国泰金龙系列证券投资基金 2009 年第 3 季度报告

（本系列基金由国泰金龙债券证券投资基金和国泰金龙行业精选证券投资基金组成）

2009年 9 月 30 日

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：二〇〇九年十月二十八日

国泰金龙债券证券投资基金

2009 第三季度报告

§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 2009 年 10 月 23 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 2009 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
交易代码	020002
系列基金名称	国泰金龙系列证券投资基金
系列其他子基金名称	国泰金龙行业混合(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	295,483,791.30 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	本基金以中信全债指数收益率作为衡量基金业绩的比较基准。
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
下属两级基金的基金简称	国泰金龙债券 A　　国泰金龙债券 C
下属两级基金的交易代码	020002　　020012
报告期末下属两级基金的份额总额	203,456,459.54 份　　92,027,331.76 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(2009 年 7 月 1 日-2009 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	3,261,182.21	1,247,493.79
2.本期利润	-4,011,585.24	-1,816,678.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0157	-0.0174
4.期末基金资产净值	203,224,117.64	91,453,761.45
5.期末基金份额净值	0.999	0.994

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上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

1.国泰金龙债券 A：

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	-1.67%	0.31%	-0.51%	0.05%	-1.16%	0.26%

2.国泰金龙债券 C：

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	-1.78%	0.31%	-0.51%	0.05%	-1.27%	0.26%

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

1.国泰金龙债券 A：

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。

2.国泰金龙债券 C：

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		
林勇	本基金的基金经理，国泰双利债券的基金经理	2006-11-11	2009-7-16	14	硕士研究生。曾任职于江西省人民银行、江西省资金融通中心、招商银行总行、基实基金管理有限公司。2005 年 5 月加盟国泰基金管理有限公司，2005 年 6 月至 2007 年 2 月任国泰货币的基金经理，2006 年 11 月至 2009 年 7 月任国泰金龙债券的基金经理，2009 年 7 月兼任国泰双利债券的基金经理。
陈强	本基金的基金经理，国泰金龙保本混合（二期）的基金经理	2009-3-27	-	12	硕士。曾任职于中行辽宁省分行、大连市商业银行、汉唐证券。2004 年 11 月加盟国泰基金管理有限公司，2004 年 11 月至 2006 年 10 月任国泰金象保本基金的基金经理助理，2005 年 6 月至 2006 年 10 月兼任国泰货币的基金经理助理，2006 年 11 月至 2007 年 11 月任国泰金象保本基金的基金经理，2008 年 8 月起担任国泰金鹿保本混合（二期）的基金经理，2009 年 3 月起兼担任国泰金龙债券的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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，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

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

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

①2009 年第三季度证券市场与投资管理回顾

三季度 A 股惯性冲高后大幅回落，8 月份以来的调整是对前期的快速上涨进行消化。国际、国内经济企稳迹象日趋明显，政策重心从“保增长”逐步向“调结构”进行转变。反映在 A 股市场上，与上半年在超宽松流动性以及对经济反转的乐观预期双重作用下强周期类品种的强势表现不同，市场在三季度也呈现出“调结构”的特征，以医药、食品饮料为代表的防御性板块因其盈利确定性强而取得了相对超额收益，不同行业的市场表现在三季度末开始有向均值回归的趋势。三季度本基金收益率 1.82%，同期沪深 300 下跌 5.11%，超额收益主要来源于：根据我们二季度对市场的判断而采取的应对策略，提前布局了医药、食品饮料、交运设备等利润增长确定性强的行业，并降低了地产、钢铁、采掘等周期性行业的配置。

②2009 年第四季度证券市场及投资管理展望

市场在经历快速上涨和急跌调整后，又重新回到相对均衡期。行业配置和个股选择在四季度对组合的贡献将重于资产配置，目前 A 股市场估值仍处在合理区间，明显的趋势性投资机会尚未出现，因此本基金四季度仍将不采取激进的战略资产配置策略，将组合整体风险控制在较低水平；核心策略仍将围绕“调结构”即经济转型和结构升级这条主线，继续加大消费品配置，并重点关注低碳经济（LCE）相关投资机会。作为应对策略，对全球流动性依然充裕而导致通胀预期受益的上游资源型行业继续保持适当配置；此外，盈利模式清晰、成长性好的中小盘品种也将是我们四季度重点布局的投资方向。

§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	22,031,503.80	5.39
	其中：股票	22,031,503.80	5.39
2	固定收益投资	258,567,662.81	63.24
	其中：债券	258,567,662.81	63.24
	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	110,681,119.71	27.07
6	其他资产	17,598,910.61	4.30
7	合计	408,879,196.93	100.00

注：股票市值为新股中签与可转债转股产生。

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	采掘业	-	-
C	制造业	18,981,358.48	6.44
C0	食品、饮料	287,652.24	0.10
C1	纺织、服装、皮毛	9,900.00	0.00
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	12,805,884.20	4.35
C7	机械、设备、仪表	4,194,546.20	1.42
C8	医药、生物制品	1,683,375.84	0.57
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,477,781.28	0.50
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,256,577.58	0.43
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	315,786.46	0.11
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	22,031,503.80	7.48

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	600219	南山铝业	1,274,228	12,168,877.40	4.13
2	000528	柳 工	218,473	3,587,326.66	1.22
3	601618	中国中冶	265,788	1,477,781.28	0.50
4	002275	桂林三金	55,783	1,404,615.94	0.48
5	002115	三维通信	32,789	632,499.81	0.21
6	002281	光迅科技	17,073	449,190.63	0.15
7	000778	新兴铸管	40,615	409,399.20	0.14
8	002297	博云新材	14,911	361,442.64	0.12
9	601888	中国国旅	26,807	315,786.46	0.11
10	002286	保龄宝	10,863	287,652.24	0.10

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	113,253,835.20	38.43
2	央行票据	20,138,000.00	6.83
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	95,056,347.26	32.26
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	30,119,480.35	10.22
7	其他	-	-
8	合计	258,567,662.81	87.75

5.5 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	010112	21国债(2)	541,220	55,734,835.60	18.91
2	010110	21国债(0)	410,960	42,230,249.60	14.33
3	0701016	07央行票据 16	200,000	20,138,000.00	6.83
4	122974	09靖城投	200,000	19,496,000.00	6.62
5	098089	09湖交投债	200,000	19,314,000.00	6.55

5.6 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。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	11,872,015.18
3	应收股利	-
4	应收利息	4,043,814.00
5	应收申购款	1,433,081.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,598,910.61

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125960	锡业转债	15,272,772.90	5.18
2	110003	新钢转债	3,049,457.40	1.03
3	125709	唐钢转债	1,947,511.45	0.66
4	110567	山鹰转债	1,300,700.00	0.44
5	110598	大荒转债	726,850.00	0.25

5.8.5 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	601618	中国中冶	1,477,781.28	0.50	新股网下申购
2	002275	桂林三金	1,404,615.94	0.48	新股网下申购
3	002115	三维通信	632,499.81	0.21	增发申购未上市
4	002281	光迅科技	449,190.63	0.15	新股网下申购
5	002297	博云新材	361,442.64	0.12	新股网下申购
6	601888	中国国旅	315,786.46	0.11	新股网下申购
7	002286	保龄宝	287,652.24	0.10	新股网下申购

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C
报告期期初基金份额总额	377,098,026.34	145,312,643.64
报告期期间基金总申购份额	88,104,406.80	40,395,802.07
报告期期间基金总赎回份额	261,745,973.60	93,681,113.95
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	203,456,459.54	92,027,331.76

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于同意设立国泰金龙系列证券投资基金的批复

2、国泰金龙系列证券投资基金合同

3、国泰金龙系列证券投资基金托管协议

4、上海浦东发展银行证券交易资金结算协议

5、国泰金龙系列证券投资基金年度报告、半年度报告及收益分配公告

6、国泰金龙系列证券投资基金代销协议

7、报告期内披露的各项公告

8、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

7.2 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。

7.3 查阅方式

投资者索阅方式，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
二〇〇九年十月二十八日

国泰金龙行业精选证券投资基金

2009 第三季度报告

§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 2009 年 10 月 23 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 2009 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
交易代码	020003
系列基金名称	国泰金龙系列证券投资基金
系列其他子基金名称	国泰金龙债券 A(020002)、国泰金龙债券 C(020012)
基金运作方式	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	531,966,222.62 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，确定相应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 股指数和深证 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 股指数和深证 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(2009 年 7 月 1 日-2009 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	40,370,800.96
2.本期利润	8,335,735.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0157
4.期末基金资产净值	415,896,901.30
5.期末基金份额净值	0.782

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。

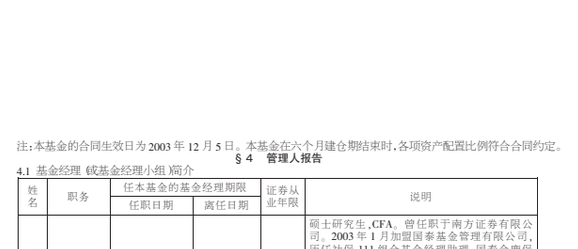
②上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.82%	1.52%	-4.57%	1.69%	6.39%	-0.17%

3.2.2 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



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		
王航	本基金的基金经理	2008-5-17	-	12	硕士研究生，CFA，曾任职于南方证券有限公司。2003 年 1 月加盟国泰基金管理有限公司，历任社保 111 组合基金经理助理、国泰金鹿保本基金和国泰金象保本基金经理助理、国泰金马稳健混合的基金经理助理、国泰金牛创新股票的基金经理助理，2008 年 5 月起任国泰金龙行业混合的基金经理。

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 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

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

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

①2009 年第三季度证券市场与投资管理回顾

三季度 A 股惯性冲高后大幅回落，8 月份以来的调整是对前期的快速上涨进行消化。国际、国内经济企稳迹象日趋明显，政策重心从“保增长”逐步向“调结构”进行转变。反映在 A 股市场上，与上半年在超宽松流动性以及对经济反转的乐观预期双重作用下强周期类品种的强势表现不同，市场在三季度也呈现出“调结构”的特征，以医药、食品饮料为代表的防御性板块因其盈利确定性强而取得了相对超额收益，不同行业的市场表现在三季度末开始有向均值回归的趋势。三季度本基金收益率 1.82%，同期沪深 300 下跌 5.11%，超额收益主要来源于：根据我们二季度对市场的判断而采取的应对策略，提前布局了医药、食品饮料、交运设备等利润增长确定性强的行业，并降低了地产、钢铁、采掘等周期性行业的配置。

②2009 年第四季度证券市场及投资管理展望

市场在经历快速上涨和急跌调整后，又重新回到相对均衡期。行业配置和个股选择在四季度对组合的贡献将重于资产配置，目前 A 股市场估值仍处在合理区间，明显的趋势性投资机会尚未出现，因此本基金四季度仍将不采取激进的战略资产配置策略，将组合整体风险控制在较低水平；核心策略仍将围绕“调结构”即经济转型和结构升级这条主线，继续加大消费品配置，并重点关注低碳经济（LCE）相关投资机会。作为应对策略，对全球流动性依然充裕而导致通胀预期受益的上游资源型行业继续保持适当配置；此外，盈利模式清晰、成长性好的中小盘品种也将是我们四季度重点布局的投资方向。

§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	307,005,785.15	73.09
	其中：股票	307,005,785.15	73.09
2	固定收益投资	89,503,102.40	21.31
	其中：债券	89,503,102.40	21.31
	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	19,532,469.37	4.65
6	其他资产	4,018,416.78	0.96
7	合计	420,059,773.70	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	2,606,321.05	0.63
B	采掘业	13,890,267.34	3.34
C	制造业	155,136,936.47	37.30
C0	食品、饮料	19,584,692.20	4.71
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	2,239,848.20	0.54
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,319,631.78	2.00
C5	电子	4,006,968.00	0.96
C6	金属、非金属	34,098,553.64	8.20
C7	机械、设备、仪表	56,967,612.80	13.70
C8	医药、生物制品	29,919,629.85	7.19
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	391,242.00	0.09
E	建筑业	7,626,381.30	1.83
F	交通运输、仓储业	2,755,696.49	0.66
G	信息技术业	28,529,066.73	6.86
H	批发和零售贸易	12,398,840.86	2.98
I	金融、保险业	64,161,827.54	15.43
J	房地产业	8,681,196.00	2.09
K	社会服务业	8,011,409.10	1.93
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,816,600.27	0.68
	合计	307,005,785.15	73.82

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	601318	中国平安	371,401	18,830,030.70	4.53
2	600406	国电南瑞	470,629	17,606,230.89	4.23
3	600016	民生银行	1,976,000	13,318,240.00	3.20
4	600535	天士力	683,082	12,418,430.76	2.99
5	000656	ST 东 源	932,674	12,329,950.28	2.96
6	600875	东方电气	227,930	10,710,430.70	2.58
7	600887	*ST 伊利	521,446	10,256,842.82	2.47
8	601169	北京银行	572,425	9,862,882.75	2.37
9	600660	福耀玻璃	922,987	9,423,697.27	2.27
10	600104	上海汽车	442,672	8,742,772.00	2.10

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	64,068,102.40	15.40
2	央行票据	9,967,000.00	2.40
3	金融债券	15,468,000.00	3.72
	其中：政策性金融债	15,468,000.00	3.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	89,503,102.40	21.52

5.5 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	010308	03国债(8)	246,650	24,763,660.00	5.95
2	010110	21国债(0)	187,240	19,240,782.40	4.63
3	080401	08农发 01	150,000	15,468,000.00	3.72
4	010004	20国债(4)	119,000	12,089,210.00	2.91
5	0901043	09央行票据 43	100,000	9,967,000.00	2.40

5.6 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。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,840,000.00
2	应收证券清算款	857,665.98
3	应收股利	16,151.31
4	应收利息	769,354.05
5	应收申购款	535,245.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,018,416.78

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 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 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	548,355,914.14
报告期期间基金总申购份额	78,190,839.77
报告期期间基金总赎回份额	94,580,531.29
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	531,966,222.62

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于同意设立国泰金龙系列证券投资基金的批复

2、国泰金龙系列证券投资基金合同

3、国泰金龙系列证券投资基金托管协议

4、上海浦东发展银行证券交易资金结算协议

5、国泰金龙系列证券投资基金年度报告、半年度报告及收益分配公告

6、国泰金龙系列证券投资基金代销协议

7、报告期内披露的各项公告

8、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

7.2 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。

7.3 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
二〇〇九年十月二十八日

宝盈增强收益债券型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年 9 月 30 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇〇九年十月二十八日

§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 2009 年 10 月 23 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 2009 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈增强收益债券
交易代码	213007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 5 月 15 日
报告期末基金份额总额	644,792,280.06 份
投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期，本基金在严格控制投资风险与保持资产流动性的前提下努力保持基金资产持续增值，并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、新股（含增发）申购以及二级市场股票投资之间的配置： ①基于对利率、信用等因素的分析，预测固定收益品种的风险和收益； ②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断； ③基于对新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等因素的分析，预测新股申购的风险和收益； ④股票市场走势的预测。
业绩比较基准	中信标普全债指数 中信标普全债指数涵盖国债、企业债、金融债、可转债，具有良好的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。 如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出，或有更科学客观的权重比例适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，在履行适当程序后实施，并在更新的招募说明书中列示。
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种，本基金的风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	宝盈增强收益债券 A/B　　宝盈增强收益债券 C
下属两级基金的交易代码	213007(前端)，213907(后端)　　213917
报告期末下属两级基金的