

# 金鑫证券投资基金 2000 年中期报告

## 重要提示

本基金的托管人中国建设银行已于 2000 年 8 月 25 日复核了本报告。

本基金的管理人、托管人愿就本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性负责，本报告书中的内容由本基金管理人负责解释。

## 一、基金简介

### (一) 基金名称：金鑫证券投资基金(简称：基金金鑫)

交易代码：500011

基金发起人：国泰君安证券股份有限公司

浙江省国际信托投资公司

上海爱建信托投资公司

国泰基金管理有限公司

基金发行日期：1999 年 10 月 15 日

基金成立日期：1999 年 10 月 21 日

基金单位总份额：三十亿份基金单位

基金类型：契约型封闭式

基金存续期：十五年

基金上市地：上海证券交易所

基金上市日期：1999 年 11 月 26 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 199 号

办公地址：上海市静安区延平路 135 号

邮政编码：200042

法定代表人：陈勇胜

总经理：李春平

负责信息管理事务人员：丁昌海、黄永明

联系地址：上海市静安区延平路 135 号

电话：021-62531534

传真：021-62531262

电子邮件：gtfund02@online.sh.cn

### (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：王雪冰  
托管部负责人：许占涛  
负责信息管理事务人员：程燕春  
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：010-67597624  
传真：010-67597634

(四) 会计师事务所

法定名称：大华会计师事务所有限公司  
注册地址：上海市昆山路 146 号  
办公地址：上海市昆山路 146 号  
法定代表人：汤云为  
邮编：200080  
电话：021-63070766  
传真：021-63243522  
经办注册会计师：曹培青 汪阳

## 二、主要财务指标：

基金净收益	496,833,566.31元
单位基金净收益	0.1656元
基金可分配净收益	514,162,199.68元
单位基金可分配净收益	0.1714元
基金资产净值	4,095,124,661.57元
单位基金资产净值	1.3650元
基金净资产收益率	17.13%
本期基金可分配收益率	17.73%
本期净值增长率	41.20%
基金累计净值增长率	36.50%

## 三、基金管理人报告

(一)、基金管理人承诺

在本报告期内，本基金基金管理人严格遵循了《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《金鑫证券投资基金契约》和其他有关法规的规定，没有发生任何损害基金持有人利益的行为。本报告已经本基金托管人复核，本基金基金管理人愿就报告中所载资料的真实性、准确性和完整性负责。

本基金基金管理人各项规章制度健全，监察稽核工作贯穿公司业务的各个层面。在本报告期内，没有发现员工有任何违法、违规行为。本基金基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范经营的基础上，在控制风险的前提下，继续为基金持有人谋求长期稳定的投资回报。

(二)、投资决策和管理模式

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据有关法规、基

金契约以及公司研究开发部和基金小组提供的研究分析报告和投资计划，确定金鑫基金的投资策略，审批重大投资项目和基金投资计划。基金经理领导的基金管理小组负责基金的投资组合管理和日常运作。基金管理小组将投资指令下达给中央交易室，交易员根据市场情况执行投资指令，并将指令执行情况及时反馈到基金管理小组。

金鑫基金管理小组由钱华（基金经理）、胡定超（基金经理助理）组成。

基金经理：钱华先生，37岁，经济学硕士，曾在中国农业银行总行、中国人民银行政策研究室工作，历任中国华阳金融租赁有限公司国际业务部经理、国泰证券有限公司基金部副总经理，现任国泰基金管理有限公司总经理助理。

基金经理助理：胡定超先生，35岁，硕士学历，曾任深圳南山基金管理有限公司研究部经理、证券投资部总经理和公司助理总裁，现任基金金鑫经理助理。

### （三）、投资理念和风格

本基金的投资理念：

#### 1、控制风险、追求收益

本基金管理人在制定投资组合时，同时考虑风险和收益两个指标，力求做到：在承担一定风险的前提下，使投资收益最大化；或在追求一定收益的前提下，使所承担的风险最小化。

#### 2、价值发现

本基金选择股票投资对象的主要依据是上市公司的内在价值。根据公司的业绩、成长性、行业地位和管理机制来判断其价值。本基金管理人努力寻找价值被低估的上市公司。

#### 3、投资蓝筹股

根据本基金的契约约定，国企大盘股是本基金的投资重点之一。中国股市处于发展阶段，国企大盘股中尚未出现公认的蓝筹股。作为专业基金管理机构，有义务去发掘一批潜在的蓝筹股。本基金管理人在国企大盘股的选择方面坚持以下标准：

- （1）属于具有良好发展前景的行业。
- （2）在行业中处于举足轻重的地位。
- （3）业绩优良并具有成长性。

#### 4、投资相对集中

集中投资可以减少管理成本，提高管理效率；分散投资可以尽可能规避市场的非系统风险。本基金管理人力求在集中投资和分散投资之间取得平衡，采取相对集中的原则，即将本基金的大部分资产相对平衡地投资于30-50个左右的股票上，同时在一只股票上不投入过多的资金，以保持基金资产的流动性。

### （四）、上半年投资管理回顾

自2000年元月始，中国证券市场迈开了世纪之交的牛步，上半年连续出现了前所未有的强势，上证指数在6月底更创出1953.33点历史新高。我们认为这种市场强势的产生，除了受年初有关向二级市场投资者配售新股和券商股票质押贷款等利好政策的刺激外，最根本的动力在于，中国经济在经历了亚洲金融风暴的冲击后，已经开始了新一轮的增长。今年上半年的经济运行情况证明我国经济已初步摆脱了近几年持续疲软的运行局面，出现了稳步回升的新趋势。据有关研究资料显示，今年经济回升具有两个明显的特点：一是国民经济增长速度的回升不象去年那样主要靠少数几个行业的快速增长来带动，而是依靠多数行业的稳定增长实现的，且各行业之间的增长速度相对差距有减小的趋势；二是部分带有“先行”特征的行业，如电子信息、通讯、电力、钢铁、铁路运输等行业，增长速度相对较快。这一定程度上说明我国国民经济的增长具有强劲的内在动力，而且这种内在动力正在不断加强。我们认为上半年我国股市的不断走强是对目前宏观经济运行状态的真实反映，股市稳定向上的发展趋势得到了经济层面的有力支持。

1999年10月本基金设立后，股指一直处于下降走势。但我们基于对国家宏观经济形势的判

断，在股市下跌时我们逐步提高建仓的力度，到1999年底已基本完成初期建仓工作，比例达到近60%。为了尽快增加仓位，本基金专门设计了一个低市值组合，即在沪深两地800多只上市公司中，挑选出159家市值较低的上市公司，组成一个投资组合，这个低市值组合的总资金规模为5亿元。这个组合中每个股票的具体比例是根据该股票在指数中的权重确定的，并在短期内迅速完成建仓目标。5亿的投资组合视为一只股票，同时买进，同时卖出。今年第一季度，由于大盘走势逐渐明朗，本基金决定进一步加快建仓速度，并将科技、网络股和国企大盘股作为投资重点。鉴于本基金的投资策略已经基本成熟，我们决定将低市值股票抛出，更换了一批高科技股票。

总体而言，在进入2000年后，随着宏观经济形势的逐步好转，本基金管理人判断证券市场也将回升，基于这种判断，本基金果断地加快了建仓的速度。根据我们对国家科教兴国战略的理解和对国际证券市场的研究，本基金管理人认为高科技股将成为活跃的板块，所以将高科技股作为第一季度的投资重点。到了第二季度，针对网络股、高科技股过热的局面，本基金管理人果断地减持了网络股和部分高科技股，同时增持业绩好的低价国企大盘股。在今年上半年中，上证指数增长率为41.09%，深市成指的增长率为43.35%，本基金净值增长率为41.2%，本基金净值增长率跟上了大市。扣除新股配售对基金净值的贡献因素 每基金单位配售新股贡献为0.1076元后，本基金净值增长率为30.07%。

#### (五)、下半年市场展望

从国家统计局近期陆续公布的数据看，今年上半年我国宏观经济呈现全面复苏的局面：固定资产投资保持较快增长，国内消费形势好转，对外贸易回升迅猛，全年国内生产总值的增长幅度可望突破8%。各种迹象表明，我国经济有可能结束连续几年下滑的局面，转为稳中有升的新态势。从政策面来看，无论是货币政策，还是财政政策，都是比较积极的。这种积极的政策为股市发展创造了有利的条件。

股市是经济的晴雨表，上半年沪深股市的大幅上扬，主要得益于经济回升。下半年宏观经济将继续向好，股市的稳步发展也就有了坚实的基础。

但是，作为专业性的基金管理机构，我们对宏观经济形势在发展过程中所蕴涵的结构性矛盾也应保持清醒的认识。我们认识到当前经济回升和企业效益的好转是初步的、恢复性的，回升的基础尚不稳固；需求不足的矛盾尚未从根本上解决；企业效益的改善更多的是依赖一些外在因素，真正靠调整结构、转换机制、加强管理等内在因素而提高的效益并不多。还有些上市公司由于经营机制等种种因素，其经营业绩很可能与宏观形势相偏离。此外，股票市场的整体市盈率普遍较高，随着股指的不断推高，市场风险正在加大。从证券市场的供求关系来看，新股发行的压力不见减轻，解决国有股流通问题迫在眉睫，而保险资金等增量资金的大举入市尚需时日，所以，证券市场供求不平衡问题在今后一段时期内仍将存在。基于以上认识，本基金管理人将密切关注国家经济形势和宏观政策走向，加强研究，积极挖掘有长线投资价值的股票，精选个股，保持合适的仓位和较好的组合结构，在控制风险的前提下，谋求基金资产的持续增值，努力给广大投资者赢得良好的回报。

#### (六)、内部监察报告

##### 基金运作合规性声明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金管理暂行办法》、《金鑫证券投资基金基金契约》和其它相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，努力为基金持有人争取最好的投资回报；同时，在“稳健为本，规范管理，精心运作，争创一流”的公司理念指导下，严格规范基金资产运作的各个环节，努力使基金持有人的风险降到最低；本基金管理人在基金管理运作中，无损害基金持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例、投资组合符合有关法规和基金契约的规定。

##### 内部监察工作报告

2000年上半年，本基金管理人依据相关的法律法规、基金契约以及内部的监察制度开展了

一系列严格有效的监察工作。我们将内部监察的重点放在以下几个方面：通过监管，确保各基金运作的相对独立性，避免各基金间可能出现的违规交叉交易；防范不当关联交易和内幕交易；加强对风险的防范。针对以上几个方面本基金管理人主要采取了以下措施：一、加强监察力度，提高监察频率。对基金资产管理各个环节的工作流程进行定期的日常监察和不定期的专项监察，并定期制作内部监察报告。二、建立监察业务反馈制度，加强监察稽核部门与其它业务部门的交流与沟通，对发现的问题及时向上级监管部门和本公司管理层汇报并督促整改，以确保基金资产运作的合法合规。三、细化监察工作的内容和方式，运用成交资料审阅、交易流程电脑监控、录音电话抽查等手段对基金交易进行监察，确保各基金运作的相对独立性和保密性。四、逐步建立科学的风险预测和监管体系，尝试利用现代金融工程的先进管理方法和管理工具对市场风险进行监控，并据市场情况随时向各基金小组发送基金运作提示函。五、通过各种方式对职工进行培训，从而不断提高员工业务技能及职业操守，使员工自觉树立风险和监察意识。

经持续跟踪监察，本报告期内，本基金运作依照规章制度规定的流程进行，管理运作合法合规；本基金资产与本基金管理人所管理的其他基金资产、基金资产与公司资产严格分开；基金管理小组人员之间保持独立；本基金运作中无不当关联交易和内幕交易；本基金净资产平稳增长，基金持有人利益得到了有效保障。

在内部监察的工作实践中，我们体会到规范经营和强化管理是基金安全运作的前提，科学化制度化的工作流程是基金安全运作的基础，防范和控制风险是基金安全运作的保障。只有这样，才能保证基金资产安全、稳定的增长，保障基金持有人的利益。我们将继续努力，提高内部监察工作的科学性和有效性，为基金的规范运作、安全管理，为维护基金持有人的利益发挥应有的作用。

## 四、基金财务报告(未经审计)

### (一)基金会计报告书

#### 1、资产负债报告书

#### 资产负债报告书

2000年06月30日

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

序号	项目	期末数	期初数
1	股票投资—成本	2,160,449,829.84	1,863,057,350.02
2	股票投资—估值增值	573,984,735.98	-117,478,291.82
3	债券投资—成本	839,756,365.24	256,996,689.89
4	债券投资—估值增值	6,977,725.91	301,150.11
5	其他投资—成本		
6	其他投资—估值增值		
7	现金		
8	银行存款	790,919,483.45	926,708,999.55
9	应收股利	64,152.00	
10	应收利息	357,565.68	442,793.48
11	应收帐款	2,852,411.91	

12	应收交易清算款		
13	应收申购款	197,000,000.00	
14	其他应收款项		
15	基金资产总值	4,572,362,270.01	2,930,029,231.23
16	应付基金管理费	4,874,169.60	3,748,338.87
17	应付基金托管费	819,176.08	624,723.12
18	应付收益		
19	应付帐款		499,890.00
20	应付交易清算款	7,120,373.19	22,129,676.60
21	应付佣金	3,120,614.13	1,875,110.98
22	其他应付款项		1,000,000.00
23	应付回购利息	107,275.44	
24	卖出回购	461,196,000.00	
25	负债总额	477,237,608.44	29,877,739.57
26	基金单位总额	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
27	未分配净收益	514,162,199.68	17,328,633.37
28	未实现估值增值	580,962,461.89	-117,177,141.71
29	基金资产净值	4,095,124,661.57	2,900,151,491.66
30	单位基金发行总份额	3,000,000,000份	3,000,000,000份
31	每份基金单位资产净值	1.3650	0.9667

## 2、损益及分配报告书

### 损益及分配报告书

2000年1—6月

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

序号	项目	本期累计数	上年同期
1	一、基金收入	527,632,655.72	
2	证券买卖差价收入	515,277,659.99	
3	其中：股票	515,277,659.99	
4	投资收入	3,503,312.30	
5	其中：股息收入	2,912,642.45	
6	债券利息收入	590,669.85	
7	回购利息收入	687,790.60	
8	其他收入	8,163,892.83	
9	其中：利息收入	7,794,467.41	
10	其他	369,425.42	
11	二、基金费用	30,799,089.41	
12	管理费	26,140,072.48	
13	托管费	4,439,955.25	
14	回购利息支出	107,275.44	
15	其他费用	111,786.24	
16	其中：上市年费	60,000.00	

17	会计师费	50,000.00	
18	其他	1,786.24	
19	三、净收益	496,833,566.31	
20	四、上期末分配净收益	17,328,633.37	
21	五、本期已分配收益		
22	六、期末未分配净收益	514,162,199.68	

## (二)会计报告书附注

### 1、主要会计政策

- (1)基金会计年度：为公历每年1月1日至12月31日。
- (2)基金记帐本位币：以人民币为记帐本位币，记帐本位币单位为元。
- (3)基金资产的估值方法
- A、上市证券按当日均价计算，该日无交易的证券，以最近一日的均价计算；
  - B、未上市的股票以其成本价计算；
  - C、未上市国债及银行存款以本金加计至估值日为止的应计利息额计算；
  - D、如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定基金资产价值时，基金管理人应按国家有关规定办理；
  - E、估值对象为基金所拥有的股票、国债和银行存款；
  - F、每日都对基金资产进行估值。

(4)基金的主要收入确认政策

- A、股息收入：在除息日确认应收股息；
- B、债券利息收入：在除息日确认应收利息；
- C、其他收入：在实际收到时确认；
- D、证券买卖价差收入：在实现成交的当日确认。

(5)证券成本的计价方法

按加权移动平均法计算库存证券的成本。当日有买入和卖出时，先计算成本后计算买卖证券价差。

A、股票

- (1)上交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成；
- (2)上交所卖出股票成本：由卖出股票的移动加权平均单价乘以卖出股数组成；
- (3)深交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成；
- (4)深交所卖出股票成本：由卖出股票的移动加权平均单价乘以卖出股数组成；
- (5)股票的佣金是按买卖股票成交金额的1‰减去经手费和证管费计算。

B、国债

- (1)买入债券成本：由买入金额、买入经手费、买入过户费组成；
- (2)卖出债券成本：由卖出国债的移动加权平均单价乘以卖出数量组成；
- (3)国债买卖不计佣金。

(6)税项说明

根据财税字〔1998〕55号《关于证券投资基金税收问题的通知》精神，对基金管理人运用基金资产买卖股票按4‰的税率征收印花税，暂对基金不征收营业税、所得税。

## (7)基金的收益分配政策

- A、每一基金单位享有同等分配权；
- B、收益分配比例不低于基金净收益的90%；
- C、基金收益分配采用现金方式，每年至少分配一次，于每个基金会计年度结束后四个  
月内实施；
- D、基金当年收益分配应先弥补上年亏损后，才进行当年收益分配；
- E、基金投资当年亏损，则不进行收益分配；

## 2、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
①国泰君安证券股份有限公司	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金750万份
	基金发起人	出租交易席位	席位使用协议	二个席位
②浙江省国际信托投资公司	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金750万份
③上海爱建信托投资公司	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金750万份
④国泰基金管理有限公司	基金管理人	提取管理费	基金契约	认购基金750万份
⑤中国建设银行	基金托管人	提取托管费	基金契约	
⑥华夏证券有限公司	席位出租人	出租交易席位	席位使用协议	二个席位
⑦南方证券有限公司	席位出租人	出租交易席位	席位使用协议	二个席位
⑧平安证券有限公司	席位出租人	出租交易席位	席位使用协议	二个席位
⑨国通证券有限责任公司	席位出租人	出租交易席位	席位使用协议	二个席位

### (2)、通过关联人席位交易情况

#### 通过关联人席位进行证券买卖2000年1—6月股票交易量及佣金情况

关联人	股票交易量(万元)	占成交量比例	佣金(万元)	占佣金量比例
国泰君安证券股份有限公司	92,152.42	17.62%	76.78	17.67%
华夏证券有限公司	105,389.55	20.13%	87.60	20.15%
南方证券有限公司	105,756.04	20.20%	88.07	20.27%
平安证券有限公司	107,898.67	20.61%	89.25	20.54%
国通证券有限责任公司	112,247.82	21.44%	92.88	21.37%
合 计	523,444.50	100.00%	434.58	100.00%

### (3)、基金管理人报酬

A、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

B、基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个  
工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人；

C、至2000年06月30日止，基金应支付基金管理人管理费共26,140,072.48元，其中已  
支付基金管理人21,265,902.88元，尚余4,874,169.60元未支付。

### (4)、基金托管人报酬

A、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

- B、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；  
C、至2000年06月30日止，基金应支付基金托管人托管费共4,439,955.25元，其中已支付基金托管人3,620,779.17元，尚余819,176.08元未支付。

### 3、主要报表项目说明

- (1)、应收帐款：2000年06月30日余额为人民币2,852,411.91元，为深交所席位交易保证金。  
(2)、应收申购款：2000年06月30日余额为人民币197,000,000.00元，为申购新股冻结的资金。  
(3)、证券买卖差价收入：2000年1—6月累计发生额为人民币515,277,659.99元，其中：

项    目	发  生  额
上海证券交易所挂牌股票	141,218,108.37元
深圳证券交易所挂牌股票	374,059,551.62元
合        计	515,277,659.99元

- (4)、基金费用：2000年1—6月累计发生额为人民币30,799,089.41元，其中：

费  用  项  目	发  生  额
管理人报酬	26,140,072.48元
托管人报酬	4,439,955.25元
回购利息支出	107,275.44元
上市年费	60,000.00元
会计师费	50,000.00元
邮电手续费等	1,786.24元
合    计	30,799,089.41元

### (三) 流通受限制的证券

- (1)、截至2000年06月30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)	成本(元)	市价(元)	市价与成本差	备注
1	大连金牛*	1999-12-8	待定	1,230,250	5,019,420.00	12,265,592.50	7,246,172.50	基金配售
2	长源电力*	2000-2-18	2000-8-18	534,600	3,261,060.00	7,585,974.00	4,324,914.00	基金配售
3	青岛碱业*	2000-2-18	2000-8-18	596,000	2,252,880.00	6,466,600.00	4,213,720.00	基金配售
4	桂冠电力*	2000-3-7	2000-9-7	610,000	3,910,100.00	10,839,700.00	6,929,600.00	基金配售
5	天水股份*	2000-3-20	2000-9-20	415,842	1,912,873.20	5,788,520.64	3,875,647.44	基金配售
6	沧州大化*	2000-3-20	2000-9-20	475,000	2,099,500.00	5,633,500.00	3,534,000.00	基金配售
7	特发信息*	2000-3-27	2000-9-27	415,841	3,285,143.90	12,130,081.97	8,844,938.07	基金配售
8	星新材料*	2000-4-3	2000-10-3	475,000	3,044,750.00	8,056,000.00	5,011,250.00	基金配售

9	首创股份*	2000-4-7	2000-10-7	1,780,000	15,984,400.00	39,035,400.00	23,051,000.00	基金配售
10	湖北迈亚*	2000-4-10	2000-10-10	326,700	1,444,014.00	4,237,299.00	2,793,285.00	基金配售
11	凌钢股份*	2000-4-10	2000-10-10	500,000	2,790,000.00	4,350,000.00	1,560,000.00	基金配售
12	赣粤高速*	2000-4-18	2000-10-18	715,000	7,865,000.00	12,126,400.00	4,261,400.00	基金配售
13	佛塑股份*	2000-4-19	2000-10-19	565,000	3,548,200.00	8,362,000.00	4,813,800.00	基金配售
14	丝绸股份*	2000-4-21	2000-10-21	630,000	2,633,400.00	7,774,200.00	5,140,800.00	基金配售
15	乌江电力*	2000-4-21	2000-10-21	465,000	3,069,000.00	6,933,150.00	3,864,150.00	基金配售
16	浪潮信息*	2000-4-24	2000-10-24	386,150	2,977,216.50	10,379,712.00	7,402,495.50	基金配售
17	广汇股份*	2000-4-24	2000-10-24	297,029	1,960,391.40	7,758,397.48	5,798,006.08	基金配售
18	首旅股份*	2000-4-27	2000-10-27	475,000	2,788,250.00	9,595,000.00	6,806,750.00	基金配售
19	春晖股份*	2000-4-28	2000-10-28	415,850	3,609,578.00	11,793,506.00	8,183,928.00	基金配售
20	兴业聚酯*	2000-4-28	2000-10-28	416,000	1,830,400.00	5,840,640.00	4,010,240.00	基金配售
21	神州股份*	2000-4-28	2000-10-28	922,500	4,243,500.00	9,409,500.00	5,166,000.00	基金配售
22	安泰科技*	2000-5-9	2000-11-9	356,450	5,339,621.00	15,038,625.50	9,699,004.50	基金配售
23	民丰特纸*	2000-5-11	2000-11-11	307,627	1,974,965.34	4,091,439.10	2,116,473.76	基金配售
24	纵横国际*	2000-5-19	2000-8-9	1,323,919	18,375,995.72	20,679,614.78	2,303,619.06	增发新股
25	金马股份*	2000-5-22	2000-11-22	340,100	1,867,149.00	4,421,300.00	2,554,151.00	基金配售
26	仕奇实业*	2000-5-23	2000-11-23	439,634	3,517,072.00	6,717,607.52	3,200,535.52	基金配售
27	兰光科技*	2000-5-23	2000-11-23	279,900	2,429,532.00	7,417,350.00	4,987,818.00	基金配售
28	隆平高科	2000-5-25	2000-11-25	645,000	8,372,100.00	8,372,100.00		基金配售
29	上实联合*	2000-6-9	2000-8-29	1,482,000	25,727,520.00	33,226,440.00	7,498,920.00	增发新股
30	南宁化工	2000-6-22	2000-7-12	108,000	502,200.00	502,200.00		二级市场
31	圣雪绒	2000-6-22	2000-7-6	95,000	817,000.00	817,000.00		二级市场
32	波导股份	2000-6-19	2000-9-23	100,000	1,600,000.00	1,600,000.00		预约申购
	波导股份	2000-6-23	2000-7-6	61,000	976,000.00	976,000.00		二级市场
33	诚志股份	2000-6-23	2000-7-6	103,000	1,019,700.00	1,019,700.00		二级市场
34	上港集箱	2000-6-28	2001-7-11	6,110,000	73,197,800.00	73,197,800.00		预约申购
35	凯乐股份	2000-6-28	2000-7-6	33,000	312,840.00	312,840.00		二级市场
合计				225,558,572.06	384,751,190.49	159,192,618.43		

## (2)、流通受限原因

上述三十五个股票为基金配售、增发新股或申购中签的未上市新股。

## (3)、受限期限

上述二十八只(带\*号)的股票为已上市未流通的新股，其中除了“纵横国际”、“上实联合”受限期限为自该股票上市日起不得少于二个月，其余各股均为自配售日起6个月后方可申请流通。

## (4)、估值办法

上述流通受限股票中有二十八只股票(带\*号)已上市流通。在编制本报表时,根据有关规定,在2000年06月30日按照均价估值,其余未上市流通的七只股票按成本价估值。若流通受限股票中已上市流通的二十八只股票(带\*号)按成本进行估值计算,本基金资产净值将为 3,940,581,443.14元,每份基金单位资产净值为 1.3135 元。

#### (四)期末基金持有股票明细(按市值占净值比例排序)

序	证券代码	股票名称	股数	市值	占净值比例
1	0801	四川湖山	4,180,654	218,731,817.28	5.34%
2	0525	红太阳	6,265,162	133,698,557.08	3.26%
3	0916	华北高速	15,600,069	125,112,553.38	3.06%
4	600664	哈药集团	6,746,115	96,401,983.35	2.35%
5	600104	上海汽车	7,050,820	95,256,578.20	2.33%
6	600601	方正科技	3,751,993	94,850,383.04	2.32%
7	0948	南天信息	3,051,644	94,387,348.92	2.30%
8	600176	中国化建	9,940,000	92,939,000.00	2.27%
9	600718	东大阿派	2,705,254	89,625,065.02	2.19%
10	0403	三九生化	3,064,658	83,726,456.56	2.04%
11	600018	上港集箱	6,110,000	73,197,800.00	1.79%
12	0657	中钨高新	4,257,484	71,866,329.92	1.75%
13	600642	申能股份	3,855,310	68,123,327.70	1.66%
14	0552	甘长风A	4,345,263	67,264,671.24	1.64%
15	0918	亚华种业	3,127,303	63,703,162.11	1.56%
16	600171	上海贝岭	2,707,952	62,147,498.40	1.52%
17	600177	雅戈尔	2,934,447	59,070,418.11	1.44%
18	600707	彩虹股份	3,667,163	56,694,339.98	1.38%
19	600866	星湖科技	3,450,720	56,005,185.60	1.37%
20	0767	漳泽电力	3,069,891	54,582,661.98	1.33%
21	0406	石油大明	4,290,090	54,484,143.00	1.33%
22	600828	成商集团	3,237,290	52,832,572.80	1.29%
23	600624	复华实业	2,903,205	50,370,606.75	1.23%
24	600895	张江高科	1,483,444	47,648,221.28	1.16%
25	600266	北京城建	2,916,640	45,207,920.00	1.10%
26	0919	金陵药业	1,687,831	43,546,039.80	1.06%
27	600008	首创股份	1,938,507	42,511,458.51	1.04%
28	600198	大唐电信	1,072,890	36,510,446.70	0.89%
29	0531	穗恒运A	2,546,298	33,254,651.88	0.81%
30	600607	上实联合	1,482,000	33,226,440.00	0.81%
31	0032	深桑达A	1,328,616	32,444,802.72	0.79%
32	600839	四川长虹	2,012,200	27,909,214.00	0.68%
33	600697	欧亚集团	1,953,088	27,870,565.76	0.68%
34	0542	TCL 通讯	1,205,430	27,604,347.00	0.67%
35	600673	成量股份	2,336,547	25,631,920.59	0.63%

36	0791	西北化工	2,761,960	25,492,890.80	0.62%
37	0956	中原油气	1,609,837	23,809,489.23	0.58%
38	600862	南通机床	1,323,919	20,679,614.78	0.50%
39	0697	咸阳偏转	957,686	19,718,754.74	0.48%
40	600656	浙江凤凰	1,439,122	16,693,815.20	0.41%
41	600500	中化国际	1,096,350	16,565,848.50	0.40%
42	0969	安泰科技	376,450	15,882,425.50	0.39%
43	0408	河北华玉	958,361	15,525,448.20	0.38%
44	0961	大连金牛	1,230,250	12,265,592.50	0.30%
45	0070	特发信息	415,842	12,130,111.14	0.30%
46	600269	赣粤高速	715,000	12,126,400.00	0.30%
47	0976	春晖股份	416,400	11,809,104.00	0.29%
48	600236	桂冠电力	614,995	10,928,461.15	0.27%
49	0977	浪潮信息	386,150	10,379,712.00	0.25%
50	600258	首旅股份	500,600	10,112,120.00	0.25%
51	0968	神州股份	922,500	9,409,500.00	0.23%
52	0998	隆平高科	645,000	8,372,100.00	0.20%
53	0973	佛塑股份	565,000	8,362,000.00	0.20%
54	600299	星新材料	475,000	8,056,000.00	0.20%
55	0301	丝绸股份	630,000	7,774,200.00	0.19%
56	600256	广汇股份	297,029	7,758,397.48	0.19%
57	0618	吉林化工	1,274,826	7,661,704.26	0.19%
58	0966	长源电力	534,600	7,585,974.00	0.19%
59	0963	华东医药	387,100	7,532,966.00	0.18%
60	0981	兰光科技	279,900	7,417,350.00	0.18%
61	0975	乌江电力	465,000	6,933,150.00	0.17%
62	600240	仕奇实业	439,634	6,717,607.52	0.16%
63	600229	青岛碱业	596,000	6,466,600.00	0.16%
64	600259	兴业聚酯	427,000	5,995,080.00	0.15%
65	600227	赤天化	471,900	5,964,816.00	0.15%
66	0965	天水股份	416,683	5,800,227.36	0.14%
67	0922	阿继电器	330,500	5,720,955.00	0.14%
68	600230	沧州大化	475,000	5,633,500.00	0.14%
69	0421	南京中北	461,539	5,330,775.45	0.13%
70	600083	PT红光	962,973	5,055,608.25	0.12%
71	0980	金马股份	340,100	4,421,300.00	0.11%
72	600231	凌钢股份	500,000	4,350,000.00	0.11%
73	0971	湖北迈亚	326,700	4,237,299.00	0.10%
74	600235	民丰特纸	307,627	4,091,439.10	0.10%
75	600130	宁波波导	161,000	2,576,000.00	0.06%
76	0990	诚志股份	103,000	1,019,700.00	0.02%
77	0982	圣雪绒	95,000	817,000.00	0.02%
78	600301	南宁化工	108,000	502,200.00	0.01%

79	600260	凯乐股份	33,000	312,840.00	0.01%
	合计		160,110,511	2,734,434,565.82	66.77%

## (五)、报告期内基金新增的股票明细

以下为通过二级市场购买而新增的股票

序号	股票代码	股票名称	购买数量	卖出数量	备注
1	600171	上海贝岭	4,983,709	2,275,757	二级市场购买
2	600624	复华实业	3,328,798	425,593	二级市场购买
3	600656	浙江凤凰	2,357,741	918,619	二级市场购买
4	600664	哈医药	6,779,212	33,097	二级市场购买
5	600673	成量股份	2,581,347	244,800	二级市场购买
6	600697	欧亚集团	2,459,365	506,277	二级市场购买
7	600707	彩虹股份	3,697,163	30,000	二级市场购买
8	600828	成商集团	3,622,616	385,326	二级市场购买
9	600839	四川长虹	2,012,200		二级市场购买
10	600866	星湖科技	3,450,720		二级市场购买
11	0403	宜春工程	3,124,824	60,166	二级市场购买
12	0406	石油大明	7,554,038	3,263,948	二级市场购买
13	0531	穗恒运A	3,824,549	1,278,251	二级市场购买
14	0542	TCL通讯	4,752,047	3,546,617	二级市场购买
15	0552	甘长风A	5,165,130	819,867	二级市场购买
16	0697	咸阳偏转	1,000,436	42,750	二级市场购买
17	0767	漳泽电力	3,544,369	474,478	二级市场购买
18	0922	阿继电器	330,500		二级市场购买
19	0956	中原油气	3,154,037	1,544,200	二级市场购买

以下为新股配售新增的股票(基金享有新股配售优先期间)

序号	股票代码	股票名称	购买数量	卖出数量	备注
1	600008	首创股份	3,560,000	1,621,493	基金配售
2	600227	赤天化	943,800	471,900	基金配售
3	600229	青岛碱业	1,192,000	596,000	基金配售
4	600230	沧州大化	950,000	475,000	基金配售
5	600231	凌钢股份	1,000,000	500,000	基金配售
6	600235	民丰特纸	615,255	307,628	基金配售
7	600236	桂冠电力	1,220,000	605,005	基金配售
8	600240	仕奇实业	879,267	439,633	基金配售
9	600256	广汇股份	594,059	297,030	基金配售
10	600258	首旅股份	950,000	449,400	基金配售
11	600259	兴业聚酯	832,000	405,000	基金配售
12	600269	赣粤高速	1,430,000	715,000	基金配售
13	600299	星新材料	950,000	475,000	基金配售
14	600500	中化国际	2,192,700	1,096,350	基金配售
15	0070	特发信息	831,683	415,841	基金配售

16	0301	丝绸股份	1,260,000	630,000	基金配售
17	0961	大连金牛	2,460,500	1,230,250	基金配售
18	0963	华东医药	674,200	287,100	基金配售
19	0965	天水股份	831,683	415,000	基金配售
20	0966	长源电力	1,069,200	534,600	基金配售
21	0968	神州股份	1,845,000	922,500	基金配售
22	0969	安泰科技	712,900	336,450	基金配售
23	0971	湖北迈亚	653,400	326,700	基金配售
24	0973	佛塑股份	1,130,000	565,000	基金配售
25	0975	乌江电力	930,000	465,000	基金配售
26	0976	春晖股份	831,700	415,300	基金配售
27	0977	浪潮信息	772,300	386,150	基金配售
28	0980	金马股份	680,200	340,100	基金配售
29	0981	兰光科技	559,800	279,900	基金配售
30	0998	隆平高科	645,000		基金配售

以下为二级市场申购新股新增的股票(基金取消新股配售优先之后)

序号	股票代码	股票名称	购买数量	卖出数量	备注
1	600130	波导股份	61,000		二级市场申购
2	600260	凯乐股份	33,000		二级市场申购
3	600301	南宁化工	108,000		二级市场申购
4	0982	圣雪绒	95,000		二级市场申购
5	0990	诚志股份	103,000		二级市场申购

以下为认购增发新股而新增的股票

序号	股票代码	股票名称	购买数量	卖出数量	备注
1	600607	上实联合	1,482,000		增发新股
2	600862	纵横国际	1,323,919		增发新股

以下为预约申购新股新增的股票(基金取消新股配售优先之后)

序号	股票代码	股票名称	购买数量	卖出数量	备注
1	600018	上港集箱	6,110,000		预约申购
2	600130	波导股份	100,000		预约申购

## (六)、报告期内基金剔除的股票明细

### 1、低市值组合股票

序号	股票代码	股票名称	买入数量	卖出数量
1	600055	万东医疗		176,828
2	600061	中纺投资		358,422
3	600067	福州大通		209,937
4	600070	浙江富润		240,671
5	600079	人福科技		156,048
6	600097	恒泰芒果		350,000

7	600109	成百集团		269, 980
8	600136	道博股份		250, 789
9	600137	长江包装		146, 640
10	600148	离合器		199, 900
11	600162	山东临工		379, 940
12	600193	厦门大洋		229, 902
13	600605	轻工机械		250, 000
14	600606	金丰投资		17, 628
15	600610	ST中纺机		373, 290
16	600612	第一铅笔		248, 891
17	600613	永生股份		200, 000
18	600614	胶带股份		199, 730
19	600615	丰华园珠		259, 190
20	600617	联华合纤		199, 460
21	600618	氯碱化工		236, 900
22	600619	冰箱压缩		178, 009
23	600623	轮胎橡胶		249, 400
24	600625	ST水仙		194, 460
25	600645	望春花		340, 000
26	600647	ST粤海发		209, 600
27	600648	外高桥		249, 900
28	600650	新锦江		331, 155
29	600659	福建福联		309, 600
30	600676	交运股份		250, 000
31	600679	凤凰股份		227, 360
32	600680	上海邮通		269, 965
33	600687	国泰股份		239, 450
34	600691	ST东碳		330, 300
35	600692	亚通股份		159, 177
36	600695	大江股份		205, 606
37	600706	长安信息		209, 300
38	600711	雄震集团		149, 400
39	600714	山川股份		249, 598
40	600721	百花村		459, 923
41	600724	宁波富达		118, 098
42	600725	云维股份		370, 000
43	600749	西藏圣地		246, 611
44	600754	新亚股份		389, 925
45	600756	泰山旅游		269, 752
46	600758	ST金帝		286, 640
47	600762	飞龙实业		269, 946
48	600763	北京中燕		399, 470

49	600765	力源液压		333, 316
50	600768	宁波华通		112, 930
51	600773	西藏金珠		186, 031
52	600774	汉商集团		265, 000
53	600775	ST熊猫		244, 800
54	600782	新华股份		269, 650
55	600786	东方锅炉		492, 770
56	600791	贵华旅业		237, 851
57	600792	云南马龙		149, 916
58	600794	大理造纸		326, 343
59	600801	华新水泥		479, 920
60	600818	ST永久		199, 077
61	600822	物贸中心		199, 340
62	600824	益民百货		404, 590
63	600825	时装股份		72, 700
64	600827	友谊华侨		268, 388
65	600829	天鹅股份		330, 000
66	600831	ST黄河科		459, 912
67	600833	ST网点		339, 428
68	600841	上柴股份		249, 300
69	600843	上工股份		198, 900
70	600844	英雄股份		269, 921
71	600845	上海钢管		98, 300
72	600847	ST渝万里		390, 000
73	600848	自仪股份		329, 995
74	600850	华东电脑		162, 280
75	600851	海欣股份		246, 878
76	600860	北人股份		500, 000
77	600864	岁宝热电		449, 570
78	600869	青海三普		299, 276
79	600875	东方电机		596, 257
80	600876	ST洛玻		505, 900
81	600880	四川电器		199, 980
82	600883	云南保山		141, 000
83	600888	新疆众和		241, 220
84	600892	ST石劝业		76, 950
85	0004	ST深安达		409, 947
86	0014	ST深华源		449, 912
87	0015	ST中浩A		179, 500
88	0018	ST深中冠A		200, 941
89	0019	深深宝A		300, 000
90	0025	深特力A		339, 050

91	0028	深益力A		299, 940
92	0030	ST英达A		399, 949
93	0035	中科健A		140, 915
94	0037	深南电A		179, 716
95	0038	深大通A		189, 271
96	0043	深南光A		200, 334
97	0045	深纺织A		220, 000
98	0047	深中桥A		225, 100
99	0050	深天马A		66, 579
100	0056	深国商		279, 884
101	0065	深圳西林		199, 180
102	0411	凯地丝绸		310, 000
103	0413	ST宝石A		289, 600
104	0416	青岛国货		319, 852
105	0417	合肥百货		229, 740
106	0517	甬成功		120, 260
107	0526	ST厦海发		220, 000
108	0536	ST闽闽东		419, 369
109	0540	中天企业		262, 270
110	0555	ST黔凯涤		209, 690
111	0590	古汉集团		279, 214
112	0591	桐君阁		289, 938
113	0593	成都华联		162, 800
114	0596	古井贡A		199, 918
115	0602	金马集团		268, 065
116	0603	威达医械		280, 000
117	0605	中联建设		196, 556
118	0606	青海明胶		190, 000
119	0607	ST重仪		341, 365
120	0611	民族集团		496, 205
121	0613	ST东海A		149, 007
122	0615	湖北金环		349, 920
123	0616	大连渤海		209, 377
124	0617	石油济柴		319, 970
125	0619	红星宣纸		148, 800
126	0622	岳阳恒立		391, 980
127	0632	三木集团		224, 188
128	0638	中辽国际		451, 681
129	0639	ST株庆云		276, 916
130	0650	九江华纤		279, 338
131	0655	华光陶磁		165, 996
132	0658	海洋集团		317, 100

133	0662	广西康达		289, 219
134	0666	经纬纺机		237, 910
135	0669	ST吉诺尔		159, 970
136	0671	石狮新发		277, 486
137	0672	铜城集团		130, 500
138	0675	银山华工		329, 867
139	0676	河南思达		249, 939
140	0678	襄阳轴承		225, 796
141	0685	佛山兴华		59, 840
142	0686	锦州六陆		269, 912
143	0689	宏业集团		259, 609
144	0710	天兴仪表		296, 359
145	0711	龙发股份		296, 532
146	0719	焦作碱业		265, 000
147	0736	重庆实业		134, 200
148	0756	新华制药		119, 195
149	0802	京西旅游		299, 974
150	0805	金狮股份		165, 805
151	0809	第一纺织		349, 923
152	0810	四川锦华		114, 000
153	0811	烟台冰轮		172, 800
154	0827	大龙泉		219, 977
155	0835	隆源实业		36, 648
156	0838	西南化机		126, 680
157	0851	中国七砂		435, 400
158	0861	茂化永业		158, 000
159	0863	北商技术		122, 460

## 2、其他剔除股票

序号	股票代码	股票名称	买入数量	卖出数量
1	600000	浦发银行		185, 000
2	600072	江南重工		1, 983, 022
3	600073	上海梅林	1, 124, 200	1, 124, 200
4	600111	稀土高科		1, 157, 106
5	600123	兰花煤业	4, 243, 510	4, 942, 960
6	600197	伊力特		853, 453
7	600200	江苏吴中		850, 191
8	600207	安彩高科		498, 268
9	600262	北方股份	252, 000	252, 000
10	600300	维维股份	25, 000	25, 000
11	600616	第一食品	4, 986, 439	5, 336, 365
12	600620	天宸股份		941, 101

13	600636	三爱富	130,990	1,748,944
14	600639	浦东金桥	890,965	1,415,712
15	600643	爱建股份		3,012,890
16	600663	陆家嘴	512,628	1,011,089
17	600675	中华企业	1,056,648	1,056,648
18	600805	江苏悦达	1,420,000	1,420,000
19	600817	良华实业		170,049
20	600820	隧道股份		1,223,787
21	600821	津劝业	1,784,747	1,784,747
22	600836	界龙实业	168,000	1,890,967
23	600894	广钢股份	3,097,715	3,097,715
24	0016	深康佳A		517,901
25	0017	ST中华A	6,735,753	9,346,441
26	0024	深招港A	360,000	360,000
27	0061	农产品	1,209,000	1,209,000
28	0066	长城电脑		690,271
29	0089	深圳机场	1,220,930	1,220,930
30	0513	丽珠集团		1,101,953
31	0583	托普软件	773,065	773,065
32	0733	振华科技	1,458,667	1,458,667
33	0798	中水渔业		1,385,975
34	0800	一汽轿车		322,522
35	0817	辽河油田		1,393,899
36	0837	秦川发展	311,520	1,795,481
37	0877	天山股份		860,018
38	0915	声乐股份	1,738,760	1,738,760
39	0931	中关村	330,000	4,917,795
40	0962	东方钽业	438,200	438,200
41	0988	华工科技	200,000	200,000
42	0989	九芝堂	172,000	172,000

## (七) 基金投资组合

### 1、按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	数量	市 值(元)	占净值比例
1	交通 运输	22,886,608	215,767,528.83	5.27%
2	能 源 电 力	12,008,594	190,817,726.71	4.66%
3	建 材 建 筑	4,291,684	66,533,595.56	1.62%
4	冶 金	6,364,184	104,364,347.92	2.55%
5	机 械 制 造	3,660,466	46,311,535.37	1.13%
6	电 子 通 讯	30,594,610	854,294,613.48	20.86%
7	石 油 化 工	34,612,984	500,386,293.61	12.22%

8	生物医药	12,271,766	203,486,174.75	4.97%
9	汽车及配件制造	7,390,920	99,677,878.20	2.43%
10	纺织服装	5,907,781	111,842,964.63	2.73%
11	家电	7,315,149	114,892,639.98	2.81%
12	酿酒食品			
13	商贸旅游	6,787,328	107,381,107.06	2.62%
14	金融地产			
15	农林牧渔	3,772,303	72,075,262.11	1.76%
16	综合	2,246,134	46,602,897.61	1.14%
	合计	160,110,511	2,734,434,565.82	66.77%

## 2、国债及货币资金合计

截止2000年6月30日，基金持有的国债及货币资金合计为1,630,533,201.41元，占基金资产净值的39.82%，其中国债市值为821,078,644.69元，占基金资产净值的20.05%。

## 3、占基金资产净值前十名的股票

序号	名称	数量	市值(元)	占净值比例
1	四川湖山	4,180,654	218,731,817.28	5.34%
2	红太阳	6,265,162	133,698,557.08	3.26%
3	华北高速	15,600,069	125,112,553.38	3.06%
4	哈药集团	6,746,115	96,401,983.35	2.35%
5	上海汽车	7,050,820	95,256,578.20	2.33%
6	方正科技	3,751,993	94,850,383.04	2.32%
7	南天信息	3,051,644	94,387,348.92	2.30%
8	中国化建	9,940,000	92,939,000.00	2.27%
9	东大阿派	2,705,254	89,625,065.02	2.19%
10	三九生化	3,064,658	83,726,456.56	2.04%

## 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、利息、应付管理费、托管费、佣金及其他应收应付款项合计为贷方余额269,843,105.66元，与基金股票市值2,734,434,565.82元和国债及货币资金1,630,533,201.41元相抵减后等于基金资产净值。

## 五、基金持有人结构及前十名持有人

### (一)、截止2000年06月30日，本基金份额结构为：

	期末持有数	比例
发起人持有	30,000,000份	1.00%
其中：国泰君安证券股份有限公司	7,500,000份	0.25%
上海爱建信托投资公司	7,500,000份	0.25%

浙江省国际信托投资公司	7,500,000份	0.25%
国泰基金管理有限公司	7,500,000份	0.25%
社会公众持有	2,970,000,000份	99.00%
合 计	3,000,000,000份	100.00%

(二) 截止2000年06月30日，本基金共有持有人377,049人，前十名持有人名称、持有份额及比例例如下：

序号	持有人姓名	期末持有数	持有比例
1	中国人寿	174,676,800	5.82%
2	中电天证	22,000,000	0.73%
3	久事大厦	20,000,000	0.67%
4	浦东子逸	17,975,000	0.60%
5	国投开发	14,400,000	0.48%
6	钢研新锐	13,500,000	0.45%
7	浙沪杭甬	10,000,000	0.33%
8	内蒙信托	9,830,700	0.33%
9	葛高庆	9,000,000	0.30%
10	毛亚珍	9,000,000	0.30%

## 六、重要事项揭示

- 经本基金托管人中国建设银行复核，本基金中期不进行收益分配，纳入年末一次性分配。
- 2000年3月29日，本公司在有关证券报刊上公布了《金鑫证券投资基金一九九九年度报告》。

3、在报告期内，关联人席位股票、国债的交易量及佣金(单位为万元)情况为：

关联人	股票成交量	比例	国债成交量	比例	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安证券股份有限公司	92,152.42	17.62%	9,390.29	36.33%	76.78	17.66%	0.08%
华夏证券有限公司	105,389.55	20.13%			87.60	20.16%	0.08%
南方证券有限公司	105,756.04	20.20%			88.07	20.27%	0.08%
国通证券有限责任公司	112,247.82	21.44%	16,460.02	63.67%	92.88	21.37%	0.08%
平安证券有限公司	107,898.67	20.61%			89.25	20.54%	0.08%
合 计	523,444.50	100.00%	25,850.31	100.00%	434.59	100.00%	0.08%

在本报告期内，基金专用交易席位无变更情况，各席位均符合证监会规定的有关交易比例即通过一个证券经营机构买卖证券年交易量不得超过该基金买卖证券年成交量的30%。

4、在报告期内，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及基金的会计师事务所无变动情况。

## 七、备查文件目录

- 关于同意设立金鑫证券投资基金的批复

- 2、金鑫证券投资基金契约
- 3、金鑫证券投资基金托管协议
- 4、金鑫证券投资基金 1999 年年度报告
- 5、金鑫证券投资基金 2000 年中期报告原件
- 6、报告期内披露的各项公告原件
- 7、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)62531534

公司网址：<http://www.gtfund.com>

**国泰基金管理有限公司**

**2000 年 8 月 30 日**