

金鑫证券投资基金 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

上海爱建信托投资有限责任公司

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：至 2014 年 10 月 20 日止

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 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	-67,510,862.26元
单位基金本期净收益	-0.0225元
基金可分配净收益	110,935,069.48元
单位基金可分配净收益	0.0370元
期末基金资产总值	3,370,565,821.90元
期末基金资产净值	3,110,935,069.48元
单位基金资产净值	1.0370元
基金资产净值收益率	-2.24%
本期基金资产净值增长率	3.08%
基金累计资产净值增长率	27.89%

(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 = (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) 基金管理小组介绍

本基金由钱华先生 (基金经理) 和崔海峰先生 (基金经理助理) 组成基金管理小组。

基金经理: 钱华先生, 38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。1998年加盟国泰基金管理有限公司, 历任国泰基金管理有限公司总经理助理兼研究发展部总监、基金管理部总监等职务。

基金经理助理: 崔海峰先生, 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, 先后从事过基金新产品开发和行业研究工作, 现担任金鑫基金经理助理。

(二) 投资理念和风格

1、投资理念:

本基金自设立以来, 一直坚持自己的投资理念。

- (1) 控制风险, 追求收益: 作为专业的投资管理人, 本基金不单纯追求高收益。在构建投资组合时, 同时考虑风险和收益两个指标。本基金追求的是, 在一定风险前提下, 使收益最大化; 或在追求一定收益的前提下, 使所承担的风险最小化。投资组合的市盈率水平是衡量风险的一个重要指标。
- (2) 价值发现: 本基金选择投资对象的主要依据是上市公司的内在价值, 只有当公司内在价值被市场所低估时才具有投资价值。我们根据公司的赢利能力、市场扩张能力和技术创新能力等综合指标来判断其内在价值。本基金认为, 考察一个公司乃至一个行业的市盈率不能简单地看其绝对值, 还应该考察市盈率的波动情况。基于相对稳定业绩的市盈率才有意义。
- (3) 投资蓝筹股: 中国股市处于发展阶段, 被市场上公认的蓝筹股并不多。但作为投资管理人, 本基金努力寻找潜在的蓝筹股。蓝筹股的一个重要特征是公司股本规模较大, 在行业中处于举足轻重的地位。这一

点是同本基金的重点投资方向----国企大盘股，有相同之处。本基金认为，蓝筹股除了具有一定的规模之外，还应该具备两个特征：属于具有良好发展前景的行业和拥有稳定的业绩。

2、投资风格：

- (1) 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性风险。本基金力求在集中投资和分散投资之间取得平衡，体现相对集中的原则，即将本基金的大部分资产相对均衡地投资于30-50个股票上，同时在一只股票上不投入过多的资金，以有效控制流动性风险。
- (2) 行业相对平衡：在构建投资组合时，采取自下而上和自上而下相结合的选股策略。本基金管理人定期检讨投资组合的行业比例。根据行业研究报告，增持成长性较好的行业，相应减持成长性较差的行业，本基金尤其注重行业的景气周期阶段和变化，对所选行业采取相对平衡的策略。在本基金的投资组合中，没有比重过大的行业。
- (3) 投资组合的整体市盈率低于市场平均水平：在构建投资组合时，本基金严格控制组合的市盈率，力求将其控制在市场平均水平之下。

(三) 2002年上半年投资管理回顾

1、形势分析

2002年上半年国民经济在平稳中保持较快增长，据国家统计局公布，一季度增长7.6%，二季度增长8.0%，呈现小幅回升的态势，为实现全年经济增长7.5%的预期目标奠定了良好的基础。但发展中也存在一些值得注意的问题，主要是财政收入增长减缓，许多行业继续处于结构调整并未有效突破，物价水平低位运行，下岗失业人数仍然较多，农村需求增长缓慢，重大特大安全事故时有发生等。从外部环境看，美国经济复苏乏力，包括出现的一系列的华尔街丑闻，对投资者的信心打击较大，日本经济也没看到很强的反弹迹象，而欧洲经济仍然是不温不火，总体上看全球经济正处在一个调整时期。

证券市场方面，在2001年下半年以来股市疲弱不振的背景下，2002年上半年管理层的政策基调发生了转变，稳定成为当前政策的基本着眼点。基于这种政策导向，继去年底管理层暂停减持国有股及下调印花税之后，今年以来，利好股市的政策措施频频推出；例如，2月份央行宣布降低金融机构人民币存、贷款利率，4月份下调证券交易佣金，5月份恢复向二级市场投资者配售新股的发行方式，6月份对增发新股抬高门槛，直至6月23日国务院决定对国内上市公司停止执行《减持国有股筹集社会保障资金管理暂行办法》中关于利用证券市场减持国有股的规定。这一系列政策充分表达了管理层在现阶段以稳定为主的调控意图。

上半年市场结束了01年下半年以来的单边下跌态势，处于平衡偏淡的震荡格局中，大致分为3个阶段：第一阶段，大致时间1月到3月初，该阶段基本处于市场单边下跌走势结束及投资者心态的调整阶段，从1月份承接01年底弱势盘跌走势，上证指数触底1339点后，在低价股、问题股带动下开始反弹，在3月初两会期间加速上扬；第二阶段，3月中下旬到4月底，市场三次冲击1700点，虽扭亏股、重组股有所表现，但热点难集中持续，无功而返，国有股减持问题的不确定性成为市场信心缺乏的重要原因之一；第三阶段，市场在冲击高点无功而返后，开始较大幅度下调，上证指数一度突破1500点，到1455点，随后开始反弹，历史龙头股、外资并购股、深圳本地股表现活跃，最后在6月23日国有股减持被叫停

情况下，市场以井喷形式突破02年上半年高点，上证指数回到1700点附近。回顾02年上半年，市场的价值中位值处于上证指数1550-1600点，而市场运行上，实际上攻的时间很短，盘整时间则较长，整体表现活跃的板块基本是低价股，表明市场虽然结束了单边下跌态势，但心态还是处于谨慎状态。

2、基金运作情况

本基金在2002年上半年的股票操作策略是在保持相对较高仓位（50%以上）的同时，进行了结构调整。这种策略实行的结果是在大盘反弹时，本基金净值的反弹力度较大，而在大盘下跌时，本基金下跌幅度也较大。由于上半年市场大部分时间处于调整阶段，所以本基金的表现与年初确定的目标存在一定差距。这说明上半年的操作策略有值得反思之处。

上半年操作中值得肯定的地方有：一是坚持既定的投资策略，将投资组合的市盈率控制在市场平均水平之下。由于采取相对低风险的投资策略，所以在1、2月份市场大幅下跌时，投资组合表现出一定的抗跌性，在3月份市场反弹时投资组合又能跟上大盘的反弹力度，在6月24日大盘接近涨停时，本基金以54%的仓位，获得了接近6%的涨幅。从整个上半年看，本基金的投资组合是比较健康的，风险较低，而投资收益保持中等水平。二是操作方向正确。02年初市场单边下调，本基金采取了减仓操作，当大盘跌到1400点（上证指数）以下时，本基金则进行增仓操作；进入3月份后，本基金较早地大规模增持股票。本基金之所以在一季度战胜大盘，在6月底较快速地反弹，与正确的操作方向不可分。

上半年需要总结的教训有：一是市场反应的敏感性不够，市场下跌前减仓不够坚决，导致净值损失较大；二是在对市场趋势有了正确判断后，操作力度不够，操作意图未能在规模上充分体现出来。

固定收益投资总结：

在2002年度上半年采取了稳健灵活的固定收益投资管理策略，即在债券期限结构上的稳健性与投资运作上的灵活性相结合。

- （1）在5月底以前采用了短期债券与结合中长期债券相结合的投资模式，在控制利率风险暴露水平的同时，把握了债券市场的投资机会；
- （2）在六月初开始，基金大幅度地降低了固定收益证券中的中长期债券比重，大幅度缩减了利率风险水平，及时回避了六月份开始的债券市场的下跌。

综合而言，2002年上半年基金在固定收益证券上的投资取得了比较满意的投资回报。

（四）2002年市场展望

本基金小组对下半年市场持谨慎乐观的态度，预计下半年将呈现出较上半年相对强势的格局。主要理由有：

- 1、国民经济运行平稳，已经显示的信息表明，全年实现7%增长的可能性很大。股市是国民经济的晴雨表，经济平稳增长，股市没有大跌的理由。
- 2、十六大将于11月份召开，社会各行业都将会有一个平稳的时期。目前的证券市场规模已相对较大，影响面已很宽，对其稳定的要求也越来越高。
- 3、停止国有股在国内证券市场减持以及提高增发门槛等措施使市场信心已得到基本恢复。
- 4、预计下半年还会有利好政策出台，例如，基金业扩容、商业保险公司提

- 高入市比例等，证券市场的资金供应环境还会进一步改善。
- 5、上市公司中报将好于去年年报，市场平均市盈率水平将有所下降。
 - 6、但由于以美国为首的世界经济的调整尚未结束，国内上市公司的盈利状况在短期内也难以出现大幅增长，故强势亦是相对而言。

在债券方面，本基金认为2002年下半年的债券市场将以收益率曲线的结构性调整为基调，以新的投资品种为主方向展开，本基金将根据对经济基本面的变动充分分析并把握固定收益证券市场的机会。

在股票方面，本基金将采取谨慎乐观的态度，继续保持相对较高的股票仓位，将结构调整和波段操作有机地结合起来，力求做到：随市场相对高低位的阶段变化在股票仓位上有明显的增减变化，体现波段操作的意图；力争使本基金的业绩在下半年达到中等以上水平。

（五）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爲，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《金鑫证券投资基金契约》和《金鑫证券投资基金托管协议》，托管金鑫证券投资基金（以下简称“金鑫基金”）。

2002年上半年，中国建设银行在金鑫基金的托管过程中，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鑫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，由金鑫基金管理人 - 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鑫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	588,895,490.74	367,375,146.07	应付证券清算款	11,959,220.98	2,988,654.88
清算备付金	3,805,979.34	5,678,492.02	应付赎回款		
交易保证金	31,464.67	151,900.08	应付赎回费		
应收证券清算款		53,031,952.25	应付管理人报酬	4,134,808.34	3,611,474.83
应收股利			应付托管费	689,134.74	601,912.47
应收利息	2,251,006.83	21,913,880.78	应付佣金	521,131.33	711,756.20
应收申购款			应付利息	134,794.47	108,147.80
其他应收款	27,411.35		应付收益		
股票投资市值	1,961,268,781.12	1,977,020,047.32	未交税金		
其中：股票投资成本	2,138,870,399.07	2,008,912,222.45	其他应付款	71,131.32	1,264,879.63
债券投资市值	733,188,311.80	945,394,403.38	卖出回购证券款	50,000,000.00	250,000,000.00
其中：债券投资成本	728,601,838.80	925,328,852.15	短期借款		
配股权证			预提费用	320,000.00	343,926.61
买入返售证券			其他负债		
待摊费用			负债合计	67,830,221.18	259,630,752.42
其他资产			持有人权益：		
			实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
			未实现利得	-173,015,144.95	-11,826,623.90
			未分配收益	394,653,369.62	122,761,693.38
			持有人权益合计	3,221,638,224.67	3,110,935,069.48
资产总计	3,289,468,445.85	3,370,565,821.90	负债及持有人权益总计	3,289,468,445.85	3,370,565,821.90

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	395,716,277.45	-38,303,403.96
1、股票差价收入	361,307,333.76	-99,162,996.32
2、债券差价收入	2,709,612.52	33,423,548.36
3、债券利息收入	10,245,431.73	17,296,193.57
4、存款利息收入	7,765,287.86	3,281,986.04
5、股利收入	13,344,988.22	6,432,764.13
6、买入返售证券收入		
7、其他收入	343,623.36	425,100.26
二、费用	45,042,554.23	29,207,458.30
1、基金管理人报酬	29,136,000.94	22,696,458.08
2、基金托管费	4,996,997.35	3,782,743.00
3、卖出回购证券支出	8,945,543.34	1,827,160.24
4、利息支出		
5、其他费用	1,964,012.60	901,096.98
其中：上市年费	60,000.00	29,752.78
信息披露费		158,684.51
审计费用		49,588.57
三、基金净收益	350,673,723.22	-67,510,862.26
加：未实现利得	-23,490,497.56	161,188,521.05
四、基金经营业绩	327,183,225.66	93,677,658.79

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	350,673,723.22	-67,510,862.26
加：期初基金净收益	676,272,943.79	394,653,369.62
加：本期损益平准金		
加：以前年度损益调整		-380,813.98
可供分配基金净收益	1,026,946,667.01	326,761,693.38
减：本期已分配基金净收益	612,000,000.00	204,000,000.00
期末基金净收益	414,946,667.01	122,761,693.38

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	3,221,638,224.67
二、本期经营活动：	
基金净收益	-67,510,862.26
未实现利得	161,188,521.05
经营活动产生的基金净值变动数	93,677,658.79
以前年度损益调整	-380,813.98
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	204,000,000.00
五、期末基金净值	3,110,935,069.48

(二) 会计报告书附注

1、基金简介

金鑫证券投资基金（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”）、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和国泰基金管理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[1999]29号文）批准，于1999年10月21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30亿份基金单位。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行。

本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）（上证上字[1999]第76号文）审核同意，于1999年11月26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[1999]29号文的规定，本基金的投资对象为国内依法公开发行的股票、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：

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：

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：

2001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。

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4,935,700.29元，债券投资成本减少5,316,514.27元，两者差额-380,813.98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	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金750万份
	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	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金750万份
上海爱建信托投资有限责任公司	基金发起人	发起认购基金	基金契约	认购基金750万份
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750万份
	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

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	30,315.04	19.07%	23.81	19.01%

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	27,338.38	19.64%

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	57,000.00	35.51%

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	122,000.00	101.16

与关联人进行国债买卖2002年1-6月交易量(万元)情况

关联人	交易量
国泰君安	12,375.40

(3) 基金管理人报酬

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值20%，超出部分不计提管理费。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

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

在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共22,696,458.08元，其中已支付基金管理人19,084,983.25元，尚余3,611,474.83元未支付。

(4) 基金托管人报酬

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

在本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共3,782,743.00元，其中已支付基金托管人3,180,830.53元，尚余601,912.47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151,900.08元，系深交所席位交易保证金。
- (2) 应收利息：2002年6月30日余额为21,913,880.78元，系应收银行存款和清算备付金利息173,439.56元及应收债券利息21,740,441.22元。
- (3) 其他应付款：2002年6月30日余额为1,264,879.63元，系应缴股利税金1,243,176.75元及暂收席位印花税返回款21,702.88元。
- (4) 预提费用：2002年6月30日余额为343,926.61元，系预提基金2002年度审计费用49,588.57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。

- (5) 其他收入：2002年1 - 6月累计发生额为425,100.26元，包括债券发行手续费返还250,200.00元，新股中签手续费返还166,038.22元及印花税返还8,862.04元。
- (6) 卖出回购证券支出：2002年1 - 6月累计发生额为1,827,160.24元，系卖出回购证券在融资期限内逐日计提的利息支出。
- (7) 应由基金承担的其他费用：2002年1 - 6月累计发生额为901,096.98元，包括上市年费29,752.78元，信息披露费158,684.51元，审计费用49,588.57元，2001年度分红手续费612,000.00元，回购交易费用26,875.00元及其他费用24,196.12元。
- (8) 未实现利得：2002年1 - 6月累计发生额为161,188,521.05元，包括本期因投资估值增值产生的未实现利得160,807,707.07元及以前年度损益调整380,813.98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	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	*招商银行	2002-4-1	2002-12-10	4,302,220	31,406,206.00	49,217,396.80	17,811,190.80	网下申购
2	安源股份	2002-6-20	2002-7-2	93,000	557,070.00	557,070.00	-	二级市场配售
3	泰豪科技	2002-6-24	2002-7-3	31,000	147,560.00	147,560.00	-	二级市场配售
4	宏智科技	2002-6-27	2002-7-9	22,000	190,960.00	190,960.00	-	二级市场配售
	合计				32,301,796.00	50,112,986.80	17,811,190.80	

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“招商银行”(带*号)为已上市未流通的新股，受限期为8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6月30日，本基金资产净值将为3,093,123,878.68元，每份基金单位资产净值为1.0310元。

(四) 期末基金持有股票明细 (按市值占净值比例排序)

序	股票代码	股票名称	库存数量	市值	占净值比例
1	000895	双汇发展	9,220,058	116,910,335.44	3.76%
2	000916	华北高速	14,362,403	87,754,282.33	2.82%
3	600664	哈药集团	5,738,694	84,014,480.16	2.70%
4	000786	北新建材	10,587,894	83,326,725.78	2.68%
5	600018	上港集箱	3,999,663	79,713,283.59	2.56%
6	600642	申能股份	5,873,218	78,466,192.48	2.52%
7	600176	中国化建	8,638,307	77,485,613.79	2.49%
8	600016	民生银行	6,038,781	76,028,252.79	2.44%
9	000973	佛塑股份	6,507,411	72,232,262.10	2.32%
10	600500	中化国际	4,752,527	71,953,258.78	2.31%
11	600219	南山实业	5,129,341	69,707,744.19	2.24%
12	600630	龙头股份	6,837,688	66,052,066.08	2.12%
13	000919	金陵药业	3,649,375	61,966,387.50	1.99%
14	600320	振华港机	4,469,634	59,803,702.92	1.92%
15	600311	荣华实业	4,640,548	59,259,797.96	1.90%
16	600052	浙江广厦	5,910,030	51,417,261.00	1.65%
17	600036	招商银行	4,302,220	49,217,396.80	1.58%
18	600361	北京华联	2,667,399	47,693,094.12	1.53%
19	000421	南京中北	4,577,295	46,139,133.60	1.48%
20	600299	星新材料	2,911,634	43,499,811.96	1.40%
21	600321	国栋建设	2,264,746	33,971,190.00	1.09%
22	000525	红太阳	3,716,106	32,367,283.26	1.04%
23	000584	蜀都A	2,316,847	31,393,276.85	1.01%
24	600008	首创股份	2,185,928	31,324,348.24	1.01%
25	600380	太太药业	1,798,550	30,809,161.50	0.99%
26	600168	武汉控股	2,533,022	27,812,581.56	0.89%
27	000983	西山煤电	3,005,200	27,046,800.00	0.87%
28	000406	石油大明	2,062,890	26,136,816.30	0.84%
29	600266	北京城建	1,954,507	25,291,320.58	0.81%
30	600104	上海汽车	3,037,888	23,574,010.88	0.76%
31	600697	欧亚集团	2,284,297	23,071,399.70	0.74%
32	000918	亚华种业	1,943,290	22,561,596.90	0.73%
33	000655	华光陶瓷	1,575,167	20,886,714.42	0.67%
34	000733	振华科技	1,588,035	18,389,445.30	0.59%
35	000659	珠海中富	2,053,680	18,339,362.40	0.59%
36	600866	星湖科技	1,636,849	17,416,073.36	0.56%
37	600028	中国石化	4,005,000	15,619,500.00	0.50%
38	000956	中原油气	1,396,548	14,831,339.76	0.48%
39	600583	海油工程	752,122	12,846,243.76	0.41%
40	000961	大连金牛	1,599,325	12,058,910.50	0.39%

41	600637	广电信息	800,332	11,732,867.12	0.38%
42	600260	凯乐科技	574,219	10,255,551.34	0.33%
43	600498	烽火通信	441,000	9,274,230.00	0.30%
44	600598	北大荒	1,106,773	8,964,861.30	0.29%
45	600236	桂冠电力	614,995	8,296,282.55	0.27%
46	000948	南天信息	477,997	7,777,011.19	0.25%
47	600177	雅戈尔	652,638	7,348,703.88	0.24%
48	600662	强生控股	520,000	6,011,200.00	0.19%
49	600037	歌华有线	210,730	5,799,289.60	0.19%
50	000565	渝三峡A	600,000	5,742,000.00	0.18%
51	600085	同仁堂	287,740	5,490,079.20	0.18%
52	600830	大红鹰	391,270	5,344,748.20	0.17%
53	600681	诚成文化	445,666	4,510,139.92	0.14%
54	600171	上海贝岭	271,100	4,332,178.00	0.14%
55	600010	钢联股份	700,000	4,109,000.00	0.13%
56	600748	浦东不锈	300,000	3,480,000.00	0.11%
57	600350	山东基建	487,000	2,756,420.00	0.09%
58	000542	TCL 通讯	156,600	2,638,710.00	0.08%
59	600026	中海发展	316,000	2,186,720.00	0.07%
60	600548	深高速	229,016	2,148,170.08	0.07%
61	000869	张裕A	110,205	2,126,956.50	0.07%
62	600019	宝钢股份	243,708	1,133,242.20	0.04%
63	600505	西昌电力	69,000	1,026,030.00	0.03%
64	600426	华鲁恒升	59,000	836,620.00	0.03%
65	600355	精伦电子	24,000	663,600.00	0.02%
66	600327	大厦股份	35,000	597,450.00	0.02%
67	600595	中孚实业	36,000	592,560.00	0.02%
68	600510	黑牡丹	27,000	559,710.00	0.02%
69	600397	安源股份	93,000	557,070.00	0.02%
70	600428	中远航运	39,000	506,220.00	0.02%
71	600580	卧龙科技	27,000	505,170.00	0.02%
72	600486	扬农化工	25,000	443,250.00	0.01%
73	600496	长江股份	30,000	431,700.00	0.01%
74	600503	宏智科技	22,000	190,960.00	0.01%
75	600590	泰豪科技	31,000	147,560.00	0.00%
76	600011	华能国际	8,020	115,327.60	0.00%
	合计			1,977,020,047.32	63.55%

(五) 报告期内基金新增的股票明细

序	股票代码	股票名称	本期新增数量			本期卖出数量
			一级申购	二级买入	其他	
1	600026	中海发展	316,000			
2	600036	招商银行	4,302,220			
3	600037	歌华有线		210,730		
4	600052	浙江广厦		5,910,030		
5	600085	同仁堂		287,740		
6	600171	上海贝岭		271,100		
7	600177	雅戈尔		652,638		
8	600260	凯乐科技		818,119		243,900
9	600266	北京城建		1,954,507		
10	600327	大厦股份	35,000			
11	600350	山东基建	387,000	100,000		
12	600355	精伦电子	24,000			
13	600361	北京华联		2,667,399		
14	600397	安源股份	93,000			
15	600426	华鲁恒升	59,000			
16	600428	中远航运	39,000			
17	600486	扬农化工	25,000			
18	600496	长江股份	30,000			
19	600500	中化国际		4,872,527		120,000
20	600503	宏智科技	22,000			
21	600505	西昌电力	69,000			
22	600510	黑牡丹	27,000			
23	600580	卧龙科技	27,000			
24	600583	海油工程	34,000	1,205,300		487,178
25	600590	泰豪科技	31,000			
26	600595	中孚实业	36,000			
27	600598	北大荒	334,000	1,872,773		1,100,000
28	600637	广电信息		800,332		
29	600662	强生控股		520,000		
30	600681	诚成文化		933,366		487,700
31	600748	浦东不锈		300,000		
32	600830	大红鹰		391,270		
33	000542	TCL 通讯		156,600		
34	000584	蜀都A		2,316,847		
35	000659	珠海中富		2,053,680		
36	000869	张裕A		659,805		549,600
37	000948	南天信息		477,997		
38	000956	中原油气		2,396,548		1,000,000

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	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	600038	哈飞股份	1,025,062		1,025,062
2	600190	锦州港	38,400		38,400
3	600198	大唐电信	38,206		38,206
4	600263	路桥建设	259,858		259,858
5	600270	外运发展	184,986		184,986
6	600292	九龙电力	367,890		367,890
7	600296	兰州铝业	369,200		369,200
8	600315	上海家化	613,028		613,028
9	600317	营口港		169,000	169,000
10	600346	冰山橡塑	112,000		112,000
11	600362	江西铜业	154,000		154,000
12	600373	鑫新股份		2,000	2,000
13	600391	成发科技	128,000		128,000
14	600395	盘江股份	104,000		104,000
15	600419	新疆天宏	85,000		85,000
16	600456	宝钛股份		18,000	18,000
17	600506	香梨股份	147,000		147,000
18	600509	天富热电		17,000	17,000
19	600520	三佳模具	71,000		71,000
20	600523	贵航股份	136,000		136,000
21	600529	山东药玻		30,000	30,000
22	600533	栖霞建设		10,000	10,000
23	600536	中软股份		8,000	8,000
24	600566	洪城股份	44,205		44,205
25	600567	山鹰纸业	183,000		183,000
26	600568	潜江制药	176,300		176,300
27	600578	京能热电		77,000	77,000
28	600582	天地科技		26,000	26,000
29	600585	海螺水泥		278,000	278,000
30	600596	新安股份	452,000		452,000
31	600601	方正科技	4,133,730		4,133,730
32	600603	ST兴业	1,496,260		1,496,260
33	600718	东软股份	31,280		31,280
34	600776	东方通信	1,223,512		1,223,512
35	600827	友谊股份		228,000	228,000
36	600839	四川长虹	1,117,700		1,117,700
37	600895	张江高科	926,638	50,000	976,638
38	000402	金融街	405,577		405,577
39	000403	三九生化	554,050		554,050
40	000548	湖南投资	139,333		139,333

41	000552	长风特电	4,086,958		4,086,958
42	000553	沙隆达A	91,161		91,161
43	000631	兰宝信息	449,763		449,763
44	000657	中钨高新	2,387,822		2,387,822
45	000710	天兴仪表	1,873,209		1,873,209
46	000791	西北化工	126,861		126,861
47	000936	华西村	279,940		279,940

(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	31,526,458.20	1.01%
2	采掘业	96,480,699.82	3.10%
3	制造业	1,062,558,897.74	34.16%
	其中：食品、饮料	178,297,089.90	5.73%
	纺织、服装、皮毛	143,668,224.15	4.62%
	石油、化学、塑胶、塑料	261,201,754.85	8.40%
	电子	35,118,090.42	1.13%
	金属、非金属	159,558,342.90	5.13%
	机械、设备、仪表	85,019,213.80	2.73%
	医药、生物制品	199,696,181.72	6.42%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	107,420,131.64	3.45%
5	建筑业	76,708,581.58	2.47%
6	交通运输、仓储业	172,308,676.00	5.54%
7	信息技术业	19,880,911.19	0.64%
8	批发和零售贸易业	148,659,950.80	4.78%
9	金融、保险业	125,245,649.59	4.03%
10	房地产业		
11	社会服务业	94,527,384.39	3.04%
12	传播与文化产业	10,309,429.52	0.33%
13	综合类	31,393,276.85	1.01%
	合计	1,977,020,047.32	63.55%

2、国债及货币资金合计

截止2002年6月30日，金鑫证券投资基金持有国债（不含应计利息）及货币资金合计为1,368,491,338.84元（货币资金中含当日证券清算款50,043,297.37元），占基金资产净值的43.99%。

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	双汇发展	116,910,335.44	3.76%
2	华北高速	87,754,282.33	2.82%
3	哈药集团	84,014,480.16	2.70%
4	北新建材	83,326,725.78	2.68%
5	上港集箱	79,713,283.59	2.56%
6	申能股份	78,466,192.48	2.52%
7	中国化建	77,485,613.79	2.49%
8	民生银行	76,028,252.79	2.44%
9	佛塑股份	72,232,262.10	2.32%
10	中化国际	71,953,258.78	2.31%

4、报告附注

(1) 报告项目的计价方法

本基金持有上市证券采用公告内容截止日的市场均价，已发行未上市股票采用成本计算。

(2) 基金持有每只股票的价值(按成本价计算)均不超过基金资产净值的10%。

(3) 基金应收利息、应付管理费、托管费、佣金、预提费用、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234,576,316.68，与基金股票市值1,977,020,047.32元和国债及货币资金合计1,368,491,338.84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	30,000,000份	1.00%
其中：国泰君安	7,500,000份	0.25%
浙江省国际信托投资公司	7,500,000份	0.25%
上海爱建信托投资有限责任公司	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2002年6月30日，本基金共有持有人161,828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	276,178,397	9.21%
2	中国人寿	210,771,935	7.03%
3	中国人保	180,498,219	6.02%
4	平安保险	178,028,700	5.93%
5	久事公司	88,899,301	2.96%

6	中国再保	81,992,600	2.73%
7	新华人寿	58,134,096	1.94%
8	中铁三招	20,700,000	0.69%
9	国通证券	20,000,000	0.67%
10	国信证券	19,998,000	0.67%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的基金持有人名册编制。

七、重要事项揭示

- 1、本基金中期不进行收益分配，纳入年末一次性分配。
- 2、2002年3月29日，本基金管理人刊登了《金鑫证券投资基金二00一年年度报告》及《金鑫证券投资基金二00一年年度收益分配报告》。基金金鑫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6.80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。
- 3、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。
- 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、华夏证券有限公司、南方证券有限公司、招商证券股份有限公司（原名国通证券股份有限公司）、平安证券有限责任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	30,315.04	19.07%	27,338.38	19.64%	57,000.00	35.51%	114,653.42	25.00%
华夏证券有限公司	31,348.33	19.72%	37,989.18	27.30%	-	-	69,337.51	15.12%
南方证券有限公司	28,497.36	17.93%	34,214.38	24.58%	-	-	62,711.74	13.67%
招商证券股份有限公司	42,856.68	26.96%	28,042.50	20.15%	15,000.00	9.35%	85,899.18	18.73%
平安证券有限责任公司	25,931.79	16.32%	11,598.96	8.33%	88,500.00	55.14%	126,030.75	27.48%
合计	158,949.20	100.00%	139,183.40	100.00%	160,500.00	100.00%	458,632.60	100.00%

关联人及券商名	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安	23.81	19.01%	0.08%
华夏证券有限公司	24.72	19.73%	0.08%
南方证券有限公司	22.16	17.69%	0.08%
招商证券股份有限公司	34.52	27.56%	0.08%
平安证券有限责任公司	20.06	16.01%	0.08%
合计	125.27	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原件
- 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。

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