

金鼎证券投资基金

2006 年年度报告

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

送出日期：二〇〇七年三月十六日

金鼎证券投资基金 2006 年年度报告

一、重要提示及目录

（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。本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2007年3月9日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

（二）目录

内容	页码
一、重要提示及目录.....	1
二、基金简介.....	2
三、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	3
四、基金管理人报告.....	5
五、基金托管人报告.....	7
六、审计报告.....	8
七、财务会计报告.....	9
八、基金投资组合报告.....	19
九、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	24
十、重大事件揭示.....	25
十一、备查文件目录.....	28

二、基金简介

（一）基金名称：金鼎证券投资基金

基金简称：基金金鼎

交易代码：500021

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2000年5月16日

报告期末基金份额总额：500,000,000份

基金合同存续期：至2007年5月31日止

基金份额上市交易的证券交易所：上海证券交易所

上市日期：2000年8月4日

（二）基金产品说明

（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。

对股票一级市场、二级市场、债券市场的收益率之间的关系进行分析，对证券市场总体风险收益状况作出评估；同时根据宏观政策面与资金面等综合因素的实际情况，预测股票市场和债券市场的预期收益率、股票与债券投资风险/收益比，定期确定和调整相应的资产配置比例。

根据行业企业景气指数、上市公司的行业基本面数据筛选朝阳行业。利用预期主营业务收入复合增长率、主营业务利润复合增长率等指标筛选成长型股票，以相对价值优选基金投资股票。

（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）基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路91弄98号201A

邮政编码：200127

办公地址：上海市延安东路700号港泰广场22-23楼

邮政编码：200001

法定代表人：陈勇胜

信息披露负责人：丁昌海

联系电话：021-23060282

传真：021-23060283

电子邮箱：xinxipilu@gtfund.com

（四）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司
 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号
 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(100032-33)
 邮政编码：100032
 法定代表人：郭树清
 信息披露负责人：尹东
 联系电话：010-67595104
 传真：010-66275830
 电子邮箱：yindong@ccb.cn

（五）信息披露情况

信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
 登载年度报告正文的管理人网址：<http://www.gtfund.com>
 年度报告置备地点：上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼
 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(100032-33)

（六）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
 办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心8楼

（七）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 楼

三、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

（一）各主要财务指标

	2006年	2005年	2004年
基金本期净收益	211,305,168.99元	-9,055,922.02元	46,821,920.17元
基金份额本期净收益	0.4226 元	-0.0181 元	0.0936 元
期末可供分配基金收益	153,760,369.64元	-17,544,799.35元	-28,790,690.60元
期末可供分配基金份额收益	0.3075元	-0.0351元	-0.0576元
期末基金资产净值	860,857,381.53 元	504,062,270.41 元	471,209,309.40 元
期末基金份额净值	1.7217 元	1.0081 元	0.9424 元
基金加权平均净值收益率	29.48%	-1.88%	9.24%
本期基金份额净值增长率	79.70%	6.97%	-3.25%
基金份额累计净值增长率	89.16%	5.27%	-1.59%

注：所述基金业绩指标不包括持有人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。

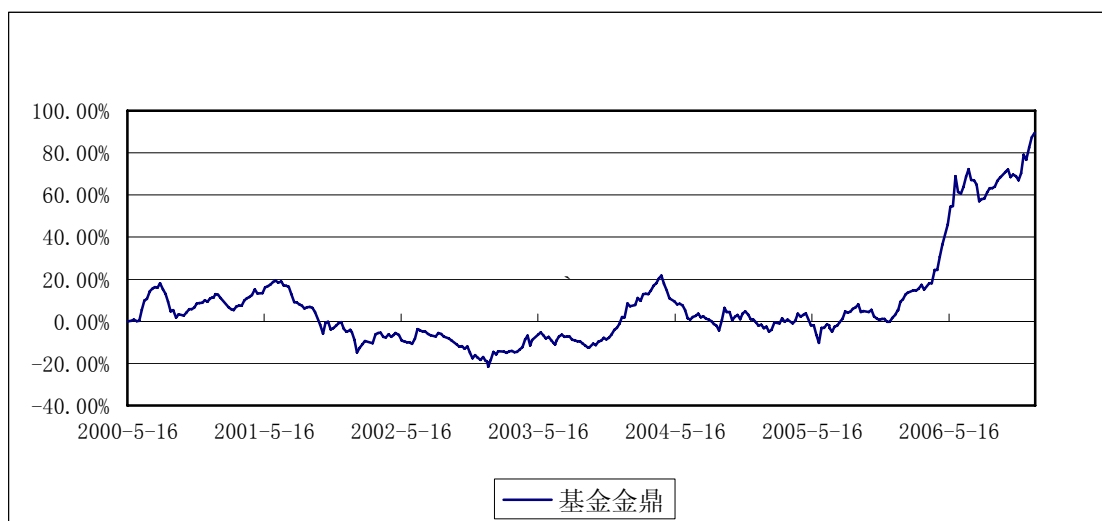
（二）基金净值表现

1、基金金鼎净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

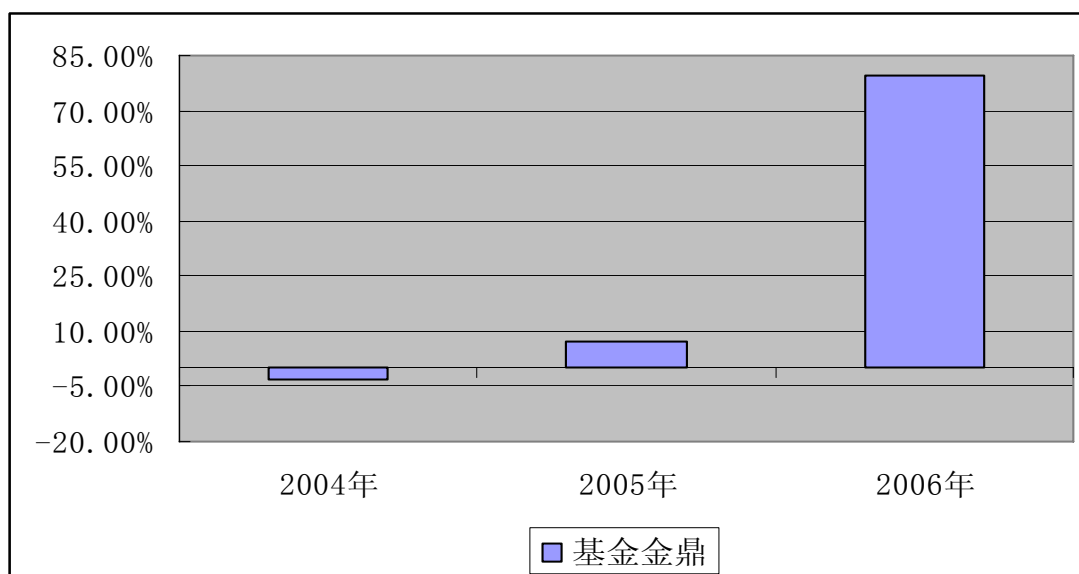
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.28%	2.05%	-	-	-	-
过去六个月	12.24%	2.00%	-	-	-	-
过去一年	79.70%	2.61%	-	-	-	-
过去三年	85.98%	2.40%	-	-	-	-
过去五年	97.08%	2.25%	-	-	-	-
自基金成立起至今	89.16%	2.19%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

2、基金金鼎累计净值增长率历史走势图



3、基金金鼎净值增长率历年对比图



（三）过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数（元）	备注
2004 年	-	
2005 年	-	
2006 年	0.800	
合计	0.800	

四、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理介绍

1、基金管理人介绍

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，并在北京设有分公司。

截至2006年12月31日，本基金管理人共管理4只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛、基金金鼎，以及7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、国泰金象保本增值混合证券投资基金、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、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金等。另外，本基金管理人于2004年获得社保基金委托资产管理人资格，目前受托管理社保基金投资组合。

2、基金经理介绍

徐学标，男，管理工程硕士，8年证券从业经历。曾任上海卫星工程研究所科技委主管设计师，上海浦东联合信托公司投资银行项目经理，华夏证券研究所行业分析师。2000年加盟国泰基金管理公司，先后任研究开发部副经理、国泰金鹰增长基金基金经理。2004年3月起担任金鼎证券投资基金基金经理。

2007年3月2日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于调整基金经理的临时公告》，由崔海峰同志担任本基金的基金经理，徐学标同志不再担任本基金的基金经理。

崔海峰，男，货币银行学硕士，9年证券投资从业经历。1999年4月加盟国泰基金管理有限公司，曾任研究开发部研究员、基金金鑫的基金经理助理，2003年1月—2004年1月任基金金盛的基金经理，2003年12月—2006年7月担任国泰金龙行业精选基金的基金经理，2006年7月起担任基金金泰的基金经理，现兼任基金金鼎的基金经理。

（二）基金运作管理合规性声明

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》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。

（三）2006年证券市场与投资管理回顾

2006年我国宏观经济继续保持了高速增长的态势，虽然在此过程中也经历了加息和准备金率上调等宏观调控措施，但总体看来全年消费增长快速、投资高位稳定，出口竞争力依然较强，外贸顺差持续加大，最终体现为超出预期的GDP增长。

在A股市场上，股权分置改革的全面推进完善了股市的体制建设，投资者队伍的不断扩大为股市带来了充裕的流动性资金，投资者信心不断增强，这些综合因素造就了2006年A股市场的大牛市，股指全年涨幅超过130%。在这个大行情中，资源价格、人民币升值、自主创新和先进制造业、新农村建设、节能环保、军工等投资主题都取得了优异的市场表现。围绕上述投资主题，本基金积极投资，在9月份之前净值增长率处于行业前列，9月份以后由于对蓝筹股溢价行情认识不足，在受益于人民币升值的地产和金融行业上配置不足，对基金投资组合的调整不够及时，造成9月份以后净值增长率相对排名出现较大幅度的下滑，本基金将在以后的操作中总结经验教训，积极加以改进。

（四）2007年的展望

对于2007年的市场，本基金仍然抱以乐观的预期。影响中国经济这一轮上升

周期的因素并没有消失，而政府的宏观调控也不希望经济出现大的波动，国际经济环境依然良好，预计2007年中国经济运行超预期的情况依旧会出现，强劲的经济增长将直接体现在企业盈利实实在在的大幅增长。行业选择上本基金继续看好：扩大内需相关的消费服务类行业，包括金融、食品饮料、旅游和信息传媒行业；“十一五规划”相关的装备制造业；同时本基金将加强策略性的配置，加强对资产注入和整体上市类上市公司的配置。

（五）内部监察报告

本报告期内，本基金管理人在继续完善内部控制制度和流程体系的同时，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、开展对公司各项业务的日常监察业务，对公司内部不当业务行为和风险隐患做到及时发现、及时查处，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规。

2、进一步优化公司内控和风险管理体系，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

2007年本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，并在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法权益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

五、基金托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《金鼎证券投资基金基金合同》和《金鼎证券投资基金托管协议》，托管金鼎证券投资基金（以下简称基金金鼎）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在基金金鼎的托管过程中，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，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，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。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人—国泰基金管理有限公司在基金金鼎投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

由基金金鼎管理人—国泰基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

六、 审计报告

金鼎证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的金鼎证券投资基金(以下简称“基金金鼎”)2006年12月31日资产负债表、2006年度经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《金鼎证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定，编制会计报表是基金金鼎的基金管理人国泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《金鼎证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了基金金鼎2006年12月31日的财务状况以及2006年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司
中国·上海市
2007年2月27日

注册会计师 汪 棣

注册会计师 陈 宇

七、财务会计报告

(一) 基金会计报表

1、资产负债表

资产负债表
2006年12月31日

单位：元

	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资 产			
银行存款		99,552,190.08	28,328,322.47
清算备付金		1,096,189.40	419,750.09
交易保证金		390,741.00	390,741.00
应收证券清算款		3,232,448.04	1,246,465.92
应收利息	6(1)	1,979,693.09	1,376,107.65
股票投资市值	6(2)	676,543,395.63	365,165,190.96
其中：股票投资成本		469,232,823.57	343,671,990.68
债券投资市值	6(2)	178,548,299.70	108,685,274.60
其中：债券投资成本		178,761,859.87	108,571,405.12
权证投资市值		-	-
其中：权证投资成本		-	-
资产总计		961,342,956.94	505,611,852.69
负债及持有人权益			
负债：			
应付证券清算款		8,111,090.82	-
应付管理人报酬		1,060,537.10	617,659.74
应付托管费		176,756.19	102,943.29
应付佣金	6(3)	415,632.80	161,776.85
应付利息		58,996.10	-
其他应付款	6(4)	307,562.40	307,202.40
卖出回购证券款		90,000,000.00	-
预提费用	6(5)	355,000.00	360,000.00
负债合计		100,485,575.41	1,549,582.28
持有人权益：			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		207,097,011.89	21,607,069.76
未分配收益		153,760,369.64	-17,544,799.35
持有人权益合计		860,857,381.53	504,062,270.41
负债及持有人权益总计		961,342,956.94	505,611,852.69

期末基金份额净值：2006年为1.7217元，2005年为1.0081元。

2、经营业绩表

经营业绩表
2006年度

单位：元

项目	附注	2006年度	2005年度
一、收入		224,885,841.55	-137,115.76
1、股票差价收入	6(6)	211,782,585.00	-7,553,751.12
2、债券差价收入	6(7)	-36,963.74	-2,133,602.75
3、权证差价收入		1,678,502.65	260,980.06
4、债券利息收入		4,263,887.28	2,981,736.74
5、存款利息收入		378,412.50	229,855.65
6、股利收入		6,819,417.86	6,057,331.41
7、其他收入	6(8)	-	20,334.25
二、费用		13,580,672.56	8,918,806.26
1、基金管理人报酬		10,644,256.11	7,226,474.70
2、基金托管费		1,774,042.59	1,204,412.51
3、卖出回购证券支出		596,682.17	41,234.73
4、其他费用	6(9)	565,691.69	446,684.32
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		300,000.00	300,000.00
审计费用		55,000.00	60,000.00
三、基金净收益		211,305,168.99	-9,055,922.02
加：未实现利得		185,489,942.13	41,908,883.03
四、基金经营业绩		396,795,111.12	32,852,961.01

3、基金收益分配表

基金收益分配表
2006年度

单位：元

项目		2006年度	2005年度
本期基金净收益		211,305,168.99	-9,055,922.02
加：期初基金净收益		-17,544,799.35	-8,488,877.33
加：本期损益平准金		-	-
可供分配基金净收益		193,760,369.64	-17,544,799.35
减：本期已分配基金净收益	6(10)	40,000,000.00	-
期末基金净收益		153,760,369.64	-17,544,799.35

4、基金净值变动表

基金净值变动表
2006年度

单位：元

项 目	2006年度	2005年度
一、期初基金净值	504,062,270.41	471,209,309.40
二、本期经营活动：		
基金净收益	211,305,168.99	-9,055,922.02
未实现利得	185,489,942.13	41,908,883.03
经营活动产生的基金净值变动数	396,795,111.12	32,852,961.01
三、本期基金份额交易：		
基金申购款	-	-
基金赎回款	-	-
基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-
四、本期向持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-40,000,000.00	-
五、期末基金净值	860,857,381.53	504,062,270.41

(二) 基金会计报表附注

1、基金简介

金鼎证券投资基金（以下简称“本基金”）是由建业基金、沈阳公众基金、陕建基金三只基金清理规范合并而成的契约型封闭式证券投资基金。经中国证券监督管理委员会《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号文）批准，上述三只基金于2000年5月16日办理了资产及负债的移交手续，本基金的发行规模为232,748,084份基金单位，由国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）和国泰基金管理有限公司作为本基金发起人，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，存续期为10年。

本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）（上证上字[2000]第51号文）审核同意，于2000年8月4日在上交所挂牌交易。

经中国证券监督管理委员会《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号文）批准，本基金于2000年10月19日基金总份额由232,748,084份基金份额扩募至5亿份基金单位，存续期延长5年至2007年5月31日。

根据《证券投资基金法》和《证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金的投资对象为国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证券监督管理委员会批准的允许基金投资的金融工具。

2、主要会计政策、会计估计及其变更

(1) 会计报表编制基础：

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

根据《金鼎证券投资基金基金合同》中的规定，本基金存续期至2007年5月31日终止。基金管理人国泰基金管理有限公司正计划将本基金于存续期结束前改制为开放式基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金本年度会计报表仍以持续经营假设为编制基础。

(2) 会计年度：为公历每年1月1日至12月31日。本报告期为2006年1月1日至2006年12月31日。

(3) 记账本位币：以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

(4) 记账基础和计价原则：本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

(5) 基金资产的估值原则：

①股票投资：上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值。

②债券投资：证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

③权证投资：从获赠确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易均价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

④实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

⑤如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 证券投资的成本计价方法：

①股票投资：买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价时冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

②债券投资：买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按

成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失)；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

③权证投资：获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。本基金至今尚未发生主动投资权证交易。

(7) 收入/(损失)的确认和计量：

- ①股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。
- ②证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。
- ③权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其相关费用的差额确认。
- ④债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。
- ⑤存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。
- ⑥股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

(8) 费用的确认和计量：

- ①本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。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%，超过部分不计提基金管理人报酬。
- ②本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。
- ③卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(9) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元。

(10) 基金的收益分配政策：

每一基金份额享有同等分配权。基金当年收益弥补以前年度亏损后，才可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配采取现金方式，每年至少分配一次，收益分配比例不低于基金净收益的90%。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

3、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1)、以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (2)、基金买卖股票、债券的差价收入,自2004年1月1日起继续免征营业税和企业所得税。
- (3)、对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,自2005年6月13日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%(此前按100%)计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。
- (4)、基金买卖股票于2005年1月24日前按照0.2%的税率缴纳股票交易印花税,自2005年1月24日起减按0.1%的税率缴纳。
- (5)、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

4、资产负债表日后事项

本基金管理人拟定的2006年度末期分红为135,000,000.00元,每10份基金份额可获得分配收益2.70元,年度总收益分配比例(包含中期分红)为90.32%。

5、关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

关联方名称	关联关系
国泰基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
上海国有资产经营有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
上海爱建信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
浙江省国际信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
上海仪电控股(集团)公司	基金管理人的股东

注:经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准,本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司,2006年1月13日本基金管理人及时进行了公告,相关工商变更登记已办理完毕。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易（单位：元）

	2006年				2005年			
	股票投资		债券投资		股票投资		债券投资	
	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例
国泰君安	628,541,690.02	25.95%	27,147,861.40	29.83%	437,149,480.38	24.26%	29,425,395.30	66.02%

	2006年				2005年			
	债券回购		交易佣金		债券回购		交易佣金	
	成交金额	比例	金额	比例	成交金额	比例	金额	比例
国泰君安	205,000,000.00	48.81%	502,350.23	25.71%	-	-	352,709.39	24.24%

注：根据本基金管理人与关联方签订的席位租赁协议，对关联方席位发生的交易佣金计算方式等同于其他证券公司，该佣金比例达到了关联方在席位租赁期内为本基金提供证券综合研究和信息服务相对应的水平。

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易（单位：元）

本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易。

(4) 基金管理人报酬

- ① 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

- ②基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并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。
- ③在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共10,644,256.11元，其中已支付基金管理人9,583,719.01元，尚余1,060,537.10元未支付。2005年1-12月共计提管理费7,226,474.70元，已全部支付。

(5) 基金托管人报酬

- ①基金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：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管人报酬

E为前一日的基金资产净值

- ②基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。
- ③本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共1,774,042.59元，其中已支付基金托管人1,597,286.40元，尚余176,756.19元未支付。2005年1-12月共计提托管费1,204,412.51元，已全部支付。

(6) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行同业存款利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为99,552,190.08元(2005年12月31日：28,328,322.47元)。2006年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为356,572.67元(2005年：213,314.63元)。

(7) 基金各关联方投资本基金的情况

① 本基金管理人本报告期末及2005年12月31日持有本基金的情况

	2006年12月31日		2005年12月31日	
	持有基金份额	占总份额比例	持有基金份额	占总份额比例
国泰基金管理有限公司	13,957,964份	2.79%	2,354,200份	0.47%

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13,957,964份，较上年度末增持了11,603,764份。

② 本基金管理人主要股东及其控制的机构在本报告期末及2005年12月31日持有本基金情况：

	2006年12月31日		2005年12月31日	
	持有基金份额	占总份额比例	持有基金份额	占总份额比例
国泰君安证券股份有限公司	2,645,800份	0.53%	2,645,800份	0.53%

6、重要会计报表项目说明（单位：元）

(1) 应收利息：

	2006年12月31日	2005年12月31日
应收银行存款利息	21,544.73	6,175.68
应收备付金利息	542.63	207.79
应收债券利息	1,957,536.10	1,369,654.54
应收权证价差保证金利息	69.63	69.64
合计	1,979,693.09	1,376,107.65

(2) 投资估值增值按投资类别分别列示如下：

	2006年12月31日	2005年12月31日
股票投资	207,310,572.06	21,493,200.28
债券投资	-213,560.17	113,869.48
合计	207,097,011.89	21,607,069.76

(3) 应付佣金：

	2006年12月31日	2005年12月31日
国泰君安证券股份有限公司	207,728.96	104,325.15
长城证券有限责任公司	56,913.04	14,311.53
东方证券有限责任公司	26,373.14	16,361.74
上海证券股份有限公司	-	6,160.37
宏源证券股份有限公司	-	13,537.36
中银国际证券有限责任公司	124,617.66	7,080.70
合计	415,632.80	161,776.85

(4) 其他应付款：

	2006年12月31日	2005年12月31日
应付债券利息的税金	54,499.60	54,499.60
应付股利收入的税金	252,702.80	252,702.80
银行间交易手续费	360.00	-
合计	307,562.40	307,202.40

(5) 预提费用：

	2006年12月31日	2005年12月31日
预提审计费用	55,000.00	60,000.00
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
合计	355,000.00	360,000.00

(6) 股票差价收入：

	2006年	2005年
卖出股票成交总额	1,256,533,345.58	904,827,630.33
减：卖出股票成本总额	1,043,696,304.89	911,621,690.96
应付佣金总额	1,054,455.69	759,690.49
股票差价收入	211,782,585.00	-7,553,751.12

注：本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计2,692,841.26元(2005年：1,835,067.72元)，已全额冲减股票投资成本。

(7) 债券差价收入：

	2006年	2005年
卖出债券成交总额	11,650,839.31	30,729,808.48
减：债券成本总额	11,362,056.02	32,458,439.80
应收利息总额	325,747.03	404,971.43
债券差价收入	-36,963.74	-2,133,602.75

(8) 其他收入：

	2006年	2005年
新股中签手续费返还	-	15,806.52
印花税返还	-	4,037.73
国债兑息手续费返还	-	490.00
合计	-	20,334.25

(9) 其他费用：

	2006年	2005年
审计费	55,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	5,793.25	5,956.81
回购交易费用	4,118.89	562.51
债券账户服务费	18,000.00	18,120.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
持有人名册查询费	1,000.00	1,000.00
联网服务费	1,000.00	1,000.00

银行间交易手续费	59.55	45.00
分红手续费	120,000.00	-
银行间结算服务费	720.00	-
合计	565,691.69	446,684.32

(10) 本期已分配基金净收益

	2006年	2005年
收益分配金额	40,000,000.00	-
累计收益分配金额	40,000,000.00	-
合计	40,000,000.00	-

7、流通转让受限制的基金资产

(1) 流通转让受限的股票

① 截至2006年12月31日止基金持有的流通转让受限制的股票资产明细如下：

A、因股权分置改革协商阶段或实施阶段而停牌：

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值 单价(元)	复牌日期	复牌开盘 单价(元)	数量(股)	期末成本总额 (元)	期末估值总额 (元)
方案沟通协商阶段停牌：								
000591	桐君阁	2006-12-18	8.52	2007-1-8	8.99	1,400,000	15,680,808.41	11,928,000.00
000731	S川美丰	2006-12-11	12.17	2007-1-15	12.76	300,000	3,741,046.24	3,651,000.00
000617	S济柴	2006-12-30	16.99	2007-1-29	17.84	273,782	3,418,726.00	4,651,556.18
合 计							22,840,580.65	20,230,556.18
方案实施阶段停牌：								
600737	中粮屯河	2006-12-22	7.72	2007-1-23	9.88	1,469,400	8,075,823.94	11,343,768.00
000895	S双汇	2006-6-1	31.02	-	-	2,512,975	34,413,643.42	77,952,484.50
000852	S江钻	2006-10-31	12.33	2007-2-27	12.92	503,363	5,345,476.83	6,206,465.79
合计							47,834,944.19	95,502,718.29

B、因新股配售或增发流通受限：

序	名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	备注
1	中国人寿	2006-12-28	2007-1-9	88,000	1,661,440.00	1,661,440.00	网上申购
	合计				1,661,440.00	1,661,440.00	

②估值方法

上述A类股票已上市，但本基金持有的部分因股权分置改革协商阶段或实施阶段而停牌。在编制本报表时，根据有关规定，在2006年12月31日按“停牌前估价”进行估值。

上述B类股票“中国人寿”为网上申购的未上市新股，在编制本报表时，根据有关规定，在2006年12月31日按成本价估值。

③流通受限期限及原因

上述A类股票截至2006年12月31日因股权分置改革而暂时停牌，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

上述B类股票为基金网上申购中签的新股。“中国人寿”已于2007年1月9日上市。

(2) 流通转让受限的债券

①本基金截至2006年12月31日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额50,000,000.00元(2005年12月31日：无)，于2007年1月5日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

②本基金截至2006年12月31日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额40,000,000元(2005年12月31日：无)，系以如下债券作为抵押：

债券名称	回购到期日	期末估值单价(元)	数量(张)	期末成本总额(元)
00国债07	2007-1-5	104.12	400,000.00	41,648,000.00
合 计				41,648,000.00

八、基金投资组合报告

(一) 基金资产组合情况

分 类	市 值(元)	占总资产比例
股票	676,543,395.63	70.37%
债券	178,548,299.70	18.57%
银行存款和清算备付金	100,648,379.48	10.47%
其他资产	5,602,882.13	0.58%
合 计	961,342,956.94	100.00%

(二) 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	31,600,540.00	3.67%
2	制造业	425,410,641.00	49.42%
	其中：食品、饮料	108,014,829.50	12.55%
	纺织、服装、皮毛	22,120,000.00	2.57%
	木材、家具	18,953,365.20	2.20%
	石油、化学、塑胶、塑料	29,736,133.25	3.45%
	电子	41,055,796.83	4.77%
	金属、非金属	87,815,232.42	10.20%
	机械、设备、仪表	92,401,170.10	10.73%
	医药、生物制品	25,314,113.70	2.94%
3	建筑业	26,085,147.40	3.03%
4	交通运输、仓储业	26,042,964.23	3.03%

5	信息技术业	32,035,500.00	3.72%
6	批发和零售贸易	33,137,582.00	3.85%
7	金融、保险业	76,897,485.88	8.93%
8	房地产业	927.00	0.00%
9	社会服务业	10,017,000.00	1.16%
10	传播与文化产业	766,000.00	0.09%
11	综合类	14,549,608.12	1.69%
	合 计	676,543,395.63	78.59%

(三) 基金投资的所有股票明细(按市值占基金资产净值比例排序)

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	2,512,975	77,952,484.50	9.06%
2	600616	第一食品	2,198,600	30,494,582.00	3.54%
3	600016	民生银行	3,000,000	30,360,000.00	3.53%
4	002069	獐子岛	400,000	29,884,000.00	3.47%
5	000612	焦作万方	3,400,000	28,356,000.00	3.29%
6	600970	中材国际	900,080	26,084,318.40	3.03%
7	600460	士兰微	2,859,113	25,474,696.83	2.96%
8	000063	中兴通讯	650,000	25,239,500.00	2.93%
9	000657	中钨高新	2,536,568	25,213,485.92	2.93%
10	000157	中联重科	1,150,000	25,127,500.00	2.92%
11	600835	上海机电	2,341,621	22,315,648.13	2.59%
12	600086	东方金钰	2,800,000	22,120,000.00	2.57%
13	600299	星新材料	1,058,525	19,233,399.25	2.23%
14	600337	美克股份	1,650,990	18,953,365.20	2.20%
15	600298	安琪酵母	850,000	18,717,000.00	2.17%
16	600343	航天动力	2,300,000	18,561,000.00	2.16%
17	601398	工商银行	3,000,000	18,090,000.00	2.10%
18	600000	浦发银行	634,506	13,311,935.88	1.55%
19	600036	招商银行	800,000	12,984,000.00	1.51%
20	600261	浙江阳光	1,000,000	12,740,000.00	1.48%
21	000591	桐君阁	1,400,000	11,928,000.00	1.39%
22	600737	中粮屯河	1,469,400	11,343,768.00	1.32%
23	600072	江南重工	1,900,000	11,115,000.00	1.29%
24	000978	桂林旅游	900,000	10,017,000.00	1.16%
25	600172	黄河旋风	2,000,000	9,460,000.00	1.10%
26	000831	关铝股份	1,598,955	9,433,834.50	1.10%
27	600386	北京巴士	1,000,000	8,870,000.00	1.03%
28	000039	中集集团	440,000	8,197,200.00	0.95%
29	601006	大秦铁路	1,000,000	8,090,000.00	0.94%
30	600790	轻纺城	1,321,648	7,520,177.12	0.87%
31	000099	中信海直	1,600,000	6,528,000.00	0.76%

32	000537	广宇发展	1,000,000	6,290,000.00	0.73%
33	000852	S 江 钻	503,363	6,206,465.79	0.72%
34	600849	上海医药	900,000	6,138,000.00	0.71%
35	002038	双鹭药业	394,172	5,534,174.88	0.64%
36	000617	S 济 柴	273,782	4,651,556.18	0.54%
37	600423	柳化股份	400,000	4,460,000.00	0.52%
38	600302	标准股份	700,000	4,424,000.00	0.51%
39	600296	S 兰 铝	300,000	3,879,000.00	0.45%
40	000731	S 川美丰	300,000	3,651,000.00	0.42%
41	600271	航天信息	100,000	3,501,000.00	0.41%
42	600797	浙大网新	500,000	3,295,000.00	0.38%
43	000877	天山股份	633,600	3,275,712.00	0.38%
44	600327	大厦股份	300,000	2,643,000.00	0.31%
45	600033	福建高速	499,993	2,554,964.23	0.30%
46	000792	盐湖钾肥	100,000	2,391,000.00	0.28%
47	600330	天通股份	300,000	1,737,000.00	0.20%
48	600189	吉林森工	201,000	1,716,540.00	0.20%
49	600085	同仁堂	100,000	1,712,000.00	0.20%
50	601628	中国人寿	88,000	1,661,440.00	0.19%
51	002025	航天电器	50,000	1,001,500.00	0.12%
52	000917	电广传媒	100,000	766,000.00	0.09%
53	600651	飞乐音响	106,700	739,431.00	0.09%
54	601988	中国银行	93,000	490,110.00	0.06%
55	002079	苏州固锔	10,000	102,600.00	0.01%
56	000848	承德露露	100	1,577.00	0.00%
57	600594	益佰制药	122	1,074.82	0.00%
58	000031	中粮地产	100	927.00	0.00%
59	600867	通化东宝	100	864.00	0.00%
60	000758	中色股份	100	829.00	0.00%
61	000755	山西三维	100	734.00	0.00%

(四) 股票投资组合的重大变动

1、累计买入价值超出期初基金资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初净值比例
1	600050	中国联通	43,739,154.73	8.68%
2	000612	焦作万方	37,212,766.19	7.38%
3	600343	航天动力	34,974,504.10	6.94%
4	600616	第一食品	29,759,394.18	5.90%
5	600855	航天长峰	29,687,007.20	5.89%
6	002069	獐子岛	27,252,906.19	5.41%
7	600460	士兰微	27,032,812.98	5.36%
8	000157	中联重科	26,569,936.78	5.27%

9	600651	飞乐音响	26,516,514.93	5.26%
10	600337	美克股份	25,543,445.98	5.07%
11	600084	新天国际	23,270,483.45	4.62%
12	600970	中材国际	22,741,328.15	4.51%
13	600000	浦发银行	21,723,063.95	4.31%
14	000831	关铝股份	20,840,729.68	4.13%
15	600086	东方金钰	20,127,366.55	3.99%
16	000960	锡业股份	19,742,399.88	3.92%
17	000591	桐君阁	19,457,967.94	3.86%
18	000758	中色股份	18,374,948.67	3.65%
19	600835	上海机电	18,165,081.88	3.60%
20	600688	S上石化	17,950,474.39	3.56%
21	000598	蓝星清洗	17,677,393.76	3.51%
22	600196	复星医药	17,021,103.16	3.38%
23	601588	北辰实业	16,938,232.09	3.36%
24	600261	浙江阳光	16,489,214.18	3.27%
25	600298	安琪酵母	16,177,730.20	3.21%
26	600742	一汽四环	15,804,472.00	3.14%
27	600018	上港集团	15,501,440.10	3.08%
28	600786	S东锅	14,929,618.63	2.96%
29	600016	民生银行	13,715,212.37	2.72%
30	600790	轻纺城	13,484,530.44	2.68%
31	600500	中化国际	13,477,064.31	2.67%
32	600058	五矿发展	13,468,178.00	2.67%
33	600331	宏达股份	13,352,876.92	2.65%
34	000099	中信海直	13,349,262.93	2.65%
35	600172	黄河旋风	13,322,422.62	2.64%
36	600096	云天化	13,215,170.01	2.62%
37	000063	中兴通讯	12,396,497.06	2.46%
38	600392	太工天成	12,281,839.68	2.44%
39	000657	中钨高新	11,505,245.61	2.28%
40	000617	S济柴	10,527,558.20	2.09%
41	600449	赛马实业	10,324,452.82	2.05%
42	000917	电广传媒	10,172,855.23	2.02%
43	601398	工商银行	10,167,840.11	2.02%
44	000089	深圳机场	10,117,756.23	2.01%

2、累计卖出价值超出期初基金资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	占期初净值比例
1	600855	航天长峰	61,721,802.15	12.24%
2	600050	中国联通	51,211,764.30	10.16%
3	000157	中联重科	37,257,118.72	7.39%
4	000612	焦作万方	31,571,984.44	6.26%

5	600616	第一食品	31,203,711.76	6.19%
6	600331	宏达股份	29,242,189.03	5.80%
7	600271	航天信息	27,101,708.19	5.38%
8	600084	新天国际	26,148,866.36	5.19%
9	000598	蓝星清洗	25,594,616.11	5.08%
10	000826	合加资源	24,905,995.02	4.94%
11	000402	金融街	23,110,314.60	4.58%
12	000960	锡业股份	22,677,291.88	4.50%
13	600000	浦发银行	21,155,353.90	4.20%
14	600742	一汽四环	21,055,783.68	4.18%
15	000758	中色股份	20,504,143.25	4.07%
16	600688	S上石化	19,703,361.39	3.91%
17	600651	飞乐音响	19,295,777.14	3.83%
18	600270	外运发展	19,118,802.82	3.79%
19	601588	北辰实业	19,058,276.89	3.78%
20	600018	上港集团	19,018,734.42	3.77%
21	600008	首创股份	18,336,393.64	3.64%
22	600196	复星医药	17,397,907.21	3.45%
23	000617	S济柴	16,160,888.04	3.21%
24	000662	索芙特	13,331,085.17	2.64%
25	600269	赣粤高速	13,113,514.56	2.60%
26	600786	S东锅	12,800,922.38	2.54%
27	600096	云天化	12,746,188.98	2.53%
28	600386	北京巴士	12,738,162.63	2.53%
29	600500	中化国际	12,470,943.14	2.47%
30	000917	电广传媒	11,834,601.30	2.35%
31	600256	广汇股份	11,559,315.28	2.29%
32	600058	五矿发展	11,506,321.41	2.28%
33	600122	宏图高科	11,497,799.63	2.28%
34	600016	民生银行	11,451,391.35	2.27%
35	600825	新华传媒	11,235,828.89	2.23%
36	000831	关铝股份	11,213,343.73	2.22%
37	600391	成发科技	10,994,230.57	2.18%
38	600172	黄河旋风	10,873,644.80	2.16%
39	600392	太工天成	10,754,797.52	2.13%
40	000089	深圳机场	10,641,748.11	2.11%

3、报告期内买入股票的成本总额：1,171,949,979.04元

报告期内卖出股票的收入总额：1,256,533,345.58元

(五) 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	178,548,299.70	20.74%
	合计	178,548,299.70	20.74%

(六) 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	41,648,000.00	4.84%
2	21国债(3)	36,204,500.40	4.21%
3	02国债(14)	31,624,857.00	3.67%
4	20国债(10)	25,698,900.00	2.99%
5	20国债(4)	24,634,979.50	2.86%

(七) 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	390,741.00
应收证券清算款	3,232,448.04
应收利息	1,979,693.09
合 计	5,602,882.13

- 4、报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

- 5、本报告期内投资权证明细如下：

a、因股权分置改革被动持有

权证代码	权证名称	配售日期	配售数量(份)	成本(元)
580996	沪场JTP1	2006/3/2	504,653	0.00
580990	茅台JCP1	2006/5/25	320,000	0.00
038008	钾肥JTP1	2006/6/29	200,000	0.00
合计			1,024,653	0.00

b、本报告期内无主动投资的权证。

- 6、本报告期内，未投资资产支持证券。
- 7、由于四舍五入原因，分项之合与合计可能有尾差。

(八) 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13,957,964份，较上一报告期末增持了11,603,764份。

九、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一) 持有人户数

基金份额持有人户数：20,140

平均每户持有人基金份额：24,826.22份

（二）持有人结构

	持有的基金份额（份）	占总份额比例
机构投资者	394,279,819.00	78.86%
个人投资者	105,720,181.00	21.14%
合 计	500,000,000.00	100.00%

（三）前十名持有人

序号	持有人姓名	期末持有数（份）	持有比例
1	人寿集团	49,634,448.00	9.93%
2	人寿股份	49,426,240.00	9.89%
3	新华保险	41,477,079.00	8.30%
4	太平人寿	22,443,925.00	4.49%
5	招商证券	21,091,355.00	4.22%
6	UBS AG	15,428,562.00	3.09%
7	中国太保	15,158,536.00	3.03%
8	平安保险	14,975,274.00	3.00%
9	国泰基金	13,957,964.00	2.79%
10	太保人寿	12,830,487.00	2.57%

注：1. UBS AG 即申银万国—花旗—UBS AG；

2. 以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的基金持有人名册编制。

十、重大事件揭示

- 1、2006年1月13日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于公司股东股权转让的公告》，经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司。
- 2、2006年6月14日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券投资方案的公告》，就本基金投资资产支持证券的方案等事项进行了公告。
- 3、2006年6月30日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司获配中国银行股份有限公司首次公开发行A股的公告》，就本基金通过网下发行和网上资金申购中国银行新股的获配数量进行了披露。
- 4、2006年7月27日，中国建设银行股份有限公司董事会召开会议，通过了委任张建国先生担任中国建设银行行长的议案；2006年10月20日，中国建设银行股份有限公司举行2006年第一次临时股东大会，委任张建国先生为建行执行董事，同时出任副董事长。2006年7月，常振明先生辞任建行副董事长、执行董事及行长的职务。

- 5、2006年10月25日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》刊登了《金鼎证券投资基金收益分配公告》，向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利0.80元。
- 6、2006年12月7日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于董事变更的公告》，经本基金管理人股东会和董事会审议通过，王耀南女士当选为公司董事，周志平先生不再担任公司董事。
- 7、2006年12月28日，中国建设银行股份有限公司根据工作需要，将“基金托管部”更名为“投资托管服务部”。
- 8、2007年1月5日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于住所变更的公告》，本基金管理人的住所变更为上海市浦东新区峨山路91弄98号201A。
- 9、2007年1月12日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下四只封闭式基金2006年度收益分配预告》，本基金拟向全体基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利2.70元。
- 10、2007年2月9日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《金鼎证券投资基金召开基金份额持有人大会公告》，鉴于本基金将于2007年5月31日到期，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《金鼎证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金管理人经与基金托管人（中国建设银行股份有限公司）协商一致，决定于2007年3月9日召开基金份额持有人大会（现场方式），审议关于金鼎证券投资基金转型有关事项的议案。
- 11、2007年2月14日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《金鼎证券投资基金停牌等相关事宜的提示性公告》，因本基金拟于2007年3月9日召开基金份额持有人大会，本基金经向上海证券交易所申请，于2007年2月15日开始停牌，直至公告基金份额持有人大会决议生效后申请复牌。
- 12、2007年2月27日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《金鼎证券投资基金召开基金份额持有人大会第一次提示性公告》，就本基金召开基金份额持有人大会的相关事宜进行了提示。
- 13、2007年3月2日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于调整基金经理的临时公告》，由崔海峰同志担任本基金的基金经理，徐学标同志不再担任本基金的基金经理。
- 14、2007年3月12日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《关于金鼎证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，本基金份额持有人大会已于2007年3月9日在北京召开，会议审议了《关于金鼎证券投资基金转型有关事项的议案》，并获得出席的基金份额持有人全票通过。
- 15、基金租用席位的选择标准是：
 - (1) 资质雄厚，信誉良好；
 - (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
 - (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；

(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），经公司同意并报董事会批准。

16、报告期内，基金租用证券公司专用席位的有关情况如下：

单位：元

券商名称	席位数量	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例
长城证券有限责任公司	2	164,651,691.33	6.80%	-	-
东方证券有限责任公司	2	315,461,502.25	13.02%	1,881,396.16	2.07%
国泰君安证券股份有限公司	2	628,541,690.02	25.96%	27,147,861.40	29.84%
宏源证券股份有限公司	2	539,542,944.88	22.27%	45,521,123.70	50.02%
上海证券有限责任公司	1	112,749,037.72	4.65%	8,539,200.00	9.38%
中银国际证券有限责任公司	1	661,359,149.23	27.30%	7,909,176.10	8.69%
长江证券有限责任公司	1	-	-	-	-
合计	11	2,422,306,015.43	100.00%	90,998,757.36	100.00%

券商名称	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
长城证券有限责任公司	-	-	129,792.74	6.64%
东方证券有限责任公司	-	-	250,784.69	12.84%
国泰君安证券股份有限公司	205,000,000.00	48.81%	502,350.23	25.71%
宏源证券股份有限公司	20,000,000.00	4.76%	437,616.85	22.40%
上海证券有限责任公司	-	-	92,367.99	4.73%
中银国际证券有限责任公司	195,000,000.00	46.43%	540,882.00	27.68%
长江证券有限责任公司	-	-	-	-
合计	420,000,000.00	100.00%	1,953,794.50	100.00%

注：(1) 本报告期内新增长江证券有限责任公司一个专用交易席位。

(2) 本报告期内终止了与大鹏证券有限责任公司的席位租用协议。

(3) 各席位均符合证监会规定的有关交易比例。

17、报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为55,000.00元，目前的审计机构提供审计服务的年限为5年。

18、报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项；基金管理人无重大人事变动；基金投资策略无变动；为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况；基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

十一、 备查文件目录

- 1、 关于同意设立金鼎证券投资基金的批复
- 2、 金鼎证券投资基金合同
- 3、 金鼎证券投资基金托管协议
- 4、 金鼎证券投资基金各年度半年度报告、年度报告及收益分配公告
- 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基金托管部
办公地点——北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
(100032-33)

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, 400-8888-688

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

2007年3月16日