国泰金龙行业精选证券投资基金

2015 第三季度报告

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:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21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2015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
基金主代码	020003
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	483,567,573.01份
投资目标	有效把握我国行业的发展趋势,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,通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险;通过行业精选,确定权投资的优势行业及相应比例;通过个股选择,挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。
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。 基金整体业绩比较基准=75%×[上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均]+25%×[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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-89,048,040.08
2.本期利润	-78,241,315.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1593
4.期末基金资产净值	301,642,022.10
5.期末基金份额净值	0.624

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

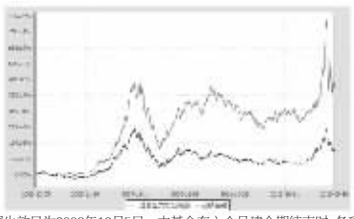
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-19.48%	3.48%	-21.86%	2.45%	2.38%	1.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

国泰金龙行业精选证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年12月5日至2015年9月30日)



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期结束时,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
		任职日期	离任日期		
杨飞	本基金的基金经理,国泰估值优势混合(LOF)(原国泰估值优势股票(LOF)),国泰成长优选混合(原国泰成长优选股票)、国泰中小盘成长混合(LOF)(原国泰中小盘成长股票(LOF))的基金经理	2014-10-21	-	7年	硕士研究生,2008年7月至2009年8月在诺德基金管理有限公司任助理研究员,2009年9月至2011年2月在景顺长城基金管理有限公司任研究员。2011年2月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2014年10月起任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理,2015年3月起兼任国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(原国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF))的基金经理,2015年5月起兼任国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)(原国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF))、和国泰成长优选混合型证券投资基金(原国泰成长优选股票型证券投资基金)的基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,本基金运作合法合规,未发生损害基金份额持有人利益的行为,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,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易,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 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度以来,在宏观经济数据疲弱、场内流动性收紧、风险偏好大幅下降的背景下,市场出现大幅调整,主板指数创下年内新低,创业板指数调整幅度超过了主板指数。

分行业看,前期涨幅落后以及估值相对较低的银行与食品饮料板块调整幅度相对较小,取得了明显的超额收益,而前期涨幅较大的计算机板块出现了大幅调整。

本季度本基金保持了较低的仓位,初期主要配置在电子、机械、计算机等行业,中后期本基金大幅加仓了环保、新能源汽车等行业,降低了机械、计算机等行业配置比例,三季度末本基金仓位也适当提升。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金在2015年第三季度的净值增长率为-19.48%,同期业绩比较基准收益率为-21.86%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,随着市场清理配资的结束,风险偏好企稳且场内流动性将会保持稳定,新兴行业的优质成长股将会取得明显的超额收益。四季度本基金将继续适当提升仓位,配置将首选景气度高的新兴行业,优选景气行业中的优质成长股。行业配置上,集中配置高景气的环保、新能源汽车产业链、电子细分行业等,个股上优选成长性好、估值合理的中小市值公司。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	216,257,084.48	70.72
	其中:股票	216,257,084.48	70.72
2	固定收益投资	77,911,750.00	25.48
	其中:债券	77,911,750.00	25.48
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,552,961.17	2.80
7	其他资产	3,075,607.84	1.01
8	合计	305,797,403.49	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	采矿业	-	-
C	制造业	153,362,269.98	50.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,343,865.00	3.43
F	批发和零售业	5,906,389.86	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,098,718.49	5.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,545,841.15	9.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	216,257,084.48	71.69

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	300145	南方泵业	868,417	29,048,548.65	9.63
2	300232	洲明科技	1,415,156	29,010,698.00	9.62
3	002104	恒宝股份	1,851,107	28,895,780.27	9.58
4	300376	易事特	828,882	28,869,960.06	9.57
5	002573	清新环境	1,546,505	27,264,883.15	9.04
6	300150	世纪瑞尔	1,897,749	17,098,718.49	5.67
7	300207	欣旺达	488,000	12,190,240.00	4.04
8	300137	先河环保	705,500	11,718,355.00	3.88
9	002111	威海广泰	467,100	9,939,888.00	3.30
10	300055	万邦达	462,000	7,650,720.00	2.54

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	63,866,900.00	21.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,044,850.00	4.66
	其中:政策性金融债	14,044,850.00	4.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	77,911,750.00	25.83

5.5 报告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	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	019423	14国债23	300,000	30,024,000.00	9.95
2	150001	15附息国债01	100,000	10,025,000.00	3.32
3	159902	15贴现国债02	100,000	9,798,000.00	3.25
4	019321	13国债21	90,000	9,009,900.00	2.99
5	018001	国开1301	85,000	8,577,350.00	2.84

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	535,352.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,313,406.46
5	应收申购款	226,849.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,075,607.84

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300145	南方泵业	29,048,548.65	9.63	重大事项
2	300150	世纪瑞尔	17,098,718.49	5.67	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	494,913,087.85
报告期基金总申购份额	172,870,945.91
减:报告期基金总赎回份额	184,216,460.75
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	483,567,573.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,本基金的基金管理人未运用固有资金交易本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国泰金龙系列证券投资基金设立的文件

2、国泰金龙系列证券投资基金基金合同

3、国泰金龙系列证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

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——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层。

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)31089000,400-888-8688

客户投诉电话:(021)31089000

公司网址:http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司
二〇一五年十月二十六日

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

2015 第三季度报告

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
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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2015年10月21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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰金鼎价值混合
基金主代码	519021
交易代码	519021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月11日
报告期末基金份额总额	1,960,981,772.58份
投资目标	本基金为价值精选混合型基金,以量化指标分析为基础,在严密的风险控制前提下,不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	A、大类资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。 B、股票资产投资策略 本基金以量化分析为基础,从上市公司的基本面分析入手,建立基金的一、二级股票池。根据股票池中个股的估值水平和α值,运用组合优化模型,积极创建并持续优化基金的股票组合,在有效控制组合总体风险的前提下,谋求超额收益。 C、债券资产投资策略 本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券置换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证综合指数收益率+35%上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。
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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-126,974,822.26
2.本期利润	-569,643,125.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2845
4.期末基金资产净值	1,590,223,458.05
5.期末基金份额净值	0.811

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	-25.39%	4.29%	-18.65%	2.13%	-6.74%	2.16%

3.2.2自基金转型以来基金累计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

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年4月11日至2015年9月30日)

注:本基金转型日期为2007年4月11日,本基金在6个月建仓结束时,基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

§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		
邓时锋	本基金的基金经理,国泰区位优势混合(原国泰区位优势股票),国泰央企改革股票的基金经理	2008-04-03	-	15年	硕士研究生。曾任职于天同证券。2001年9月加盟国泰基金管理有限公司,历任行业研究员、社保111组合基金经理助理、国泰金鼎价值混合和国泰金泰封闭的基金经理助理,2008年4月起任国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金的基金经理,2009年5月起兼任国泰区位优势混合型证券投资基金(原国泰区位优势股票型证券投资基金)的基金经理,2013年9月至2015年3月兼任国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)的基金经理,2015年9月起兼任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,本基金运作合法合规,未发生损害基金份额持有人利益的行为,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,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易,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 异常交易行为专项说明

本报告期内,本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

稳增长政策见效缓慢。上半年GDP同比增长7%,创近6年最低。三季度宏观经济失速下行,8月官方制造业PMI为49.7创三年新低。中国8月财新制造业PMI终值降至47.3,初值47.1,出现逾6年来最显著放缓。1-8月份,全国固定资产投资(不含农户)同比名义增长10.9%,增速比1-7月份回落0.3个百分点,创下2000年12月以来新低。全国房地产开发投资同比名义增长3.5%,增速比1-7月份回落0.8个百分点,续创6年多新低。7月CPI同比上涨1.6%,涨幅创年内新高;7月PPI同比下降5.4%,同比降幅比上月扩大0.6个百分点,连降41个月,8月CPI同比上涨2.0%,涨幅创12个月新高;8月PPI同比下降5.9%,降幅进一步扩大。在比较严峻的经济形势下,三季度宏观经济政策依然倾向于宽松走向,央行自8月26日起存贷款利率下调25bp,自9月6日起存款准备金率下调50bp。发改委也出台多项措施促投资稳增长。我们预计四季度经济有望企稳回升。

8月11日央行完善人民币兑美元汇率中间价报价机制后,人民币出现一定程度的贬值。从国际国内经济金融形势看,我们认为当前人民币汇率不具备持续贬值的基础,但仍需关注外围市场,如美联储加息进展、欧日经济与货币政策、资金从新兴市场撤离的情况。

三季度A股市场延续了6月份的大幅调整,上证综指、深证综指、沪深300、创业板指等主要指数跌幅都接近30%,很多前期涨幅巨大的个股下跌超过一半以上。从行业表现来看,银行、休闲服务、医药生物、食品饮料等相对抗跌,而钢铁、采掘、非银金融、家用电器、有色金属等基本面乏力的行业跌幅居前。

本基金在7月初的下跌中坚持较高仓位,反弹后在8月中旬做了阶段性减仓,9月初开始适度增加了TMT等新兴行业配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金在2015年第三季度的净值增长率为-25.39%,同期业绩比较基准收益率为-18.65%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为国内经济企稳基础不牢,下半年对包括财政与货币政策在内的稳增长政策的需求更为迫切,其中财政政策以基建投资为主,货币政策以降低社会实际无风险利率为目标。中期来看,考虑到融资成本下行,我们对后市仍有信心,将兼顾自上而下配置与自下而上择股。

在有效控制风险的情况下,我们仍将保持积极心态把握结构性投资机会。本基金下一阶段将关注以下几个方面的投资机会:(1)符合经济结构转型方向的信息服务行业和环保行业等;(2)管理优秀,执行力强,在互联网时代积极转型的传统行业龙头;(3)业绩增长确定性强的食品饮料和医药等消费品行业;(4)符合国家产业结构调整规划,在未来产业升级过程中受益的优势装备制造业;(5)国企改革推进受益的蓝筹板块和个股。

本基金将一如既往地恪守基金契约,在价值投资理念的指导下,精选个股,注重组合的流动性,力争在有效控制风险的情况下为投资者创造最大的价值。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	1,207,211,795.93	75.69
	其中:股票	1,207,211,795.93	75.69
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	130,000,405.00	8.15
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	235,020,734.24	14.74
7	其他资产	22,673,954.80	1.42
8	合计	1,594,906,889.97	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	采矿业	-	-
C	制造业	622,524,014.98	39.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,291,466.00	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	30,966,990.00	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	322,967,136.56	20.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	114,042,192.55	7.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	115,419,995.84	7.26
S	综合	-	-
	合计	1,207,211,795.93	75.91

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	600872	中炬高新	8,006,120	116,168,801.20	7.31
2	300271	华宇软件	3,000,000	105,750,000.00	6.65
3	300357	我武生物	2,562,181	91,751,701.61	5.77
4	300188	美亚柏科	3,800,000	84,702,000.00	5.33
5	002507	涪陵榨菜	4,403,400	71,555,250.00	4.50
6	300376	易事特	2,004,500	69,816,735.00	4.39
7	300479	神思电子	1,432,000	69,738,400.00	4.39
8	000793	华闻传媒	7,000,000	67,410,000.00	4.24
9	002400	省广股份	3,599,881	65,733,827.06	4.13
10	300203	聚光科技	2,700,786	64,953,903.30	4.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,191,438.52
2	应收证券清算款	16,240,156.31
3	应收股利	-
4	应收利息	65,131.10
5	应收申购款	5,177,228.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,673,954.80

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5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 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,189,010,563.27
报告期基金总申购份额	214,570,185.24
减:报告期基金总赎回份额	442,598,975.93
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,960,981,772.58

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,本基金的基金管理人未运用固有资金交易本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、关于核准金鼎证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复

2、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同

3、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

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——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层。

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)31089000,400-888-8688

客户投诉电话:(021)31089000

公司网址:http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司
二〇一五年十月二十六日

国泰金龙债券证券投资基金

2015 第三季度报告

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:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21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2015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
基金主代码	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	917,037,853.67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总回报,力求基金资产的稳定增值。
投资策略	以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券置换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。在对拟公开发行股票的公司进行充分研究的基础上,择机参与拟公开发行股票的申购。因申购所持有的股票资产自可上市交易之日起在180个自然日内卖出;因可转债转股所持有的股票资产自可上市交易之日起在180个自然日内卖出。
业绩比较基准	自2015年9月1日起,本基金的业绩比较基准由"中信全债指数收益率",变更为"中证综合债指数收益率"。
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
下属分级基金的基金简称	国泰金龙债券A / 国泰金龙债券C
下属分级基金的交易代码	020002 / 020012
报告期末下属分级基金的份额总额	422,035,700.00份 / 495,002,153.67份

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)	
	国泰金龙债券A	国泰金龙债券C
1.本期已实现收益	5,606,654.80	4,038,503.44
2.本期利润	7,443,890.06	5,273,357.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0202	0.