

金鼎证券投资基金 2001 年中期报告

重要提示

本基金的托管人中国建设银行已于 2001 年 8 月 27 日复核了本报告。

本基金的管理人、托管人愿就本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性负责，本报告书中的内容由本基金管理人负责解释。

一、 基金简介

(一) 基金名称：金鼎证券投资基金(简称：基金金鼎)

交易代码：500021

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

基金成立日期：2000 年 5 月 16 日

基金单位总份额：5 亿份基金单位

基金类型：契约型封闭式

基金存续期：至 2007 年 5 月 31 日

基金上市地：上海证券交易所

基金上市日期：2000 年 8 月 4 日

(二) 基金管理人

法定名称：国泰基金管理有限公司

注册地址：上海浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区延平路 121 号三和大厦 27 楼

邮政编码：200042

法定代表人：陈勇胜

总经理：李春平

负责信息管理事务人员：丁昌海、黄永明

联系地址：上海市静安区延平路 121 号三和大厦 27 楼

电话：021-62531069

传真：021-62531262

电子邮件：huangym@gtfund.com

(三) 基金托管人

法定名称：中国建设银行

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

邮政编码：100032

法定代表人：王雪冰

托管部负责人：江先周

负责信息管理事务人员：黄秀莲

联系地址：北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行基金托管部

电话：010-67597646

传真：010-66212638

电子邮件：huangxiulian/zh/ccb@ccb.com.cn

(四) 会计师事务所

法定名称：安达信·华强会计师事务所

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 1 座 11 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 1 座 11 层

法定代表人：张本廉

邮编：200021

电话：010-65053333

传真：010-65051828

经办注册会计师：何影帆、张向际

经办注册会计师：何影帆、张向际

联系人：韩歆

联系人电话：021-63866688-640

传真：021-63862288

(五) 律师事务所

法定名称：上海锦天城律师事务所

注册地址：上海市延安东路 700 号港泰广场 12 楼

办公地址：上海市延安东路 700 号港泰广场 12 楼

法定代表人：史焕章

邮编：200001

电话：021-53850388

传真：021-53850389

经办律师：沈国权、聂鸿胜

二、主要财务指标

基金本期净收益	23,006,133.73元
单位基金本期净收益	0.0460元
基金可分配净收益	24,248,230.67元
单位基金可分配净收益	0.0485元
期末基金资产总值	571,027,648.33元
期末基金资产净值	569,274,957.11元
单位基金资产净值	1.1385元
基金资产净值收益率	4.32%
本期基金资产净值增长率	6.90%
累计资产净值增长率	18.72%

注、(1)基金资产净值收益率=本期净收益/调整后期初基金资产净值

(2) 本期基金资产净值增长率 = (分红前单位净值 / 期初单位净值) * (期末单位净值 / 分红后单位净值) - 1

(3) 累计资产净值增长率 = (2000年度净值增长率 + 1) * (本期净值增长率 + 1) - 1

其中, 2000年度净值增长率 = (扩募前单位净值 / 期初单位净值) * (期末单位净值 / 扩募后单位净值) - 1

三、基金管理人报告

本基金由张以杰先生担任基金经理, 并配备研究员协理。

张以杰先生, 37岁, 研究生学历, 曾任《上海证券年鉴》编辑部副主任、君安证券研究所首席市场分析师、《君安财经快讯》主编。1999年加盟国泰基金管理有限公司, 现任基金金鼎的基金经理。

(一) 上半年投资管理回顾

上半年中国证券市场走出了稳步盘升、不断创新高的强势行情。大盘总体表现坚挺, 成交活跃。股指虽处高位, 仍有不俗表现。以新股次新股为主的个股行情逐步展开, 资产重组板块、传统行业类个股也有较好的表现, 市场气氛较为乐观。

总体来看, 上半年市场投资理念也有所变化和发展。一方面长期持有、稳健投资的投资方式为广大投资者所认可; 另一方面基于小流通盘、低市值的个股投资思路普遍受到欢迎。而纯粹基于公司基本面和良好业绩的投资思路以及单纯追求高科技概念的投机手法都在一定程度上遭到市场冷遇。

上半年末本基金资产净值为569,274,957.11元, 每份基金单位资产净值为1.1385元。其中持有国债及货币资金为174,947,214.62元, 占基金资产净值的30.73%; 持有股票市值为395,756,893.89元, 占基金资产净值的69.52%。基金持有每只股票的价值(按成本价计算)均不超过基金资产净值的10%。国债持有比例也占基金资产净值的20%以上。

从股票投资组合来看, 重点投资行业主要有制造业、信息技术业等行业。在制造业中又以机械、设备、仪表业, 石油、化学、塑胶、塑料业, 食品、饮料业, 纺织、服装、皮毛业持仓比例较大。与去年相比, 信息技术业持仓比例明显下降, 而传统产业投资比重进一步上升, 基本符合市场运行的规律和特征。新股和次新股投资比例加大, 而中小流通盘的个股则成为投资首选。基本把握住了市场热点, 因而取得了较好的投资收益。

上半年, 本基金小组基金管理运作较好, 基金业绩稳步提升, 基金净值增长率为6.90%, 同期基金净值平均增长率为0.65%, 股指平均增长率为3.08%。

上半年, 本基金小组严格遵守基金管理的各项法规和条例, 严格按照投资决策委员会的要求管理基金。注意控制持仓比例, 调整持仓结构。能坚持谨慎投资、控制风险的原则, 及时防范和化解可能的市场风险。同时不排除在准确研判大势和市场热点的前提下把握市场投资机会, 积极参与一二级市场投资, 取得了较好的业绩。

(二) 下半年市场展望

由于股指在高位运行时间过长, 市场一时又难以向上突破, 大盘调整的压力日渐加大; 加之国有股减持办法已正式开始实施, 上市公司大规模增发筹资的高峰已经到来, 市场扩容压力较为明显; 而周边市场如B股, H股, 红筹股等市场的火爆也使资金出现了一定的分流; 另外“三板”市场已开始交易, 科技板也即将设立, 创业板仍在开与不开间徘徊, 都使市场的不确定性增加。

从宏观面来看，经济走势整体向好的背景下也有不乐观的因素存在。进出口贸易渐现滑坡迹象、我国部分地区持续干旱将严重影响今年的农业收成，这些都对我国宏观基本面构成较大的影响，宏观形势尚不容盲目乐观。

从技术面考虑，沪深两市的大牛市行情自1999年至今已运行两年有余。其间股指一路盘升，成交持续活跃，市场规模日益扩大，投资者队伍也迅速壮大。由于股市发展快速，期间市场未作充分调整，市场积聚的风险变大；相对而言，投资者风险意识较为淡薄，对市场风险的承受能力极为有限。由此，预计市场在下半年逐步转弱的可能性日益增大。

基于上述分析，本基金拟进一步加大风险控制力度，调整持仓比例，将持仓比例控制在70%以下。对基金重仓股要加大调研力度，注重公司的基本面分析和市场分析，密切跟踪市场最新动态，随时调整操作策略。在保持持股相对稳定的同时注意把握短期波动规律，尽量避免可能的市场风险。与此同时，要加大组合投资力度，以保证基金较好的流动性，化解市场流动性风险。

（三）内部监察报告

基金运作合规性声明：

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《金鼎证券投资基金基金契约》和其他有关法律法规的规定，以“取信于市场、取信于社会公众投资者”为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，遵循“稳健为本，规范管理，精心运作，争创一流”的公司理念，在基金资产的管理运作中，无损害基金持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例、投资组合符合有关法规和基金契约的约定。

内部监察工作报告：

本报告期内，本基金管理人依据相关的法律法规、基金契约以及内部管理制度进行持续的内部监察稽核；对监察稽核中发现的问题及时进行监察提示，要求改进；定期制作监察稽核报告报中国证监会和公司管理层。内部监察稽核的重点是规范基金资产的运作，防范和控制投资风险。

本基金管理人采取的主要措施有：

一是结合开放式基金的前期准备，修订和完善决策、投资、交易等工作制度，修订和完善各部门的岗位职责和工作流程，以及部门之间的业务运作流程，目前执行情况良好。在规范投资运作流程方面，重新修订了《投资决策委员会工作规程》、《投资研究联席会议工作规程》以及《基金管理小组工作规程》，并制定了基金小组月度报告、季度报告和半年度报告的实施细则以及相应的风险控制规定，调整充实了相关岗位的人员，理顺了从研究、决策到投资组合管理以及风险控制的整个流程，为规范基金管理的行为提供了制度保障。稽核监察部据此进行定期检查或不定期抽查，如果发现违反的情况将严肃查处。

二是加强对投资运作合规性的监察，通过实时监控、现场监察、报表审核、资料查阅、人员询问等方式，加大监察力度，提高监察频率，防范不当关联交易、内幕交易、操作市场行为，以及本基金和本基金管理人管理的其它基金之间可能出现的违规交叉交易，杜绝各种可能违反基金契约及法律法规事件的发生，确保基金持有人的合法权益不受侵犯。

三是加强风险管理，修订完善各项风险控制指标，构架风险监控体系；开展各业务流程中的风险揭示并建立相应的防范措施；建立风险责任追究制度，将风险控制列入考核范围，做到风险与投资并重，风险与投资分离，以控制风险提高经营业绩，以规范投资运作降低风险。

四是加强员工行为准则监察和职业道德教育。通过岗位培训与日常考核，严格员工行为规范，提高公司员工的职业素养；对关键岗位员工进行重点监察，并要求其对自己的职务行为进行持续的自律承诺，促进员工遵守法律法规和公司制度的自觉性。

五是完善法人治理结构，增设独立董事，发挥独立董事对基金运作中重大事项的监督作用，充分保障基金持有人的利益。

六、加强稽核监察人员的自身建设，提高稽核监察人员的业务能力，并加强监察稽核部门与

其它业务部门的交流与沟通，增强稽核监察工作的有效性，促进业务发展。

经持续跟踪监察，本报告期内，本基金的日常投资运作符合法规和基金契约的规定，公开信息披露及时、完整、准确；本基金资产与本基金管理人管理的其他基金资产、基金资产与公司资产严格分开，各基金管理小组保持独立运作；本基金运作中没有发生重大违规和损害基金持有人利益的行为，没有运用基金资产进行内幕交易、操纵市场行为和不当关联交易；亦无员工发生任何违法违规行为，没有受到主管部门的任何处罚。

本基金管理人将继续努力，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，促进基金规范运作，防范和控制风险，切实保障基金资产的安全管理，争取给投资者以更好的回报。

四、基金财务报告（未经审计）

（一）基金会计报告书

1、资产负债报告书

资产负债报告书

2001年6月30日

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

序号	项 目	期末数	期初数
1	股票投资—成本	350,729,765.57	348,334,123.62
2	股票投资—估值增值	45,027,128.32	31,211,266.30
3	债券投资—成本	116,018,901.88	115,000,000.00
4	债券投资—估值增值	-401.88	
5	其他投资—成本		
6	其他投资—估值增值		
7	现金		
8	银行存款	56,954,903.68	53,550,080.32
9	应收股利		
10	应收利息	2,036,268.56	416,407.94
11	应收帐款	250,000.00	250,000.00
12	应收交易清算款		2,901,933.89
13	应收申购款		
14	其他应收款项	11,082.20	14,740.06
15	基金资产总值	571,027,648.33	551,678,552.13
16	应付基金管理人报酬	1,330,943.71	1,319,112.47
17	应付基金托管费	116,902.84	114,930.96
18	应付收益		
19	应付帐款		
20	应付交易清算款		
21	应付佣金	304,844.67	723,151.60
22	其他应付款项		68,000.00
23	应付回购利息		

24	卖出回购		
25	负债总额	1,752,691.22	2,225,195.03
26	基金单位总额	500,000,000.00	500,000,000.00
27	未分配净收益	24,248,230.67	18,242,090.80
28	未实现估值增值	45,026,726.44	31,211,266.30
29	基金资产净值	569,274,957.11	549,453,357.10
30	单位基金发行总份额	500,000,000份	500,000,000份
31	每份基金单位资产净值	1.1385	1.0989

2、损益及分配报告书

损益及分配报告书

编制单位： 国泰基金管理有限公司 单位： 元

序号	项 目	2001年1—6月	2000年5月16日—6月30日
1	一、基金收入	29,114,768.83	4,143,101.16
2	证券买卖差价收入	24,594,044.25	3,622,878.69
3	其中：股票	24,594,044.25	3,622,878.69
4	债券		
5	投资收入	3,310,248.86	32,689.00
6	其中：股息收入	1,710,755.48	32,689.00
7	债券利息收入	1,599,493.38	
8	回购利息收入		
9	其他收入	1,210,475.72	447,533.47
10	其中：利息收入	1,084,375.79	446,413.44
11	扩募费用结余收入		
12	申购冻结利息收入		
13	其他	126,099.93	1,120.03
14	二、基金费用	6,108,635.10	514,866.49
15	管理费	3,975,884.61	441,231.85
16	托管费	677,101.39	73,538.64
17	回购交易费用		
18	回购利息支出	1,336,167.12	
19	其他费用	119,481.98	96.00
20	其中：上市年费	60,000.00	
21	会计师费	900.00	
22	信息披露费		
23	律师费		
24	持有人大会费		
25	分红手续费	50,999.98	
26	其他	7,582.00	96.00
27	三、净收益	23,006,133.73	3,628,234.67
28	四、上期未分配净收益	18,242,090.80	3,617,406.90

29	五、本期已分配净收益	16,999,993.86	
30	六、期末未分配净收益	24,248,230.67	7,245,641.57

(二)会计报告书附注

1、主要会计政策

- (1) 基金会计年度：为公历每年1月1日至12月31日。
- (2) 基金记帐原则：权责发生制。
- (3) 基金记帐本位币：以人民币为记帐本位币，记帐本位币单位为元。
- (4) 基金资产的估值方法
 - A、上市证券按当日均价计算，该日无交易的证券，以最近一日的均价计算；
 - B、未上市的股票以其成本价计算；
 - C、未上市国债及银行存款以本金加计至估值日为止的应计利息额计算；银行间市场国债以票面面值乘以利率计至估值日为止的应计利息额计算；
 - D、如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定基金资产价值时，基金管理人应按国家有关规定办理；
 - E、估值对象为基金所持有的股票、债券和银行存款；
 - F、每日都对基金资产进行估值。
- (5) 基金的主要收入确认政策
 - A、股息收入：在除息日确认应收股息；
 - B、债券利息收入：交易所上市的债券利息收入，在除息日确认应收利息；银行间市场国债利息收入为每日计提的应计利息；
 - C、其他收入：在实际收到时确认；
 - D、证券买卖价差收入：在实现成交的当日确认。
- (6) 证券成本的计价方法
证券投资按取得时的实际成本计价，出售成本按移动加权平均法计算。
- (7) 税项说明
根据财税字〔1998〕55号及财税字〔2001〕61号《关于证券投资基金税收问题的通知》，主要税项规定如下：
 - A、以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围。
 - B、基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，在2003年底以前暂免征收营业税。
 - C、对基金管理人运用基金资产买卖股票按4%的税率征收印花税，暂对基金不征收营业税、所得税。
 - D、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (8) 基金的收益分配政策
 - A、每一基金单位享有同等分配权；
 - B、收益分配比例不低于基金净收益的90%；
 - C、基金收益分配采用现金方式，每年至少分配一次，于每个基金会计年度结束后四个月内实施；
 - D、基金当年收益分配应先弥补上年亏损后，才进行当年收益分配；
 - E、基金投资当年亏损，则不进行收益分配。

2、关联关系

(1)、关联人关系、交易性质及法律依据

关联人名称	关联关系	交易性质	法律依据	备注
国泰君安证券股份有限公司 (以下简称“国泰君安”)	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金264.58万份
	席位出租人	出租交易席位	席位使用协议	租用二个席位
国泰基金管理有限公司	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金235.42万份
	基金管理人	提取管理费	基金契约	
中国建设银行	基金托管人	提取托管费	基金契约	

(2)、通过关联人席位交易情况

通过关联人席位进行证券买卖2001年1—6月股票交易量(万元)、债券回购交易量(万元)及佣金(万元)情况

关联人	交易量	比例	债券回购交易量	利息支出	佣金	比例
国泰君安	7,744.63	19.74%			6.50	19.83%
中国建设银行			11,500.00	72.84		

(3)、基金管理人报酬

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%年费率计提；另一部分是业绩报酬，当基金的可分配净收益高于同期银行一年定期储蓄利率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。具体方法如下：

(i)、基金管理费

A、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

B、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；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人；

C、本期，基金应支付基金管理人管理费共3,975,884.61元，其中已支付基金管理人3,274,467.58元，尚余701,417.03元未支付。资产负债报告书中“应付基金管理人报酬”含2000年度应付基金管理人业绩报酬629,526.68元。

(ii)、管理人业绩报酬

业绩报酬根据基金全年的经营业绩情况，在满足以下几个基本条件下每年计提一次，直接用于奖励基金管理人员：

A、基金年平均单位资产净值不能低于面值；

B、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；

C、基金资产净值增长率超过证券市场平均收益率；

D、基金收益分配后其每单位资产净值不能低于面值。

在满足以上条件的情况下，基金业绩报酬计算方法为：

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

2001年上半年未提取业绩报酬。2000年度应支付基金管理人业绩报酬629,526.68元尚未支付。

(4)、基金托管人报酬

A、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

- B、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；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人；
- C、本期，基金应支付基金托管人托管费共677,101.39元，其中已支付基金托管人560,198.55元，尚余116,902.84元未支付。

3、主要报表项目说明

- (1)、应收帐款：2001年6月30日余额250,000.00元，为深交所席位交易保证金。
- (2)、其他应收款：2001年6月30日余额11,082.20元，系交易所自动扣除，待向席位券商收回的应由席位券商支付的交易所风险基金。
- (3)、证券买卖差价收入：2001年1—6月累计发生额为人民币24,594,044.25元，其中：

项 目	发 生 额
上海证券交易所挂牌股票	18,539,828.79元
深圳证券交易所挂牌股票	6,054,215.46元
合 计	24,594,044.25元

(三)流通受限制的证券

- (1)、截至2001年6月30日止，基金持有的流通受限制的证券明细如下：

股票名称	申购日期	上市日期	数量(股)	申购金额(元)	备注
交大昂立	2001-6-22	2001-7-2	15,000	206,550.00	网上申购

- (2)、流通受限原因

上述股票为申购中签的未上市新股。

(四)期末基金持有股票明细(按市值占净值比例排序)

序	代码	证券名称	库存数量	市值	占净值比例
1	600715	松辽汽车	4,997,800	75,816,626.00	13.32%
2	0869	张 裕 A	1,833,735	43,697,905.05	7.68%
3	0403	三九生化	1,902,648	36,473,762.16	6.41%
4	0748	湘计算机	2,100,000	36,099,000.00	6.34%
5	600335	中 发 展	1,438,157	31,883,940.69	5.60%
6	0955	欣龙无纺	1,886,142	31,064,758.74	5.46%
7	600824	益民百货	2,214,700	29,344,775.00	5.15%
8	0811	烟台冰轮	1,202,103	20,567,982.33	3.61%
9	0063	中兴通讯	440,000	15,140,400.00	2.66%

10	600345	长江通信	350,842	13,942,461.08	2.45%
11	600680	上海邮通	650,000	13,318,500.00	2.34%
12	600063	皖维高新	1,000,000	13,110,000.00	2.30%
13	0966	长源电力	729,488	9,432,279.84	1.66%
14	600832	东方明珠	320,750	8,217,615.00	1.44%
15	0581	苏威孚 A	400,000	5,224,000.00	0.92%
16	600630	龙头股份	323,000	4,295,900.00	0.75%
17	0979	科苑集团	138,200	3,812,938.00	0.67%
18	600242	华龙集团	150,000	2,836,500.00	0.50%
19	0070	特发信息	50,000	1,271,000.00	0.22%
20	600530	交大昂立	15,000	206,550.00	0.04%
	合计			395,756,893.89	69.52%

(五)报告期内基金新增的股票明细

序号	证券代码	股票名称	本期新增			本期卖出
			一级申购	二级买入	其他	
1	0063	中兴通讯			1,619,418	1,179,418
2	0070	特发信息		50,000		
3	0581	威孚高科		400,000		
4	0811	烟台冰轮		1,202,103		
5	0979	科苑集团		138,200		
6	600063	皖维高新		1,000,000		
7	600242	华龙集团		150,000		
8	600335	中 发 展	14,000	1,474,157		50,000
9	600530	交大昂立	15,000			
10	600630	龙头股份		323,000		
11	600832	东方明珠		320,750		

注：其他项包括增发、转增及配股。

(六)报告期内基金剔除的股票明细

序号	证券代码	股票名称	期初结存	本期增加	本期卖出
1	0406	石油大明	400,000		400,000
2	0524	东方宾馆		350,000	350,000
3	0548	湖南投资		139,333	139,333
4	0657	中钨高新	264,873		264,873
5	0725	京东方 A	434,295	30,000	464,295
6	0726	鲁 泰 A	736,831		736,831
7	0963	华东医药	235,154		235,154
8	600019	宝钢股份	2,521,500		2,521,500

9	600141	兴发集团	271,600	51,100	322,700
10	600237	铜峰电子	590,279	20,000	610,279
11	600276	恒瑞医药	553,678		553,678
12	600295	鄂尔多斯		36,668	36,668
13	600305	恒顺醋业		72,000	72,000
14	600319	亚星化学		42,000	42,000
15	600321	国栋建设		11,000	11,000
16	600329	中新药业		46,000	46,000
17	600332	广州药业		477,553	477,553
18	600360	华微电子		31,000	31,000
19	600363	联创光电		13,000	13,000
20	600367	红星发展		22,000	22,000
21	600376	天鸿宝业		17,000	17,000
22	600377	宁沪高速	30,000		30,000
23	600381	白 唇 鹿		13,000	13,000
24	600390	金瑞科技	7,000		7,000
25	600395	盘江股份		31,000	31,000
26	600468	特精股份		30,000	30,000
27	600518	康美药业		13,000	13,000
28	600550	天威保变		55,000	55,000
29	600568	潜江制药		23,000	23,000
30	600589	广东榕泰		54,000	54,000
31	600664	哈药集团	887,510		887,510
32	600754	新亚股份		651,060	651,060
33	600776	东方通信		200,000	200,000

(七)基金投资组合

1、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	2,836,500.00	0.50%
2	采掘业		
3	制造业	263,612,424.97	46.31%
	其中：食品、饮料	43,697,905.05	7.68%
	纺织、服装、皮毛	35,360,658.74	6.21%
	石油、化学、塑胶、塑料	49,583,762.16	8.71%
	电子	1,271,000.00	0.22%
	机械、设备、仪表	133,492,549.02	23.45%
	医药、生物制品	206,550.00	0.04%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	9,432,279.84	1.66%
5	建筑业		
6	交通运输、仓储业		

7	信息技术业	78,500,361.08	13.79%
8	批发和零售贸易	29,344,775.00	5.15%
9	金融、保险业		
10	房地产业		
11	社会服务业		
12	传播与文化产业		
13	综合	12,030,553.00	2.11%
	合 计	395,756,893.89	69.52%

2、国债及货币资金合计

截止2001年6月30日，金鼎证券投资基金持有国债及货币资金为174,947,214.62元，占基金资产净值的30.73%。

国债合计由上市国债市值1,018,500.00元、银行间市场国债成本115,000,000.00元和银行间市场国债利息1,973,810.94元构成。

3、占基金资产净值前十名的股票

序号	名称	数量	市 值(元)	占净值比例
1	松辽汽车	4,997,800	75,816,626.00	13.32%
2	张 裕 A	1,833,735	43,697,905.05	7.68%
3	三九生化	1,902,648	36,473,762.16	6.41%
4	湘计算机	2,100,000	36,099,000.00	6.34%
5	中 发 展	1,438,157	31,883,940.69	5.60%
6	欣龙无纺	1,886,142	31,064,758.74	5.46%
7	益民百货	2,214,700	29,344,775.00	5.15%
8	烟台冰轮	1,202,103	20,567,982.33	3.61%
9	中兴通讯	440,000	15,140,400.00	2.66%
10	长江通信	350,842	13,942,461.08	2.45%

4、报告附注

(1)、报告项目的计价方法

本基金持有上市证券采用公告内容截止日的市场均价，已发行未上市股票采用成本计算。

(2)、基金持有每只股票的价值(按成本价计算)均不超过基金资产净值的10%。

(3)、基金应收利息、应付管理费、托管费、佣金、及其他应收应付款项合计为贷方余额1,429,151.40元，与基金股票市值395,756,893.89元和国债及货币资金174,947,214.62元相抵后等于基金资产净值。

(4)、本报告中股票投资组合的行业分类方法，遵照中国证监会于2001年4月颁布的《上市公司行业分类指引》执行。

五、基金持有人结构及前十名持有人

(一) 截止2001年6月30日，本基金份额结构为：

	期末持有数	比例
发起人持有	5,000,000份	1.00%

其中：国泰君安证券股份有限公司	2,645,800份	0.53%
国泰基金管理有限公司	2,354,200份	0.47%
社会公众持有	495,000,000份	99.00%
合 计	500,000,000份	100.00%

(二) 截止2001年6月30日，前十名持有人名称、持有份额及比例如下：

序号	持有人姓名	期末持有数	持有比例
1	平安保险	20,992,847	4.20%
2	中国人寿	19,520,071	3.90%
3	中保人寿	3,000,000	0.60%
4	国泰君安	2,645,800	0.53%
5	国泰管理	2,354,200	0.47%
6	杨 社 利	2,000,000	0.40%
7	张 占 来	1,979,000	0.40%
8	汤 玉 林	1,800,000	0.36%
9	陈 泽 源	1,800,000	0.36%
10	夏 风	1,800,000	0.36%

注：以上信息以上海证券中央登记结算公司提供的基金持有人名称编制。

六、重要事项揭示

- 1、本基金中期不进行收益分配，纳入年末一次性分配。
- 2、2001年3月30日，本基金管理人在有关证券报刊上公布了《金鼎证券投资基金二000年年度报告》和《金鼎证券投资基金二000年年度收益分配公告》。基金金鼎二000年度收益分配方案为每100份基金单位派发现金收益3.40元(二000年派发的收益暂免税)，权益登记日为2001年4月6日，除息交易日为2001年4月9日，红利发放日为2001年4月12日。
- 3、2001年5月9日，本基金管理人在有关证券报刊上刊登了《国泰基金管理有限公司公告》。国泰基金管理有限公司于2001年2月21日在上海举行第六次股东会，会议进行了董事会和监事会换届选举，选举了陈勇胜、吴畏、罗新泉、沈强、周栋、张明芝、李春平为第二届董事会董事，选举李予瑾、翁新孟、黄永明为第二届监事会监事。
- 4、根据中国证券监督管理委员会证监基金字(1998)29号《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》的有关规定，本基金管理人租用了国泰君安证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、大鹏证券股份有限公司、东方证券有限责任公司及宏源证券股份有限公司的交易席位。交易佣金费率为股票交易金额的0.1% 并扣除应由券商负担的交易手续费及证管费，国债交易不提取佣金。在报告期内，发起人及席位券商股票、国债的交易量及佣金(单位为万元)情况为：

席位券商名称	股票成交量	比例	国债成交量	比例	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安证券股份有限公司	7,744.63	19.74%			6.50	19.83%	0.08%
长城证券有限责任公司	7,540.16	19.23%			6.23	19.01%	0.08%
大鹏证券股份有限公司	8,767.74	22.36%			7.35	22.43%	0.08%
东方证券有限责任公司	8,822.87	22.50%	101.88	100.00%	7.44	22.70%	0.08%
宏源证券股份有限公司	6,342.13	16.17%			5.25	16.03%	0.08%
合 计	39,217.53	100.00%	101.88	100.00%	32.77	100.00%	0.08%

在本报告期内，基金专用交易席位无变更情况，各席位均符合证监会规定的有关交易比例即

通过一个证券经营机构买卖证券年交易量不得超过该基金买卖证券年成交量的30%。

- 5、本报告期内，基金管理人、托管人无重大诉讼、仲裁事项；基金管理人、托管人机构及高级管理人员无任何处罚情况；基金管理人及基金托管人办公地址无变动情况。

七、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、 金鼎证券投资基金契约
- 3、 金鼎证券投资基金托管协议
- 4、 金鼎证券投资基金 2000 年年度报告原件
- 5、 金鼎证券投资基金 2001 年中期报告原件
- 6、 报告期内披露的各项公告原件
- 7、 国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人国泰基金管理有限公司。

咨询电话：(021)62531069

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2001 年 8 月 30 日