

国泰金龙行业精选证券投资基金

[2012] 第四季度报告

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:二〇一三年一月十九日

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、完整性、及时性给予承诺。

基金管理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2013年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31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 国泰金龙行业精选证券投资基金

系列其他基金名称 国泰金龙债券A(020002),国泰金龙债券C(020012)

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2003年12月5日

报告期末基金份额总额 886,189,720.72份

投资目标 有效把握行业发展的趋势,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,通过资产配置有效避险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和相对比例;通过个股选择,挖掘具有突出成长潜力且具备当前市场优势的上市公司的投资价值。

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数,债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数和深圳国债指数。

风险收益特征 承担中等风险,获取相对回报。

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(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -27,886,929.07

2.本期利润 11,655,524.92

3.加权平均基金份额本期利润 0.0131

4.期末基金份额净值 385,545,647.01

0.435

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,计算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 本基金报告期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

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 3.08% 0.89% 6.81% 0.82% -3.73% 0.07%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

周广山 本基金的基金经理 2012-1-19 - 8

硕士研究生,长期从事MBA、2005年1月-2008年3月担任国泰基金管理有限公司研究员,在任研究员期间,2007年1月担任国泰基金管理有限公司,历任行业研究员,基金经理助理,2011年4月至2012年8月担任国泰债券基金经理,2012年1月19日担任国泰金龙行业精选证券投资基金基金经理,2012年1月19日担任国泰金龙行业混合型证券投资基金基金经理。

刘庆 本基金的基金经理 2012-8-6 - 18

硕士研究生,长期从事MBA、2005年4月加入国泰基金管理有限公司,历任行业研究员,基金经理助理,2008年4月担任国泰基金管理有限公司,历任行业研究员,基金经理助理,2008年6月至2011年1月兼任国泰基金管理有限公司,历任行业研究员,基金经理助理,2011年8月任国泰债券基金经理,2012年1月19日担任国泰金龙行业精选证券投资基金基金经理,2012年1月19日担任国泰金龙行业混合型证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日,首任基金经理,任职日期为基金合同生效日。2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 基金经理对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金期内,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,严格遵守基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度地保护投资人利益的原则,在投资运作中严格遵守基金合同的规定,并按照基金合同的规定,对基金的内部风险控制制度和流程,对基金的投资和风险管理进行有效控制,严格控制不同投资组合之间的日内反向交易,严格执行不公允交易和利益输送的双向反向交易,确保公平对待所有投资人。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金公平交易制度指引》的规定,未发现内幕交易、操纵市场和不正当关联交易等行为,信息披露及时、准确、完整,本基金与基本基金管理人所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、精心管理及健全内控体系,有效保障投资人合法权益。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金期内,本基金的业绩表现遵照执行。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本报告期内,基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望。

展望2013年一季度,GDP增速将有望在第四季度逐季回升之后保持在一个相对稳定的阶段,而市场的热点将集中在这三个方面:一是经济持续的持续性,是否能进入到之前的周期,二个是小周期,A股市场的热点将集中在新兴产业,特别是新能源、新材料、节能环保、高端制造等,三者是政策的持续性,因此在市场交易都将把握全年行业投资的机会,在新一轮的起点,本基将始终关注经济形势发生的变化,以及新一届政府推进改革的进程,谨记过去一年犯过的错误,努力为基金持有人创造一个稳健、持续的投资回报。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称 国泰金龙行业精选证券投资基金

报告送出日期:二〇一三年一月十九日

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、完整性、及时性给予承诺。

基金管理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2013年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

5.2 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 国泰金龙行业精选证券投资基金

系列其他基金名称 国泰金龙债券A(020002),国泰金龙债券C(020012)

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2003年12月5日

报告期末基金份额总额 886,189,720.72份

投资目标 有效把握行业发展的趋势,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,通过资产配置有效避险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和相对比例;通过个股选择,挖掘具有突出成长潜力且具备当前市场优势的上市公司的投资价值。

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数,债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数和深圳国债指数。

风险收益特征 承担中等风险,获取相对回报。

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(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -27,886,929.07

2.本期利润 11,655,524.92

3.加权平均基金份额本期利润 0.0131

4.期末基金份额净值 385,545,647.01

0.435

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,计算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 本基金报告期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

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 3.08% 0.89% 6.81% 0.82% -3.73% 0.07%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

周广山 本基金的基金经理 2012-1-19 - 8

硕士研究生,长期从事MBA、2005年1月-2008年3月担任国泰基金管理有限公司研究员,在任研究员期间,2007年1月担任国泰基金管理有限公司,历任行业研究员,基金经理助理,2011年4月至2012年8月担任国泰债券基金经理,2012年1月19日担任国泰金龙行业精选证券投资基金基金经理,2012年1月19日担任国泰金龙行业混合型证券投资基金基金经理。

刘庆 本基金的基金经理 2012-8-6 - 18

硕士研究生,长期从事MBA、2005年4月加入国泰基金管理有限公司,历任行业研究员,基金经理助理,2008年6月至2011年1月兼任国泰基金管理有限公司,历任行业研究员,基金经理助理,2011年8月任国泰债券基金经理,2012年1月19日担任国泰金龙行业精选证券投资基金基金经理,2012年1月19日担任国泰金龙行业混合型证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日,首任基金经理,任职日期为基金合同生效日。2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 基金经理对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金期内,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,严格遵守基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度地保护投资人利益的原则,在投资运作中严格遵守基金合同的规定,并按照基金合同的规定,对基金的内部风险控制制度和流程,对基金的投资和风险管理进行有效控制,严格控制不同投资组合之间的日内反向交易,严格执行不公允交易和利益输送的双向反向交易,确保公平对待所有投资人。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金公平交易制度指引》的规定,未发现内幕交易、操纵市场和不正当关联交易等行为,信息披露及时、准确、完整,本基金与基本基金管理人所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、精心管理及健全内控体系,有效保障投资人合法权益。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金期内,本基金的业绩表现遵照执行。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本报告期内,基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望。

展望2013年一季度,GDP增速将有望在第四季度逐季回升之后保持在一个相对稳定的阶段,而市场的热点将集中在这三个方面:一是经济持续的持续性,是否能进入到之前的周期,二个是小周期,A股市场的热点将集中在新兴产业,特别是新能源、新材料、节能环保、高端制造等,三者是政策的持续性,因此在市场交易都将把握全年行业投资的机会,在新一轮的起点,本基将始终关注经济形势发生的变化,以及新一届政府推进改革的进程,谨记过去一年犯过的错误,努力为基金持有人创造一个稳健、持续的投资回报。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称 国泰金龙行业精选证券投资基金

报告送出日期:二〇一三年一月十九日

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、完整性、及时性给予承诺。

基金管理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2013年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

3.2 基金产品概况

基金简称 国泰金龙行业精选证券投资基金

报告送出日期:二〇一三年一月十九日

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、完整性、及时性给予承诺。

基金管理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2013年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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