

# 金鼎证券投资基金上市公告书

上市推荐人

国泰君安证券股份有限公司

## 重要提示

本上市公告书根据《证券投资基金管理暂行办法》及原有投资基金清理规范的有关规定和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人及基金托管人愿就本公告书所载资料的真实性、准确性和完整性负个别及连带责任，上市公告书的内容由本公司负责解释。上海证券交易所对本基金上市及有关事项的审核均不构成对本公告内容的任何保证。如有投资者购买金鼎证券投资基金，应仔细阅读本上市公告书。

## 摘 要

基金名称：	金鼎证券投资基金
基金简称：	基金金鼎
基金代码：	500021
基金份额总额：	232,748,084 份
本次可流通份数：	230,420,624 份
每份基金面值：	1.00 元人民币
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
上市推荐人：	国泰君安证券股份有限公司
上市地点：	上海证券交易所

上市时间： 2000 年 8 月 4 日

## 一、基金概况

金鼎证券投资基金是按照《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）原有投资基金清理规范的有关要求和《关于中国建设银行原有投资基金清理规范方案的批复》（证监基金字[2000]14号）由原“建业基金”、“沈阳公众基金”、“陕建基金”清理规范合并而成的契约型封闭式投资基金。基金存续期在原基础上延长 5 年（自 1992 年 5 月 31 日至 2007 年 5 月 31 日）。

基金发起人为国泰君安证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司；基金管理人为国泰基金管理有限公司；基金托管人为中国建设银行。

基金总份额为 232,748,084 份基金单位。2000 年 5 月 31 日，本基金管理人国泰基金管理公司正式管理本基金。

本基金管理人根据本基金持有人大会授权，向中国证券监督管理委员会提出上市、扩募、续期申请，该申请已获批准。

根据中国证监会《关于同意建业基金、沈阳公众基金、陕建基金合并规范为金鼎证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》（证监基金字[2000]51号）的批复，经上海证券交易所（上海上[2000]00号）批准，金鼎证券投资基金将于 2000 年 8 月 4 日在上海证券交易所挂牌交易。

基金金鼎总份额为 232,748,084 份基金单位，其中，本基金发起人持有 2,327,460 份基金单位，其余基金单位全部由公众持有。本次上市流通的份额为 230,420,624 份基金单位。

基金上市后交易单位每手为 100 份基金单位。

根据中国证监会《关于同意建业基金、沈阳公众基金、陕建基金合并规范为金鼎证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》（证监基金字[2000]51号）的批复，本基金在上市后，由原来的 232,748,084

份基金单位扩募到 5 亿份基金单位。扩募后，基金存续期将延长 5 年（至 2007 年 5 月 31 日）。

## 二、基金持有人结构及前十名持有人

（一）基金持有人结构：本基金发起人持有 2,327,460 份基金单位，公众持有 230,420,624 份基金单位，共计 232,748,084 份基金单位。

（二）前十名持有人：（截至 2000 年 7 月 28 日）

序号	名称	份 额	比 例
1	建行东支	9,515,200	4.09%
2	建行信托	4,926,400	2.12%
3	通汇建行	4,405,441	1.89%
4	国泰君安	1,231,600	0.53%
5	国泰管理	1,095,860	0.47%
6	马丽娟	602,062	0.26%
7	程林	550,055	0.24%
8	甘国福	487,779	0.21%
9	大连信托	467,146	0.20%
10	周晓圆	369,480	0.16%

（三）基金持有人总数为：52066 户，其中持有 1000 基金单位以上的基金持有人户数为 00000 户。

## 三、基金发起人、基金管理人、基金托管人及中介机构简介

（一）基金发起人

国泰君安证券股份有限公司

法定代表人：金建栋

注册地址：上海浦东新区商城路 618 号

成立时间：1999 年 8 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字〔1999〕  
77号文批准

组织形式：股份有限公司

实收资本：37.2718 亿元人民币

存续期间：持续经营

**国泰基金管理有限公司**

法定代表人：陈勇胜

注册地址：上海浦东新区商城路 199 号

成立时间：1998 年 3 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字〔1998〕5  
号

组织形式：有限责任公司

实收资本：1.1 亿元人民币

存续期间：持续经营

(二) 基金管理人

**国泰基金管理有限公司**

法定代表人：陈勇胜

注册地址：上海浦东新区商城路 199 号

成立时间：1998 年 3 月 5 日

组织形式：有限责任公司

信息披露负责人：丁昌海、黄永明

联系电话：021 - 62531534

公司概况：本公司经中国证监会证监基字〔1998〕5 号文批准，  
由国泰证券有限责任公司、中国电力信托投资公司、上海爱建信托投  
资公司、浙江省国际信托投资公司共同发起设立。

公司下设有证券投资部、研究开发部、财务部、监察稽核部、综合管理部等部门。此外还设立投资决策委员会和风险控制委员会两个专门机构。

公司现有员工 45 人，其中 80% 以上具有三年证券业或五年金融业从业经验，高级管理人员均具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

公司已经建立健全内部风险控制制度、内部稽核制度、财务管理、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

截止 2000 年 7 月 28 日，国泰基金管理有限公司管理基金净总资产已达 8,101,453,074.11 元。目前，国泰基金管理有限公司管理的其他基金有两只，基本情况如下：

#### **基金金泰**

- 1、基金名称：金泰证券投资基金
- 2、基金成立日期：1998 年 4 月 7 日
- 3、基金单位总份额：20 亿份
- 4、基金资产净值：3,263,317,466.49 元
- 5、基金单位净值：1.6317 元

#### **基金金鑫**

- 1、基金名称：金鑫证券投资基金
- 2、基金成立日期：1999 年 11 月 26 日
- 3、基金单位总份额：30 亿份
- 4、基金资产净值：4,284,381,884.37 元
- 5、基金单位净值：1.4281 元

#### **基金珠江**

- 1、基金名称：珠江证券投资基金
- 2、基金成立日期：2000 年 4 月 26 日
- 3、基金单位总份额：233,640,000 份

4、基金资产净值： 279,756,238.57 元

5、基金单位净值： 1.1974 元

### (三) 基金托管人

**中国建设银行**

法定代表人：王雪冰

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

邮政编码：100032

联系电话：010 - 67597640 010 - 67597641

联系人：刘思远

成立时间：1954 年 9 月 9 日

组织形式：国有独资

实收资本：851 亿元

存续期间：持续经营

发展概况：中国建设银行是我国四大国有商业银行之一，从事我国法律允许商业银行开办的一切金融业务。建设银行始终坚持以效益为中心，以支持经济增长和防范金融风险为重点，强化现代商业银行经营理念和意识，加强管理，规范经营，努力提高资产质量和经营效益，全行综合性经营能力、竞争能力、风险防范能力和盈利能力大大提高，取得了良好的经济效益。

财务状况：截至 1999 年末，中国建设银行总资产已达 19389 亿元，一般性存款余额为 17644 亿元，贷款余额 12009 亿元，1998、1999 年分别实现利润 20.58 亿元和 73.66 亿元。

基金托管部门设置及员工情况：中国建设银行总行于 1998 年获准设立证券投资基金托管部，主要业务部门包括综合管理处、基金市场处、市场监管处和清算核算处，现有员工 15 人。

托管其他基金的说明：截止 2000 年 5 月 31 日，中国建设银行现已托管的基金为：

- 1、基金名称：兴华证券投资基金
- 2、基金名称：泰和证券投资基金
- 3、基金名称：兴和证券投资基金
- 4、基金名称：金鑫证券投资基金
- 5、基金名称：珠江证券投资基金

(四) 基金上市推荐人：国泰君安证券股份有限公司

法人代表：金建栋

注册地址：上海浦东商城路 618 号

联系电话：010 - 88026389

联系人：倪毓明 张颢

(五) 基金移交验资机构：上海大华会计师事务所有限公司

法定代表人：汤云为

注册地址：上海昆山路 146 号

联系电话：021-63070766

注册会计师：汪阳、曹勤

(六) 法律顾问：上海锦天城律师事务所

法人代表：史焕章

注册地址：上海市延安东路 700 号港泰广场 12 楼

联系电话：021 - 53850388 53850141

经办律师：沈国权、聂鸿胜

#### 四、基金的沿革

本基金由原“建业基金”、“沈阳公众基金”、“陕建基金”三只基金合并而成，其历史沿革分别为：

### 1、建业基金

建业基金是经中国人民银行（证管办）[1992]36号文及中国人民银行上海市分行沪银金管[93]5389号文批准设立，由建设银行原上海市信托投资公司单独发起并管理的存续期为十年的封闭式契约型证券投资基金。该基金于1993年9月10日起向上海市普教系统的教职员工定向发行，于1993年12月31日全额募足并开始运作。

经中国人民银行复[1996]330号文、中国人民银行上海市分行沪银非银管[1996]11182号文和上海市证券交易所上证上[96]字第107号文审核同意，建业基金于1996年11月29日在上海证券交易所挂牌交易。

建业基金基金规模为一亿基金单位。

### 2、沈阳公众基金

沈阳公众基金是经中国人民银行沈阳市分行沈银金[1992]109号文批准设立，由中国建设银行沈阳市信托投资股份有限公司独立发行并管理的存续期不定的封闭式契约型证券投资基金。该基金于1992年5月31日向社会公众公开发行并投入运作。

经中国人民银行沈银金字[1992]267号文审核同意，沈阳公众基金于1992年10月28日在沈阳证券交易中心挂牌上市。由于经济形势发展需要沈阳证券交易中心于1994年3月7日与上海证券交易所联网，沈阳公众基金成为在上交所挂牌交易的基金。

沈阳公众基金基金规模为5950万基金单位。

### 3、陕建基金

陕建基金是经中国人民银行陕西省分行陕银复[1992]150号文批准设立，由原建设银行陕西省信托投资公司（现建设银行西安市东大街支行）发起，陕西建银基金管理有限责任公司管理的存续期不定的封闭式契约型证券投资基金。该基金于1993年9月向社会公众公开发行并投入运作。

经中国人民银行陕西省分行审核同意大连证券交易中心大证交

字[1993]第10号文，陕建基金于1994年1月28日在大连证券交易中心挂牌交易。

陕建基金基金规模为5000万基金单位。

依据《证券投资基金管理暂行办法》、《国务院办公厅转发证监会原有投资基金清理规范方案的通知》（国办发[1999]28号）的有关规定；根据原有投资基金清理规范的有关要求及中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]14号《关于中国建设银行原有投资基金清理规范方案的批复》的精神，及2000年3月23日以通讯方式召开原基金临时持有人大会所形成的决议，将以上三只基金规范重组为金鼎证券投资基金。具体的合并办法为：参与合并的三只基金均从3月15日的每基金单位净资产中提取0.01元作为该基金合并及上市相关费用，提取费用后的基金净值按照1：1的比例折算为新基金单位。基金合并后，本基金已发行的全部基金单位将转换为合并后新基金的相应基金单位，本基金持有人将转换为合并后新基金的持有人。届时合并及上市相关费用如有剩余，仍划归合并后新基金所有。基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行。

## 五、基金投资组合情况

### （一）基金投资目标

本基金是以属于朝阳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。

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资部分将主要投资于沪深两市属于朝阳产业的上市公司，即在产业的生命周期中处于成长期和正进入成熟期的上市

公司。例如：涉及网络经济、环保、电子通讯、生物制药及新材料、软件集成等产业的上市公司。

## （二）投资组合情况

本基金基金资产已于 2000 年 5 月 16 日全部划至本基金的托管人——中国建设银行“金鼎证券投资基金专户”，但由于基金金鼎是由三只原有投资基金规范合并而成，有大量的协调工作要做，5 月 31 日，基金管理人国泰基金管理有限公司才开始本基金的投资运作。

投资组合情况如下：（截止 2000 年 7 月 28 日，单位：元）

银行存款	63,640,103.81
股票投资	211,498,814.23
债券投资	

## （三）基金经理

本基金由张以杰先生担任基金经理，负责基金的日常投资运作。

张以杰：现年 36 岁，硕士，8 年证券业从业经验，历任上海证券年鉴编辑部副主任、君安证券有限公司市场分析师、君安财经快讯主编。现担任基金金鼎的基金经理。

# 六、基金契约摘要

## （一）前言

本基金契约是根据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、原有投资基金清理规范的有关要求和中国证监会的有关规定而订立，并经建业基金、沈阳公众基金和陕建基金三只基金持有人大会表决通过。

## （二）基金契约的当事人

- 1、基金发起人：国泰君安证券股份有限公司  
国泰基金管理有限公司

2、基金管理人：国泰基金管理有限公司

3、基金托管人：中国建设银行

### (三) 基金基本情况

基金名称：金鼎证券投资基金。

基金类型：契约型封闭式（在符合有关规定并经基金持有人大会同意、中国证监会批准后可转型为契约型开放式）。

基金投资目标：本基金是以属于朝阳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。

基金单位总份额：232,748,084 份基金单位（上市后经中国证监会批准，可分次扩募）。

每份基金单位面值为人民币 1.00 元。

基金存续期限为：1992 年 5 月 31 日—2007 年 5 月 31 日。

### (四) 基金的沿革（参见本公告书第四条《基金的历史沿革》）

### (五) 基金的上市与交易安排

本基金经主管部门批准和基金持有人大会通过，将根据《暂行办法》及有关规定申请在上海证券交易所上市。本基金上市后，将根据《暂行办法》及有关规定、《原有投资基金清理方案》的政策和交易所的交易规则进行交易。

### (六) 基金的托管

基金托管人与基金管理人须按照《暂行办法》、本基金契约及其他有关规定，订立《金鼎证券投资基金托管协议》。

### (七) 基金的投资

#### 1、投资目标

本基金是以属于朝阳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、投资范围

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

## 3、投资组合

由于本基金由《证券投资基金暂行办法》颁布前的老基金规范后设立，经中国证监会批准，基金资产和投资比例存在一段调整期，调整期为基金上市之日起六个月内。调整期结束后本基金的投资组合须符合下列规定：

(1) 本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%。

(2) 本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。

(3) 本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%，本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%。

(4) 遵守中国证监会规定的其他比例限制。

## 4、投资决策

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。

管理人的投资行为将受国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定约束，并以充分保障投资者利益为前提，权衡投资中的收益和风险。

## 5、投资限制

本基金禁止从事下列行为：

- (1) 投资于其他基金；
- (2) 将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- (3) 从事证券信用交易；
- (4) 以基金资产进行房地产投资；
- (5) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- (6) 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- (7) 中国证监会规定禁止从事的其他行为。

#### (八) 基金发起人的权利和义务

基金发起人拥有首次扩募后按约定及有关规定持有基金单位、出席或委派代表出席基金持有人大会、取得基金收益、依法转让基金单位、监督基金经营情况，获取基金业务及财务状况的资料、参与基金清算，取得基金清算后的剩余资产，以及法律、法规认可的其他权利。

基金发起人负有公告上市公告书、首次扩募后在基金存续期间持有符合规定比例的基金单位、遵守基金契约、承担基金亏损或终止时的有限责任、不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动以及法律、法规规定的其他义务。

#### (九) 基金管理人的权利与义务

基金管理人拥有运用基金资产、取得管理人报酬、依照有关规定代表基金行使股东权利以及《暂行办法》、基金契约及有关法律法规规定的基金管理人的其它权利。

基金管理人负有诚信尽责地运用基金资产、控制投资风险、保护基金利益、按规定计算并公告基金资产净值及基金单位资产净值、按规定进行信息披露、保守基金商业秘密、按规定向基金持有人分配基金收益、按规定召集基金持有人大会、保存基金会计资料、因自身过错导致基金资产损失时承担赔偿责任、因基金托管人过错导致基金资

产损失时向基金托管人追偿等义务。

#### (十) 基金托管人的权利与义务

基金托管人拥有监督基金管理人的投资运作、获得基金托管费等权利。

基金托管人负有诚信尽责地保管基金资产、控制保管风险、保护基金利益、保管基金的重大合同及有关凭证、开设和保管基金资金帐户与证券帐户、从事基金清算交割、保守基金商业秘密、复核审查基金管理人计算的基金资产净值和基金单位资产净值、按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告、建立并保存基金持有人名册并负责基金单位转让的过户和登记、按有关规定保存基金会计资料、依据基金管理人的指令或有关规定向基金持有人支付基金收益、因过错导致资产损失时承担赔偿责任等义务。

#### (十一) 基金持有人的权利和义务

基金持有人拥有出席或委派代表出席基金持有人大会并根据所持有的基金单位数量行使表决权、取得基金收益、监督基金经营情况并获取基金业务及财务状况的资料、转让基金单位、取得基金清算后的剩余资产以及基金契约规定的其它权利。每份基金单位具有同等的合法权益。

基金持有人负有遵守基金契约、交纳基金认购款项及规定的费用、承担基金亏损或者终止的有限责任、不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动等义务。

#### (十二) 基金持有人大会

基金持有人大会依一定的事由以一定的程序召开，基金持有人大会就有关基金持有人利益的重大事项进行讨论表决，包括：修改基金契约、提前终止基金、更换基金托管人、更换基金管理人、基金扩募、续期或转型及中国证监会规定的其他情形。基金持有人大会决议必须经出席会议的基金持有人所持表决权的半数以上通过，但更换基金管

理人或托管人应由持有半数以上基金单位总额的基金持有人通过。

基金持有人大会决议对全体基金持有人、基金管理人和基金托管人具有相同约束力，基金持有人大会决议经中国证监会批准后方可生效。

### (十三) 基金托管人、基金管理人更换的条件和程序

#### 1、基金托管人的更换

有下列情形之一者，经中国证监会和中国人民银行批准，可以依一定程序更换基金托管人：

(1)基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；

(2)基金管理人充分理由认为更换基金托管人符合基金持有人利益的；

(3)代表 50% 以上基金单位的基金持有人要求基金托管人退任的；

(4)中国人民银行充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

#### 2、基金托管人更换程序

(1)提名：新任基金托管人由基金管理人提名；

(2)决议：被提名的新任基金托管人经基金持有人大会决议通过；

(3)批准：经中国证监会和中国人民银行审查批准后，新任基金托管人方可继任，原任基金托管人方可退任。

(4)公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会和中国人民银行批准后 5 个工作日内公告。

新任基金托管人与原基金托管人进行资产管理交接手续，并与交接管理人核对资产总值。

#### 3、基金管理人的更换

有下列情形之一者，经中国证监会批准，可以依一定程序更换基金管理人：

- (1)基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- (2)代表 50% 以上基金单位的基金持有人要求基金管理人退任；
- (3)中国证监会会有充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责的；
- (4)基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金持有人利益。

#### 4、 更换基金管理人的程序：

- (1)提名：由中国证监会或基金托管人提名新任基金管理人；
- (2)决议：基金持有人大会对被提名的新任基金管理人形成决议；
- (3)批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准后方可继任，原任基金管理人经中国证监会批准后方可退任。

(4)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内在中国证监会指定的信息披露报刊上公告。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由基金发起人在获得批准后 5 个工作日内公告。

### (十四) 基金资产

#### 1、 基金资产总值

基金资产总值是指基金所拥有的股票、债券、银行存款本息及其他投资所形成的价值总和。

#### 2、 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去按照国家有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。

#### 3、 基金资产的帐户

本基金资产开立基金专用帐户，与基金管理人和基金托管人自有的资产帐户以及其他基金资产帐户相独立。

#### 4、 基金资产的处分

本基金资产应独立于基金管理人和托管人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依据《暂行办法》、本基金契约及其他有关规定处分外，基金资产不得被处分。

#### (十五) 基金资产估值

1、估值目的：客观、准确地反映基金资产是否保值、增值。

2、估值日：每日对基金资产进行估值。

3、估值方法：

1) 上市证券按当日平均价为准；该日无交易的证券，以最近前一个交易日的平均价为准；

2) 未上市的股票（指申购的新股）以其成本价计算；

3) 未上市债券及存款，以本金加计至估值日止应计利息额计算；

4) 如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定资产价值时，基金管理人依照国家有关规定办理。

4、估值对象：基金所拥有的股票、债券、股息红利、债券利息和银行存款本息等资产。

5、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。用于公开披露的基金资产估值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金契约规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

#### (十六) 基金费用与税收

基金费用主要有：基金管理人报酬、基金托管人托管费、基金上市费用、证券交易费用、基金信息披露费用、基金持有人大会费用、会计师费用和律师费用以及按照国家有关规定可以列入的其它费用。

1、基金管理人的报酬

基金管理人的报酬由两部分组成，一部分是基金管理费，以基金资产净值的 1.5% 的年费率计提；另一部分是业绩报酬，当基金的可分配净收益率高于同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上，且当年基金资产净值增长率高于同期证券市场平均收益率时，按一定比例计提。具体计提方法如下：

(1) 基金管理费：

该项费用按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。若本基金持有现金的比例超过资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \times 1 \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值（扣除本基金持有现金比例超过 20% 部分的基金资产净值）

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2) 业绩报酬：

业绩报酬根据基金全年的经营业绩情况，在同时满足如下条件的情况下每年计提一次，直接用于奖励基金管理人员：

基金年平均单位资产净值不能低于面值；

基金可分配净收益率超过同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上；

基金资产净值增长率超过证券市场平均收益率；

基金收益分配后其每单位资产净值不能低于面值。

在同时满足以上条件的情况下，基金业绩报酬的计算方法为：

$$\text{业绩报酬} = \text{调整后期初资产净值} \times \text{Min} [ M, N ] \times 5\%$$

其中，

$M = \text{基金可分配净收益率} - 1.2 \times \text{同期银行一年定期储蓄存款利率}$  (如果年内利率发生变动, 则按时间段进行加权平均调整);

$N = \text{基金资产净值增长率} - \text{证券市场平均收益率}$ ;

$\text{Min}[M, N]$  为  $M$ 、 $N$  中较小者;

$\text{基金可分配净收益率} = \text{当年可分配净收益} / \text{调整后年初基金资产净值}$ ;

$\text{基金资产净值增长率} = (\text{年末基金资产净值} - \text{调整后年初资产净值}) / \text{调整后年初基金资产净值}$ ;

$\text{调整后年初基金资产净值} = \text{上年度末基金资产净值} - \text{上年度已分配收益}$ ;

$\text{证券市场平均收益率} = [(\text{上证综指年涨跌值} \times \text{沪市平均总市值} + \text{深证综指年涨跌值} \times \text{深市平均总市值}) / (\text{沪市平均总市值} + \text{深市平均总市值})] \times 80\% + \text{同期国债收益率} \times 20\%$

$\text{沪市平均总市值} = (\text{年初沪市总市值} + \text{年末沪市总市值}) / 2$

$\text{深市平均总市值} = (\text{年初深市总市值} + \text{年末深市总市值}) / 2$

在每个会计年度末由基金管理人计算、基金托管人复核, 得出当年基金的净收益金额, 作为当年可分配收益, 同时计算出基金资产净值增长率, 以确定基金管理人是否应计提业绩报酬并计算其数额。业绩报酬在次年经审计调整后从基金资产中一次性支付给基金管理人员。

## 2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.25\% \times 1 \div \text{当年天数}$

$H$  为每日应支付的基金托管费

$E$  为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金

托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

基金和基金持有人应根据国家有关规定依法纳税。

#### (十七) 基金收益与分配

基金收益包括基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、存款利息收入及其他收入，因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入基金收益。基金净收益为基金收益扣除国家有关规定可以在基金收益中扣除费用后的余额。

基金收益分配的比例不低于基金会计年度净收益的 90%；基金收益每会计年度结束后的四个月内分配一次，采取现金形式分配；基金当年收益应先弥补上一年亏损，基金投资当年亏损则不进行收益分配；每份基金单位享有同等分配权。

基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。

#### (十八) 基金的会计与审计

基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。

基金管理人聘请大华会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。

基金管理人（或托管人）认为有充分理由更换会计师事务所时，须经基金托管人（或管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所后 5 个工作日内公告。

#### (十九) 基金的信息披露

本基金的信息披露将按照《暂行办法》、《证券投资基金信息披露指引》、本基金契约及其他有关规定进行。本基金的信息披露事项将在中国证监会指定的信息披露报刊上公告。

本基金的信息披露的内容包括：

1、基金年度报告经注册会计师审计后，在基金会计年度结束的

90 日内公告；

2、基金中期报告在基金会计年度前六个月结束后的 60 日内公告；

3、基金投资组合三个月至少公告一次，于截止日后 15 个工作日内公告；

4、基金资产净值每周至少公告一次，于截止日后 1 个工作日内公告；

5、临时公告；

6、澄清公告与说明。

本基金定期公告、临时公告等文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所、证券交易所、有关销售机构及其网点，基金持有人可免费查阅。

#### (二十) 基金的扩募、续期和转型

本基金具备以下条件后，管理人可以向中国证监会申请基金的扩募或在存续期满时申请基金的续期：

- 1、本基金管理人、托管人最近三年内无重大违法、违规行为；
- 2、基金持有人大会和基金托管人同意扩募或续期；
- 3、中国证监会规定的其他条件。

由于本基金是由三只原有投资基金合并而来，本基金首次扩募不受《暂行办法》规定的条件限制，本基金首次扩募已经持有人大会授权，并按《原有投资基金清理方案》的有关政策执行。

在具备有关条件、基金持有人大会通过并经中国证监会批准，本基金可以由契约封闭式转为契约开放式。

#### (二十一) 基金的终止和清算

有下列情形之一的，基金将终止并进入清算程序：

- (1)基金封闭期满，未被批准续期；
- (2)基金经批准提前终止；

(3)因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止。

在中国证监会监督下，由基金清算小组进行基金清算。

#### (二十二) 违约责任

由于本基金契约当事人的过错，造成基金契约不能履行或不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属基金契约两方或三方当事人的过错，根据实际情况，由两方或三方承担各自应负的违约责任。

#### (二十三) 争议的处理

本基金契约当事人发生纠纷时，可以通过协商或调解解决。不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的，可向人民法院起诉。

#### (二十四) 基金契约的效力

本基金契约经各方当事人盖章以及各方法定代表人或其授权代表签字并经中国证监会批准后生效，有效期为本基金契约生效日起至基金清算结果报中国证监会批准并公告之日。

#### (二十五) 基金契约的修改和终止

基金契约的修改应经基金契约当事人同意，修改本基金契约应召开基金持有人大会，基金契约修改的内容应经基金持有人大会决议同意，本基金契约的修改应报中国证监会批准。

基金终止后，应当对基金进行清算。中国证监会对基金清算结果批准并予以公告后基金契约方能终止。

## 七、基金运作情况

### (一) 基金管理人报告

1、金鼎证券投资基金改制成立后，为了争取基金长期稳定的投资收益，基金管理人将会加强对市场的研判，精心操作，力求给投资人较好的回报。



未分配净收益：	3,617,406.90
未实现增值估值：	-795.096.66
基金资产净值：	235,570,394.24
每份基金单位资产净值：	1.0121

(二) 基金管理人将按照《基金契约》及《证券投资基金信息披露指引》的规定披露基金财务状况。

### (三) 财务状况

#### 1、资产负债状况（截止 2000 年 7 月 28 日，单位：元）

股票投资：	178,759,002.05
债券投资：	
股票投资——估值增值：	32,739,812.18
债券投资——估值增值：	
银行存款：	63,640,103.81
其他应收款：	2,964.97
应收利息：	112,650.18
交易保证金：	258,722.15
基金资产总值：	275,513,255.34
应付管理人报酬：	745,967.29
应付托管费：	124,327.89
其他应付款：	250,000.00
应付佣金：	395,475.50
负债合计：	1,515,770.68
实收基金：	232,748,084.00
未分配收益：	3,617,406.90
已实现净收益：	4,892,181.58

未实现资本利得：	32,739,812.18
持有人权益合计：	273,997,484.66
基金资产净值：	273,997,484.66
每份基金单位资产净值：	1.1772

注：上述披露的本基金财务数据未经审计。

## 2、重要财务事项

- (1) 净收益主要是证券买卖差价收入和银行利息收入。
- (2) 未实现投资收益是指基金资产的估值增值

上市证券以计算日市场平均价 为准；该日无交易的，以最近的交易日平均价为准；未上市的股票以发行价计算；未上市的债券以本金加计至估值日止应计利息计算；

## 3、资产净值计算方法：

资产净值=实收基金 + 净收益 + 未实现投资收益

## 九、 风险 揭示

本基金的投资也存在风险，主要有：

### (一) 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响所引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如业内竞争、市场前景、管理能力、财务状况等都会导致公司盈利发生变化。

#### 5、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 6. 扩募风险

本基金上市后即行扩募，由于基金规模的扩大将导致基金单位净值的下降，引起基金市场价格的波动，从而产生风险。

### (二) 管理风险

在基金的管理运作过程中，可能因基金管理人经济形势和证券市场等判断有误，及获取的信息不全等影响基金的收益水平。同时基金管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平也存在相关的影响。

### (三) 其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

## 十、重要事项揭示

### (一) 基金发起人持有基金单位份额情况：

发起人名称	认购份额	占基金总规模的比重
国泰君安证券股份有限公司	1,231,600	0.529%

国泰基金管理有限公司

1,095,860

0.471%

根据《基金契约》及有关规定，自本基金上市之日起，在本基金存续期间内，各基金发起人持有的基金单位不得低于本基金总规模的0.5%，全部基金发起人持有的基金份额不得低于基金总规模1%，其余部分在基金上市二个月后方可流通。

(二) 本基金 230,420,624 份基金单位将于 2000 年 8 月 4 日在上海证券交易所挂牌上市。原三只老基金具体的合并办法为：参与合并的三只基金均从 3 月 15 日的每基金单位净资产中提取 0.01 元作为该基金合并及上市相关费用，提取费用后的基金净值按照 1:1 的比例折算为新基金单位。基金合并后，本基金已发行的全部基金单位将转换为合并后新基金的相应基金单位，本基金持有人将转换为合并后新基金的持有人。届时合并及上市相关费用如有剩余，仍划归合并后新基金所有。原三只老基金份额折算成金鼎基金的具体比例为：建业基金为 1:1.2316；沈阳公众基金为 1:1.0001；陕建基金为 1:1.0016。

(三) 基金的首次扩募续期已经原基金持有人大会通过，首次扩募续期不再需要召开基金持有人大会。

(四) 本基金管理人已经持有人大会授权，向中国证券监督管理委员会提出扩募至 5 亿份基金单位的申请，该申请已获批准。本基金将于上市后，由原来的 232,748,084 份基金单位扩募到 5 亿份基金单位，以每份基金单位价格 1.01 元向原持有人按比例配售，基金发起人按规定认购，原持有人及基金发起人认购后剩余部份由商业保险公司认购。

(五) 本基金在扩募到 5 亿份基金单位规模后，基金存续期延长 5 年（至 2007 年 5 月 31 日）。

(六) 本基金原管理人声明如下：

(1) 原管理人已提交了金鼎证券投资基金规范、合并和移交有关的以及可能对基金规范、合并和移交产生影响的相关资料、文件和信息；

(2) 原管理人所提供文件资料，如为副本/复印件，均经原管理

人与原件核对无误；

(3) 原管理人所提供的文件、资料均为真实、完整和准确，而没有任何虚假、不实、错误或者重大遗漏；

(4) 截至本声明签署日，金鼎基金资产真实、完整、独立，不存在任何诉讼、仲裁或行政处罚案件；

(5) 由于历史原因和基金操作中的不规范，原管理人将部分基金资产以个人名义开立资金帐户和证券帐户从事证券投资，原管理人提供给各中介机构查证的以个人名义开设的资金帐户和证券帐户上的资金和股票，确系基金资产。

(七) 本基金原管理人承诺：将所有原基金有关资料及会计帐册保存 15 年以上，以备查询。

(八) 本基金上市首日设涨跌幅限制，限制幅度为 2000 年 8 月 3 日基金单位净值的 30%。2000 年 8 月 3 日基金单位净值将在 2000 年 8 月 4 日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公布。

## 十一、备查文件

1、中国证监会《关于中国建设银行原有投资基金清理规范方案的批复》

2、原建业基金、陕建基金和沈阳公众基金 1999 年度临时持有人大会决议

3、中国证监会《关于金鼎证券投资基金上市、扩募和续期的批复》

4、金鼎证券投资基金基金契约

5、金鼎证券投资基金托管协议

6、金鼎证券投资基金上市法律意见书

7、基金发起人营业执照

8、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

## 9、基金托管人业务资格批件和营业执照

国泰基金管理有限公司

2000年8月3日