

金鼎证券投资基金 2002 年年度报告

重要提示

本基金的托管人中国建设银行已于 2003 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。

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，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人在作出投资决策前应仔细阅读基金的销售文件。

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：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31-32 楼

邮政编码：200122

法定代表人：陈勇胜

总经理：李春平

信息披露负责人：丁昌海

电话：021-50819801

传真：021-50816885

电子邮件：dingch@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
 信息披露负责人：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：普华永道中天会计师事务所有限公司
 注册地址：上海市浦东新区沈家弄 325 号
 办公地址：上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼
 法定代表人：Kent Watson
 邮编：200021
 电话：021-63863388
 传真：021-63863300
 经办注册会计师：李丹、郭杭翔

(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

(一) 各类财务指标

	2002 年度	2001 年度	2000 年度
基金本期净收益	-58,903,576.40元	17,047,139.60元	14,624,683.90元
单位基金本期净收益	-0.1178元	0.0341元	0.0292元
基金可分配净收益	-112,341,673.48元	-40,417,698.66元	18,242,090.80元
单位基金可分配净收益	-0.2247元	-0.0808元	0.0365元
期末基金资产总值	388,897,427.10元	460,669,636.83元	551,678,552.13元
期末基金资产净值	387,658,326.52元	459,582,301.34元	549,453,357.10元
单位基金资产净值	0.7753元	0.9192元	1.0989元
基金资产净值收益率	-12.82%	3.20%	4.55%
本期基金资产净值增长率	-15.65%	-13.69%	11.20%
基金累计资产净值增长率	-19.04%	-4.02%	11.20%

(二) 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 - 本期已分配净收益 + 期末未实现利得 (若未实现利得为负数, 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 / 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 = 期末单位净值 / 期初单位净值 - 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) × (2001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) 基金产品说明书

<p>投资目标</p>	<p>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。</p>
<p>投资范围</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>本基金进行投资组合的基本范围是: 债券的部分控制在基金资产净值的20% - 60%; 股票比例控制在40% - 80%。</p>
<p>投资理念</p>	<p>价格终将反映价值。</p>
<p>投资策略</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>业。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	<p>业绩基准=80%×【上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均收益率】+20%×【上证国债指数收益率】</p>
风险收益特征	<p>承担较高风险,获取较高的超额收益</p>

(二) 基金经理人介绍

胡定超先生,基金经理,男,38岁,经济学硕士,11年证券从业经历,历任深圳市南山基金管理公司研究部经理、证券投资总部总经理和公司助理总裁。1999年加盟国泰基金管理有限公司,先后担任金泰基金和金鑫基金经理助理。

2003年1月起由何江旭先生任本基金基金经理,徐学标先生任基金经理助理,胡定超先生因工作需要不再担任本基金基金经理。

何江旭,男,31岁,经济学硕士,9年证券期货从业经历。曾就职于浙江金达期货经纪有限公司、君安证券公司、国信证券公司。2000年加盟国泰基金管理有限公司,任研究开发部总监助理、投资决策委员会秘书,现任基金管理部副总监兼金鑫基金基金经理。

徐学标,男,33岁,管理工程硕士。5年证券从业经历,曾先后在上海卫星工程研究所、浦东联合信托有限责任公司、华夏证券研究所任职。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。

(三) 2002年证券市场与投资管理回顾

2002年中国经济仍未走出通货紧缩的阴影,全年居民消费价格同比下降约0.8%,但在固定资产投资和外贸增长的拉动下,全年的GDP增长达到8%的水平,实际增长情况好于年初的预期。在国债投资的推动下,固定资产投资继续快速增长;入世效应及世界经济形势回暖的双重影响,成为我国出口增长的有力的支撑因素;消费需求增长保持平稳,汽车、住房等成为全年消费的亮点。在宏观经济快速增长的同时,企业效益明显改善,金融运行平稳,民间投资渐趋活跃。党的16大的胜利召开,确立了中国经济发展的新方向,将对我国市场经济和证券市场的发展带来深远的影响。

2002年中国证券市场走势与良好的宏观经济状况出现较大反差。尽管政府先后出台降低印花税、国有股停止减持以及引进QFII等多项政策,但股票市场依然呈现弱势,股票指数振荡下行,全年股指下跌幅度接近18%。2002年市场的弱势特征还表现为投资者对利空因素的敏感,全年的两次大盘股融资对市场的进一步下跌有推动作用。全年的市场走势再次促使广大市场参与者深入思考有关证券市场体制变革、上市公司治理、投资理念的演变以及如何与国际市场接轨等深层次问题。

2002年债券市场跌宕起伏,年初最高收益率接近4.8%,但至年末却只有3.9%;市场品种更加丰富,本息拆离金融债、浮动企业债、30年国债等相继出现。

金鼎基金在2002年没能取得理想的业绩,净值出现缩水,在此向基金持有人深表歉意。根据我国宏观经济良好的发展态势,本基金在02年度主要投资了能源、交通、运输港口、乳业和房地产等成长性好的行业,并围绕北京奥运工程和上海浦江两岸综合开发等重大建设项目进行了投资,同时在相对高位减持了前景

不甚乐观的通信设备业、信息技术业的股票，对基本面发生变化的重仓股进行了清理。但由于调整清理的力度不够，加之三季度以后采取了相对重仓策略，加重了短期基金净值下跌的幅度，使基金净值遭受了较大的损失。但此一阶段重仓投资的部分股票在03年初随着指数的走强为本基金带来了一定的收益，为03年基金业绩的提升创造了较有利的条件。

（四）2003年市场投资展望

1、影响证券市场的因素分析

宏观经济因素：2003年我国的GDP仍将保持平稳增长，固定资产投资的增长将继续推动GDP增长，消费增长将保持平稳。宏观经济对股市的影响将呈现中性，对市场起稳定的作用。

政策因素：证券市场的稳定和“承受能力”将得到更多的重视。在我国证券市场以股权分割为特征的情况下，为了保持市场的稳定，管理层必须在现有市场的制度基础与推进市场化改革和国际化进程之间做出合适的制度安排。

公司业绩：2002年度上市公司的业绩较上年有较大的增长，2003年度随着宏观经济增长、企业整体微观效益的改善以及上市公司战略重组与外资并购的持续深入，预计上市公司业绩还会有进一步的提高，上市公司业绩的改善将对二级市场的表现有一定的支撑作用。

资金供求状况：2003年以基金为主的机构投资者规模仍将会有较大的增长，居民储蓄存款、保险资金、企业年金等市场外围资金在市场已处于相对低位和日趋规范的情况下，入市意愿将会增强。而资金需求方面会保持平稳略有增加的状态，大盘股的融资仍将构成对市场的压力。总体看，2003年的市场资金相对充裕，投资者心理的变化将决定资金的运动方向。

投资者信心：在经过了2001年和2002年的大幅下跌后，市场的悲观情绪已得到了较充分的释放，投资者的心态逐渐趋向平稳，2003年市场信心将可能得到逐步恢复。

2、市场可能的走势特征分析

（1）由于我国整体经济环境平稳，市场本身在大幅下跌后也需要修整，但市场在短期内尚难形成牛市的预期，预计2003年市场整体走势还是有可能呈现1350~1650点间箱体振荡的格局，年K线以阳线报收的概率较大。

（2）投资理念的转变将使股票定价结构发生大的调整，机构投资者的增加将带来对市场流动性的新要求，而加入WTO后的外资并购及国际制造业转移将会给市场提供局部热点。

（3）在缺乏新产业和科技变革牵引作用的情况下，2003年证券市场的机会将更多地来源于我国宏观经济增长所引发的行业周期性变动，能否把握行业景气度变化并提前作出行动将是今年投资成败的关键之一。

3、2003年基金投资策略

作为一个以朝阳行业为投资方向的基金，本基金管理小组将从国内经济发展、国际产业变迁的角度优选行业投资方向，并坚持以行业配置为中心的投资策略。2003年我国装备工业及建筑、建材等行业可望继续增长，同时以汽车、房产为龙头的消费结构升级将直接带动上下游产业的发展，电力、民航、电信等传统垄断行业的改革在2003年将进入实质性的实施阶段，这些行业中竞争优势明显的

企业将逐渐脱颖而出，这给我们选择投资标的提供较好的空间。

债券投资方面，2003年本基金将注意提高在金融债、企业债券、可转换公司债券上的投资比重；并通过在充分研究的基础上引入定量化自动交易手段和债券创新工具等来提高投资收益。

本基金管理小组在新的一年里将以投资人的利益为重，注重调研，积极操作，精心运作金鼎基金，逐步恢复基金的分红能力，力争取得较好的收益回报投资人。

（五）内部监察报告

1、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》及其实施准则、和其他有关法律法规的规定，严格遵守基金契约的约定，遵循“稳健为本，规范运作，精心管理，争创一流”的公司理念，本着诚实信用、勤勉尽责的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。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为。

2、内部监察工作报告：

本报告期内，随着基金管理规模的扩大和新业务拓展步伐的加快，本基金管理人切实加强公司内部控制体系建设，进一步完善公司的内部监察稽核制度和风险控制体系，提高防范和化解风险的能力，确保公司的规范运作和 risk 的有效防范。

本基金管理人采取的主要监察稽核措施包括：

一、加强基金投资管理合法合规性的监控。其中即包括对投资比例和投资交易行为的实时监控和预警，也包括对研究投资交易等流程的合规性监察，通过现场检查、专项稽核、报表审核和资料查阅、外部审计等方式，防范基金管理中各种违规行为的发生，切实保护基金持有人的合法权益。

二、聘请国际著名咨询机构进行管理咨询，将国际先进管理经验与公司实际相结合，进一步完善公司经营机制、提高管理效率。公司在调整完善组织结构和职能设置的基础上，修订了各项标准业务流程和岗位说明书体系，督促各部门严格依照业务流程规定的程序进行操作，从而完善了公司业务管理体系和控制规范。

三、加强风险管理，运用国际先进的风险管理方法，量化分析投资管理中面临的 market risk、集中风险和流动性风险等 risk 因素，并通过 risk 报告及时揭示投资组合的 risk 暴露程度，有效地防范和化解相关 risk。

四、完善公司内部控制体系，根据证监会颁布的《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》，结合公司管理咨询成果，对公司各项内部控制制度进行了修订和完善，细化了内部控制程序和措施，并通过日常监察稽核保障内部控制措施的落实。

五、加强对员工行为准则的监察，通过持续的职业道德教育、自律承诺、经常性行为监察和定期考核等，促进员工遵纪守法的自觉性和职业道德素质的提高。

六、加强监察稽核人员自身建设。在进一步完善科学详细的工作流程和职责要求的基础上，加强培训力度，不断提升稽核监察和 risk 管理人员的业务素质和能力。

经持续监察稽核，本报告期内，本基金的投资运作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所管理的其他资产、基金资产和公司资产严格分开、公平对待；各基金管理小组保持独立运作；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。通过稳健经营、规范运作，保护了基金持有人的合法权益。

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工作的科学性和有效性，确保基金资产的规范运作和风险控制，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”）。

2002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。

2002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。

2002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
2003年3月11日

五、 基金财务报告

(一) 审计报告书

金鼎证券投资基金全体基金持有人

我们接受委托，审计了金鼎证券投资基金(以下简称“基金金鼎”) 2002年12月31日的资产负债表及2002年度的经营业绩表和基金净值变动表。这些会计报表由基金金鼎管理人国泰基金管理有限公司负责，我们的责任是对这些会计报表发表审计意见。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，我们结合基金金鼎的实际情况，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，上述基金金鼎会计报表符合中华人民共和国企业会计准则、《证券投资基金会计核算办法》、《金鼎证券投资基金基金契约》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，在所有重大方面公允地反映了基金金鼎2002年12月31日的财务状况及2002年度的经营成果和净值变动情况，会计方法的选用遵循了一贯性原则。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师 李丹

2003年1月17日

注册会计师 郭杭翔

(二)基金会计报表
1、资产负债表

资产负债表
2002年12月31日

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

资产	年初数	年末数	负债及持有人权益	年初数	年末数
资产：			负债：		
银行存款	41,557,932.13	35,698,005.73	应付证券清算款		14,817.78
清算备付金	3,958,357.15	4,003,935.73	应付赎回款		
交易保证金	250,000.00	250,000.00	应付赎回费		
应收证券清算款	4,781,432.99	12,646,968.51	应付管理人报酬	593,484.56	502,922.01
应收股利			应付托管费	98,914.11	83,820.33
应收利息	397,763.68	943,794.26	应付佣金	124,936.82	128,837.66
应收申购款			应付利息		
其他应收款	4,283.23	30,000.00	应付收益		
股票投资市值	314,250,117.65	250,094,565.07	未交税金		
其中：股票投资成本	372,959,256.15	321,531,252.73	其他应付款		252,702.80
债券投资市值	95,469,750.00	85,230,157.80	卖出回购证券款		
其中：债券投资成本	95,467,546.70	85,520,803.76	短期借款		
配股权证			预提费用	270,000.00	256,000.00
买入返售证券			其他负债		
待摊费用			负债合计	1,087,335.49	1,239,100.58
其他资产			持有人权益：		
			实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
			未实现利得	-58,706,935.20	-71,727,333.62
			未分配收益	18,289,236.54	-40,614,339.86
			持有人权益合计	459,582,301.34	387,658,326.52
资产总计	460,669,636.83	388,897,427.10	负债及持有人权益总计	460,669,636.83	388,897,427.10

2、经营业绩表

经营业绩表

2002年度

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

项目	2001年度	2002年度
一、收入	28,985,621.05	-50,073,471.26
1、股票差价收入	21,253,601.46	-61,891,042.86
2、债券差价收入	319,396.03	5,042,643.42
3、债券利息收入	3,217,691.80	3,645,847.35
4、存款利息收入	2,187,968.91	947,537.71
5、股利收入	1,858,434.47	2,107,388.71
6、买入返售证券收入		0.00
7、其他收入	148,528.38	74,154.41
二、费用	11,938,481.45	8,830,105.14
1、基金管理人报酬	7,749,137.95	6,508,461.60
2、基金托管费	1,305,976.97	1,084,743.60
3、卖出回购证券支出	2,381,406.85	761,128.64
4、利息支出		
5、其他费用	501,959.68	475,771.30
其中：上市年费	60,000.00	60,000.00
信息披露费	320,000.00	320,000.00
审计费用	50,900.00	50,000.00
三、基金净收益	17,047,139.60	-58,903,576.40
加：未实现利得	-89,918,201.50	-13,020,398.42
四、基金经营业绩	-72,871,061.90	-71,923,974.82

3、基金收益分配表

基金收益分配表

2002年度

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

项目	2001年度	2002年度
本期基金净收益	17,047,139.60	-58,903,576.40
加：期初基金净收益	18,242,090.80	18,289,236.54
加：本期损益平准金		
可供分配基金净收益	35,289,230.40	-40,614,339.86
减：本期已分配基金净收益	16,999,993.86	
期末基金净收益	18,289,236.54	-40,614,339.86

4、基金净值变动表

基金净值变动表

2002年度

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

项目	金额
一、期初基金净值	459,582,301.34
二、本期经营活动：	
基金净收益	-58,903,576.40
未实现利得	-13,020,398.42
经营活动产生的基金净值变动数	-71,923,974.82
三、本期基金单位交易：	
基金申购款	
基金赎回款	
基金单位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	
五、期末基金净值	387,658,326.52

(三)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（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（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、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财政部颁布的《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》、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。本报告期为2002年1月1日至2002年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：

任何上市流通的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（平均价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价估值。

未上市的股票应区分以下情况处理：

a. 配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

b. 首次公开发行的股票，按成本估值。

配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按市价高于配股价的差额估值；如果市价等于或低于配股价，则估值额为零。

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，基金管理公司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。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

(5) 基金的主要收入确认政策：

股票差价收入：于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

债券差价收入：卖出上市债券，应于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；卖出非上市债券，应于实际收到价款时确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

债券利息收入：为债券持有期内按债券票面价值与票面利率逐日计提的利息。

存款利息收入：按本金与适用的利率逐日计提的利息确认，计提对象为银行存款和清算备付金。

股利收入：在除息日确认股利收入，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

买入返售证券收入：在证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。

其他收入：在实际收到时确认。

(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：

以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围。

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。

对基金管理人运用基金资产买卖股票按2‰的税率征收印花税。

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：

每一基金单位享有同等分配权。

收益分配比例不低于基金净收益的90%。

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。

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。

基金投资当年亏损，则不进行收益分配。

(9) 会计政策变更：

本基金以前年度原执行由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中有关基金会计核算的规定。根据中华人民共和国财政部2001年11月11日颁布的《证券投资基金会计核算办法》的规定，本基金已于2002年1月1日起执行该办法。

其主要影响是变更了本基金证券交易所交易债券的成本计价方法及利息收入确认方法：成本计价方法由含息成本变更为不含息成本；利息收入由收到时认列变更为在债券实际持有期内逐日计提。上述会计政策的变更对本基金资产净值无影响。

本基金于2002年1月1日起采用变更后的会计政策，并相应调整应收利息和投资成本科目的年初余额。根据2002年1月财政部有关基金核算会议传达的精神，本基金不对以前年度的会计报表进行追溯调整。上述调整形成的差额1,188.91元因金额非重大而直接列入本年度债券利息收入。

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	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	
宏源证券股份有限公司	基金管理人股东	持有公司股份	公司章程	
以下简称“宏源证券”	席位出租人	出租交易席位	席位使用协议	租用二个席位

(2) 通过关联人席位交易及与关联人进行交易情况

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	2002年度				2001年度			
	交易量	比例	佣金	比例	交易量	比例	佣金	比例
国泰君安	12,318.82	19.39%	9.89	19.40%	14,673.64	20.27%	12.24	20.28%
宏源证券	12,649.60	19.91%	10.13	19.88%	13,628.33	18.82%	11.34	18.79%

注：根据2002年1月1日起执行的《证券投资基金会计核算办法》，2002年度的佣金已扣除风险基金。2001年度的佣金含风险基金。

通过关联人席位进行债券投资买卖年交易量(万元)情况

关联人	2002年度		2001年度	
	交易量	比例	交易量	比例
国泰君安	5,275.89	26.41%	-	-
宏源证券	3,906.22	19.55%	-	-

通过关联人席位进行债券回购年交易量(万元)情况

关联人	2002年度		2001年度	
	交易量	比例	交易量	比例
国泰君安	8,800.00	28.48%	-	-
宏源证券	3,800.00	12.30%	-	-

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	2002年度		2001年度	
	交易量	利息支出	交易量	利息支出
中国建设银行	40,000.00	38.19	34,500.00	177.36

与关联人进行国债买卖年交易量(万元)情况

关联人	2002年度交易量	2001年度交易量
国泰君安	4,164.80	-

(3) 基金管理人报酬

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。本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值20%，超出部分不计提管理费。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

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。

在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共6,508,461.60元，其中已支付基金管理人6,005,539.59元，尚余502,922.01元未支付。2001年度共计提7,749,137.95元，已全部支付。

(4) 基金托管人报酬

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

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。

在本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共1,084,743.60元，其中已支付基金托管人1,000,923.27元，尚余83,820.33元未支付。2001年度共计提1,305,976.97元，已全部支付。

5、主要报表项目说明

- (1) 交易保证金：2002年12月31日余额为250,000.00元，系深交所席位交易保证金。
- (2) 应收利息：2002年12月31日余额为943,794.26元，系应收银行存款和清算备付金利息21,638.11元及应收债券利息922,156.15元。
- (3) 其他应付款：2002年12月31日余额为252,702.80元，系应缴股利税金。
- (4) 预提费用：2002年12月31日余额为256,000.00元，系预提基金2002年度审计费用50,000.00元，预提基金2001年及2002年信息披露费200,000.00元及预提基金2002年度债券托管账户维护费6,000.00元。
- (5) 其他收入：2002年累计发生额为74,154.41元，包括债券发行手续费返还13,544.00元，新股中签手续费返还59,181.10元及印花税返还1,429.31元。
- (6) 卖出回购证券支出：2002年累计发生额为761,128.64元，系卖出回购证券在融资期限内逐日计提的利息支出。
- (7) 应由基金承担的其他费用：2002年累计发生额为475,771.30元，包括上市年费60,000.00元，信息披露费320,000.00元，审计费用50,000.00元，回购交易费用9,437.50元及其他费用36,333.80元。
- (8) 未实现利得：2002年累计发生额为-13,020,398.42元，系本期因投资估值增值产生的未实现利得。

(四) 流通受限制的证券

1、截至2002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	*中国联通	2002-9-26	2003-4-9	1,066,085	2,451,995.50	2,889,090.35	437,094.85	网下申购
2	中信证券	2002-12-20	2003-1-6	32,000	144,000.00	144,000.00	-	网上申购
3	中信证券	2002-12-24	2003-1-6	82,000	369,000.00	369,000.00	-	二级市场配售
4	皖通高速	2002-12-26	2003-1-7	81,000	178,200.00	178,200.00	-	二级市场配售
	合计				3,143,195.50	3,580,290.35	437,094.85	

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。

根据中国证券监督管理委员会的政策规定，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。

根据中国证券监督管理委员会证监发行字[2002]54号文《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》，自2002年5月20日起，恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股市值参与配售，但累计申购总额不得超过基金按规定可申购的总额。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

3、受限期限

上述“中国联通”(带*号)为已上市未流通的新股，受限期为6个月。

4、估值办法

上述“中国联通”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2002年12月31日按照均价估值，其余未上市流通的三只股票按成本价估值。若流通受限股票中已上市流通的股票(带*号)按成本进行估值计算，于2002年12月31日，本基金资产净值将为387,221,231.67元，每份基金单位资产净值为0.7744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	600050	中国联通	9,330,465	25,285,560.15	6.52%
2	600824	益民百货	2,346,880	23,187,174.40	5.98%
3	000869	张裕A	1,332,535	19,455,011.00	5.02%
4	000811	烟台冰轮	1,481,529	15,304,194.57	3.95%
5	600508	上海能源	1,443,502	14,969,115.74	3.86%
6	000966	长源电力	1,786,163	12,110,185.14	3.12%
7	000955	欣龙无纺	1,391,817	10,048,918.74	2.59%
8	600642	申能股份	798,280	7,703,402.00	1.99%
9	000895	双汇发展	734,385	7,578,853.20	1.96%
10	600597	光明乳业	634,448	7,188,295.84	1.85%
11	600052	浙江广厦	1,249,666	7,023,122.92	1.81%
12	600036	招商银行	782,700	6,379,005.00	1.65%
13	600519	贵州茅台	248,820	6,354,862.80	1.64%
14	000542	TCL 通讯	394,000	5,606,620.00	1.45%
15	600503	宏智科技	351,119	5,586,303.29	1.44%
16	600832	东方明珠	331,484	5,171,150.40	1.33%
17	000581	威孚高科	538,556	5,159,366.48	1.33%
18	600019	宝钢股份	1,134,807	4,664,056.77	1.20%
19	600170	上海建工	540,990	4,398,248.70	1.13%

20	600010	钢联股份	952,464	4,314,661.92	1.11%
21	600195	中牧股份	552,159	4,306,840.20	1.11%
22	600535	天士力	231,881	4,159,945.14	1.07%
23	000027	深能源A	647,502	4,072,787.58	1.05%
24	600598	北大荒	631,562	3,700,953.32	0.95%
25	000927	一汽夏利	638,479	3,696,793.41	0.95%
26	600790	轻纺城	665,920	3,589,308.80	0.93%
27	600260	凯乐科技	260,513	3,272,043.28	0.84%
28	000919	金陵药业	183,020	2,878,904.60	0.74%
29	000541	佛山照明	242,813	2,802,062.02	0.72%
30	600276	恒瑞医药	233,598	2,403,723.42	0.62%
31	600266	北京城建	250,000	2,390,000.00	0.62%
32	600335	中发展	231,163	2,343,992.82	0.60%
33	600011	华能国际	193,499	2,165,253.81	0.56%
34	600566	洪城股份	178,979	2,031,411.65	0.52%
35	600103	青山纸业	507,127	1,937,225.14	0.50%
36	600509	天富热电	165,986	1,699,696.64	0.44%
37	600641	中远发展	140,000	1,233,400.00	0.32%
38	600500	中化国际	139,327	1,231,650.68	0.32%
39	600506	香梨股份	106,408	986,402.16	0.25%
40	600675	中华企业	109,972	732,413.52	0.19%
41	600030	中信证券	114,000	513,000.00	0.13%
42	600063	皖维高新	36,552	264,270.96	0.07%
43	600012	皖通高速	81,000	178,200.00	0.05%
44	600018	上港集箱	971	16,176.86	0.00%
	合计			250,094,565.07	64.51%

(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	600010	钢联股份		1,173,164		220,700
2	600012	皖通高速	81,000			
3	600018	上港集箱		960,971		960,000
4	600019	宝钢股份		1,934,807		800,000
5	600030	中信证券	114,000			
6	600036	招商银行	280,600	802,100		300,000
7	600050	中国联通	1,877,085	9,133,380		1,680,000
8	600052	浙江广厦		2,442,157		1,192,491
9	600103	青山纸业		903,500		396,373
10	600195	中牧股份		552,159		
11	600260	凯乐科技		260,513		
12	600266	北京城建		250,000		

13	600276	恒瑞医药		350,982	34,160	151,544
14	600500	中化国际		143,400	53,972	58,045
15	600503	宏智科技	16,000	365,119		30,000
16	600506	香梨股份		406,408		300,000
17	600508	上海能源		1,443,502		
18	600509	天富热电	2,000	263,986		100,000
19	600519	贵州茅台		226,200	22,620	
20	600535	天士力	29,000	202,881		
21	600597	光明乳业	48,000	586,448		
22	600598	北大荒	50,000	956,100		374,538
23	600641	中远发展		200,000		60,000
24	600642	申能股份		596,280	402,000	200,000
25	600675	中华企业		229,972		120,000
26	600790	轻纺城		665,920		
27	000027	深能源A		793,380	128,322	274,210
28	000541	佛山照明		242,813		
29	000542	TCL 通讯		545,700		151,700
30	000581	威孚高科		606,360		67,804
31	000895	双汇发展			734,385	
32	000919	金陵药业		183,020		

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	600016	民生银行		343,595	343,595
2	600026	中海发展		22,000	22,000
3	600028	中国石化	20,000		20,000
4	600098	广州控股	50,000		50,000
5	600111	稀土高科		200,000	200,000
6	600188	兖州煤业		200,000	200,000
7	600210	紫江企业		521,128	521,128
8	600258	首旅股份		9,700	9,700
9	600263	路桥建设		258,201	258,201
10	600270	外运发展		52,990	52,990
11	600311	荣华实业	58,690		58,690
12	600317	营口港		44,000	44,000
13	600327	大厦股份		19,000	19,000
14	600329	中新药业	60,000		60,000
15	600345	长江通信	341,241	16,408	357,649
16	600350	山东基建		50,000	50,000

17	600351	亚宝药业		12,000	12,000
18	600353	旭光股份		17,000	17,000
19	600355	精伦电子		13,000	13,000
20	600357	承德钒钛		34,000	34,000
21	600358	国旅联合	6,300		6,300
22	600361	华联综超	500		500
23	600371	华冠科技		20,000	20,000
24	600397	安源股份		27,000	27,000
25	600416	湘电股份		26,000	26,000
26	600426	华鲁恒升		24,000	24,000
27	600428	中远航运		328,000	328,000
28	600456	宝钛股份		4,000	4,000
29	600458	时代新材		12,000	12,000
30	600486	扬农化工		4,000	4,000
31	600496	长江股份		28,000	28,000
32	600498	烽火通信	928,630	50,000	978,630
33	600499	科达机电		9,000	9,000
34	600505	西昌电力		31,000	31,000
35	600510	黑牡丹		13,000	13,000
36	600511	国药股份		18,000	18,000
37	600512	腾达建设		17,000	17,000
38	600515	第一投资		10,000	10,000
39	600516	海龙科技		20,000	20,000
40	600522	中天科技		29,000	29,000
41	600525	长园新材		15,000	15,000
42	600526	菲达环保		15,000	15,000
43	600529	山东药玻		5,000	5,000
44	600531	豫光金铅		22,000	22,000
45	600532	华阳科技		19,000	19,000
46	600536	中软股份		7,000	7,000
47	600548	深高速		79,675	79,675
48	600549	厦门钨业		10,000	10,000
49	600551	科大创新		17,000	17,000
50	600552	方兴科技		18,000	18,000
51	600553	太行股份		14,000	14,000
52	600557	康缘药业		19,000	19,000
53	600559	裕丰股份		19,000	19,000
54	600560	金自天正		15,000	15,000
55	600561	江西长运		14,000	14,000
56	600563	法拉电子		19,000	19,000
57	600565	迪马股份		7,000	7,000
58	600571	信雅达		5,000	5,000

59	600577	精达股份		6,000	6,000
60	600578	京能热电		23,000	23,000
61	600579	黄海股份		22,000	22,000
62	600580	卧龙科技		3,000	3,000
63	600581	八一钢铁		47,000	47,000
64	600583	海油工程		4,000	4,000
65	600585	海螺水泥		37,000	37,000
66	600586	金晶科技		21,000	21,000
67	600587	新华医疗		9,000	9,000
68	600590	泰豪科技		24,000	24,000
69	600591	上海航空		63,000	63,000
70	600592	龙溪股份		13,000	13,000
71	600593	大连圣亚		7,000	7,000
72	600595	中孚实业		20,000	20,000
73	600599	浏阳花炮	248,000		248,000
74	600619	海立股份		125,509	125,509
75	600680	上海邮通	841,310	17,900	859,210
76	600715	ST松辽	3,060,820		3,060,820
77	600780	通宝能源		379,500	379,500
78	600823	世茂股份		199,973	199,973
79	600827	友谊股份	80,000	152,000	232,000
80	600887	伊利股份		257,524	257,524
81	000002	万科A		110,000	110,000
82	000039	中集集团		107,000	107,000
83	000063	中兴通讯	13,033		13,033
84	000070	特发信息	1,175,335	50,000	1,225,335
85	000748	湘计算机	1,538,750	326,200	1,864,950
86	000792	盐湖钾肥		457,789	457,789
87	000959	首钢股份	537,915		537,915

(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	4,687,355.48	1.21%
2	采掘业	14,969,115.74	3.86%
3	制造业	110,165,433.96	28.42%
	其中：食品、饮料	44,883,863.04	11.58%
	纺织、服装、皮毛	10,048,918.74	2.59%
	造纸、印刷	1,937,225.14	0.50%
	石油、化学、塑胶、塑料	3,536,314.24	0.91%
	金属、非金属	8,978,718.69	2.32%
	机械、设备、仪表	31,337,820.95	8.08%

	医药、生物制品	9,442,573.16	2.44%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	27,751,325.17	7.16%
5	建筑业	13,811,371.62	3.56%
6	交通运输、仓储业	194,376.86	0.05%
7	信息技术业	36,478,483.44	9.41%
8	批发和零售贸易业	24,418,825.08	6.30%
9	金融、保险业	6,892,005.00	1.78%
10	房地产业	1,965,813.52	0.51%
11	社会服务业		
12	传播与文化产业		
13	综合类	8,760,459.20	2.26%
	合 计	250,094,565.07	64.51%

2、国债及货币资金合计

截止2002年12月31日，金鼎证券投资基金持有国债（不含应计利息）及货币资金合计为137,564,249.99元（货币资金中含当日证券清算款12,632,150.73元），占基金资产净值的35.49%。

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	中国联通	25,285,560.15	6.52%
2	益民百货	23,187,174.40	5.98%
3	张裕A	19,455,011.00	5.02%
4	烟台冰轮	15,304,194.57	3.95%
5	上海能源	14,969,115.74	3.86%
6	长源电力	12,110,185.14	3.12%
7	欣龙无纺	10,048,918.74	2.59%
8	申能股份	7,703,402.00	1.99%
9	双汇发展	7,578,853.20	1.96%
10	光明乳业	7,188,295.84	1.85%

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、预提费用及其他应收应付款项合计为贷方余额488.54元，与基金股票市值250,094,565.07元，国债及货币资金合计137,564,249.99元相抵减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2002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	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%

(三) 截止2002年12月31日，本基金共有持有人43,705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	15,003,600	3.00%
2	光大证券	10,438,200	2.09%
3	东莞财信	6,866,412	1.37%
4	平安保险	4,663,333	0.93%
5	信息公司	4,201,900	0.84%
6	皖维高新	4,085,655	0.82%
7	吴翔	3,524,200	0.70%
8	国泰君安	2,645,800	0.53%
9	国泰管理	2,354,200	0.47%
10	黄沙坪矿	1,945,500	0.39%

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册编制。

七、重要事项揭示

- 1、2002年3月29日，本基金管理人刊登了《金鼎证券投资基金二00一年年度报告》及《金鼎证券投资基金二00一年年度收益分配报告》。基金金鼎二00一年年度不进行收益分配。
- 2、2002年4月17日，安达信同普华永道正式签署合并的法律文件，定于从2002年7月1日起，安达信在中国内地及香港的业务并入普华永道，以普华永道的名义营业。因此，本基金的会计师事务所由安达信·华强会计师事务所改为普华永道中天会计师事务所有限公司。
- 3、2002年5月10日，本基金管理人刊登了《金鼎证券投资基金关于更换基金经理的公告》。因工作需要，经国泰基金管理有限公司第二届董事会第六次会议审议同意，聘任胡定超先生为基金金鼎基金经理，张以杰先生不再担任基金金鼎基金经理。2003年1月29日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司关于更换基金经理的公告》。因工作需要，经国泰基金管理公司第二届董事会第九次会议审议批准，公司决定聘任何江旭先生为金鼎基金基金经理，胡定超先生不再担任金鼎基金基金经理。
- 4、2002年6月12日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司迁址公告》。国泰基金管理有限公司办公地址自2002年6月17日起，由上海市延平路121

号三和大厦迁至上海市浦东新区世纪大道1600号浦项集团商务广场31 - 32层。

- 5、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，本基金管理人2002年度向国泰君安、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、宏源证券及上海证券有限责任公司这六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。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，债券交易不提取佣金。

- 6、在报告期内，关联人及席位券商股票、债券、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	债券交易量	比例	回购交易量	比例	证券交易量	比例
国泰君安	12,318.82	19.39%	5,275.89	26.41%	8,800.00	28.48%	26,394.71	23.07%
长城证券有限责任公司	12,718.88	20.01%	2,103.73	10.53%	6,300.00	20.39%	21,122.61	18.46%
大鹏证券股份有限公司	10,913.00	17.17%	1,638.66	8.20%	7,500.00	24.27%	20,051.66	17.52%
东方证券有限责任公司	11,265.01	17.73%	7,054.14	35.31%	4,500.00	14.56%	22,819.15	19.94%
宏源证券	12,649.60	19.91%	3,906.22	19.55%	3,800.00	12.30%	20,355.82	17.79%
上海证券有限责任公司	3,682.31	5.79%	-	-	-	-	3,682.31	3.22%
合计	63,547.62	100.00%	19,978.64	100.00%	30,900.00	100.00%	114,426.26	100.00%

关联人及券商名	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安	9.89	19.40%	0.08%
长城证券有限责任公司	10.20	20.01%	0.08%
大鹏证券股份有限公司	8.79	17.24%	0.08%
东方证券有限责任公司	8.94	17.55%	0.08%
宏源证券	10.13	19.88%	0.08%
上海证券有限责任公司	3.02	5.92%	0.08%
合计	50.97	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。

- 7、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、金鼎证券投资基金各年度中期报告、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

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。

客户服务中心电话：(021)68674688

投资者投诉电话：(021)50819801

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2003年3月27日