

# 金盛证券投资基金季度报告

## 2005 年第 1 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 2005 年 4 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。

### 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、各主要财务指标

	2005年1-3月
基金本期净收益	-18,676,370.46元
基金份额本期净收益	-0.0374元
期末基金资产净值	502,670,875.73元
期末基金份额净值	1.0053元

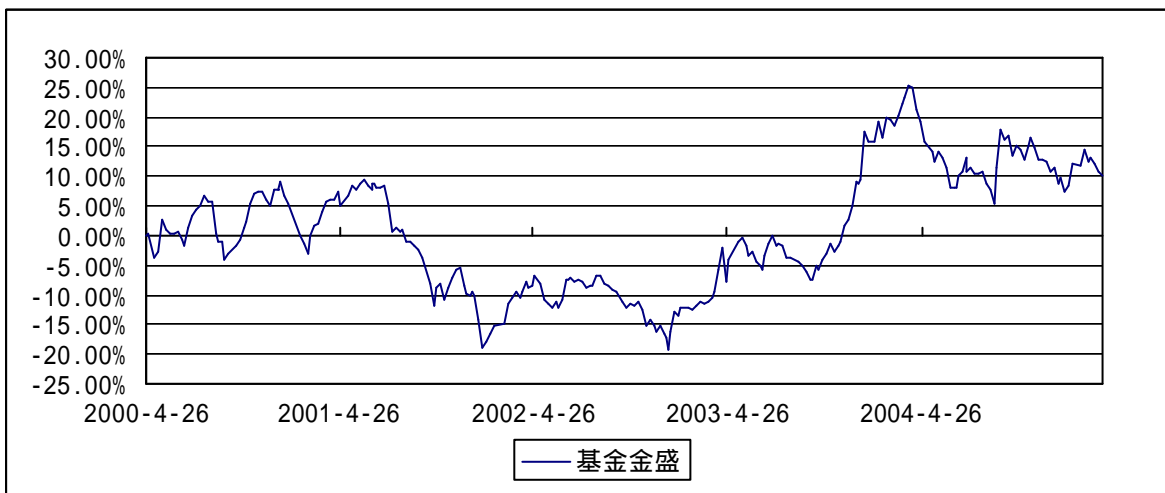
注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	净值增长率 标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基准 收益率标准差	-	-
过去三个月	-1.41%	1.86%	-	-	-	-

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》及其实施准则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，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

报告期内本基金未发生任何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、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，有效保障了投资人的合法权益。

### 2、基金经理介绍

王雄辉，基金经理，男，经济学硕士，6年证券从业经历。曾任南开大学教师，国泰基金管理有限公司研究开发部行业研究员，金泰基金基金经理助理，金泰基金基金经理，投资决策委员会秘书，理财部投资经理。

### 3、市场与投资管理回顾

一季度上证综指经历一月份下跌、二月份反弹、三月份创出新低的过程，本基金净值从1.0197元下跌至1.0053元，下跌幅度为1.41%，表现不好的原因主要是对年初阶段性行情的发展思路不清晰，从而在组合结构上应对有误，具体表现在对一批成长性较好的二线蓝筹个股持仓比例不足、而另外一些如输变电行业、造纸行业的仓位却带来超过市场平均水平的损失。

一月底，在大盘持续下跌之后，本基金股票仓位接近满仓，迎来一波较大幅度的反弹。银行、房地产等周期类股票在领衔上涨之后，真正持续上涨并屡创新高的如中集集团、贵州茅台、中兴通讯、苏宁电器、烟台万华等少数股票。这些股票的上涨有它们的道理。宏观经济投资周期已过，上游有周期之嫌，下游有成本压力，所以必须转移到有控制能力的竞争力强的企业上，同样的以行业属性表现，还有能源、港口机场公路等行业中的优势企业。

这种表现应该不只是一季度的事情，从基本面看也许是贯穿全年的主题。在认识到这一点之后，三月份本基金组合结构相应作了一些调整，从价值估值的角度选择性的增加了一些此类优势企业的比重，使得后期业绩表现有所改善。

## 五、基金投资组合报告

### 1、基金资产组合情况

分 类	市值(元)	占总资产比例
股票	362,944,807.11	71.92%
债券	122,187,345.33	24.21%
银行存款及清算备付金	14,412,590.61	2.86%
应收证券清算款	3,330,133.46	0.66%
其他资产	1,797,969.76	0.36%
合 计	504,672,846.27	100.00%

### 2、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	31,247,700.16	6.22%
3	制造业	173,868,676.92	34.59%
	其中：食品、饮料	42,774,492.11	8.51%
	纺织、服装、皮毛	3,612,346.50	0.72%
	造纸、印刷	20,089,669.65	4.00%
	石油、化学、塑胶、塑料	8,154,350.00	1.62%
	金属、非金属	49,469,709.31	9.84%
	机械、设备、仪表	11,066,898.95	2.20%
	医药、生物制品	38,701,210.40	7.70%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	20,511,253.00	4.08%
5	建筑业	85,186.89	0.02%
6	交通运输、仓储业	45,205,664.64	8.99%
7	信息技术业	43,370,350.28	8.63%
8	批发和零售贸易	31,575,975.22	6.28%
9	金融、保险业	17,080,000.00	3.40%
10	房地产业	-	-
11	社会服务业	-	-
12	传播与文化产业	-	-
13	综合类	-	-
	合 计	362,944,807.11	72.20%

### 3、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	000895	双汇发展	1,967,432	26,757,075.20	5.32%
2	000039	中集集团	821,301	22,232,618.07	4.42%
3	600085	同仁堂	914,177	21,080,921.62	4.19%
4	000063	中兴通讯	713,282	21,070,350.28	4.19%
5	600018	上港集箱	1,236,746	20,208,429.64	4.02%
6	000488	晨鸣纸业	2,219,853	20,089,669.65	4.00%
7	600900	长江电力	2,300,000	19,711,000.00	3.92%
8	600009	上海机场	1,200,000	19,704,000.00	3.92%
9	600036	招商银行	2,000,000	17,080,000.00	3.40%
10	000983	西山煤电	1,103,000	16,390,580.00	3.26%

### 4、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	122,187,345.33	24.31%
	合计	122,187,345.33	24.31%

### 5、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	银行间00国债07	50,000,000.00	9.95%
2	银行间00国债12	41,453,333.33	8.25%
3	02国债(14)	13,959,000.00	2.78%
4	20国债(4)	7,985,512.00	1.59%
5	21国债(15)	4,889,500.00	0.97%

### 6、报告附注

- (1)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)
交易保证金	329,026.98
应收利息	1,468,942.78
合 计	1,797,969.76

- (4)报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

## 六、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、金盛证券投资基金各年度半年度报告、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——上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31-32 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) 68674688，400-8888-688

客户投诉电话：(021) 50819801

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2005 年 4 月 20 日