

基金代码：184703 基金简称：基金金盛

金盛证券投资基金季度报告 2008 年第 2 季度

一、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 2008 年 7 月 14 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。

二、基金产品概况

1、基金简介

基金简称：基金金盛

交易代码：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

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、基金产品说明

(1) 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。

(2) 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策略；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。

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，将资产权重的较大部分配置到处于起步或成长阶段的行业。

(3) 业绩比较基准：无。

(4) 风险收益特征：承担较高风险，获取较高的超额收益。

三、主要财务指标和基金净值表现（未经审计）

1、主要财务指标

2008 年 4-6 月

1、本期利润 -146,363,493.84 元

2、本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 -220,733,631.97 元

3、基金份额本期利润 -0.2927 元

4、期末基金资产净值 613,846,816.09 元

5、期末基金份额净值 1.2277 元

注：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。

2、基金金盛净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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	-18.36%	4.25%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

3、基金金盛累计净值增长率历史走势图

四、基金管理人报告

1、基金管理合规性声明

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。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金类型包括：封闭式基金、开放式基金的股票型基金、指数型股票基金、混合基金（偏股型）、债券基金（债券型）、保本基金和货币基金等，其中封闭式基金三只、股票型基金三只、混合基金（偏股型）三只。本公司所管理的各类型基金大类资产配置仓位相当，同类型基金的业绩表现差异均在 5%之内。

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。

2、基金经理介绍

吴战峰，男，硕士研究生，13 年证券基金从业经历。1995 年 2 月至 1996 年 8 月在深圳中大投资基金管理公司投资部任投资经理；1996 年 8 月至 2000 年 10 月在平安证券公司资产管理部任投资经理；2000 年 10 月至 2004 年 8 月在招商证券公司研究开发中心任行业部经理、高级分析师；2004 年 8 月至 2005 年 4 月在国信证券公司任行业首席分析师；2006 年 2 月至 2007 年 9 月在国投瑞银基金管理有限公司任高级组合经理；2007 年 10 月加盟国泰基金管理有限公司，2008 年 4 月起任基金金盛的基金经理。

3、本基金的投资策略和业绩表现说明

(1) 2008 年第二季度证券市场与投资回顾

2008 年二季度，市场整体呈现先扬后抑的形态，在 4 月底出台的降低印花税政策刺激下，市场出现了短期的上涨行情，但随后市场在投资者担忧全球经济放缓、国内高通胀、自然灾害对经济的负面影响、“大小非”减持等因素的影响下，以地产、有色等周期性等行业领先市场持续大幅下跌，市场投资意愿低迷，相对而言，煤炭、医药、通信设备等制造行业表现相对稳定。

本基金在二季度初期在市场反弹过程中保持了较高的持股比例，在二季度中后期逐步降低了对钢铁、汽车、银行等行业的配置，对行业前景争议较大的地产、有色等行业采取更为谨慎的投资策略，适当增加了煤炭、医药、商业零售行业的配置。

(2) 2008 年第三季度证券市场及投资管理展望

我们对 08 年三季度 A 股市场的整体看法依然谨慎，投资者依然担忧政府为抑制高通胀而采取措施使经济降温，另外，部分周期性行业比如地产、有色、钢铁等在未来一段时间内能否保持盈利增长也不明确。但随着市场大幅下跌，部分公司的投资机会显现，我们看好医药、煤炭、基建、商业零售等行业的投资机会。

五、基金投资组合报告（未经审计）

1、报告期末基金资产组合情况

分 类	市 值(元)	占 总 资 产 比 例
股票	374,466,352.51	60.50%
债券	198,318,505.90	32.04%
权证	647,529.12	0.10%
银行存款及结算备付金	36,983,306.58	5.97%
其他资产	8,584,046.61	1.39%
合 计	618,999,740.72	100.00%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市 值(元)	占 净 值 比 例
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采掘业	50,714,952.39	8.26%
3	制造业	110,908,547.51	18.07%
	其中：食品、饮料	5,271,339.76	0.86%
	石油、化学、塑胶、塑料	23,404,340.08	3.81%
	金属、非金属	52,319,987.53	8.52%
	机械、设备、仪表	14,114,702.64	2.30%
	医药、生物制品	15,790,852.50	2.57%
	其他制造业	7,325.00	0.00%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	26,904,630.64	4.38%
5	建筑业	9,190,940.20	1.50%
6	交通运输、仓储业	18,155,871.41	2.96%
7	信息技术业	31,104,565.25	5.07%
8	批发和零售贸易	28,127,316.46	4.58%
9	金融、保险业	81,620,362.17	13.30%
10	房地产业	17,739,166.48	2.89%
11	社会服务业	-	-
12	传播与文化产业	-	-
13	综合类	-	-
	合 计	374,466,352.51	61.00%

3、报告期末按市值占基金资产净值比例的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数 量(股)	市 值(元)	占 净 值 比 例
1	600000	浦发银行	802,428	17,653,416.00	2.88%
2	601169	北京银行	1,233,773	16,964,378.75	2.76%
3	601628	中国人寿	560,931	13,417,469.52	2.19%
4	600036	招商银行	561,720	13,155,482.40	2.14%
5	600188	兖州煤业	633,686	12,559,656.52	2.05%
6	600030	中信证券	490,000	11,720,800.00	1.91%
7	000063	中兴通讯	172,355	10,789,423.00	1.76%
8	601001	大同煤业	499,875	10,567,357.50	1.72%
9	002251	步步高	186,316	9,045,641.80	1.47%
10	601006	大秦铁路	654,510	8,907,881.10	1.45%

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债 券 品 种	市 值(元)	占 净 值 比 例
1	国家债券	175,910,051.10	28.66%

2	金融债券	19,870,000.00	3.24%
3	企业债券	2,538,454.80	0.41%
	合计	198,318,505.90	32.31%

5、报告期末按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	99 国债(8)	65,386,693.20	10.65%
2	21 国债(15)	49,828,073.50	8.12%
3	20 国债(4)	41,712,954.60	6.80%
4	05 农发 14	19,870,000.00	3.24%
5	02 国债(10)	18,982,329.80	3.09%

6、报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产的构成如下：

分类	市值(元)
存出保证金	1,137,218.63
应收证券清算款	3,108,126.64
应收利息	3,357,689.45
应收股利	65,243.04
待摊费用	915,768.85
合计	8,584,046.61

(4) 本报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

(5) 本报告期末本基金持有的权证明细如下：

权证代码	权证名称	数量(份)	成本(元)
580024	宝钢 CWB1	540,960	761,791.32
合计		540,960	761,791.32

(6) 本报告期内本基金未投资资产支持证券。

(7) 由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

六、本基金管理人运用固有资金投资本基金情况

截止本报告期末，本基金管理人运用固有资金投资本基金的基金份额为 22,267,084 份。报告期内所持有的基金份额无变动。

七、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、报告期内披露的各项公告
- 6、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

备查文件存放地点：本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点--上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 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。

投资者查阅方式：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) 33134688, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 23060279

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2008年7月19日