

# 国泰中小盘成长股票型证券投资基金 (LOF)（原金盛证券投资基金转型） 2009年第4季度报告

2009年12月31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：2010年1月20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2010年1月18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。

本基金系原封闭式基金金盛证券投资基金转型而来。金盛证券投资基金自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金盛证券投资基金的上市交易，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。

从2009年10月19日起金盛证券投资基金终止上市，并自金盛证券投资基金终止上市之日起，基金名称更改为“国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”，《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。

本报告中，原金盛证券投资基金报告期自2009年10月1日至2009年10月18日止，国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）报告期自2009年10月19日至2009年12月31日止。

本报告中财务资料未经审计。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

|             |   |
|-------------|---|
| 基金简称:       | 国泰中小盘成长股票(LOF)  |
| 基金主代码:      | 160211  |
| 基金运作方式:     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日:    | 2009年10月19日   |
| 报告期末基金份额总额: | 5,111,289,319.09份   |
| 投资目标:       | 本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略:       | 本基金的大类资产配置主要通过宏观经济发展趋势的预测分析,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。其中,股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小盘股票为投资对象,采取自下而上、三重过滤的精选个股策略。 |
| 业绩比较基准:     | 本基金的业绩基准=35%×天相中盘成长指数+45%×天相小盘成长指数+20%×中证全债指数   |
| 风险收益特征:     | 本基金是股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司,属于高风险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  |

### 2.2 原金盛证券投资基金

|         |        |
|---------|--------|
| 基金简称:   | 国泰金盛封闭 |
| 基金主代码:  | 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。<br>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

| 项目              | 2009年第4季度报告                  |                              |
|-----------------|------------------------------|------------------------------|
|                 | 转型后(2009年10月19日-2009年12月31日) | 转型前(2009年10月01日-2009年10月18日) |
| 1. 本期已实现收益      | 3,313,410.58                 | -659,304.50                  |
| 2. 本期利润         | 108,394,876.71               | 10,780,392.68                |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0386                       | 0.0216                       |
| 4. 期末基金资产净值     | 5,172,690,478.54             | 549,926,313.74               |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.012                        | 1.0999                       |

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 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

##### 3.2.1.1 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

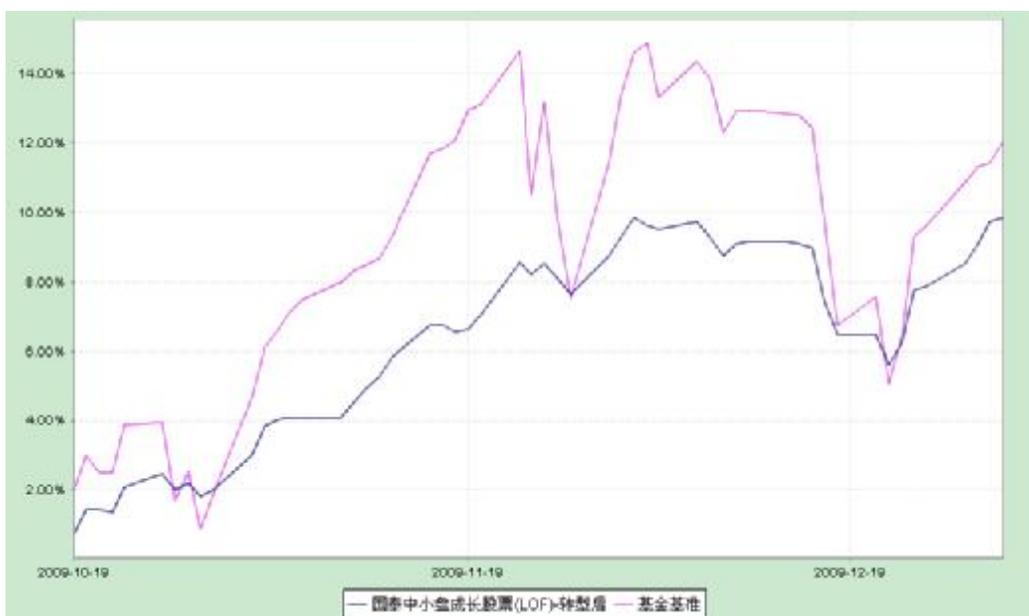
| 阶段                              | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|---------------------------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 2009年10月<br>19日至2009<br>年12月31日 | 9.84%  | 0.53%         | 12.03%         | 1.47%                 | -2.19% | -0.94% |

##### 3.2.1.2 自基金转型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

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

转型后累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年10月19日至2009年12月31日)



注：(1) 本基金的合同生效日为2009年10月19日，截止至2009年12月31日不满一年；

(2) 本基金的建仓期为6个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在6个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.2 金盛证券投资基金

#### 3.2.2.1 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 |
|------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
| 2009年10月1日至2009年10月18日 | 2.00%  | 0.63%     | -          | -             | -   | -   |

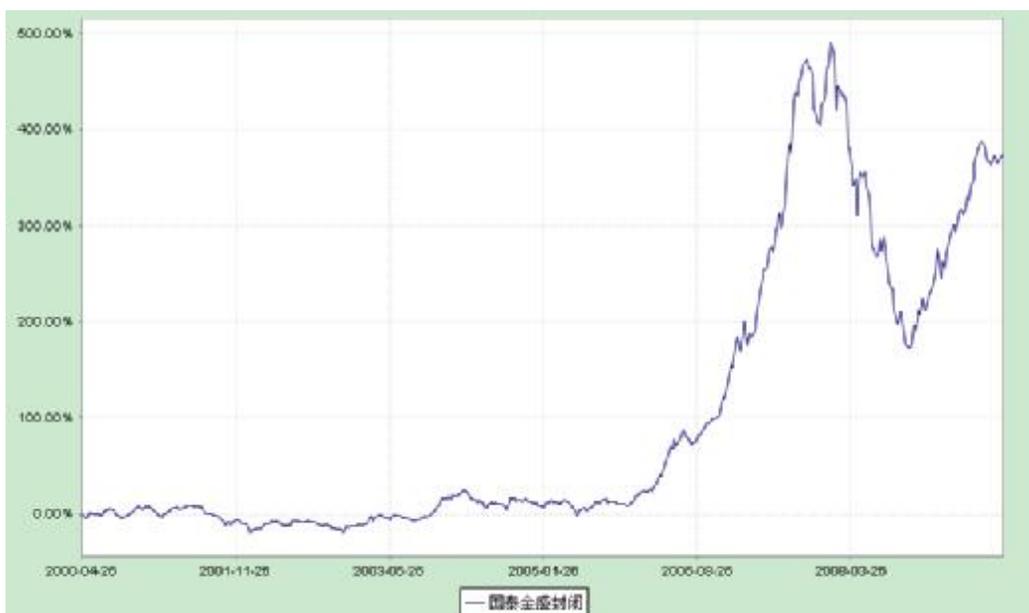
注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

#### 3.2.2.2 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

转型前累计净值增长率历史走势图

(2000年4月26日至2009年10月18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 |        |  |
| 张玮 | 本基金的基金经理 (原国泰金盛封闭的基金经理)、国泰金鹰增长股票的基金经理 | 2009-10-19  | -    | 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月至2009年10月兼任国泰金盛封闭的基金经理,2009年10月起任国泰中小盘成长股票的基金经理。 |

### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

本基金合同生效日为2009年10月19日,截止本报告期末不满完整投资季度,不作比较。

#### 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

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

##### (1) 2009年第四季度证券市场与投资管理回顾

在国际市场环境趋暖,国内流动性收紧政策趋稳的背景下,加之企业盈利增长超预期,继三季度调整之后,四季度市场呈现震荡攀升走势,单季涨幅达到18%。大消费板块中的家电、汽车、餐饮旅游、商业零售等行业涨幅居前,而上半年表现突出、与流动性关系密切的房地产、金融服务以及公用事业等行业涨幅落后。

国泰金盛封闭在四季度成功转型为国泰中小盘成长股票型开放式基金(LOF),在建仓期稳步提高股票资产比例,重点配置了金融、家电、交运设备、商业贸易、机械等行业。考虑估值风险,建仓阶段重点投向具有估值优势的中盘成长股,对于高估值的小市值品种相对谨慎。

##### (2) 2010年第一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体现亦属正常。随着政府调整经济结构的力度不断加强,证券市场行情演绎可能也将呈现相应的行业结构分化特征。

一季度我们仍处于建仓阶段，将着眼于全年布局，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，更多地通过自下而上的选股方法，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。在目前中小市值股票估值水平已经不低的情况下，优先选择有估值安全边际的中盘成长股，同时耐心等待优质小盘成长股估值合理回归的介入机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金盛封闭 2009 年 10 月 1 日至 10 月 18 日期间的净值增长率为 2.00%；国泰中小盘成长股票（LOF）2009 年 10 月 19 日至 12 月 31 日期间的净值增长率为 9.84%，同期业绩比较基准为 12.03%。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)投资组合报告

（报告期：2009 年 10 月 19 日-2009 年 12 月 31 日）

#### 5.1.1 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              | 2,235,271,730.30 | 33.03        |
|    | 其中：股票             | 2,235,271,730.30 | 33.03        |
| 2  | 固定收益投资            | 91,269,000.00    | 1.35         |
|    | 其中：债券             | 91,269,000.00    | 1.35         |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 3  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 4  | 买入返售金融资产          | 2,405,800,000.00 | 35.55        |
|    | 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      | 2,033,521,747.81 | 30.05        |
| 6  | 其他资产              | 1,802,489.23     | 0.03         |
| 7  | 合计                | 6,767,664,967.34 | 100.00       |

**5.1.2 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       | 20,762,344.24    | 0.40         |
| B   | 采掘业            | 46,340,284.56    | 0.90         |
| C   | 制造业            | 1,158,094,558.12 | 22.39        |
| C0  | 食品、饮料          | 106,222,468.48   | 2.05         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 6,157,521.84     | 0.12         |
| C2  | 木材、家具          | -                | -            |
| C3  | 造纸、印刷          | -                | -            |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 60,294,498.73    | 1.17         |
| C5  | 电子             | 140,343,362.72   | 2.71         |
| C6  | 金属、非金属         | 310,289,228.76   | 6.00         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 371,690,419.44   | 7.19         |
| C8  | 医药、生物制品        | 163,097,058.15   | 3.15         |
| C99 | 其他制造业          | -                | -            |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,906,359.02     | 0.04         |
| E   | 建筑业            | 72,162,180.84    | 1.40         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 2,688,434.22     | 0.05         |
| G   | 信息技术业          | 127,702,360.44   | 2.47         |
| H   | 批发和零售贸易        | 212,635,846.34   | 4.11         |
| I   | 金融、保险业         | 389,386,395.63   | 7.53         |
| J   | 房地产业           | 169,990,406.69   | 3.29         |
| K   | 社会服务业          | 33,602,560.20    | 0.65         |
| L   | 传播与文化产业        | -                | -            |
| M   | 综合类            | -                | -            |
|     | 合计             | 2,235,271,730.30 | 43.21        |

**5.1.3 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  | 600660 | 福耀玻璃   | 15,561,704 | 232,491,857.76 | 4.49         |
| 2  | 600036 | 招商银行   | 9,869,832  | 178,150,467.60 | 3.44         |
| 3  | 601318 | 中国平安   | 3,108,895  | 171,269,025.55 | 3.31         |
| 4  | 600704 | 中大股份   | 6,391,696  | 169,763,445.76 | 3.28         |
| 5  | 000527 | 美的电器   | 5,871,561  | 136,220,215.20 | 2.63         |
| 6  | 600060 | 海信电器   | 5,492,657  | 119,965,624.03 | 2.32         |
| 7  | 600887 | *ST 伊利 | 3,972,686  | 105,196,725.28 | 2.03         |
| 8  | 600970 | 中材国际   | 1,810,622  | 67,300,819.74  | 1.30         |
| 9  | 600406 | 国电南瑞   | 1,368,563  | 67,004,844.48  | 1.30         |
| 10 | 600325 | 华发股份   | 3,573,363  | 66,964,822.62  | 1.29         |

#### 5.1.4 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       | 41,434,000.00 | 0.80         |
| 2  | 央行票据       | 49,835,000.00 | 0.96         |
| 3  | 金融债券       | -             | -            |
|    | 其中: 政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券       | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券    | -             | -            |
| 6  | 可转债        | -             | -            |
| 7  | 其他         | -             | -            |
| 8  | 合计         | 91,269,000.00 | 1.76         |

#### 5.1.5 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  | 0901049 | 09 央行票据 49 | 500,000 | 49,835,000.00 | 0.96         |
| 2  | 010004  | 20 国债(4)   | 210,000 | 21,168,000.00 | 0.41         |
| 3  | 010203  | 02 国债(3)   | 200,000 | 20,266,000.00 | 0.39         |

### 5.1.6 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。

### 5.1.7 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。

### 5.1.8 投资组合报告附注

5.1.8.1 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。

5.1.8.2 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。

#### 5.1.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元）     |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 422,304.52   |
| 2  | 应收证券清算款 | 134,275.35   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,237,725.56 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | 8,183.80     |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,802,489.23 |

#### 5.1.8.4 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。

#### 5.1.8.5 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  | 600060 | 海信电器 | 55,680,000.00  | 1.08         | 定向增发     |

## 5.2 原金盛证券投资基金投资组合报告

(报告期: 2009年10月01日-2009年10月18日)

### 5.2.1 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               | 176,644,487.58 | 32.00        |
|    | 其中: 股票             | 176,644,487.58 | 32.00        |
| 2  | 固定收益投资             | 310,198,300.00 | 56.19        |
|    | 其中: 债券             | 310,198,300.00 | 56.19        |
|    | 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       | 56,203,124.79  | 10.18        |
| 6  | 其他资产               | 8,988,212.11   | 1.63         |
| 7  | 合计                 | 552,034,124.48 | 100.00       |

### 5.2.2 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      | 5,338,124.76  | 0.97         |
| C  | 制造业      | 88,555,663.42 | 16.10        |
| C0 | 食品、饮料    | 13,988,400.00 | 2.54         |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | -             | -            |
| C2 | 木材、家具    | -             | -            |

|     |                |                |       |
|-----|----------------|----------------|-------|
| C3  | 造纸、印刷          | -              | -     |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | -              | -     |
| C5  | 电子             | -              | -     |
| C6  | 金属、非金属         | 31,580,251.56  | 5.74  |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 38,069,414.02  | 6.92  |
| C8  | 医药、生物制品        | 4,917,597.84   | 0.89  |
| C99 | 其他制造业          | -              | -     |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -              | -     |
| E   | 建筑业            | 11,007,872.00  | 2.00  |
| F   | 交通运输、仓储业       | -              | -     |
| G   | 信息技术业          | 6,849,848.50   | 1.25  |
| H   | 批发和零售贸易        | 13,580,593.32  | 2.47  |
| I   | 金融、保险业         | 13,621,160.00  | 2.48  |
| J   | 房地产业           | 19,135,570.80  | 3.48  |
| K   | 社会服务业          | 18,555,654.78  | 3.37  |
| L   | 传播与文化产业        | -              | -     |
| M   | 综合类            | -              | -     |
|     | 合计             | 176,644,487.58 | 32.12 |

### 5.2.3 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  | 600660 | 福耀玻璃  | 1,732,602 | 19,145,252.10 | 3.48         |
| 2  | 002140 | 东华科技  | 622,882   | 18,555,654.78 | 3.37         |
| 3  | 002073 | 青岛软控  | 900,000   | 14,778,000.00 | 2.69         |
| 4  | 000338 | 潍柴动力  | 256,360   | 14,433,068.00 | 2.62         |
| 5  | 600704 | 中大股份  | 700,000   | 10,955,000.00 | 1.99         |
| 6  | 000656 | ST东源  | 669,002   | 9,854,399.46  | 1.79         |
| 7  | 600887 | *ST伊利 | 450,000   | 9,189,000.00  | 1.67         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 8  | 000024 | 招商地产 | 300,000 | 8,142,000.00 | 1.48 |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 129,000 | 7,229,160.00 | 1.31 |
| 10 | 600325 | 华发股份 | 378,681 | 7,081,334.70 | 1.29 |

#### 5.2.4 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       | 41,518,300.00  | 7.55         |
| 2  | 央行票据       | 198,624,000.00 | 36.12        |
| 3  | 金融债券       | 70,056,000.00  | 12.74        |
|    | 其中: 政策性金融债 | 70,056,000.00  | 12.74        |
| 4  | 企业债券       | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券    | -              | -            |
| 6  | 可转债        | -              | -            |
| 7  | 其他         | -              | -            |
| 8  | 合计         | 310,198,300.00 | 56.41        |

#### 5.2.5 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 | 70,056,000.00 | 12.74        |
| 2  | 0901043 | 09 央行票据 43 | 500,000 | 49,835,000.00 | 9.06         |
| 2  | 0901047 | 09 央行票据 47 | 500,000 | 49,835,000.00 | 9.06         |
| 4  | 0901035 | 09 央行票据 35 | 400,000 | 39,868,000.00 | 7.25         |
| 5  | 0801119 | 08 央票 119  | 400,000 | 39,152,000.00 | 7.12         |

#### 5.2.6 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。

#### 5.2.7 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。

### 5.2.8 投资组合报告附注

5.2.8.1 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。

5.2.8.2 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。

#### 5.2.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 422,304.52   |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,021,077.22 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,544,830.37 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 8,988,212.11 |

#### 5.2.8.4 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。

#### 5.2.8.5 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原封闭式基金情况

单位：份

|                    |               |
|--------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的封闭式基金份额 | 22,267,084.00 |
| 报告期初至转型前买入总份额      | -             |

|                      |               |
|----------------------|---------------|
| 报告期初至转型前卖出总份额        | -             |
| 转型前最后一日管理人持有的封闭式基金份额 | 22,267,084.00 |
| 转型前最后一日持有的封闭式基金份额占基金 | 4.45          |

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

|                   |                  |
|-------------------|------------------|
| 合同生效日基金份额总额       | 500,000,000.00   |
| 合同生效日至报告期末基金总申购份额 | 4,514,369,288.09 |
| 合同生效日至报告期末卖出总份额   | -                |
| 合同生效日至报告期末拆分份额    | 96,920,031.00    |
| 报告期期末基金份额总额       | 5,111,289,319.09 |

注：截止本报告期末，本基金尚处于封闭期。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金自2009年10月22日至2009年11月18日开放集中申购，经普华永道中天会计师事务所有限公司验资后，于集中申购验资完成日对原金盛证券投资基金进行了基金份额折算，折算后原金盛证券投资基金份额变更登记为国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）份额。并在2009年11月25日发布了《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）集中申购结果公告》和《关于原金盛证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

根据《国泰中小盘成长证券投资基金（LOF）基金合同》及《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》等有关规定，经深圳证券交易所深证上[2009]204号文核准，本基金于2010年1月7日起上市交易，同日开放日常申购、赎回业务，并于2010年1月4日发布《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》和《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回业务的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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、关于同意国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)募集的批复
- 6、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同
- 7、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)托管协议
- 8、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)代销协议
- 9、报告期内披露的各项公告
- 10、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

### 9.2 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。

### 9.3 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

2010年1月20日