

金盛证券投资基金 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	-65,457,577.04元	19,216,864.38元	11,477,243.73元
单位基金本期净收益	-0.1309元	0.0384元	0.0230元
基金可分配净收益	-83,680,478.58元	-45,248,611.83元	40,530,062.14元
单位基金可分配净收益	-0.1674元	-0.0905元	0.0811元
期末基金资产总值	417,857,471.25元	456,062,506.96元	582,356,994.40元
期末基金资产净值	416,319,521.42元	454,751,388.17元	579,256,927.64元
单位基金资产净值	0.8326元	0.9095元	1.1585元
基金资产净值收益率	-14.39%	3.54%	2.94%
本期基金资产净值增长率	-8.46%	-16.00%	7.80%
基金累计资产净值增长率	-17.11%	-9.45%	7.80%

（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）基金产品说明书

投资目标	本基金是以涉及新兴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。
投资范围	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。 本基金的股票投资部分将重点投资于沪深两市涉及新兴产业的上市公司。新兴行业主要包含在产业生命周期中处于起步或成长阶段的行业。
投资理念	价格终将反映价值。
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。 本基金在行业资产配置中坚持相对集中的投资策略，挖掘具有良好发展态势的行业，将资产权重的较大部分配置到处于起步或成长阶段的行业。
业绩比较基准	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〕
风险收益特征	承担较高风险，获取较高的超额收益。

（二）基金经理人介绍

吕俊，基金经理，男，30岁，工商管理硕士，8年证券从业经历。曾就职于广州珠江基金管理公司、平安证券公司。2000年加盟国泰基金管理有限公司，曾任研究开发部副经理。

2003年1月起由崔海峰先生任本基金基金经理，吕俊先生因工作需要不再担任本基金基金经理。

崔海峰，男，29岁，经济学硕士。4年证券从业经历。1999年加盟国泰基金管理有限公司，先后任研究开发部副经理、金鑫基金经理助理。

（三）2002年证券市场及投资管理回顾

2002年本基金净值增长率为-8.46%，上证指数增长率为-17.52%，尽管在封闭式基金中净值增长率排名居于中上游水平，但对实际净值的下降给基金持有人带来的损失，本基金管理人深表歉意。

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。党的十六大的胜利召开，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。

2002年本基金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，并在公司研究部的大力支持下，本基金将手机、外贸、电力等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01年三季度以来竞争力不断增强，市场占有率迅速提高，本基金管理小组判断在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，而目前的市场份额相对很小，该行业刚进入腾飞阶段，因而2002年将股票组合的较大比重配置于手机行业；随着世界经济的反弹和复苏，我国进出口贸易也开始走出低谷，并经过贸易行业的优胜劣汰，信誉良好的大贸易公司正在进一步占领市场，外贸行业也成为本基金2002年投资较多的行业；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，本基金在这个行业的投资比例也比较高。

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。本基金在2002年保持“适度集中于重点子行业”的总体策略，取得了较好回

报。

在债券方面，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，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）2003年展望和投资策略：

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、2003年市场走势特征分析：

（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：

（1）类别资产配置：

尽管本基金十分重视并积极预测宏观经济与政策对证券市场的影响、把握证券市场趋势，但市场本身的演变、发展受到各类因素的影响，有些因素对市场的影响具有长期性，但在一个阶段内并非是主导因素。有些因素对市场的影响尽管是中短期性质，但有可能是阶段性的主导因素，因此，能较好预测市场趋势并不容易。本基金在市场预测和类别资产配置上，首先采取较为稳健的策略，在趋势

不甚明朗的时期保持中等仓位；其次，如果对市场趋势在一个阶段有较好的把握时，则进行较大的仓位增减操作。本基金预测2003年市场将处于平衡市，并进行振荡整固，市场的活跃度将有所加大，存在较好的投资机会。

（2）行业资产配置：

本基金坚持以行业基本面研究为先导的投资思路，结合本基金的规模特征，继续保持“适度集中于重点子行业”的策略。在行业资产配置中，引入行业相对集中投资的策略，挖掘近期和未来阶段具有良好发展态势的新兴行业，将资产权重的大部分配置到这些行业，以便能分享这些潜力行业的较好增长，使整体资产更大可能超越市场平均表现。

2003年本基金将主要关注内需旺盛的新兴产业，在目前全球经济复苏时断时续的背景下，国内经济的增长更加依赖于内需的增长，人们的消费层次不断升级，内需型产业环境宽松，具有良好的增长潜力，例如汽车、环保产业等，本基金将重点关注这些新兴行业的上市公司。同时，本基金不放弃其它内需特征明显、或正步出周期低谷、或受到战争因素刺激等的阶段性新兴行业，包括钢铁、有色金属、水泥、石化产品等。

（3）风格资产配置：

对风格资产的理解有多种角度，本基金主要关注稳健性资产和非稳健性资产、大市值个股和一般市值个股，以及区域板块。本基金在行业资产配置上采取相对集中投资策略，而在风格资产配置上采取相对平衡的策略。

本基金将保持一定比重的稳定性资产，例如机场、港口、公路以及其他公用事业企业。同时，将把较大资产比重配置到大市值个股，特别是具有较好的成长潜力和流动性的绩优蓝筹企业。另外，本基金将适当关注沪深本地企业，这些企业地处我国经济发展前沿地区，潜在发展机会很大，同时这些企业的股票市场表现活跃，也具有较好的参与机会。

（4）债券投资：

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；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。

2003年市场机会大于风险，本基金将积极把握潜力行业，采取相对集中投资的策略，积极参与市场的波段操作，力争以良好的业绩回报本基金投资人。

（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风险的有效防范。

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，通过现场查看、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市場风险、集中风险和流动性风险等风险因素，并通过风险报告及时揭示投资组合的风险暴露程度，有效地防范和化解相关风险。

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风险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，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，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基金持有人利益的行为。

2002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
2003年3月11日

五、基金财务报告

(一) 审计报告

金盛证券投资基金全体持有人：

我们接受委托，审计了金盛证券投资基金(以下简称“基金金盛”) 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盛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，我们结合基金金盛的实际情况，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，上述基金金盛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》、《金盛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盛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	62,888,718.51	28,199,381.43	应付证券清算款		
清算备付金	4,033,245.80	2,917,983.75	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	6,242,736.63		应付管理人报酬	589,664.32	540,037.46
应收股利			应付托管费	98,277.37	90,006.26
应收利息	779,611.17	1,142,651.96	应付佣金	39,802.16	105,007.65
应收申购款			应付利息		
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	237,022,813.88	未交税金		
其中：股票投资成本	339,725,053.65	277,718,702.31	其他应付款	30,137.06	263,660.58
债券投资市值	110,078,800.00	148,324,640.23	卖出回购证券款		
其中：债券投资成本	110,137,416.68	148,598,579.86	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	1,311,118.79	1,537,949.83
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	-40,969,828.06
			未分配收益	22,746,926.52	-42,710,650.52
			持有人权益合计	454,751,388.17	416,319,521.42
资产总计	456,062,506.96	417,857,471.25	负债及持有人权益总计	456,062,506.96	417,857,471.25

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	30,269,518.25	-56,272,288.00
1、股票差价收入	23,660,248.99	-66,505,025.73
2、债券差价收入	16,496.02	2,251,688.57
3、债券利息收入	2,904,099.98	4,991,039.83
4、存款利息收入	1,777,557.81	856,261.81
5、股利收入	1,860,963.32	2,063,418.14
6、买入返售证券收入		
7、其他收入	50,152.13	70,329.38
二、费用	11,052,653.87	9,185,289.04
1、基金管理人报酬	7,707,833.04	6,684,254.54
2、基金托管费	1,291,437.60	1,114,506.66
3、卖出回购证券支出		910,029.59
4、利息支出	1,494,109.59	
5、其他费用	559,273.64	476,498.25
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	50,000.00	50,000.00
三、基金净收益	19,216,864.38	-65,457,577.04
加：未实现利得	-106,722,403.85	27,025,710.29
四、基金经营业绩	-87,505,539.47	-38,431,866.75

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	19,216,864.38	-65,457,577.04
加：期初基金净收益	40,530,062.14	22,746,926.52
加：本期损益平准金		
可供分配基金净收益	59,746,926.52	-42,710,650.52
减：本期已分配基金净收益	37,000,000.00	0.00
期末基金净收益	22,746,926.52	-42,710,650.52

4、基金净值变动表

基金净值变动表

2002年

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	-65,457,577.04
未实现利得	27,025,710.29
经营活动产生的基金净值变动数	-38,431,866.75
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	416,319,521.42

(三)会计报表附注

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：

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，以最近交易日的均价估值。

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均价估值；

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：

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5,965.21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	23,360.20	21.37%	18.64	21.42%	10,840.75	24.36%	9.05	24.42%

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。

②通过关联人席位进行债券投资买卖年交易量(万元)情况

	2002年度		2001年度	
关联人	交易量	比例	交易量	比例
国泰君安	1,034.09	4.96%	-	-

③通过关联人席位进行债券回购2002年交易量(万元)情况

	2002年度		2001年度	
关联人	交易量	比例	交易量	比例
国泰君安	11,700.00	18.45%	-	-

④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

	2002年度		2001年度	
关联人	交易量	利息支出	交易量	利息支出
中国建设银行	55,000.00	51.23	10,000.00	65.34

⑤与关联人进行国债投资买卖年交易量(万元)情况

关联人	2002年度交易量	2001年度交易量
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

- 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6,684,254.54元，其中已支付基金管理人6,144,217.08元，尚余540,037.46元未支付。2001年度共计提管理费7,707,833.04元，已全部支付。

(4) 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1,114,506.66元，其中已支付基金托管人1,024,500.40元，尚余90,006.26元未支付。2001年度共计提托管费1,291,437.60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) 应付收益：2002年12月31日余额为283,237.88元，系应付未付2000年红利。
- (3) 应收利息：2002年12月31日余额为1,142,651.96元，系应收银行存款和清算备付金利息29,443.64元及应收债券利息1,113,208.32元。
- (4) 其他应付款：2002年12月31日余额为263,660.58元，其中“珠江基金”应付未付1995年红利12,170.50元，及2001年应缴股利税金17,966.56元、2002年应缴股利税金233,523.52元。
- (5) 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。
- (6) 卖出回购证券支出：2002年累计发生额为910,029.59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年累计发生额为70,329.38元，包括债券发行手续费返还865.50元，新股中签手续费返还65,055.98元，印花税返还1,151.90元及通海高科（SZ000991）换购吉林电力（SZ000875）股份利息收入3,256.00元。
- (8) 应由基金承担的其他费用：2002年累计发生额为476,498.25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9,912.50元及其他费用36,585.75元。
- (9) 未实现利得：2002年累计发生额为27,025,710.29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	*中国联通	2002-9-26	2003-4-9	1,234,766	2,860,661.80	3,370,605.86	509,944.06	二级市场配售
2	中信证券	2002-12-20	2003-1-6	71,000	319,500.00	319,500.00	-	网上申购
3	中信证券	2002-12-24	2003-1-6	64,000	288,000.00	288,000.00	-	二级市场配售
4	皖通高速	2002-12-26	2003-1-7	72,000	158,400.00	158,400.00	-	二级市场配售
	合计				3,626,561.80	4,136,505.86	509,944.06	

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票市值参与配售，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415,809,577.36元，每份基金单位资产净值为0.8316元。

(五)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	2,254,854	32,086,572.42	7.71%
2	600500	中化国际	2,903,362	25,665,720.08	6.16%
3	000939	凯迪电力	1,327,675	15,175,325.25	3.65%
4	000877	天山股份	1,238,956	14,012,592.36	3.37%
5	600609	金杯汽车	2,299,250	11,887,122.50	2.86%
6	600050	中国联通	3,990,000	10,812,900.00	2.60%
7	000541	佛山照明	842,601	9,723,615.54	2.34%
8	600686	厦门汽车	907,812	8,914,713.84	2.14%
9	000895	双汇发展	771,107	7,957,824.24	1.91%
10	600694	大商股份	1,024,094	7,404,199.62	1.78%
11	600130	波导股份	358,151	7,281,209.83	1.75%
12	600366	宁波韵升	612,782	6,048,158.34	1.45%
13	600018	上港集箱	349,871	5,828,850.86	1.40%
14	600270	外运发展	294,043	4,766,437.03	1.14%
15	600009	上海机场	510,000	4,605,300.00	1.11%
16	600620	天宸股份	387,850	4,440,882.50	1.07%
17	600276	恒瑞医药	420,936	4,331,431.44	1.04%
18	600104	上海汽车	567,000	3,872,610.00	0.93%
19	600019	宝钢股份	904,420	3,717,166.20	0.89%
20	600780	通宝能源	354,200	3,205,510.00	0.77%
21	600832	东方明珠	200,000	3,120,000.00	0.75%
22	600881	亚泰集团	504,946	2,847,895.44	0.68%
23	600748	浦东不锈	300,000	2,580,000.00	0.62%

24	600580	卧龙科技	189,300	2,451,435.00	0.59%
25	600835	上菱电器	220,907	2,425,558.86	0.58%
26	600084	新天国际	255,084	2,226,883.32	0.53%
27	000748	湘计算机	268,766	2,077,561.18	0.50%
28	000002	万 科A	212,360	2,032,285.20	0.49%
29	600642	申能股份	190,000	1,833,500.00	0.44%
30	000027	深能源A	273,806	1,722,239.74	0.41%
31	000659	珠海中富	200,000	1,542,000.00	0.37%
32	600688	上海石化	482,936	1,530,907.12	0.37%
33	600591	上海航空	232,000	1,512,640.00	0.36%
34	000876	新 希 望	173,287	1,367,234.43	0.33%
35	600839	四川长虹	175,940	1,198,151.40	0.29%
36	600628	新 世 界	166,416	1,154,927.04	0.28%
37	000720	鲁能泰山	68,200	975,942.00	0.23%
38	000922	阿继电器	120,000	970,800.00	0.23%
39	000739	普洛药业	114,900	934,137.00	0.22%
40	000022	深赤湾A	77,735	890,843.10	0.21%
41	000811	烟台冰轮	84,291	870,726.03	0.21%
42	000088	盐田港A	55,849	827,123.69	0.20%
43	000973	佛塑股份	97,900	805,717.00	0.19%
44	000910	大亚科技	98,545	740,072.95	0.18%
45	600166	福田汽车	77,209	721,132.06	0.17%
46	600693	东百集团	101,586	720,244.74	0.17%
47	600030	中信证券	135,000	607,500.00	0.15%
48	000710	天兴仪表	82,474	602,884.94	0.14%
49	600578	京能热电	72,150	588,022.50	0.14%
50	000581	威孚高科	61,269	586,957.02	0.14%
51	600315	上海家化	49,600	545,104.00	0.13%
52	600296	兰州铝业	57,600	494,208.00	0.12%
53	600176	中国化建	55,700	399,926.00	0.10%
54	000807	云铝股份	30,400	245,632.00	0.06%
55	600563	法拉电子	17,000	222,360.00	0.05%
56	600511	国药股份	20,000	219,400.00	0.05%
57	600525	长园新材	12,000	201,360.00	0.05%
58	600361	华联综超	11,647	172,492.07	0.04%
59	000001	深发展A	15,400	160,468.00	0.04%
60	600012	皖通高速	72,000	158,400.00	0.04%
	合计			237,022,813.88	56.93%

(六)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	000001	深发展A		2,297,951		2,282,551
2	000002	万科A		255,960		43,600
3	000022	深赤湾A		83,835		6,100
4	000027	深能源A		1,499,935	45,634	1,271,763
5	000088	盐田港A		55,849		
6	000541	佛山照明		965,741		123,140
7	000542	TCL 通讯		3,516,667		1,261,813
8	000581	威孚高科		178,967		117,698
9	000659	珠海中富		500,000		300,000
10	000739	普洛药业		478,000		363,100
11	000748	湘计算机		268,766	448,224	448,224
12	000807	云铝股份		30,400		
13	000877	天山股份		1,238,956		
14	000895	双汇发展		200,000	740,307	169,200
15	000922	阿继电器		120,000		
16	000939	凯迪电力		1,327,675		
17	000973	佛塑股份		161,300		63,400
18	600009	上海机场		510,000		
19	600012	皖通高速	72,000			
20	600018	上港集箱		1,193,025		843,154
21	600019	宝钢股份		2,694,420		1,790,000
22	600030	中信证券	64,000	71,000		
23	600050	中国联通	2,008,766	3,440,000		1,458,766
24	600084	新天国际		900,000		644,916
25	600104	上海汽车		567,000		
26	600130	波导股份		1,060,697		702,546
27	600166	福田汽车		77,209		
28	600176	中国化建		55,700		
29	600270	外运发展		536,613		242,570
30	600276	恒瑞医药		455,016		34,080
31	600296	兰州铝业		57,600		
32	600315	上海家化		49,600		
33	600361	华联综超		19,347		7,700
34	600366	宁波韵升		899,950		287,168
35	600511	国药股份	20,000			
36	600525	长园新材	12,000			

37	600563	法拉电子	17,000			
38	600578	京能热电	9,000	705,700		642,550
39	600580	卧龙科技	11,000	200,000		21,700
40	600591	上海航空	58,000	200,000		26,000
41	600609	金杯汽车		2,299,250		
42	600620	天宸股份		800,000		412,150
43	600642	申能股份		1,310,000	402,000	1,522,000
44	600688	上海石化		482,936		
45	600693	东百集团		200,000		98,414
46	600694	大商股份		1,024,094		
47	600748	浦东不锈		800,000		500,000
48	600780	通宝能源	354,200			
49	600832	东方明珠		433,282		233,282
50	600839	四川长虹		207,031		31,091
51	600881	亚泰集团		504,946		

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	000066	长城电脑		634,687	634,687
2	000409	四通高科	469,019		469,019
3	000505	珠江控股	1,961,054		1,961,054
4	000513	丽珠集团	2,671,039		2,671,039
5	000514	ST渝开发	503,301		503,301
6	000551	创元科技	563,164		563,164
7	000605	四环药业	100,000		100,000
8	000652	泰达股份	1,349,243	3,699	1,352,942
9	000685	公用科技	722,014	300,309	1,022,323
10	000713	丰乐种业		600,000	600,000
11	000875	吉电股份		41,800	41,800
12	000959	首钢股份	347,729	129,000	476,729
13	600000	浦发银行		412,200	412,200
14	600011	华能国际	18,899		18,899
15	600026	中海发展		78,000	78,000
16	600036	招商银行		276,000	276,000
17	600057	ST厦新		210,000	210,000
18	600063	皖维高新	1,028,310		1,028,310
19	600073	上海梅林		800,000	800,000
20	600085	同仁堂		231,527	231,527

21	600170	上海建工	200,000	330,000	530,000
22	600183	生益科技		200,000	200,000
23	600266	北京城建		50,000	50,000
24	600317	营 口 港		16,000	16,000
25	600327	大厦股份		19,000	19,000
26	600350	山东基建		417,000	417,000
27	600351	亚宝药业		17,000	17,000
28	600353	旭光股份		9,000	9,000
29	600355	精伦电子		10,000	10,000
30	600357	承德钒钛		34,000	34,000
31	600371	华冠科技		17,000	17,000
32	600373	鑫新股份		2,000	2,000
33	600379	宝光股份		19,000	19,000
34	600391	成发科技	11,000		11,000
35	600397	安源股份		26,000	26,000
36	600416	湘电股份		31,000	31,000
37	600426	华鲁恒升		20,000	20,000
38	600428	中远航运		25,000	25,000
39	600456	宝钛股份		5,000	5,000
40	600458	时代新材		18,000	18,000
41	600486	扬农化工		6,000	6,000
42	600496	长江股份		16,000	16,000
43	600499	科达机电		4,000	4,000
44	600503	宏智科技		10,000	10,000
45	600505	西昌电力		5,000	5,000
46	600506	香梨股份	14,000		14,000
47	600509	天富热电		3,000	3,000
48	600510	黑 牡 丹		11,000	11,000
49	600512	腾达建设		16,000	16,000
50	600515	第一投资		7,000	7,000
51	600516	海龙科技		31,000	31,000
52	600520	三佳模具		7,000	7,000
53	600522	中天科技		25,000	25,000
54	600526	菲达环保		20,000	20,000
55	600531	豫光金铅		16,000	16,000
56	600532	华阳科技		23,000	23,000
57	600533	栖霞建设		3,000	3,000
58	600535	天士力		21,000	21,000
59	600536	中软股份		3,000	3,000
60	600548	深 高 速	28,515		28,515
61	600549	厦门钨业		17,000	17,000
62	600551	科大创新		12,000	12,000

63	600552	方兴科技		14,000	14,000
64	600553	太行股份		18,000	18,000
65	600557	康缘药业		19,000	19,000
66	600559	裕丰股份		21,000	21,000
67	600560	金自天正		11,000	11,000
68	600561	江西长运		15,000	15,000
69	600565	迪马股份		9,000	9,000
70	600571	信雅达		4,000	4,000
71	600577	精达股份		6,000	6,000
72	600579	黄海股份		19,000	19,000
73	600581	八一钢铁		44,000	44,000
74	600582	天地科技		19,000	19,000
75	600586	金晶科技		11,000	11,000
76	600587	新华医疗		4,000	4,000
77	600590	泰豪科技		161,000	161,000
78	600592	龙溪股份		20,000	20,000
79	600593	大连圣亚		13,000	13,000
80	600595	中孚实业		16,000	16,000
81	600597	光明乳业		48,000	48,000
82	600598	北大荒		300,000	300,000
83	600602	广电电子		850,000	850,000
84	600630	龙头股份	327,020		327,020
85	600641	中远发展		772,940	772,940
86	600646	ST国嘉	603,022		603,022
87	600661	交大南洋	298,351		298,351
88	600675	中华企业		44,700	44,700
89	600762	金荔科技		553,900	553,900
90	600772	石油龙昌	861,882		861,882
91	600823	世茂股份		1,082,353	1,082,353
92	600827	友谊股份	209,400	384,600	594,000
93	600836	界龙实业		54,700	54,700
94	600887	伊利股份		48,750	48,750
95	600894	广钢股份		500,000	500,000

(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		
3	制造业	92,162,743.27	22.14%
	其中：食品、饮料	9,325,058.67	2.24%

	纺织、服装、皮毛		
	造纸、印刷	740,072.95	0.18%
	石油、化学、塑胶、塑料	4,823,654.12	1.16%
	电子	1,420,511.40	0.34%
	金属、非金属	21,049,598.56	5.06%
	机械、设备、仪表	50,051,656.13	12.02%
	医药、生物制品	4,550,831.44	1.09%
	其他制造业	201,360.00	0.05%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	22,524,597.49	5.41%
5	建筑业		
6	交通运输、仓储业	18,589,594.68	4.47%
7	信息技术业	52,258,243.43	12.55%
8	批发和零售贸易业	38,278,603.87	9.19%
9	金融、保险业	767,968.00	0.18%
10	房地产业	2,032,285.20	0.49%
11	社会服务业		
12	传播与文化产业		
13	综合类	10,408,777.94	2.50%
	合 计	237,022,813.88	56.93%

2、国债及货币资金合计

截止2002年12月31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179,442,005.41元，占基金资产净值的43.10%。

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	TCL 通讯	32,086,572.42	7.71%
2	中化国际	25,665,720.08	6.16%
3	凯迪电力	15,175,325.25	3.65%
4	天山股份	14,012,592.36	3.37%
5	金杯汽车	11,887,122.50	2.86%
6	中国联通	10,812,900.00	2.60%
7	佛山照明	9,723,615.54	2.34%
8	厦门汽车	8,914,713.84	2.14%
9	双汇发展	7,957,824.24	1.91%
10	大商股份	7,404,199.62	1.78%

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) 基金应收股利、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145,297.87元,与基金股票市值237,022,813.88元,国债及货币资金合计179,442,005.41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	2,692,308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12月31日,本基金共有持有人20,962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	中国人寿保险公司	33,593,807	6.72%
2	中国平安保险股份有限公司	23,588,887	4.72%
3	中国人民保险公司	18,132,496	3.63%
4	国信证券有限责任公司	13,000,000	2.60%
5	长城证券有限责任公司	8,370,196	1.67%
6	中油财务有限责任公司	6,266,999	1.25%
7	广州证券有限责任公司	4,980,000	1.00%
8	中国太平洋保险公司	3,656,080	0.73%
9	广州市科进步基金会	3,501,000	0.70%
10	张海欣	3,034,200	0.61%

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。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，经国泰基金管理有限公司二届九次董事会审议批准，公司决定聘任崔海峰为金盛基金基金经理，吕俊不再担任金盛基金基金经理。

- 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。

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
国泰君安小计	23,360.20	21.37%	1,034.09	4.96%	11,700.00	18.45%	36,094.29	18.65%
广州国投小计	14,629.34	13.38%	1,566.30	7.50%	-	0.00%	16,195.65	8.37%
海通证券小计	24,432.37	22.35%	6,743.59	32.31%	15,000.00	23.66%	46,175.96	23.85%
申银万国小计	23,257.68	21.28%	2,475.90	11.86%	21,200.00	33.44%	46,933.58	24.24%
兴业证券小计	23,630.91	21.62%	9,052.17	43.37%	15,500.00	24.45%	48,183.08	24.89%
合 计	109,310.51	100.00%	20,872.05	100.00%	63,400.00	100.00%	193,582.56	100.00%

关联人及券商名	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安小计	18.64	21.42%	0.08%
广州国投小计	11.49	13.20%	0.08%
海通证券小计	19.64	22.57%	0.08%
申银万国小计	18.29	21.01%	0.08%
兴业证券小计	18.97	21.80%	0.08%
合 计	87.03	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。

- 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