

金盛证券投资基金 2002 年中期报告

重要提示

本基金的托管人中国建设银行已于 2002 年 8 月 28 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：金盛证券投资基金（简称：基金金盛）

交易代码：184703

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 4 月 26 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 2009 年 11 月 30 日止

基金上市地：深圳证券交易所

基金上市日期：2000 年 6 月 30 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

负责信息管理事务人员：丁昌海、黄永明

联系地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31-32 楼

电话：021-50819830

传真：021-58313388

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：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：何影帆、陈经纬
 联系人：韩歆
 联系人电话：021-63863388-2569
 传真：021-63863300

(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

基金本期净收益	-68,724,848.30元
单位基金本期净收益	-0.1374元
基金可分配净收益	-45,971,956.57元
单位基金可分配净收益	-0.0919元
期末基金资产总值	622,861,903.54元
期末基金资产净值	464,006,356.05元
单位基金资产净值	0.9280元
基金资产净值收益率	-15.11%
本期基金资产净值增长率	2.03%
基金累计资产净值增长率	-7.61%

(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） + 以前年度损益调整

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 = 期末基金单位净值 / 期初基金单位净值 - 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) 基金经理介绍

基金经理：吕俊先生，29岁，硕士，七年证券从业经验。曾先后任广州珠江基金管理公司经理助理、平安证券公司资产管理部基金管理室高级分析师。2000年加入国泰基金管理公司任研究开发部副经理，本期中途开始担任基金金盛经理。

(二) 投资理念和投资目标

本基金为以新兴产业为投资重点的成长型基金，所追求的投资目标是在尽可能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。本基金的股票投资部分主要投资于沪深两市涉及新兴产业的上市公司，例如：电子通讯、环保、及新材料等产业的上市公司。

(三) 上半年投资管理回顾

1、基金业绩

上半年，基金净值增长2.03%，换算成年增长率4.06%，超过同期银行存款利率水平。

2、市场回顾

2002年上半年的股票市场的基本情况为：期间最后一个交易日收盘仅比期间开盘价超出5.4%，而最高点与最低点相差不足30%。在大箱体中，经历了两次V形的“急跌—急升”过程。第一次从元旦开始，最低跌了17.3%，而后基本回到原位置，历时2个多月。第二次从五一节以后开始，最低跌了12.2%，然后强劲反弹到1732点，比下跌开始时反而高出3.9%，时间上正好也是接近两个月。在此中间是两个月左右的窄幅度盘整。

上半年的行情与三个大的政策密切相关，它们分别是调整佣金政策；新股按市值配售；停止通过证券市场减持国有股。这些政策的出台体现出管理层保持市场稳定运行的用心，也逐步增强了投资者的信心。

在今年的第一次反弹中，以深圳本地绩差低价股为代表，典型的如深深房、

银广夏等最高涨幅超过150%，它们上涨的背景是当地确定了即将有计划地重组本地上市公司。上海方面，受黄浦江两岸开发概念影响，本地房地产公司涨幅较多。主流机构投资者所看好的投资品种在一季度基本没有出色的表现。但是凭借较广的覆盖面，一些基金也取得了一定的增长。第二次反弹中，基金等机构参与较深，适逢上海推出180指数，所以热点更加鲜明地反应了这些机构的投资偏好——一大市值的价值型股票。由于整个市场对于牛熊转折时期高价股的恐惧心理还没有解除，并且部分地延续了一季度反弹的经验，所以低价股受到欢迎。

债券方面，本基金在上半年度采取了稳健积极的固定收益投资管理策略，综合考虑债券期限结构的稳健性和投资运作的灵活性。具体地说，是构筑了一个风险水平相对较低的固定收益资产期限结构，结合灵活的投资手段，实现了比较理想的整体收益水平。从投资范围看，拓展了固定收益投资品种，开始投资于可转换债券及金融债券。

（四）下半年市场分析及基金投资策略

1、市场分析

根据国家统计部门以及券商研究分析人员提供的宏观分析报告，上半年国内经济形势好于预期，除个别指标不尽如人意之外，其他指标都交出了较好的答卷。从三大需求看，社会消费品零售总额增长8.6%，低于去年同期1.7个百分点。投资需求同比增长21.5%，比去年同期加快6.4个百分点。出口增长14.1%，出口需求对促进经济增长作用明显。今年上半年GDP增长7.8%，已经远远超出年初7.3%的平均预测水平。考虑到投资增长的特点，下半年投资增速将回落；受美国经济复苏不确定以及国际贸易保护主义盛行的影响，下半年对外贸易增长幅度不会太高；今年以来消费增长一直较低，即使下半年有所回升，估计也到不了去年同期的水平；总之，今年下半年我国经济加速增长的可能性较小。如果没有大的国内国际经济形势变化，预测全年的经济增长速度为7.6%左右。

同时国家将保持政策的稳定连贯，新出台政策更加务实。中外合资合作证券公司基金公司、新基金公司将真正进入市场，带来新的资金供应。总体而言，我们认为虽然有一定的不确定因素，但下半年A股市场将强于去年同期水平，股指将在比较合理的位置作宽幅振荡，不排除创出阶段性高点的可能。

2、基金投资策略

本基金在报告期内更换了基金经理之后，继续按照契约的规定进行管理运作，注意资产配置和组合投资，特别是强化了对子行业进行投资的策略。经过必要的行业划分，并在研究员的支持下，本基金将手机、外贸、电力等三个子行业作为重点投资方向。手机行业是通信行业中的一个新兴子行业，国产手机自去年三季度以来竞争力不断增强，市场占有率迅速提高，我们认为在3G通信技术大规模应用之前，国产手机至少在数量上将占据大部分市场，而目前的市场份额只是很小一部分。该行业刚刚进入腾飞阶段，因而将股票组合的20%左右配置于手机行业；随着美国经济为首的西方经济反弹和复苏，我国进出口贸易也开始走出低谷，上半年开局良好。经过贸易不景气的淘汰，信誉良好的大贸易公司正在进一步占领市场，外贸行业也成为我们本期投资较多的行业；电力体制改革今年上半年在国家的推动下逐步启动，电力行业资产庞大，盈利丰厚，其内部的合纵连横必然带来较多投资机会，我们在这个行业的投资比例也比较高。

与大部分基金相比，本基金的集中度略高一些。我们采取这种策略主要出于以下考虑：

首先，我们认为高度重视流动性管理无疑是正确的，但以本基金5亿基金单位的规模，即便在单个品种上配置较高一些，也不会使流动性下降到无法忍受的地步。另外，经过精心挑选出来的重仓品种作长线投资，一般情况下只作部分调整，无须全部退出，对流动性的要求可以适当放宽。而且，所谓“牛市集中，熊市分散”是过去资金推动型市场环境下的经验总结，并不能照搬到现在的市场。5亿单位规模的基金由于覆盖面窄，不够分散，在今天的上涨行情中表现反而不如20亿以上规模的基金。反过来，在弱市中，精选品种的表现战胜大盘使集中投资反而更安全。

第二，目前市场上业绩真实、成长迅速、价格远低于价值的上市公司并不多，在研究资源有限的前提下，基金面对这个现实有两条道路可走：其一是抓住波段，以仓位调整取胜，降低选股的重要性；其二是有效利用质优公司的稀缺性，对精选品种作相对集中的投资，并且确信其表现足以战胜大盘的波动给组合带来正贡献。我们认为两种道路都是可取的，关键是必须恰当地结合基金本身的实际情况。

第三，市场正在形成新的偏见——从盲目追捧“绩优高成长”到不信任所有的高成长上市公司。这种钟摆式的动摇十分常见，并且会使不同的投资者之间的定价差异增大，如果认真分析这种差异，找出被低估的对象，就能够为持有人盈利。

基金的使命是分享上市公司的成长和提高定价的效率，基金的收益也来自于此。本基金将继续保持“适度集中于重点子行业”的总体策略，力争在下半年为投资者贡献更好回报。

（四）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、和其他有关法律法规的规定，严格遵守基金契约的约定，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用基金资产，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；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：

一是聘请国际著名咨询机构进行管理咨询，运作国际经验结合公司实际，进一步修订和完善业务运作流程，督促各部门严格依照业务运作流程规定的程序进行操作。

二是加强对投资运作合规性的审核，在业务流程中增加合规性审核的环节，将合规运作作为对基金经理考核的重要内容，杜绝各种可能违反基金契约及法律法规事件的发生，切实保护基金持有人的合法权益。

三是加强目标管理和授权管理，确保基金小组在授权范围内规范运作，对超出授权范围的严格审批程序。

四是加强风险管理，修订完善各项风险控制指标，构架风险监控体系；运用

国际先进的风险管理程序，量化投资过程中的风险指标，对市场风险、行业风险和个股风险提出风险评估意见。

五是除通过实时监控、现场监察、报表审核、资料查阅、人员询问等方式，加大内部日常监察力度外，开展专项稽核监察和基金经理离任审计，促进合规运作。

六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。

七是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。

八是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。

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，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现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、操纵市场和不当关联交易；亦无员工发生违法违规行，没有受到主管部门的任何处罚。

本基金管理人将诚实信用，勤勉尽责，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、基金托管人报告

中国建设银行根据《金盛证券投资基金契约》和《金盛证券投资基金托管协议》，托管金盛证券投资基金（以下简称金盛基金）。

2002年上半年，中国建设银行在金盛基金的托管过程中，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年上半年，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盛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年上半年，由金盛基金管理人—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盛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8月08日

五、基金财务报告(未经审计)

(一)基金会计报表

1、资产负债表

资产负债表

2002年6月30日

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

资 产	年初数	期末数	负债及持有人权益	年初数	期末数
资产：			负债：		
银行存款	62,888,718.51	51,069,160.45	应付证券清算款		
清算备付金	4,033,245.80	4,323,155.82	应付赎回款		
交易保证金	250,000.00	500,000.00	应付赎回费		
应收证券清算款	6,242,736.63	6,660,666.67	应付管理人报酬	589,664.32	551,562.21
应收股利		83,599.44	应付托管费	98,277.37	91,927.04
应收利息	779,611.17	4,524,174.81	应付佣金	39,802.16	389,828.94
应收申购款			应付利息		59,583.91
其他应收款	1,262.87		应付收益	283,237.88	283,237.88
股票投资市值	271,788,131.98	304,153,974.05	未交税金		
其中：股票投资成本	339,725,053.65	296,393,208.18	其他应付款	30,137.06	160,274.28
债券投资市值	110,078,800.00	251,547,172.30	卖出回购证券款		157,000,000.00
其中：债券投资成本	110,137,416.68	249,329,625.55	短期借款		
配股权证			预提费用	270,000.00	319,133.23
买入返售证券			其他负债		
待摊费用			负债合计	1,311,118.79	158,855,547.49
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	-67,995,538.35	9,978,312.62
			未分配收益	22,746,926.52	-45,971,956.57
			持有人权益合计	454,751,388.17	464,006,356.05
资产总计	456,062,506.96	622,861,903.54	负债及持有人权益 总计	456,062,506.96	622,861,903.54

2、经营业绩表

经营业绩表 2002年1-6月

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

项目	2001年1-6月	2002年1-6月
一、收入	30,997,853.35	-64,335,134.36
1、股票差价收入	27,770,010.10	-69,684,472.49
2、债券差价收入	16,590.58	1,452,605.44
3、债券利息收入	1,348,821.05	2,241,094.72
4、存款利息收入	890,288.94	496,441.51
5、股利收入	935,210.52	1,118,998.50
6、买入返售证券收入		
7、其他收入	36,932.16	40,197.96
二、费用	5,874,654.08	4,389,713.94
1、基金管理人报酬	4,022,288.31	3,290,059.72
2、基金托管费	677,180.14	548,807.51
3、卖出回购证券支出	1,058,493.03	310,696.73
4、利息支出		
5、其他费用	116,692.60	240,149.98
其中：上市年费		29,752.78
信息披露费		158,684.51
审计费用		24,795.19
三、基金净收益	25,123,199.27	-68,724,848.30
加：未实现利得	-21,121,205.72	77,973,850.97
四、基金经营业绩	4,001,993.55	9,249,002.67

3、基金收益分配表

基金收益分配表 2002年1-6月

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

项目	2001年1-6月	2002年1-6月
本期基金净收益	25,123,199.27	-68,724,848.30
加：期初基金净收益	40,530,062.14	22,746,926.52
加：本期损益平准金		
加：以前年度损益调整		5,965.21
可供分配基金净收益	65,653,261.41	-45,971,956.57
减：本期已分配基金净收益	37,000,000.00	
期末基金净收益	28,653,261.41	-45,971,956.57

4、基金净值变动表

基金净值变动表

2002年1-6月

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	454,751,388.17
二、本期经营活动：	
基金净收益	-68,724,848.30
未实现利得	77,973,850.97
经营活动产生的基金净值变动数	9,249,002.67
以前年度损益调整	5,965.21
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	464,006,356.05

(二) 会计报告书附注

1、基金简介

金盛证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原广州珠江投资基金管理有限公司管理的珠江投资基金按照有关法律、法规清理规范而成。本基金管理人根据基金持有人大会授权，向中国证监会提出上市、扩募、续期申请，该申请已获批准。基金上市申请经《关于广东省原有投资基金清理规范总体方案的批复》(证监基金字[1999]41号文)、《关于同意珠江投资基金规范为珠江证券投资基金并申请上市的批复》(证监基金字[2000]39号文)和深圳证券交易所证上[2000]79号文审核同意，于2000年6月30日在深圳证券交易所挂牌交易。

经中国证券监督管理委员会(证监基金字[2000]40号文)批准，本基金于2000年9月8日基金单位总份额由233,640,000份扩募至500,000,000份，存续期延长至2009年11月30日。

根据《证券投资基金管理暂行办法》和证监基金字[2000]40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6月30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：
 - ①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。
 - ②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。
 - ③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。
 - ④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。
 - ⑤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：
 - ①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。
 - ②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。
 - ③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。
 - ④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。
 - ⑤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。
 - ⑥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。
 - ⑦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:

- ①以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围。
- ②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。
- ③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。
- ④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:

- ①每一基金单位享有同等分配权。
- ②收益分配比例不低于基金净收益的90%。
- ③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。
- ④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。
- ⑤基金投资当年亏损，则不进行收益分配。

(9) 会计政策变更:

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》，本基金从2002年1月1日起执行该办法，其对会计报表主要影响如下:

①2001年度资产负债表及2001年1—6月的经营业绩表的比较数字按《证券投资基金会计核算办法》的科目重新编排分类。

②对债券投资的核算，原证券交易所交易的债券投资的成本包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，现为不含息成本；原证券交易所交易的债券利息收入在除息日确认应收利息，现根据债券票面价值与票面利率逐日计提利息。此项会计政策变更不对基金资产净值产生影响。本基金于2002年1月1日起采用变更后的会计政策，且不对以前各期的会计报表进行追溯调整。此次变更调整影响数为2002年1月1日应收利息增加91,939.73元，债券投资成本减少85,974.52元，两者差额5,965.21元计入以前年度损益调整科目。

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269.23万份
	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230.77万份
	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

①通过关联人席位进行股票买卖2002年1-6月交易量(万元)及佣金(万元)情况

关联人	交易量	比例	佣金	比例
国泰君安	13,625.04	20.52%	10.95	20.78%

②通过关联人席位进行国债投资买卖2002年1-6月交易量(万元)情况

关联人	交易量	比例
国泰君安	1,034.09	7.51%

③通过关联人席位进行债券回购2002年1-6月交易量(万元)情况

关联人	交易量	比例
国泰君安	11,700.00	24.27%

④与关联人进行债券回购2002年1-6月交易量(万元)及利息支出(万元)情况

关联人	交易量	利息支出
中国建设银行	19,000.00	14.98

⑤与关联人进行国债投资买卖2002年1-6月交易量(万元)情况

关联人	交易量
国泰君安	6,218.00
中国建设银行	1,088.00

(3) 基金管理人报酬

①基金管理费按前一日基金资产净值的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

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；并于次月前五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3,290,059.72元，其中已支付基金管理人2,738,497.51元，尚余551,562.21元未支付。

(4) 基金托管人报酬

①基金托管费按前一日基金资产净值的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；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

③在本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共548,807.51元，其中已支付基金托管人456,880.47元，尚余91,927.04元未支付。

5、主要报表项目说明

- (1) 交易保证金：2002年6月30日余额为500,000.00元，系深交所席位交易保证金。
- (2) 应付收益：2002年6月30日余额为283,237.88元，系应付未付2000年红利。
- (3) 应收利息：2002年6月30日余额为4,524,174.81元，系应收银行存款和清算备付金利息21,005.29元及应收债券利息4,503,169.52元。
- (4) 其他应付款：2002年6月30日余额为160,274.28元，其中“珠江基金”应付未付1995年红利12,170.50元，系应缴股利税金148,103.78元。
- (5) 预提费用：2002年6月30日余额为319,133.23元，系预提基金2002年度审计费用24,795.19元，预提基金2001年及2002年信息披露费258,684.51元及预提基金2002年度债券托管账户维护费及上市年费35,653.53元。
- (6) 卖出回购证券支出：2002年1—6月累计发生额为310,696.73元，系卖出回购证券在融资期限内逐日计提的利息支出。
- (7) 其他收入：2002年1—6月累计发生额为40,197.96元，包括新股中签手续费返还39,601.52元及印花税返还596.44元。
- (8) 应由基金承担的其他费用：2002年1—6月累计发生额为240,149.98元，包括上市年费29,752.78元，信息披露费158,684.51元，审计费用24,795.19元，回购交易费用6,362.50元及其他费用20,555.00元。
- (9) 未实现利得：2002年1—6月累计发生额为77,973,850.97元，包括本期因投资估值增值产生的未实现利得77,967,885.76元及以前年度损益调整5,965.21元。

(三) 流通受限制的证券

1、截至2002年6月30日止，基金持有的流通受限制的证券明细如下：

序号	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	通海高科	2000-7-7	待定	11,000	185,680.00	185,680.00	-	网上申购
2	*招商银行	2001-4-1	2002-8-12	276,000	2,014,800.00	3,157,440.00	1,142,640.00	网下申购
3	安源股份	2002-6-20	2002-7-2	26,000	155,740.00	155,740.00	-	二级市场配售
4	泰豪科技	2002-6-24	2002-7-3	11,000	52,360.00	52,360.00	-	二级市场配售
5	宏智科技	2002-6-27	2002-7-9	10,000	86,800.00	86,800.00	-	二级市场配售
	合计				2,495,380.00	3,638,020.00	1,142,640.00	

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。

3、受限期限

上述“通海高科”至今未上市流通，具体流通日期由该公司另行发布公告决定。公司上述“招商银行”（带*号）为已上市未流通的新股，受限期为4个月。

4、估值办法

上述“招商银行”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6月30日按照均价估值，其余未上市流通的四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6月30日，本基金资产净值将为462,863,716.05元，每份基金单位资产净值为0.9257元。

(四) 期末基金持有股票明细 (按市值占净值比例排序)

序号	股票代码	股票名称	库存数量	市值	占净值比例
1	000542	TCL 通讯	2,314,166.00	38,993,697.10	8.40%
2	600500	中化国际	2,018,675.00	30,562,739.50	6.59%
3	000720	鲁能泰山	1,440,167.00	28,832,143.34	6.21%
4	000001	深发展 A	1,607,951.00	24,344,378.14	5.25%
5	600018	上港集箱	988,297.00	19,696,759.21	4.24%
6	600130	波导股份	904,192.00	18,463,600.64	3.98%
7	000027	深能源 A	1,499,935.00	15,869,312.30	3.42%
8	600366	宁波韵升	899,950.00	13,616,243.50	2.93%
9	000541	佛山照明	965,741.00	12,960,244.22	2.79%
10	000895	双汇发展	940,307.00	11,923,092.76	2.57%
11	600620	天宸股份	800,000.00	10,864,000.00	2.34%
12	600748	浦东不锈	800,000.00	9,280,000.00	2.00%
13	600602	广电电子	850,000.00	8,755,000.00	1.89%
14	600686	厦门汽车	696,662.00	8,213,644.98	1.77%
15	600642	申能股份	570,000.00	7,615,200.00	1.64%
16	600835	上菱电器	383,648.00	5,052,644.16	1.09%
17	600084	新天国际	410,030.00	4,526,731.20	0.98%
18	000659	珠海中富	500,000.00	4,465,000.00	0.96%
19	000876	新希望	260,915.00	3,991,999.50	0.86%
20	000739	青岛东方	290,000.00	3,372,700.00	0.73%
21	600036	招商银行	276,000.00	3,157,440.00	0.68%
22	600641	中远发展	217,486.00	2,936,061.00	0.63%
23	600823	世茂股份	200,354.00	2,460,347.12	0.53%
24	600350	山东基建	370,000.00	2,094,200.00	0.45%
25	000748	湘计算机	155,300.00	1,830,987.00	0.39%
26	000710	天兴仪表	148,874.00	1,813,285.32	0.39%
27	000811	烟台冰轮	122,963.00	1,694,430.14	0.37%

28	000973	佛塑股份	127,000.00	1,409,700.00	0.30%
29	000022	深赤湾A	83,835.00	1,182,911.85	0.25%
30	600693	东百集团	110,000.00	1,116,500.00	0.24%
31	000910	大亚股份	98,545.00	1,017,969.85	0.22%
32	600361	北京华联	19,347.00	345,924.36	0.07%
33	600327	大厦股份	19,000.00	324,330.00	0.07%
34	600426	华鲁恒升	20,000.00	283,600.00	0.06%
35	600595	中孚实业	16,000.00	263,360.00	0.06%
36	600510	黑牡丹	11,000.00	228,030.00	0.05%
37	000991	通海高科	11,000.00	185,680.00	0.04%
38	600397	安源股份	26,000.00	155,740.00	0.03%
39	000652	泰达股份	11,097.00	115,186.86	0.02%
40	600503	宏智科技	10,000.00	86,800.00	0.02%
41	600590	泰豪科技	11,000.00	52,360.00	0.01%
	合计			271,788,131.98	59.77%

(五) 报告期内基金新增的股票明细

序号	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	600018	上港集箱		1,193,025		204,728
2	600036	招商银行	276,000			
3	600084	新天国际		900,000		489,970
4	600130	波导股份		1,020,297		116,105
5	600327	大厦股份	19,000			
6	600350	山东基建	47,000	370,000		47,000
7	600361	北京华联		19,347		
8	600366	宁波韵升		899,950		
9	600397	安源股份	26,000			
10	600426	华鲁恒升	20,000			
11	600503	宏智科技	10,000			
12	600510	黑牡丹	11,000			
13	600590	泰毫科技	11,000			
14	600595	中孚实业	16,000			
15	600602	广电电子		850,000		
16	600620	天宸股份		800,000		
17	600641	中远发展		772,940		555,454
18	600642	申能股份	402,000	900,000		732,000
19	600693	东百集团		200,000		90,000
20	600748	浦东不锈		800,000		
21	600823	世茂股份		1,082,353		881,999

22	000001	深发展 A		1,737,951		130,000
23	000022	深赤湾 A		83,835		
24	000027	深能源 A		1,499,935		
25	000541	佛山照明		965,741		
26	000542	TCL 通讯		2,686,866		372,700
27	000659	珠海中富		500,000		
28	000739	青岛东方		478,000		188,000
29	000748	湘计算机		155,300	448,224	448,224
30	000895	双汇发展		200,000	740,307	
31	000973	佛塑股份		127,000		

注：其他项包括送股、配股、转赠、增发数量。

(六) 报告期内基金剔除的股票明细

序号	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	600000	浦发银行		412,200	412,200
2	600011	华能国际	18,899		18,899
3	600026	中海发展		78,000	78,000
4	600057	ST厦新		210,000	210,000
5	600063	皖维高新	1,028,310		1,028,310
6	600073	上海梅林		800,000	800,000
7	600085	同仁堂		231,527	231,527
8	600170	上海建工	200,000	330,000	530,000
9	600183	生益科技		200,000	200,000
10	600266	北京城建		50,000	50,000
11	600317	营口港		16,000	16,000
12	600355	精伦电子		10,000	10,000
13	600373	鑫新股份		2,000	2,000
14	600379	宝光股份		19,000	19,000
15	600391	成发科技	11,000		11,000
16	600428	中远航运		25,000	25,000
17	600456	宝钛股份		5,000	5,000
18	600486	扬农化工		6,000	6,000
19	600496	长江股份		16,000	16,000
20	600505	西昌电力		5,000	5,000
21	600506	香梨股份	14,000		14,000
22	600509	天富热电		3,000	3,000
23	600520	三佳模具		7,000	7,000
24	600533	栖霞建设		3,000	3,000
25	600536	中软股份		3,000	3,000

26	600548	深 高 速		28,515	28,515
27	600578	京能热电		9,000	9,000
28	600580	卧龙科技		11,000	11,000
29	600582	天地科技		19,000	19,000
30	600598	北 大 荒		300,000	300,000
31	600628	新 世 界	630,552		630,552
32	600630	龙头股份	327,020		327,020
33	600646	ST国嘉	603,022		603,022
34	600661	交大南洋	298,351		298,351
35	600675	中华企业		44,700	44,700
36	600772	石油龙昌	861,882		861,882
37	600827	友谊股份	209,400	384,600	594,000
38	600894	广钢股份		500,000	500,000
39	000066	长城电脑		634,687	634,687
40	000409	四通高科	469,019		469,019
41	000505	珠江控股	1,961,054		1,961,054
42	000513	丽珠集团	2,671,039		2,671,039
43	000514	ST渝开发	503,301		503,301
44	000551	创元科技	563,164		563,164
45	000605	四环药业	100,000		100,000
46	000685	公用科技	722,014	300,309	1,022,323
47	000713	丰乐种业		600,000	600,000
48	000959	首钢股份	347,729	129,000	476,729

(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	采掘业		
3	制造业	114,194,167.77	24.61%
	其中：食品、饮料	15,915,092.26	3.43%
	纺织、服装、皮毛	228,030.00	0.05%
	造纸、印刷	1,017,969.85	0.22%
	石油、化学、塑胶、塑料	6,158,300.00	1.33%
	电子	8,940,680.00	1.93%
	金属、非金属	9,543,360.00	2.06%
	机械、设备、仪表	72,390,735.66	15.60%
	医药、生物制品		
4	电力、煤气及水的生产和供应业	23,484,512.30	5.06%
5	建筑业		
6	交通运输、仓储业	20,994,857.92	4.52%

7	信息技术业	59,375,084.74	12.80%
8	批发和零售贸易业	42,709,272.18	9.20%
9	金融、保险业	27,501,818.14	5.93%
10	房地产业	2,936,061.00	0.63%
11	社会服务业	2,094,200.00	0.45%
12	传播与文化产业		
13	综合类	10,864,000.00	2.34%
	合 计	304,153,974.05	65.55%

2、债券（不含国债）合计

截止2002年6月30日，金盛证券投资基金持有债券（不含应计利息）合计为14,085,928.00元，占基金资产净值的3.04%。

3、国债及货币资金合计

截止2002年6月30日，金盛证券投资基金持有国债（不含应计利息）及货币资金合计为299,514,227.24元（货币资金中含当日证券清算款6,660,666.67元），占基金资产净值的64.55%。

4、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	TCL通讯	38,993,697.10	8.40%
2	中化国际	30,562,739.50	6.59%
3	鲁能泰山	28,832,143.34	6.21%
4	深发展A	24,344,378.14	5.25%
5	上港集箱	19,696,759.21	4.24%
6	波导股份	18,463,600.64	3.98%
7	深能源A	15,869,312.30	3.42%
8	宁波韵升	13,616,243.50	2.93%
9	佛山照明	12,960,244.22	2.79%
10	双汇发展	11,923,092.76	2.57%

5、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) 基金应收股利、应收利息、应付管理费、托管费、佣金、预提费用、卖出回购款、回购利息及其他应收应付款项合计为贷方余额153,747,773.24元，与基金股票市值304,153,974.05元，债券（不含国债）合计14,085,928.00元和国债及货币资金合计299,514,227.24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6月30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	2,692,308份	0.54%
国泰基金管理有限公司	2,307,692份	0.46%
社会公众持有	495,000,000份	99.00%
合 计	500,000,000份	100.00%

(二) 截止2002年6月30日，本基金共有持有人21,456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	平安保险	23,588,887	4.72%
2	人寿保险	21,544,687	4.31%
3	中国人保	18,132,496	3.63%
4	国信证券	15,000,000	3.00%
5	国都证券	6,183,345	1.24%
6	广州证券	4,500,000	0.90%
7	大众保险	4,047,600	0.81%
8	中国太保	3,932,089	0.79%
9	杨桂英	3,542,500	0.71%
10	广科进步基金会	3,501,000	0.70%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳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《金盛证券投资基金二00一年年度报告》及《金盛证券投资基金二00一年年度收益分配报告》。基金金盛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，安达信中国内地及香港的业务于并入普华永道，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《金盛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，聘任吕俊先生为基金金盛基金经理，曹华强先生不再担任基金金盛基金经理。
- 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，经本基金管理人认真研究，我们向国

泰君安、广州国际信托投资公司、海通证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司（以下简称“申银万国”）、兴业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，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	13,625.04	20.52%	1,034.09	7.51%	11,700.00	24.27%	26,359.13	20.53%
广州国际信托投资公司	12,982.08	19.55%	1,566.30	11.37%	-	0.00%	14,548.38	11.33%
海通证券有限责任公司	10,505.27	15.82%	2,125.01	15.42%	8,000.00	16.60%	20,630.28	16.07%
申银万国	15,357.20	23.13%	-	0.00%	15,000.00	31.12%	30,357.20	23.65%
兴业证券股份有限公司	13,932.79	20.98%	9,052.17	65.70%	13,500.00	28.01%	36,484.95	28.42%
合计	66,402.38	100.00%	13,777.56	100.00%	48,200.00	100.00%	128,379.95	100.00%

关联人及券商名	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安	10.95	20.78%	0.08%
广州国际信托投资公司	10.20	19.34%	0.08%
海通证券有限责任公司	8.34	15.82%	0.08%
申银万国	12.03	22.81%	0.08%
兴业证券股份有限公司	11.20	21.25%	0.08%
合计	52.72	100.00%	

自2002年5月13日起，本基金启用了兴业证券股份有限公司的067500席位作为新的主清算席位，并停用原有的038300席位。

在本报告期内，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、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、关于同意设立金盛证券投资基金的批复
- 2、金盛证券投资基金契约
- 3、金盛证券投资基金托管协议
- 4、金盛证券投资基金 2000 年年度报告
- 5、金盛证券投资基金 2000 年年度收益分配报告
- 6、金盛证券投资基金 2001 年中期报告
- 7、金盛证券投资基金 2001 年年度报告
- 8、金盛证券投资基金 2001 年年度收益分配报告
- 9、金盛证券投资基金 2002 年中期报告
- 10、 报告期内披露的各项公告原件
- 11、 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)50819830

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2002 年 8 月 30 日