金盛证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30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：二〇〇九年八月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于2009年8月21日复核了本报告中的财务指标、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，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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰金盛封闭
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
基金合同存续期	至2009年11月30日止
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2000年6月30日

2.2 基金产品说明

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。 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。
风险收益特征	承担较高风险，获取较高的超额收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	尹东
	联系电话	021-38561600转	010-67595003
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-888-8688	010-67595096
传真		021-38561800	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2009年1月1日－2009年6月30日）
本期已实现收益	116,595,565.67
本期利润	229,914,802.05
加权平均基金份额本期利润	0.4598
本期基金份额净值增长率	44.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009年1月1日－2009年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.2295
期末基金资产净值	750,417,944.93
期末基金份额净值	1.5008

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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	8.35%	2.13%	-	-	-	-
过去三个月	16.98%	1.80%	-	-	-	-
过去六个月	44.17%	2.82%	-	-	-	-
过去一年	22.24%	3.65%	-	-	-	-
过去三年	144.90%	3.57%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	349.75%	2.72%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

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

金盛证券投资基金

自基金合同生效以来基金累计净值增长率历史走势图

（2000年4月26日至2009年6月30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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日，是经中国证监会证监基字〔1998〕5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至2009年6月30日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、金盛证券投资基金，以及11只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金。另外，本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月24日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
吴战峰	本基金的基金经理	2008-4-3	-	14	硕士研究生。曾任职于深圳中大投资基金管理公司、平安证券公司、招商证券公司、国信证券公司、国投瑞银基金管理有限公司。2007年10月加盟国泰基金管理有限公司，2008年4月起任国泰金盛封闭的基金经理。
张玮	本基金的基金经理、国泰金鹰增长股票的基金经理	2009-4-22	-	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月起兼任国泰金盛封闭的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

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、债券基金、保本基金和货币基金等，其中封闭式基金三只、股票型基金两只、混合基金（股型）二只。本基金与本基金管理人管理的其他同类型基金（除国泰金鑫封闭外）的业绩表现差异均在5%之内，与国泰金鑫封闭的业绩表现差异为5.77%，主要由于行业配置差异所致。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2009年上半年国内A股市场呈现持续上涨的行情，推动市场持续上涨的主要原因是投资者预期全球经济特别是国内经济见底回升、市场流动性过剩、A股市场估值处于历史较低水平等因素。2009年上半年行业轮动现象比较突出，一季度小盘股、新能源、地产、工程机械等行业表现活跃，二季度金融、地产、煤炭、汽车等行业表现良好。

本基金在09年年初，由于对市场持比较乐观的态度，股票配置比例较高，在行业配置方面比较均衡，把握了一些中小盘股票的投资机会，并在一季度末逐步减持了部分估值过高的中小盘股，在二季度初逐步增大了金融、地产、采掘行业的配置。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对2009年下半年证券市场依然持谨慎乐观态度，在上半年证券市场持续大幅上涨之后，虽然部分行业和公司的投资价值得到比较好的挖掘，但在全球经济见底预期、国内四万亿投资的拉动以及地产、汽车等行业的强劲拉动下，中国经济的增长趋势仍十分明确，部分行业的投资机会依然存在，我们看好金融、地产、能源、基建等行业的投资机会，但仍需要关注部分行业和公司估值出现泡沫的风险以及宏观经济政策变化对市场的影响，我们仍将坚持自下而上的选择投资目标，并以研究为基础，对公司进行理性的价值评估，合理地进行行业配置，为基金持有人争取更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人长设的估值委员会按照相关法律法规规定，并依据相关制度及流程，对基金估值相关工作进行评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，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

本基金本报告期内未进行收益分配，本基金遵守了基金合同和相关法律法规的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金盛证券投资基金

报告截止日：2009年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资 产：		
银行存款	13,737,608.38	20,557,565.52
结算备付金	699,675.06	2,901,421.88
存出保证金	390,741.00	391,375.85
交易性金融资产	680,664,623.13	512,733,092.26
其中：股票投资	522,360,610.13	356,945,529.50
债券投资	158,304,013.00	155,787,562.76
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	60,631,452.95	-
应收利息	2,449,111.33	4,548,563.71
应收股利	28,645.00	-
应收申购款	-	-
其他资产	-	-
资产总计	758,601,856.85	541,132,019.22
负债和所有者权益	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	9,000,000.00
应付证券清算款	6,201,823.54	9,519,707.36
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	601,516.81	362,523.84
应付托管费	100,252.86	60,420.67
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	229,822.98	793,882.81
应交税费	287,030.48	287,030.48
应付利息	-	36.00
应付利润	283,104.68	283,104.68
其他负债	480,360.57	322,170.50
负债合计	8,183,911.92	20,628,876.34
所有者权益：		
实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未分配利润	250,417,944.93	20,503,142.88
所有者权益合计	750,417,944.93	520,503,142.88
负债和所有者权益总计	758,601,856.85	541,132,019.22

注：报告截止日2009年6月30日，基金份额净值1.5008元，基金份额总额500,000,000.00份。

6.2 利润表

会计主体：金盛证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入	234,933,699.66	-421,804,799.40
1.利息收入	2,152,076.97	4,497,197.57
其中：存款利息收入	222,794.70	396,068.86
债券利息收入	1,919,226.27	3,974,674.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,056.00	126,454.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	119,462,386.31	-153,154,083.11
其中：股票投资收益	117,548,130.19	-155,964,483.96
债券投资收益	-136,524.44	504,951.85
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	105,832.34
股利收益	2,050,780.56	2,199,616.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	113,319,236.38	-273,147,913.86
4.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
二、费用（以“-”号填列）	-5,018,897.61	-22,252,156.12
1.管理人报酬	-2,968,715.22	-8,311,030.40
2.托管费	-494,786.18	-1,386,340.06
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-1,326,751.81	-11,149,378.71
5.利息支出	-144.00	-830,939.92
其中：卖出回购金融资产支出	-144.00	-830,939.92
6.其他费用	-228,500.40	-574,467.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	229,914,802.05	-444,056,955.52

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金盛证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	20,503,142.88	520,503,142.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	229,914,802.05	229,914,802.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	250,417,944.93	750,417,944.93
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日		
	实收基金	未分配利润	实收基金
一、期初所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	971,403,768.63	1,471,403,768.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-444,056,955.52	-444,056,955.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-413,499,997.02	-413,499,997.02
五、期末所有者权益（基金净值）	500,000,000.00	113,846,816.09	613,846,816.09

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期间和本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司（国泰基金”）	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司（国泰君安”）	基金发起人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	85,953,033.33	10.19%	1,119,244,029.94	35.14%

6.4.4.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	18,534,941.01	96.44%

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	69,837.42	9.87%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	933,392.38	34.93%	208,850.86	20.78%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至@2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至@2008年6月30日
当期应支付的管理费	2,968,715.22	8,311,030.40
其中：当期已支付	2,367,198.41	7,508,771.86
期末未支付	601,516.81	802,258.54

注：支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的20%，超过部分不计提管理人报酬。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值X 1.5%／当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年6月30日
当期应支付的托管费	494,786.18	1,386,340.06
其中：当期已支付	394,533.32	1,252,048.97
期末未支付	100,252.86	134,291.09

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X 0.25%／当年天数。

鉴于对2008年4月28日基金收益分配实施中有关公允价值变动问题存在不同理解，本基金管理人和托管人决定对上述公允价值变动自2008年4月28日起暂停计提基金管理费和基金托管费。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期内，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。（2008年1月1日至2008年6月30日：同）。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年6月30日
期初持有的基金份额	22,267,084.00	22,267,084.00
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	22,267,084.00	22,267,084.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.45%	4.45%

注：（1）根据中国证监会证监基字〔2005〕96号《关于基金管理公司运用固有资金进行基金投资有关事项的通知》的有关规定，国泰基金运用固有资金投资本基金，其持有本基金份额的比例不得超过本基金总份额的10%，且持有的基金份额在基金合同终止前不得出售。

（2）封闭式基金均是通过交易所买入，除交易所统一收取的手续费外无其他费用。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009年6月30日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安	2,692,308.00	0.54%	2,692,308.00	0.54%

注：封闭式基金均是通过交易所买入，除交易所统一收取的手续费外无其他费用。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	13,737,608.38	214,246.45	33,439,536.21	354,727.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金在承销期内未买入关联方所承销的证券（2008年1月1日至2008年6月30日：无）。

6.4.5 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至2009年6月30日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限制的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

截至2009年6月30日止，本基金未持有因上市公司未能按交易所要求按时披露重要信息、公布的重大事项可能产生重大影响而暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至2009年6月30日止，本基金无正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	522,360,610.13	68.86
	其中：股票	522,360,610.13	68.86
2	固定收益投资	158,304,013.00	20.87
	其中：债券	158,304,013.00	20.87
	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	14,437,283.44	1.90
6	其他资产	63,499,950.28	8.37
7	合计	758,601,856.85	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	32,799,918.96	4.37
C	制造业	168,620,859.19	22.47
C0	食品、饮料	17,057,856.48	2.27
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	4,236,454.20	0.56
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	33,443,417.65	4.46
C7	机械、设备、仪表	84,007,746.75	11.19
C8	医药、生物制品	29,875,384.11	3.98
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	21,324,164.00	2.84
E	建筑业	24,407,536.30	3.25
F	交通运输、仓储业	30,258,816.36	4.03
G	信息技术业	26,547,779.48	3.54
H	批发和零售贸易	28,189,643.53	3.76
I	金融、保险业	130,879,076.81	17.44
J	房地产业	38,803,769.92	5.17
K	社会服务业	17,556,524.86	2.34
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,972,520.72	0.40
	合计	522,360,610.13	69.61

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	1,638,678	37,722,367.56	5.03
2	600036	招商银行	1,394,494	31,250,610.54	4.16
3	002073	青岛软控	1,098,289	21,921,848.44	2.92
4	002140	东华科技	691,474	17,556,524.86	2.34
5	601628	中国人寿	621,001	17,108,577.55	2.28
6	600519	贵州茅台	115,248	17,057,856.48	2.27
7	000024	招商地产	532,450	16,905,287.50	2.25
8	601318	中国平安	321,670	15,909,798.20	2.12
9	600660	福耀玻璃	1,732,602	14,224,662.42	1.90
10	600704	中大股份	936,080	13,273,614.40	1.77

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本管理人网站的半年度报告报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002073	青岛软控	21,063,251.18	4.05
2	000063	中兴通讯	14,261,161.71	2.74
3	002140	东华科技	12,618,863.88	2.42
4	600660	福耀玻璃	12,125,100.43	2.33
5	600028	中国石化	12,119,775.00	2.33
6	600036	招商银行	11,998,397.84	2.31
7	600704	中大股份	11,872,644.30	2.28
8	601318	中国平安	11,543,108.80	2.22
9	600519	贵州茅台	11,160,548.25	2.14
10	000338	潍柴动力	10,690,535.18	2.05
11	601857	中国石油	10,392,427.00	2.00
12	600009	上海机场	10,267,708.42	1.97
13	600050	中国联通	10,144,513.00	1.95
14	601628	中国人寿	10,035,370.28	1.93
15	601006	大秦铁路	9,164,677.22	1.76
16	600837	海通证券	9,105,824.50	1.75
17	600535	天士力	9,063,369.55	1.74
18	600717	天津港	9,043,235.76	1.74
19	600795	国电电力	8,905,193.18	1.71
20	600000	浦发银行	7,551,448.78	1.45

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600804	鹏博士	55,373,313.30	10.64
2	600100	同方股份	45,028,199.61	8.65
3	600436	片仔癀	20,587,803.73	3.96
4	600138	中青旅	19,331,752.23	3.71
5	600256	广汇股份	18,518,828.90	3.56
6	600050	中国联通	13,597,224.20	2.61
7	002140	东华科技	12,830,974.54	2.47
8	002084	海鸥卫浴	12,070,710.19	2.32
9	600527	江南高纤	11,774,956.56	2.26
10	002063	远光软件	11,689,993.66	2.25
11	000983	西山煤电	11,572,681.65	2.22
12	000001	深发展A	10,248,322.25	1.97
13	600348	国阳新能	9,664,570.29	1.86
14	600963	岳阳纸业	8,674,102.07	1.67
15	600000	浦发银行	8,260,379.78	1.59
16	002232	启明信息	8,067,810.07	1.55
17	600867	通化东宝	7,752,811.28	1.49
18	002022	科华生物	7,584,554.95	1.46
19	000651	格力电器	7,509,166.88	1.44
20	600015	华夏银行	7,328,271.44	1.41

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	388,322,120.48
卖出股票的收入（成交）总额	455,095,367.50

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	97,208,914.40	12.95
2	央行票据	12,868,200.00	1.71
3	金融债券	48,200,000.00	6.42
	其中：政策性金融债	48,200,000.00	6.42
4	企业债券	26,898.60	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	158,304,013.00	21.10

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	090401	09农发01	500,000	48,200,000.00	6.42
2	010308	03国债(8)	300,390	30,459,546.00	4.06
3	009908	99国债(8)	240,550	24,223,385.00	3.23
4	010203	02国债(3)	200,000	20,280,000.00	2.70
5	010110	21国债(0)	192,430	19,700,983.40	2.63

7.7 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。

7.8 期末按公允价值