初基金资产净值比例(%)

1 600050 中国联通 73,807,400.11 9.42

2 600036 招商银行 72,360,708.73 9.24

3 000002 万科A 61,120,499.84 7.80

4 601390 中国中铁 52,748,135.73 6.74

5 600030 中信证券 52,435,533.87 6.70

6 601318 中国平安 49,912,327.17 6.37

7 600153 建发股份 44,022,397.21 5.62

8 601186 中国铁建 38,765,489.55 4.95

9 600005 武钢股份 38,449,030.06 4.91

10 601166 兴业银行 34,133,497.65 4.36

11 601398 中国银行 33,808,392.52 4.32

12 600737 中粮屯河 33,532,911.72 4.28

13 600674 川投能源 31,412,927.37 4.01

14 000026 旗滨集团 30,963,226.95 3.95

15 601628 中国人寿 30,313,125.80 3.87

16 600748 上实发展 30,022,546.13 3.83

17 600019 宝钢股份 26,894,301.44 3.43

18 000063 中兴通讯 26,206,295.29 3.35

19 600383 金地集团 26,160,158.08 3.34

20 601169 北京银行 25,378,366.92 3.24

21 601939 建设银行 24,646,084.00 3.15

22 600015 华夏银行 24,497,741.02 3.13

23 601919 中国远洋 24,436,581.91 3.12

24 600558 五矿发展 23,990,538.16 3.06

25 601898 中煤能源 23,550,234.31 3.01

26 600997 开滦股份 22,790,490.39 2.91

27 600361 华联综超 22,486,534.94 2.87

28 600308 华泰股份 22,421,635.29 2.86

29 600100 同方股份 21,156,805.03 2.70

30 600048 保利地产 20,357,858.47 2.60

31 000001 深发展A 20,251,599.32 2.59

32 000848 承德露露 19,722,477.90 2.52

33 000599 齐翔双星 19,596,279.27 2.50

34 600519 贵州茅台 19,138,184.51 2.44

35 600887 伊利股份 19,102,288.60 2.44

36 600161 天坛生物 18,773,022.31 2.44

37 600693 翻石造纸业 18,321,278.51 2.34

38 000932 华菱钢铁 17,533,361.59 2.24

39 000667 石嘴山炭业 17,244,239.51 2.20

40 600795 国电电力 17,129,305.41 2.19

41 600270 外运发展 17,012,968.41 2.17

42 600428 中远航运 16,833,252.96 2.15

43 600122 宏发高科 16,627,187.13 2.12

44 600836 世博实业 16,532,507.00 2.11

45 601001 大同煤业 16,515,517.95 2.11

46 600911 南宁糖业 16,375,543.39 2.09

47 000401 莱钢股份 16,232,503.16 2.07

48 600011 华能国际 16,158,378.76 2.06

49 000539 尚电A 16,075,822.31 2.05

50 600830 香港金融 15,868,236.19 2.03

51 000960 锡业股份 15,843,508.07 2.02

52 000612 焦作万方 15,693,648.82 2.00