

金泰证券投资基金 2002 年年度报告

重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 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：金泰证券投资基金(简称：基金金泰)

交易代码：500001

基金发起人：国泰君安证券股份有限公司

中国电力财务有限公司

浙江省国际信托投资公司

上海爱建信托投资有限责任公司

基金发行日期：1998 年 3 月 23 日

基金成立日期：1998 年 3 月 27 日

基金单位总份额：20 亿份基金单位

基金类型：契约型封闭式

基金存续期：至 2013 年 3 月 26 日止

基金上市地：上海证券交易所

基金上市日期：1998 年 4 月 7 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：中国工商银行
 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
 邮政编码：100032
 法定代表人：姜建清
 托管部总经理：周月秋
 信息披露负责人：刘长江
 联系地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行基金托管部
 电话：010-66107333
 传真：010-66106904
 电子邮件：cjliu@icbc.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	-160,598,651.43元	146,197,600.89元	905,103,607.41元
单位基金本期净收益	-0.0803元	0.0731元	0.4526元
基金可分配净收益	-289,802,045.67元	32,919,481.99元	938,271,145.56元
单位基金可分配净收益	-0.1449元	0.0165元	0.4691元
期末基金资产总值	1,714,693,224.72元	2,086,973,422.77元	3,347,985,128.09元
期末基金资产净值	1,710,197,954.33元	2,032,919,481.99元	3,341,982,314.44元
单位基金资产净值	0.8551元	1.0165元	1.6710元

基金资产净值收益率	-8.03%	5.87%	41.05%
本期基金资产净值增长率	-14.52%	-17.37%	45.69%
基金累计资产净值增长率	37.76%	61.16%	95.03%

(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 / 调整后期初基金资产净值

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 = (1998年度基金资产净值增长率 + 1) × (1999年度基金资产净值增长率 + 1) × (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

三、 基金管理人报告

(一) 基金产品说明书

投资目标	本基金是平衡性基金, 并以价值型和成长型股票为投资重点; 投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下, 谋求长期稳定的投资收益。
投资范围	本基金投资于国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许本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、深两市的价值型股票和成长型股票。
投资理念	价格终将反映价值。
投资策略	本基金投资时, 根据宏观经济环境及其对证券市场的影响, 决定投资策略; 根据货币政策的变化、利率的走势, 决定国债在投资组合中的比例; 根据对行业及地区经济发展状况的深入研究, 决定股票投资重点; 根据对上市公司的调查研究, 确定具体的股票投资组合。 本基金的股票投资将以中长期投资为主。在充分研究的前提下, 主要投资于价值型和成长型股票中被低估的股票, 以实现基金资产的稳定增值。 在股票投资组合中, 将保留一定比例的短期投资。短期投资主要根据市场变化, 相机抉择, 灵活投资, 在防范风险的前提下, 增加基金的收益。 为保证基金资产的流动性和收益性, 在国债投资组合中, 长期国

	<p>债和短期国债将保持适当的比例。</p> <p>在不违反《暂行办法》及基金契约有关规定的情况下，基金管理人可根据具体情况，对基金投资组合进行调整。</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>承担中等风险、获取中等的超额收益。</p>

（二）基金经理人介绍

王雄辉，基金经理，男，34岁，硕士，5年证券从业经历。曾在南开大学任教，1998年进入国泰基金管理有限公司，先后担任公司研究开发部行业研究员、金鑫基金经理助理、金泰基金经理助理等工作。

2003年1月起由黄刚先生任本基金基金经理，王雄辉先生因工作需要不再担任本基金基金经理。

黄刚，男，37岁，经济学硕士，8年证券期货从业经历。曾就职于上海金属交易所、上海期货交易所。2000年加盟国泰基金管理有限公司，先后任研究开发部经理、市场部经理、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年本基金净值增长率为-14.5%，跌幅略超过比较基准。

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年本基金的操作基本可分成两个阶段。上半年本基金管理小组判断中国加入WTO后证券市场运行机制将发生变化，认为国际化、规范化是市场发展的方向，而这将给市场带来一个下跌过程。因此本基金上半年的整体操作较为谨慎。第二阶段为“6.24”行情以后，由于对股市调控政策的意图和预期效果过于乐观，因此对市场的趋势判断变成了相对乐观，在操作上有所增仓，从而在第四季度市场下挫时形成了较被动的局面。

在行业资产配置上，大部分时间采取自下而上的配置方法。在以组合投资为主的机构投资者日益成为市场主流的背景下，这种行业配置方法未能收到预期的效果。在个股选择方面，基金组合中中小盘股比例较高，在追求成长性的同时，付出了流动性不足的代价，部分个股全年跌幅较深，影响了基金净值的表现。

（四）2003年市场及投资管理展望

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

根据上述分析，本基金2003年的投资策略将主要包括以下方面：

（1）把握市场节奏，积极操作。基于对2003年市场“平衡偏多”的预期，本基金操作将着重把握市场的波动机会，注意克服市场下跌中的恐慌情绪，设定合理的盈利预期，并以严格的投资纪律来保证投资策略得以贯彻。

（2）加强研究国民经济各行业的周期性和景气关联度。我们将密切关注汽车、交通运输以及电子通讯等成长型行业以及石化、能源、电力等周期性行业，加大行业配置力度，力争通过积极的行业配置策略，把握我国宏观经济增长的脉

搏，充分享受我国GDP高速增长成果。

(3) 深化在中国加入WTO后国内证券市场与国际接轨趋势方面的认识，重新评估大盘蓝筹等价值型股票的投资价值。加强对具有潜在外资并购题材、符合全球制造业转移方向的行业研究，例如金融保险业、汽车制造、电子元器件、旅游等行业，挖掘符合国际投资理念的个股进行投资。

(4) 在股票选择方面，坚持以公司基本面研究为出发点，强调对价值型股票的合理估值以及对成长型股票的合理判断，寻找被低估的股票，并注意控制交易成本，在控制风险的同时将公司的优秀研究成果转化为超额投资收益。

(5) 债券投资方面，本基金2003年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。

总之，我们认为2003年证券市场将稳定发展，整个市场氛围筑底偏暖。我们将齐心协力、勤勉尽责，继续加强风险控制，努力把握和捕捉投资机会，力争给基金持有人带来满意的回报。

(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市场风险、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

本托管人——中国工商银行，依据《金泰证券投资基金基金契约》与《金泰证券投资基金托管协议》，托管金泰证券投资基金。

2002年度，在对金泰证券投资基金的托管过程中，本托管人严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对金泰证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，没有发生任何损害基金持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为托管人所应尽的义务。

本托管人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对金泰证券投资基金的投资组合进行了监督，认为国泰基金管理有限公司在金泰证券投资基金的投资运作、基金资产净值及单位基金资产净值的计算上，遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，没有发现任何损害基金持有人利益的行为。

本托管人依法对金泰证券投资基金管理人——国泰基金管理有限公司在2002年度内所编制和披露的金泰证券投资基金资产净值公告、基金投资组合公告、基金中期报告、基金年度报告等公告信息进行了复核，认为金泰证券投资基金管理人——国泰基金管理有限公司在2002年度内所编制和披露的基金信息是准确、真实、完整的。

中国工商银行基金托管部

2003年3月11日

五、基金财务报告

(一) 审计报告书

金泰证券投资基金全体持有人：

我们接受委托，审计了金泰证券投资基金（以下简称“基金金泰”）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

表由基金金泰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，我们结合基金金泰的实际情况，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，上述基金金泰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》、《金泰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泰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	357,681,727.60	144,025,126.59	应付证券清算款		
清算备付金	3,476,134.75	7,022,610.72	应付赎回款		
交易保证金	750,000.00	750,000.00	应付赎回费		
应收证券清算款	1,488,835.80	2,813,852.09	应付管理人报酬	2,625,648.21	2,236,363.47
应收股利			应付托管费	437,608.04	372,727.24
应收利息	1,080,589.36	7,760,542.87	应付佣金	275,535.92	190,677.92
应收申购款			应付利息	129,177.88	
其他应收款	451,000.00	21,210.53	应付收益		
股票投资市值	1,265,769,457.23	1,074,500,900.43	未交税金		
其中：股票投资成本	1,461,450,582.78	1,397,406,698.95	其他应付款	250,000.00	1,389,501.76
债券投资市值	456,259,707.30	477,798,981.49	卖出回购证券款	50,000,000.00	
其中：债券投资成本	462,127,846.21	483,568,452.39	短期借款		
配股权证			预提费用	320,000.00	306,000.00
买入返售证券			其他负债		
待摊费用			负债合计	54,037,970.05	4,495,270.39
其他资产			持有人权益：		
			实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
			未实现利得	-201,549,264.46	-328,675,269.42
			未分配收益	234,468,746.45	38,873,223.75
			持有人权益合计	2,032,919,481.99	1,710,197,954.33
资产总计	2,086,957,452.04	1,714,693,224.72	负债及持有人权益总计	2,086,957,452.04	1,714,693,224.72

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	198,326,773.86	-123,628,940.75
1、股票差价收入	157,180,955.98	-188,592,060.30
2、债券差价收入	5,660,231.79	27,143,576.42
3、债券利息收入	16,929,669.75	24,752,097.50
4、存款利息收入	7,907,415.57	3,677,991.64
5、股利收入	10,215,970.58	9,031,228.35
6、买入返售证券收入		
7、其他收入	432,530.19	358,225.64
二、费用	52,129,172.97	36,969,710.68
1、基金管理人报酬	37,233,363.33	29,018,492.68
2、基金托管费	6,205,560.63	4,836,415.42
3、卖出回购证券支出	13,903.75	2,469,404.56
4、利息支出	5,626,144.76	
5、其他费用	3,050,200.50	645,398.02
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	100,000.00	100,000.00
三、基金净收益	146,197,600.89	-160,598,651.43
加：未实现利得	-605,260,433.34	-127,126,004.96
四、基金经营业绩	-459,062,832.45	-287,724,656.39

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	146,197,600.89	-160,598,651.43
加：期初基金净收益	938,271,145.56	234,468,746.45
加：本期损益平准金		
加：以前年度损益调整		-2,996,871.26
可供分配基金净收益	1,084,468,746.45	70,873,223.76
减：本期已分配基金净收益	850,000,000.00	32,000,000.01
期末基金净收益	234,468,746.45	38,873,223.75

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	2,032,919,481.99
二、本期经营活动：	
基金净收益	-160,598,651.43
未实现利得	-127,126,004.96
经营活动产生的基金净值变动数	-287,724,656.39
以前年度损益调整	-2,996,871.26
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	32,000,000.01
五、期末基金净值	1,710,197,954.33

(三)会计报表附注

1、基金简介

金泰证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）、上海爱建信托投资有限责任公司、浙江省国际信托投资公司和中国电力财务有限公司四家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和基金契约发起，经中国证券监督管理委员会（证监基字[1998]7号文）批准，于1998年3月27日募集成立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发行规模为20亿份基金单位。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行。

本基金于1998年4月7日在上交所挂牌交易。根据《证券投资基金管理暂行办法》和证监基字[1998]7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2,996,871.26元在本年度基金净值变动表的“以前年度损益调整”科目单独列示，并扣减当期可分配收益。

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3300万份
	席位出租人	出租交易席位	席位使用协议	租用二个席位
浙江省国际信托投资公司 (以下简称“浙江国投”)	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金900万份
	席位出租人	出租交易席位	席位使用协议	租用二个席位
上海爱建信托投资有限责任公司 (以下简称“爱建信托”)	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金900万份
	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	基金管理人	提取管理费	基金契约	
中国工商银行	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

通过关联人席位进行股票买卖2002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	38,641.70	16.80%	30.74	16.81%	58,475.27	20.71%	48.92	20.68%
爱建信托	18,112.86	7.87%	14.13	7.73%	49,793.56	17.63%	41.58	17.58%
浙江国投	36,805.97	16.00%	28.57	15.63%	53,659.54	19.00%	44.92	18.98%

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2002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	19,136.80	13.24%	-	-
爱建信托	30,841.00	21.34%	-	-
浙江国投	18,905.71	13.08%	11,541.50	26.99%

通过关联人席位进行债券回购2002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	33,000.00	16.67%	-	-
爱建信托	33,000.00	16.67%	43,200.00	38.84%
浙江国投	10,000.00	5.05%	5,530.00	4.97%

与关联人进行债券回购2002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
中国工商银行	88,495.00	90.10	346,800.00	491.26

与关联人进行国债投资买卖2002年交易量(万元)情况

关联人	2002年度交易量	2001年度交易量
中国工商银行	9,401.50	-

(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。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29,018,492.68元，其中已支付基金管理人26,782,129.21元，尚余2,236,363.47元未支付。2001年度共计提37,233,363.33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%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4,836,415.42元，其中已支付基金托管人4,463,688.18元，尚余372,727.24元未支付。2001年度共计提6,205,560.63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750,000.00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7,760,542.87元，系应收银行存款和清算备付金利息63,744.60元及应收债券利息7,696,798.27元。
- (3) 其他应收款：2002年12月31日余额为21,210.53元，系交易所于2001年度自动扣除，待向席位券商收回应由席位券商支付的交易所风险基金及卫星运行费。
- (4) 其他应付款：2002年12月31日余额为1,389,501.76元，系应缴股利税金1,139,501.76元及深交所席位交易保证金250,000.00元。
- (5) 预提费用：2002年12月31日余额为306,000.00元，系预提基金2002年度审计费用100,000.00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2,469,404.56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358,225.64元，包括债券发行手续费返还137,793.55元，新股中签手续费返还213,368.50元及印花税返还7,063.59元。
- (8) 应由基金承担的其他费用：2002年累计发生额为645,398.02元，包括上市年费60,000.00元，信息披露费320,000.00元，审计费用100,000.00元，2001年度分红手续费96,000.00元，回购交易费用34,875.00元及其他费用34,523.02元。
- (9) 未实现利得：2002年累计发生额为-127,126,004.96元，包括本期因投资估值增值产生的未实现利得-130,122,876.22元及以前年度损益调整2,996,871.26元。

(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	2002-10-9	4,540,735	10,443,690.50	12,305,391.85	1,861,701.35	二级市场配售
2	中信证券	2002-12-20	2003-1-6	82,000	369,000.00	369,000.00	-	网上申购
3	中信证券	2002-12-24	2003-1-6	318,000	1,431,000.00	1,431,000.00	-	二级市场配售
4	皖通高速	2002-12-26	2003-1-7	343,000	754,600.00	754,600.00	-	二级市场配售
	合计				12,998,290.50	14,859,991.85	1,861,701.35	

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。

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账户，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1,708,336,252.98元，每份基金单位资产净值为0.8542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	600260	凯乐科技	5,582,429	70,115,308.24	4.10%
2	600315	上海家化	4,991,125	54,852,463.75	3.21%
3	000581	威孚高科	5,643,748	54,067,105.84	3.16%
4	000542	TCL 通讯	3,585,071	51,015,560.33	2.98%
5	600008	首创股份	4,572,884	47,786,637.80	2.79%
6	600050	中国联通	13,673,303	37,054,651.13	2.17%
7	600066	宇通客车	2,920,186	36,064,297.10	2.11%
8	600310	桂东电力	2,610,907	34,855,608.45	2.04%
9	600641	中远发展	3,904,621	34,399,711.01	2.01%
10	600500	中化国际	3,730,726	32,979,617.84	1.93%
11	600036	招商银行	3,931,226	32,039,491.90	1.87%
12	000895	双汇发展	3,046,243	31,437,227.76	1.84%
13	600675	中华企业	4,627,352	30,818,164.32	1.80%
14	600170	上海建工	3,651,843	29,689,483.59	1.74%
15	000598	蓝星清洗	4,043,561	29,234,946.03	1.71%
16	600028	中国石化	9,234,792	27,981,419.76	1.64%
17	000903	云内动力	2,518,596	27,628,998.12	1.62%
18	600790	轻纺城	5,079,173	27,376,742.47	1.60%
19	000157	中联重科	2,890,660	26,189,379.60	1.53%
20	600812	华北制药	5,084,242	24,607,731.28	1.44%
21	000559	万向钱潮	2,728,125	22,370,625.00	1.31%
22	000659	珠海中富	2,773,105	21,380,639.55	1.25%
23	000927	天津汽车	3,507,573	20,308,847.67	1.19%
24	600311	荣华实业	2,146,349	20,025,436.17	1.17%
25	600011	华能国际	1,711,139	19,147,645.41	1.12%

26	600637	广电信息	1,621,472	17,625,400.64	1.03%
27	600321	国栋建设	1,596,326	17,399,953.40	1.02%
28	600582	天地科技	903,821	15,075,734.28	0.88%
29	600018	上港集箱	887,750	14,789,915.00	0.86%
30	600416	湘电股份	1,435,423	14,339,875.77	0.84%
31	600302	标准股份	1,217,826	12,762,816.48	0.75%
32	600320	振华港机	1,064,455	11,251,289.35	0.66%
33	600519	贵州茅台	436,590	11,150,508.60	0.65%
34	000726	鲁泰A	1,295,767	10,754,866.10	0.63%
35	600607	上实联合	1,099,182	9,683,793.42	0.57%
36	600350	山东基建	2,172,347	9,232,474.75	0.54%
37	600019	宝钢股份	2,000,000	8,220,000.00	0.48%
38	600609	金杯汽车	1,581,848	8,178,154.16	0.48%
39	600694	大商股份	920,976	6,658,656.48	0.39%
40	600583	海油工程	453,050	6,351,761.00	0.37%
41	600824	益民百货	640,592	6,329,048.96	0.37%
42	600628	新世界	888,796	6,168,244.24	0.36%
43	000983	西山煤电	910,160	5,624,788.80	0.33%
44	600692	亚通股份	437,973	5,531,598.99	0.32%
45	600428	中远航运	582,050	5,250,091.00	0.31%
46	600276	恒瑞医药	480,888	4,948,337.52	0.29%
47	600236	桂冠电力	464,911	4,779,285.08	0.28%
48	000966	长源电力	499,940	3,389,593.20	0.20%
49	600503	宏智科技	201,743	3,209,731.13	0.19%
50	600598	北大荒	380,328	2,228,722.08	0.13%
51	600591	上海航空	295,100	1,924,052.00	0.11%
52	600030	中信证券	400,000	1,800,000.00	0.11%
53	600887	伊利股份	67,234	1,190,041.80	0.07%
54	600596	新安股份	88,300	870,638.00	0.05%
55	600012	皖通高速	343,000	754,600.00	0.04%
56	000959	首钢股份	105,000	606,900.00	0.04%
57	600579	黄海股份	74,400	606,360.00	0.04%
58	600578	京能热电	62,000	505,300.00	0.03%
59	600563	法拉电子	38,000	497,040.00	0.03%
60	600511	国药股份	41,000	449,770.00	0.03%
61	600549	厦门钨业	17,000	260,780.00	0.02%
62	600458	时代新材	18,000	247,860.00	0.01%
63	000039	中集集团	15,124	218,088.08	0.01%
64	600560	金自天正	13,000	207,090.00	0.01%
	合计			1,074,500,900.43	62.83%

(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	000542	TCL 通讯		4,159,570		574,499
2	000659	珠海中富		2,773,105		
3	000726	鲁 泰A		996,744	299,023	
4	000903	云内动力		2,813,514	514,086	809,004
5	000927	天津汽车		3,367,730	209,843	70,000
6	000966	长源电力		499,940		
7	600012	皖通高速	343,000			
8	600019	宝钢股份		2,000,000		
9	600030	中信证券	318,000	82,000		
10	600036	招商银行	2,688,887	7,918,000		6,675,661
11	600050	中国联通	8,033,735	9,132,568		3,493,000
12	600066	宇通客车		2,920,186		
13	600236	桂冠电力		464,911		
14	600302	标准股份		1,282,626		64,800
16	600350	山东基建	258,000	2,497,347		583,000
17	600416	湘电股份	69,000	1,366,423		
18	600428	中远航运	69,000	1,503,650		990,600
19	600458	时代新材	18,000			
20	600503	宏智科技	31,000	645,243		474,500
21	600511	国药股份	41,000			
22	600549	厦门钨业	17,000			
23	600560	金自天正	13,000			
24	600563	法拉电子	38,000			
25	600578	京能热电	62,000			
26	600579	黄海股份	62,000		12,400	
27	600582	天地科技		903,821		
28	600583	海油工程	27,000	432,900		6,850
29	600591	上海航空	276,000	102,100		83,000
30	600598	北 大 荒	217,000	2,292,128		2,128,800
31	600609	金杯汽车		1,581,848		
32	600628	新 世 界		791,546	97,250	
33	600694	大商股份		920,976		
34	600790	轻 纺 城		5,079,173		
35	600812	华北制药		5,084,242		

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	000042	深长城A		87,743	87,743
2	000066	长城电脑		398,683	398,683
3	000088	盐田港A	1,491,081		1,491,081
4	000153	新力药业	474,480		474,480
5	000513	丽珠集团	176,500	57,900	234,400
6	000651	格力电器		1,952,401	1,952,401
7	000733	振华科技	2,163,813		2,163,813
8	000739	普洛药业		299,986	299,986
9	000811	烟台冰轮		376,619	376,619
10	000917	电广传媒	1,688,115		1,688,115
11	000930	丰原生化	2,353,503	808,171	3,161,674
12	600002	齐鲁石化	1,140,354		1,140,354
13	600010	钢联股份	4,468,723		4,468,723
14	600026	中海发展		347,000	347,000
15	600053	江西纸业		304,723	304,723
16	600076	青鸟华光	2,409,636		2,409,636
17	600096	云天化		390,878	390,878
18	600131	岷江水电		1,753,323	1,753,323
19	600163	福建南纸	4,004,418		4,004,418
20	600195	中牧股份		496,574	496,574
21	600198	大唐电信	3,508,434		3,508,434
22	600299	星新材料	974,770		974,770
23	600317	营口港		121,000	121,000
24	600327	大厦股份		27,000	27,000
25	600345	长江通信	131,604	144,801	276,405
26	600351	亚宝药业		13,000	13,000
27	600353	旭光股份		22,000	22,000
28	600355	精伦电子		18,000	18,000
29	600357	承德钒钛		124,000	124,000
30	600361	华联综超		430,501	430,501
31	600371	华冠科技		23,000	23,000
32	600373	鑫新股份		5,000	5,000
33	600379	宝光股份	41,000		41,000
34	600397	安源股份		93,000	93,000
35	600419	新疆天宏	177,400		177,400
36	600422	昆明制药	298,824		298,824
37	600426	华鲁恒升		57,000	57,000
38	600456	宝钛股份		19,000	19,000
39	600486	扬农化工		15,000	15,000
40	600496	长江股份		34,000	34,000

41	600499	科达机电		5,000	5,000
42	600505	西昌电力		24,000	24,000
43	600506	香梨股份		194,200	194,200
44	600509	天富热电		315,000	315,000
45	600510	黑牡丹		22,000	22,000
46	600512	腾达建设		59,000	59,000
47	600515	第一投资		15,000	15,000
48	600516	海龙科技		70,000	70,000
49	600520	三佳模具	40,000		40,000
50	600522	中天科技		64,000	64,000
51	600523	贵航股份	148,000		148,000
52	600525	长园新材		12,000	12,000
53	600526	菲达环保		19,000	19,000
54	600531	豫光金铅		33,000	33,000
55	600532	华阳科技		24,000	24,000
56	600533	栖霞建设		33,000	33,000
57	600535	天士力		26,000	26,000
58	600536	中软股份		10,000	10,000
59	600548	深高速	230,639		230,639
60	600551	科大创新		11,000	11,000
61	600552	方兴科技		31,000	31,000
62	600553	太行股份		36,000	36,000
63	600557	康缘药业		26,000	26,000
64	600559	裕丰股份		24,000	24,000
65	600561	江西长运		18,000	18,000
66	600565	迪马股份		9,000	9,000
67	600566	洪城股份	435,200	208,100	643,300
68	600571	信雅达		4,000	4,000
69	600577	精达股份		4,000	4,000
70	600580	卧龙科技		36,000	36,000
71	600581	八一钢铁		178,000	178,000
72	600586	金晶科技		24,000	24,000
73	600587	新华医疗		8,000	8,000
74	600590	泰豪科技		28,000	28,000
75	600592	龙溪股份		42,000	42,000
76	600593	大连圣亚		17,000	17,000
77	600595	中孚实业		32,000	32,000
78	600597	光明乳业		202,000	202,000
79	600630	龙头股份	1,091,454		1,091,454
80	600642	申能股份		2,305,246	2,305,246
81	600823	世茂股份		300,000	300,000
82	600827	友谊股份		190,000	190,000

(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	2,228,722.08	0.13%
2	采掘业	39,957,969.56	2.34%
3	制造业	575,144,510.29	33.63%
	其中：食品、饮料	63,803,214.33	3.73%
	纺织、服装、皮毛	10,754,866.10	0.63%
	造纸、印刷		
	石油、化学、塑胶、塑料	177,308,215.57	10.37%
	电子	18,122,440.64	1.06%
	金属、非金属	26,705,721.48	1.56%
	机械、设备、仪表	248,444,213.37	14.53%
	医药、生物制品	30,005,838.80	1.75%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	57,898,147.06	3.39%
5	建筑业	29,689,483.59	1.74%
6	交通运输、仓储业	28,250,256.99	1.65%
7	信息技术业	91,279,942.59	5.34%
8	批发和零售贸易业	52,135,567.52	3.05%
9	金融、保险业	33,839,491.90	1.98%
10	房地产业	65,217,875.33	3.81%
11	社会服务业	61,798,397.63	3.61%
12	传播与文化产业		
13	综合类	37,060,535.89	2.17%
	合 计	1,074,500,900.43	62.83%

2、国债及货币资金合计

截止2002年12月31日，金泰证券投资基金持有国债(不含应计利息)及货币资金合计为631,660,570.89元(货币资金中含当日证券清算款2,813,852.09元)，占基金资产净值的36.93%。

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	凯乐科技	70,115,308.24	4.10%
2	上海家化	54,852,463.75	3.21%
3	威孚高科	54,067,105.84	3.16%
4	TCL 通讯	51,015,560.33	2.98%
5	首创股份	47,786,637.80	2.79%
6	中国联通	37,054,651.13	2.17%
7	宇通客车	36,064,297.10	2.11%
8	桂东电力	34,855,608.45	2.04%
9	中远发展	34,399,711.01	2.01%
10	中化国际	32,979,617.84	1.93%

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、应收帐款、应付管理费、托管费、佣金、预提费用、卖出回购款、回购利息、应付帐款及其他应收应付款项合计为借方余额

4,036,483.01元，与基金股票市值1,074,500,900.43元和国债及货币资金合计631,660,570.89元相加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	30,000,000份	1.50%
其中：国泰君安	16,500,000份	0.83%
中国电力财务有限公司	4,500,000份	0.23%
爱建信托	4,500,000份	0.23%
浙江国投	4,500,000份	0.23%
社会公众持有	1,970,000,000份	98.50%
合 计	2,000,000,000份	100.00%

(二) 截止2002年12月31日，本基金共有持有人149,959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	中国太保	141,675,967	7.08%
2	中国人寿	120,709,330	6.04%
3	平安保险	76,944,584	3.85%
4	中国人保	72,321,827	3.62%
5	久事公司	38,341,039	1.92%
6	中再保险	26,402,193	1.32%
7	李辅弼	18,068,000	0.90%
8	国泰君安	16,500,000	0.83%
9	华宝信托	15,699,659	0.78%
10	大亚公司	14,443,000	0.72%

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

- 2002年3月29日，本基金管理人刊登了《金泰证券投资基金二00一年年度报告》及《金泰证券投资基金二00一年年度收益分配报告》。基金金泰二00一年年度收益分配方案为每100份基金单位派发现金收益1.60元（二00一年派发的收益暂免税），权益登记日为2002年4月4日，除息交易日为2002年4月5日，红利发放日为2002年4月11日。
- 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。
- 4、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，公司决定聘任黄刚为金泰基金基金经理，王雄辉不再担任金泰基金基金经理。
- 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、浙江国投、爱建信托、申银万国证券股份有限公司（以下简称“申银万国”）、国信证券有限公司、海通证券有限公司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
爱建信托	18,112.86	7.87%	30,841.00	21.34%	33,000.00	16.67%	81,953.86	14.31%
国泰君安	38,641.70	16.80%	19,136.80	13.24%	33,000.00	16.67%	90,778.50	15.85%
国信证券有限公司	40,638.16	17.66%	25,397.01	17.58%	70,000.00	35.35%	136,035.17	23.76%
海通证券有限公司	41,146.76	17.88%	31,922.14	22.09%	37,000.00	18.69%	110,068.90	19.22%
申银万国	54,744.36	23.79%	18,315.82	12.67%	15,000.00	7.57%	88,060.18	15.38%
浙江国投	36,805.97	16.00%	18,905.71	13.08%	10,000.00	5.05%	65,711.68	11.48%
合计	230,089.81	100.00%	144,518.48	100.00%	198,000.00	100.00%	572,608.29	100.00%
	关联人及券商名	佣金	比例	平均佣金比率				
	爱建信托	14.13	7.73%	0.08%				
	国泰君安	30.74	16.81%	0.08%				
	国信证券有限公司	32.02	17.52%	0.08%				
	海通证券有限公司	33.03	18.08%	0.08%				
	申银万国	44.29	24.23%	0.08%				
	浙江国投	28.57	15.63%	0.08%				
	合计	182.78	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、关于同意设立金泰证券投资基金的批复
- 2、金泰证券投资基金契约
- 3、金泰证券投资基金托管协议
- 4、金泰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