

金鼎证券投资基金 2001 年年度报告

重要提示

本基金的托管人中国建设银行已于 2002 年 3 月 25 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：五亿份基金单位

基金类型：契约型封闭式

基金存续期：至 2007 年 5 月 31 日止

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：张恩照

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、陈经纬

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

1、各类财务指标

	2001 年度	2000 年度
基金本期净收益	17,047,139.60元	14,624,683.90元
单位基金本期净收益	0.0341元	0.0292元
基金可分配净收益	-40,417,698.66元	18,242,090.80元
单位基金可分配净收益	-0.0808元	0.0365元
期末基金资产总值	460,669,636.83元	551,678,552.13元
期末基金资产净值	459,582,301.34元	549,453,357.10元
单位基金资产净值	0.9192元	1.0989元
基金资产净值收益率	3.20%	4.55%
本期基金资产净值增长率	-13.69%	11.20%
基金累计资产净值增长率	-4.02%	11.20%

2、2000年年度报告披露的各类财务指标

各类指标	2000 年度
基金本期净收益	14,624,683.90元
单位基金本期净收益	0.0292元
基金可分配净收益	18,242,090.80元
单位基金可分配净收益	0.0365元
期末基金资产净值	549,453,357.10元
单位基金资产净值	1.0989元
基金资产净值收益率	2.97%
本期基金资产净值增长率	11.28%
基金累计资产净值增长率	11.28%

3、指标说明

(1) 本次披露的2001年度各类财务指标是根据基金行业约定的公式计算出来，2000年度的各类财务指标已作相应的调整。

(2) 主要财务指标计算公式

基金可分配净收益=基金本期净收益+以前年度未分配净收益+未实现估值增值（若未实现估值增值为负数，则相加；若为正数，则不加）

基金资产净值收益率=基金本期净收益/调整后期初基金资产净值

其中，2000年度基金资产净值收益率=2000年度基金净收益/[（期初基金资产净值*本期天数+扩募日资金流入额*扩募日至本期末天数）/本期天数]

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

基金累计资产净值增长率=（2000年度基金资产净值增长率+1）*（本期基金资产净值增长率+1）-1

其中，2000年度基金资产净值增长率=（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

（一）基金经理简介

张以杰先生，38岁，经济学硕士，10年证券从业经验，历任《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，任基金金鼎的基金经理。

（二）投资理念和风格

本基金始终坚持价值型投资理念，注重公司基本面分析，崇尚业绩和成长性。重点关注朝阳行业，在注重企业创新能力、成长性的同时，注重对上市公司的管理者及其管理制度的研究，重视企业管理体制、运作机制、企业文化、员工素质等方面的考察。把企业文化和企业管理作为判断企业价值和成长性的重要标志。

本基金偏重稳健成长型投资风格，不放弃一定风险条件下的最大收益，同时寻求一定收益条

件下的最小风险，力求风险和收益相对平衡条件下的高投资回报率。

（三）2001年投资管理回顾

1、2001年证券市场形势回顾与分析

2001年证券市场运作状况明显的分为两个阶段。

上半年，中国宏观经济继续保持了良好的增长势头。根据国家统计局发布的2001年上半年国民经济运行情况报告，上半年国民经济增长率达到了7.9%，一、二、三产业增资平稳，国内需求成为推动经济增长的主要动力，国内消费品市场（例如房地产市场）销售活跃，保持了较高的增长水平；投资需求快速增长。

在这种形势下，上半年中国证券市场走出了震荡向上的行情。年初承接2000年末的升势，上证指数在1月8日达到了历史新高2131.98点；随后经过一个半月的调整，于1900点处获得强有力的支撑，开始连续的攀升，到6月14日再创新高2245.43点。上半年上证指数升幅6.97%，深圳成指微跌0.81%，其中B股、新股、次新股板块对活跃股市、推动大盘上升起了重要作用；重组股板块也继续走强，而科技股、网络股、绩优股则受境外市场影响大多走势不佳。

进入下半年之后，虽然有申奥成功、入世成功等利好，但世界经济发展出现减速的迹象，对中国的经济产生了不利影响，突出地反映在出口贸易下降上。“9.11”事件发生之后，美国经济出现衰退，世界经济也受到重创。受此影响，中国经济的增长速度明显下降，股市走势也明显受压。与此同时，中国股市在经历了数年牛市之后，已积聚了较大的市场风险；股市本身也暴露出很多问题，如上市公司业绩造假、中介机构审查不严、恶庄横行等，带来证券市场诚信危机，受到监管部门严厉查处；而国有股减持有关方案的讨论和试行，则从根本上改变了投资者对市场供求关系的预期，股市由供求大体平衡突然改变为供大于求。在多种因素共同作用之下，股市出现大幅下跌。

2、基金运作情况报告：

2001年我国证券市场表现出了先扬后抑的大幅震荡走势，本基金的运作情况也与市场发展状况基本同步，明显地分为两个阶段。上半年本基金运作状况良好，主要是重点投资制造业和信息技术业等行业，加大了新股和次新股的投资比例，把握住了市场热点，因而取得了较好的投资收益。下半年基金净值则随大盘回落，但回落幅度小于大盘。总体来看，本基金在本年度的管理运作情况稳健。前期仓位控制较为合理，基金净值增长率也稳居前列。

本基金下半年曾一度将仓位下调到60%附近。但由于对市场下调的幅度之大估计不足，此后采取了保持仓位不变、适当调整持仓结构的投资策略。特别是在“9.11”事件发生之后，本基金经过对国内外经济政治形势的审慎分析，认为世界经济政治格局将可能发生变化，我国将面临一个新的大发展的良好机遇，我国经济在世界范围内一枝独秀的良好局面仍将得以保持，我国股市也将因此而受益，我国证券市场中长期稳定向好的主基调将不会改变。因此，本基金在股市连续大幅下调之后采取了低位补仓和继续调整持仓结构的操作策略，基金持仓在第三季度有所加大，第四季度略有下调。然而市场短期走势明显超出了本基金对市场的调整预期，致使本基金净值表现在下半年不如上半年，但基金净值增长率仍战胜大盘。

（四）2002年市场展望

2002年将成为我国历史上重要的一年。党的十六大将在今年召开，为今后中国发展指明方向；国内经济全力挖掘内需，今年仍将保持7%以上快速增长；今年又是中国加入WTO后的第一年，中国政府将逐步兑现入世的承诺；与此同时，国际社会也将兑现对中国的承诺，中国的国际经济环境将趋于宽松；世界经济方面，美国等主要经济体正逐步走出经济衰退，出现了一定的复苏迹象，预计这种复苏态势将持续一般时间。这种状况对中国经济发展十分有利。

证券市场方面，发展和规范是两个根本问题。2001年可以说是规范年。监管部门对市场的监管力度明显加强。这当然有利于股市的长远发展。但在规范的同时，政府也注意到了稳定的重要性。从目前披露的信息看，监管部门将适当调整监管的方式方法。在国有股减持、打击上市公司造假、中介机构诚信等问题上，将会采取慎重和现实的措施，充分体现政府稳定社会、稳定经济、稳定股市的意图。

从股市的供求关系看，2002年的股市供求关系将维持在一个大体平衡的局面，一方面，随着股市人气、信心的恢复，新股和增发的节奏将恢复到正常水平，供给将不断增加；另一方面，基金市场的扩容步伐也将加快，商业保险资金扩大入市比例，拓宽入市渠道，社保基金也逐步入市，增量资金的出现，将明显增加股市的需求。本基金管理人认为，只要供求大体平衡，股市就将稳步上升。

当前股市总体处于较低水平，市场风险已在一定程度上释放。但作为专业性的基金管理人，我们也对证券市场面临的不确定性时刻保持清醒的头脑。中国股市存在的一些深层次问题并未在去年得到根本解决，稳定发展将成为今年证券市场的主要特征。从整体上讲，2002年是市场信心恢复年，走势应以箱体震荡整理为主。本基金管理人对2002年的证券市场持谨慎并偏乐观的态度。从控制风险的角度出发，本基金将进行结构调整，在保持一定的国债和现金比例的同时，加大对通讯、生物医药、能源、房地产、环保、航空快递、新材料等朝阳行业的投资力度，加强组合投资、波段操作的力度，并密切关注国际股市对中国股市的影响。

（五）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，本基金管理人以加强公司内控体系建设为重要工作内容，在总结前三年内部监察和风险控制工作的基础上，进一步完善和优化公司的内部监察稽核制度和风险控制体系，提高防范和及时化解投资风险和管理风险的能力，确保公司的规范运作，切实保障基金持有人的利益。本基金管理人依据国家相关法律法规、基金契约和管理制度对基金投资运作和内控流程的完善和执行情况进行持续的监察稽核；对监察稽核中发现的问题及时提示、督促改进并追踪改进效果；定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：一、加强基金投资管理合法合规性的监控。采取了实时监控、现场查看、专项稽核、报表审核和资料查阅等方式，加大监控力度和监察频率，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金持有人的合法权益。二、建立健全全面风险管理体系。完善风险控制指标体系和技术手段，构建风险评估体系和风险预警机制，通过定期的风险报告提供量化的风险评估结果，揭示投资组合的风险暴露程度，及时预警。推行部门风险管理责任制，细化风险控制流程，防范和控制风险。三、结合开放式基金的筹备，完善内部控制制度体系。完善和细化各部门的岗位职责和工作流程，修订和优化了投资决策、研究开发和基金管理、投资交易等各环节管理制度和工作规程，理顺了研究、决策、投资、交易及风险控制的体系运作流程，为规范基金管理的行为提供了制度保障，提高了基金运作效率。四、完善法人治理结构，建立了独立董事制度。独立董事在公司管理重大事项的决策方面已发挥了重要的监督作用。同时董事会还成

立了多个专门委员会，进一步发挥董事会的作用。五、加强员工行为准则监察和职业道德教育。通过持续有效的职业道德教育、自律承诺、经常性行为监察和定期考核等，促进员工职业道德素质的提高和遵守法律法规、公司制度的自觉性。六、加强监察稽核人员自身建设。在充实人员、增添设备的基础上，制定了科学详细的工作流程和要求，提高稽核监察人员的业务素质和能力。同时加强监察稽核部门和其他业务部门的交流和沟通，促进监察工作效率的提高。

经持续跟踪监察，本报告期内，本基金的投资管理符合法律法规和基金契约的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人管理的其他资产、基金资产和公司资产严格分开；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。

本基金管理人将继续以“全心全意为投资人服务”为宗旨，坚持“取信于市场、取信于社会”的价值取向，不断提高内部监察稽核工作的有效性和科学性，加强基金资产的规范运作和风险控制工作，保障基金资产的安全管理，维护基金投资者的合法利益，并争取以更好的收益回报基金持有者。

四、基金托管人报告

中国建设银行根据《金鼎证券投资基金契约》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“金鼎基金”）。

2001年，中国建设银行在金鼎基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及各项实施准则、基金契约、托管协议和其它有关规定，依法安全保管了基金的全部资产，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，勤勉尽职地履行了基金托管人的义务，不存在损害基金持有人利益的行为。

2001年，按照《证券投资基金管理暂行办法》及各项实施准则、基金契约、托管协议和其它有关规定，本托管人对基金管理人—国泰基金管理有限公司在金鼎基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值、每份基金单位净值和其它财务费用计算上进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金持有人利益的行为。

2001年，由金鼎基金管理人—国泰基金管理有限公司编制并经中国建设银行基金托管部复核审查的有关金鼎基金的信息披露合法、真实、完整。

中国建设银行基金托管部
2002年3月25日

五、基金财务报告

(一) 审计报告

金鼎证券投资基金全体基金持有人

安达信·华强会计师事务所（以下简称“我们”）接受委托，审计了金鼎证券投资基金（以下简称“贵基金”）二〇〇一年十二月三十一日的资产负债报告书和二〇〇一年度的收益及分配报告书。编制会计报告书是贵基金管理人的责任，我们的责任是依据我们的审计对该报告书发表意见。我们的审计是依据《中国注册会计师独立审计准则》进行的。在审计过程中，我们结合贵基金的实际状况，实施了包括抽查会计记录等我们认为必要的审计程序。

我们认为，上述会计报告书符合证券投资基金的有关制度、办法和规定及贵基金的基金契约，在所有重大方面公允地反映了贵基金二〇〇一年十二月三十一日的财务状况和二〇〇一年度的经营成果，会计处理方法的选用遵循了一贯性原则。

安达信 • 华强会计师事务所
中国 • 北京

中国注册会计师：何影帆、陈经纬
2002年1月18日

(二)基金会计报告书

1、资产负债报告书

资产负债报告书

2001年12月31日

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

序号	项 目	年末数	年初数
1	股票投资—成本	372,959,256.15	348,334,123.62
2	股票投资—估值增值	-58,709,138.50	31,211,266.30
3	债券投资—成本	95,467,546.70	115,000,000.00
4	债券投资—估值增值	2,203.30	
5	其他投资—成本		
6	其他投资—估值增值		
7	买入返售债券		
8	现金		
9	银行存款	45,516,289.28	53,550,080.32
10	应收股利		
11	应收利息	397,763.68	416,407.94
12	应收账款	250,000.00	250,000.00
13	应收交易清算款	4,781,432.99	2,901,933.89
14	应收申购款		
15	其他应收款项	4,283.23	14,740.06
16	基金资产总值	460,669,636.83	551,678,552.13
17	应付基金管理人报酬	593,484.56	1,319,112.47
18	应付基金托管费	98,914.11	114,930.96
19	应付收益		
20	应付账款		
21	应付交易清算款		
22	应付佣金	124,936.82	723,151.60
23	其他应付款项	270,000.00	68,000.00
24	应付回购利息		
25	卖出回购		
26	负债总额	1,087,335.49	2,225,195.03
27	基金单位总额	500,000,000.00	500,000,000.00

28	未分配净收益	18,289,236.54	18,242,090.80
29	未实现估值增值	-58,706,935.20	31,211,266.30
30	基金资产净值	459,582,301.34	549,453,357.10
31	单位基金发行总份额	500,000,000份	500,000,000份
32	每份基金单位资产净值	0.9192	1.0989

2、收益及分配报告书

收益及分配报告书

2001年度

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

序号	项 目	本年数	2000年5月16日—12月31日
1	一、基金收入	28,985,621.05	20,438,578.55
2	证券买卖差价收入	21,572,997.49	17,507,460.68
3	其中：股票	21,253,601.46	17,507,460.68
4	债券	319,396.03	
5	投资收入	5,076,126.27	438,846.56
6	其中：股息收入	1,858,434.47	64,529.00
7	债券利息收入	3,217,691.80	374,317.56
8	回购利息收入		
9	其他收入	2,336,497.29	2,492,271.31
10	其中：银行存款利息收入	2,187,968.91	1,192,064.11
11	扩募费用结余收入		1,226,390.40
12	其他	148,528.38	73,816.80
13	二、基金费用	11,938,481.45	5,813,894.65
14	管理人报酬	7,749,137.95	3,844,009.43
15	托管费	1,305,976.97	535,747.19
16	回购交易费用		
17	回购利息支出	2,381,406.85	115,726.03
18	其他费用	501,959.68	1,318,412.00
19	其中：上市年费	60,000.00	55,000.00
20	会计师费	50,900.00	80,000.00
21	信息披露费	320,000.00	640,620.00
22	律师费		40,000.00
23	分红手续费	50,999.98	
24	其他	20,059.70	502,792.00
25	三、净收益	17,047,139.60	14,624,683.90
26	四、上期末未分配净收益	18,242,090.80	3,617,406.90
27	五、本期已分配净收益	16,999,993.86	
28	六、期末未分配净收益	18,289,236.54	18,242,090.80

(三) 会计报告书附注

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封闭式证券投资基金。经中国证券监督管理委员会（证监基字[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（证监基字[2000]51号文）批准，本基金于2000年10月19日基金单位总份额由232,748,084份基金单位扩募至5亿份基金单位，存续期延长5年至2007年5月31日。

根据《证券投资基金管理暂行办法》和证监基字[2000]51号文的规定，本基金的投资对象为国内依法公开发行的股票、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、会计报表编制基础

本基金的会计报表按照中华人民共和国《企业会计准则》，中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金管理暂行办法》实施准则第五号证券投资基金信息披露指引，及中国证券监督管理委员会允许的如主要会计政策所述的基金行业的实务操作约定而编制。

3、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) 基金记账原则：权责发生制。
- (3) 基金记账本位币：以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。
- (4) 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；银行间同业市场国债以成本加计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、估值对象为基金所拥有的股票、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；银行间同业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，至2003年12月31日前暂免征收营业税；
- C、对基金管理人运用基金资产买卖股票在2001年11月16日前按4‰的税率征收印花税，自2001年11月16日起按2‰的税率征收印花税；
- 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。

4、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及与关联人进行交易情况

(i)、通过关联人席位进行股票买卖年交易量(万元)及佣金(万元)情况

关联人	2001年度				2000年5-12月			
	交易量	比例	佣金	比例	交易量	比例	佣金	比例
国泰君安	14,673.64	20.27%	12.24	20.28%	55,102.52	62.88%	45.30	62.69%

(ii)、通过关联人席位进行国债投资买卖年交易量(万元)情况

2001年度及2000年5-12月均无通过关联人席位进行国债投资买卖。

(iii)、通过关联人席位进行债券回购年交易量(万元)情况

2001年度及2000年5-12月均无通过关联人席位进行债券回购。

(iv)、与关联人进行债券回购年交易量(万元)及利息支出(万元)情况

关联人	2001年度		2000年5-12月	
	交易量	利息支出	交易量	利息支出
中国建设银行	34,500.00	177.36	-	-

(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、至2001年12月31日止，基金应支付基金管理人管理费共7,749,137.95元，其中已支付基金管理人7,155,653.39元，尚余593,484.56元未支付。2000年度共计提3,214,482.75元，已全部支付。

(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年末提取业绩报酬。2000年度应支付基金管理人业绩报酬629,526.68元，已全部支付。

(4) 基金托管人报酬

(i)、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

(ii)、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；

(iii)、至2001年12月31日止，基金应支付基金托管人托管费共1,305,976.97元，其中已支付基金托管人1,207,062.86元，尚余98,914.11元未支付。2000年度共计提535,747.19元，已全部支付。

5、主要报表项目说明

(1) 应收账款：2001年12月31日余额250,000.00元，系深交所席位交易保证金。

(2) 其他应收款：2001年12月31日余额4,283.23元，系交易所自动扣除，应由席位券商支付的交易所风险基金。

(3) 其他应付款：2001年12月31日余额为270,000元，其中预提基金2001年度审计费用50,000元，预提基金2001年度信息披露费220,000元。

(4) 证券买卖差价收入：2001年1-12月累计发生额为21,572,997.49元，其中：

项 目	发 生 额
上海证券交易所挂牌股票	20,537,163.13元
深圳证券交易所挂牌股票	716,438.33元
上海证券交易所挂牌债券	1,896.03元
银行间同业市场债券	317,500.00元
合 计	21,572,997.49元

(四) 流通受限制的证券

1、截至2001年12月31日止，基金持有的流通受限制的证券明细如下：

序	股票名称	配售日期	可流通日	数量(股)	配售金额(元)	市价(元)	市价与成本差	备注
1	*华能国际	2001-11-21	2002-3-6	18,899	150,247.05	238,505.38	88,258.33	网下申购
2	*深高速	2001-12-11	2002-3-25	79,675	291,610.50	565,692.50	274,082.00	网下申购
	合计				441,857.55	804,197.88	362,340.33	

2、流通受限原因

基金获配新股，从新股获配日至新股上市日或以下规定期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。

2000年5月18日起新股发行时不再单独向基金配售新股。基金可使用以基金名义开设的股票帐户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者参与认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在约定期限内不能自由流通。

上述二只股票为基金配售新股。

3、受限期限

上述“华能国际”、“深高速”(带*号)为已上市未流通的新股，受限期为3个月。

4、估值办法

上述“华能国际”、“深高速”已上市，但本基金持有部分未流通。在编制本报表时，根据有关规定，在2001年12月31日按照均价估值。若流通受限股票中已上市流通的二只股票(带*号)按成本进行估值计算，于2001年12月31日，本基金资产净值将为459,219,961.01元，每份基金单位资产净值为0.9184元。

(五) 期末基金持有股票明细(按市值占净值比例排序)

序	股票代码	股票名称	库存数量	市值	占净值比例
1	000869	张裕A	1,783,735	33,141,796.30	7.21%
2	600335	中发展	1,773,192	28,690,246.56	6.24%
3	000811	烟台冰轮	1,897,424	26,734,704.16	5.82%
4	600824	益民百货	2,243,242	24,384,040.54	5.31%
5	600715	松辽汽车	3,060,820	24,180,478.00	5.26%
6	600498	烽火通信	928,630	22,333,551.50	4.86%
7	000955	欣龙无纺	1,963,105	22,104,562.30	4.81%

8	000966	长源电力	2,500,290	21,727,520.10	4.73%
9	000070	特发信息	1,175,335	18,734,839.90	4.08%
10	000748	湘计算机	1,538,750	17,326,325.00	3.77%
11	600680	上海邮通	841,310	14,630,380.90	3.18%
12	600063	皖维高新	1,494,532	13,645,077.16	2.97%
13	600345	长江通信	341,241	10,619,419.92	2.31%
14	600599	浏阳花炮	248,000	8,779,200.00	1.91%
15	600832	东方明珠	350,750	7,246,495.00	1.58%
16	000927	天津汽车	1,123,290	6,852,069.00	1.49%
17	000959	首钢股份	537,915	3,846,092.25	0.84%
18	600566	洪城股份	228,979	3,716,329.17	0.81%
19	600827	友谊股份	80,000	1,159,200.00	0.25%
20	600329	中新药业	60,000	1,026,600.00	0.22%
21	600311	荣华实业	58,690	779,990.10	0.17%
22	600098	广州控股	50,000	753,000.00	0.16%
23	600548	深圳高速	79,675	565,692.50	0.12%
24	600170	上海建工	50,000	547,500.00	0.12%
25	000063	中兴通讯	13,033	303,277.91	0.07%
26	600011	华能国际	18,899	238,505.38	0.05%
27	600358	国旅股份	6,300	106,029.00	0.02%
28	600028	中国石化	20,000	69,400.00	0.02%
29	600361	北京华联	500	7,795.00	0.00%
	合计			314,250,117.65	68.38%

(六)报告期内基金新增的股票明细

序	股票代码	股票名称	本期新增数量			本期卖出数量
			一级申购	二级买入	其他	
1	600011	华能国际	18,899			
2	600028	中国石化		800,000		780,000
3	600063	皖维高新		1,594,532		100,000
4	600098	广州控股		50,000		
5	600170	上海建工		50,000		
6	600311	荣华实业		58,690		
7	600329	中新药业	46,000	60,000		46,000
8	600335	中发展	14,000	1,974,742		215,550
9	600358	国旅联合		326,300		320,000
10	600361	北京华联	24,000			23,500
11	600498	烽火通信	71,000	1,137,630		280,000
12	600548	深 高 速			79,675	
13	600566	洪城股份		228,979		
14	600599	浏阳花炮	48,000	300,000		100,000
15	600827	友谊股份		80,000		

16	600832	东方明珠		500,750		150,000
17	000063	中兴通讯	1,619,418	200,000	110,505	1,916,890
18	000070	特发信息		1,175,335		
19	000811	烟台冰轮		2,124,624		227,200
20	000927	天津汽车		1,123,290		
21	000959	首钢股份		537,915		

注：其他项包括送股、配股、转赠、增发数量。

(七)报告期内基金剔除的股票明细

序	股票代码	股票名称	期初结存	本期新增数量	本期卖出数量
1	600019	宝钢股份	2,521,500		2,521,500
2	600141	兴发集团	271,600	51,100	322,700
3	600237	铜峰电子	590,279	20,000	610,279
4	600242	华龙集团		150,000	150,000
5	600276	恒瑞医药	553,678		553,678
6	600295	鄂尔多斯		36,668	36,668
7	600305	恒顺醋业	72,000		72,000
8	600319	亚星化学		42,000	42,000
9	600321	国栋建设		11,000	11,000
10	600322	天房发展		67,000	67,000
11	600331	宏达股份		24,000	24,000
12	600332	广州药业		477,553	477,553
13	600360	华微电子		31,000	31,000
14	600363	联创光电		13,000	13,000
15	600367	红星发展		22,000	22,000
16	600376	天鸿宝业		17,000	17,000
17	600377	宁沪高速	30,000		30,000
18	600381	白唇鹿		13,000	13,000
19	600390	金瑞科技	7,000		7,000
20	600391	成发科技		12,000	12,000
21	600395	盘江股份		31,000	31,000
22	600468	特精股份		30,000	30,000
23	600506	香梨股份		18,000	18,000
24	600518	康美药业		13,000	13,000
25	600530	交大昂立		15,000	15,000
26	600550	天威保变		55,000	55,000
27	600568	潜江制药		53,000	53,000
28	600589	广东榕泰		54,000	54,000
29	600630	龙头股份		323,000	323,000
30	600664	哈药集团	887,510		887,510
31	600754	新亚股份		651,060	651,060

32	600776	东方通信		200,000	200,000
33	000403	三九生化	2,159,485		2,159,485
34	000406	石油大明	400,000		400,000
35	000524	东方宾馆		350,000	350,000
36	000548	湖南投资		139,333	139,333
37	000581	威孚高科		500,000	500,000
38	000657	中钨高新	264,873		264,873
39	000725	京东方A	434,295	30,000	464,295
40	000726	鲁泰A	736,831		736,831
41	000963	华东医药	235,154		235,154
42	000979	科苑集团		138,200	138,200

(八)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	采掘业	69,400.00	0.02%
3	制造业	192,231,984.90	41.83%
	其中：食品、饮料	33,921,786.40	7.38%
	纺织、服装、皮毛	22,104,562.30	4.81%
	石油、化学、塑胶、塑料	22,424,277.16	4.88%
	电子	18,734,839.90	4.08%
	金属、非金属	3,846,092.25	0.84%
	机械、设备、仪表	90,173,826.89	19.62%
	医药、生物制品	1,026,600.00	0.22%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	22,719,025.48	4.94%
5	建筑业	547,500.00	0.12%
6	交通运输、仓储业	565,692.50	0.12%
7	信息技术业	65,212,955.23	14.19%
8	批发和零售贸易业	25,551,035.54	5.56%
9	金融、保险业		
10	房地产业		
11	社会服务业	106,029.00	0.02%
12	传播与文化产业		
13	综合类	7,246,495.00	1.58%
	合 计	314,250,117.65	68.38%

2、国债及货币资金合计

截止2001年12月31日，金鼎证券投资基金持有国债及货币资金为146,118,365.19元，占基金资产净值的31.79%。

国债合计由上市国债市值5,469,750.00元、银行间同业市场国债成本90,000,000.00元和银

行间同业市场国债利息350,892.92元构成。

3、占基金资产净值前十名的股票

序号	股票名称	市值(元)	占净值比例
1	张裕A	33,141,796.30	7.21%
2	中发展	28,690,246.56	6.24%
3	烟台冰轮	26,734,704.16	5.82%
4	益民百货	24,384,040.54	5.31%
5	松辽汽车	24,180,478.00	5.26%
6	烽火通信	22,333,551.50	4.86%
7	欣龙无纺	22,104,562.30	4.81%
8	长源电力	21,727,520.10	4.73%
9	特发信息	18,734,839.90	4.08%
10	湘计算机	17,326,325.00	3.77%

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786,181.50元，与基金股票市值314,250,117.65元和国债及货币资金146,118,365.19元相抵后等于基金资产净值。

六、基金持有人结构及前十名持有人

(一) 截止2001年12月31日，本基金持有人结构为：

	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12月31日，本基金共有持有人46,099人，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	中国人寿	26,395,466	5.28%
2	平安保险	18,768,233	3.75%
3	单竹水电	5,883,800	1.18%
4	皖维高新	4,085,655	0.82%
5	耿光霞	4,014,073	0.80%
6	吴翔	3,524,200	0.70%
7	国泰君安	2,645,800	0.53%

8	国泰管理	2,354,200	0.47%
9	李世扬	2,300,000	0.46%
10	许清忠	2,200,000	0.44%

注：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称编制。

七、重要事项揭示

- 2001年3月30日，本基金管理人刊登了《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。
- 2001年5月9日，本基金管理人刊登了《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。
- 2001年8月30日，本基金管理人刊登了《金鼎证券投资基金二00一年中期报告》。
- 2001年9月13日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司公告》。为完善公司治理结构，经公司第二届董事会第二次会议和2001年第一次临时股东会审议并选举董辅弼、龚浩成、曹尔阶、吴鹏等四名独立董事。
- 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督有关问题的通知》的有关要求，经本基金管理人认真研究，我们向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这五家券商租用交易席位。我们选择证券经营机构的标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
 - (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；
 - (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。
- 交易佣金为股票交易金额的1‰并扣除应由券商负担的交易手续费和证管费，国债交易不提取佣金。

- 6、在报告期内，关联人及席位券商股票、国债、回购的交易量及佣金(单位为万元)情况为：

关联人及券商名	股票交易量	比例	国债交易量	比例	回购交易量	比例	证券交易量	比例
国泰君安	14,673.64	20.27%	-	-	-	-	14,673.64	20.06%
长城证券有限责任公司	16,516.04	22.81%	-	-	-	-	16,516.04	22.58%
大鹏证券股份有限公司	14,004.95	19.35%	648.79	86.43%	-	-	14,653.74	20.03%
东方证券有限责任公司	13,576.48	18.75%	101.88	13.57%	-	-	13,678.36	18.70%
宏源证券股份有限公司	13,628.33	18.82%	-	-	-	-	13,628.33	18.63%
合计	72,399.44	100.00%	750.67	100.00%	-	-	73,150.11	100.00%

关联人及券商名	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安	12.24	20.28%	0.08%
长城证券有限责任公司	13.67	22.65%	0.08%
大鹏证券股份有限公司	11.80	19.56%	0.08%
东方证券有限责任公司	11.30	18.72%	0.08%
宏源证券股份有限公司	11.34	18.79%	0.08%
合 计	60.35	100.00%	

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%。

- 7、2002年1月11日，本基金托管人中国建设银行行长、法定代表人由王雪冰变更为张恩照。
- 8、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。

八、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
- 5、金鼎证券投资基金 2000 年年度收益分配报告
- 6、金鼎证券投资基金 2001 年中期报告
- 7、金鼎证券投资基金 2001 年年度报告
- 8、报告期内披露的各项公告原件
- 9、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

2002 年 3 月 29 日