

金鑫证券投资基金 2001 年年度报告

重要提示

本基金的托管人中国建设银行已于 2002 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。

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：上海市静安区延平路 121 号三和大厦 27 楼

邮政编码：200042

法定代表人：陈勇胜

总经理：李春平

负责信息事务人员：丁昌海、黄永明

联系地址：上海市静安区延平路 121 号三和大厦 27 楼

电话：021-62531069

传真：021-62531262

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：安达信·华强会计师事务所
 注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 1 座 11 层
 办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 1 座 11 层
 法定代表人：张本廉
 邮编：200021
 电话：010-65053333
 传真：010-65051828
 经办注册会计师：何影帆、陈经纬
 联系人：韩歆
 联系人电话：021-63866688-640
 传真：021-63862288

(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

1、各类财务指标

	2001 年度	2000 年度	1999 年度
基金本期净收益	330,380,425.83元	658,944,310.42元	17,328,633.37元
单位基金本期净收益	0.1101元	0.2196元	0.0058元
基金可分配净收益	221,638,224.67元	676,272,943.79元	-99,848,508.34元
单位基金可分配净收益	0.0739元	0.2254元	-0.0333元
期末基金资产总值	3,289,468,445.85元	5,265,206,036.75元	2,930,029,231.23元
期末基金资产净值	3,221,638,224.67元	4,436,512,955.25元	2,900,151,491.66元
单位基金资产净值	1.0739元	1.4788元	0.9667元
基金资产净值收益率	8.64%	22.72%	0.57%
本期基金资产净值增长率	-15.46%	52.97%	-4.06%
基金累计资产净值增长率	24.07%	46.76%	-4.06%

2、2000年年度报告披露的各类财务指标

	2000 年度	1999 年度
基金本期净收益	658,944,310.42元	17,328,633.37元
单位基金本期净收益	0.2196元	0.0058元
基金可分配净收益	676,272,943.79元	17,328,633.37元
单位基金可分配净收益	0.2254元	0.0058元
期末基金资产净值	4,436,512,955.25元	2,900,151,491.66元
单位基金资产净值	1.4788元	0.9667元
基金资产净值收益率	22.72%	0.58%
本期基金资产净值增长率	52.97%	-3.33%
基金累计资产净值增长率	47.88%	-3.33%

3、指标说明

(1) 本次披露的2001年度各类财务指标是根据基金行业约定的公式计算出来，2000年度及1999年度的各类财务指标已作相应的调整。

(2) 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+未实现估值增值（若未实现估值增值为负数，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/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）*（本期基金资产净值增长率+1）-1

三、基金管理人报告

（一）基金小组介绍

本基金由钱华先生（基金经理）和胡定超先生（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：胡定超先生，36岁，经济学硕士，曾任深圳南山基金管理有限公司研究部经理、证券投资总部总经理和公司助理总裁。1999年加盟国泰基金管理有限公司，现任基金金鑫经理助理。

（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，而是在构建投资组合时，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。(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。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价值。对上市公司市盈率。本基金认为,考察市盈率不能简单地看其绝对值,还应该结合市场来看其动态市盈率,稳定的动态的市盈率才有意义。(3) 投资蓝筹股。中国股市处于发展阶段,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盘子较大,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,蓝筹股除了富有一定的规模之外,还应该有两个特征: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,以保持基金资产的流动性。

(2) 行业相对平衡:

在制定投资组合时,采取自下而上的选股策略,即首先考察上市公司的基本面,然后再分析其所处的行业和公司在行业中的地位。本基金不事先选定行业比例,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) 投资组合的市盈率处于市场平均水平:

在构建本基金投资组合时,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) 2001年投资管理回顾

1、形势分析

2001年证券市场运作状况明显的分为两个阶段。

上半年,中国宏观经济继续保持了良好的增长势头。根据国家统计局发布的2001年上半年国民经济运行情况报告,上半年国民经济增长率达到了7.9%,一、二、三产业增长平稳,国内需求成为推动经济增长的主要动力,国内消费品市场(例如房地产市场等)销售活跃,保持了较高的增长水平;投资需求快速增长。

在这种形势下,上半年中国证券市场走出了相对平稳的行情。年初承接2000年末的升势,上证指数在1月8日达到了历史新高2131.98点,随后经过一个半月的调整,于1900点处获得强有力的支撑,开始连续的攀升,到6月14日再创新高2245.43点。上半年上证指数升幅6.97%,深圳成指微跌0.81%,其中B股、新股、次新股板块对活跃股市、推动大盘上升起了重要作用;重组股板块也继续走强,而科技股、网络股、绩优股则受境外市场影响大多走势不佳。

进入下半年之后,世界经济发展出现减速的迹象,对中国的经济产生了不利影响。较突出地反映在出口贸易下降上。“9.11”事件发生之后,美国经济出现衰退,世界经济也受到重创。受此影响,中国经济的发展速度明显下降。

2001年下半年除了国际和国内经济形势发生较大变化之外,国有股减持有关方案的讨论和试行,对股市的影响更大。本基金认为,国有股全流通的预期将从根本上改变对股市供求关系,股市由供求大体平衡突然改变为供大于求。股市大幅下跌也就是情理之中的事情。

2、基金运作情况:

本基金的运作情况也明显地分为两个阶段。

本基金在上半年的操作策略是结构调整和控制仓位。制定这一操作策略的主要依据是:

(1) 投资组合有老化倾向。有些个股前景不明朗,风险增加;有些个股短期涨幅过大,回调压

力增加；整个投资组合的表现不如大盘。基于上述情况，有必要对部分个股进行清理，同时增加一些新的投资品种。（2）上半年大部分时间，上证指数都在2100点以上的高位运行，市场积聚的风险较大。在这种情况下，不宜保持过高比例的股票仓位。

本基金在上半年进行了两次较大规模的减仓操作。第一次是在年初，减持了许多高价高科技股，提高了现金比重。第二次是在第二季度，减持了一些基本面发生变化、前景不明确的个股，同时还减持了一部分重点投资的个股，将股票仓位降至66%左右的水平。在减持这些股票的同时，又增加了传统产业中部分优秀的新品种。另外，对部分股价回落幅度较大的个股进行增仓操作。

下半年股市进入大幅调整，但本基金的操作策略未做大的调整。下半年本基金未象上半年那样进行较大规模的减持操作，在清理了部分个股的同时，又增持了一些新的品种，使本基金的股票仓位一直保持在60%左右。

从总体看，下半年操作有失误的地方，主要是未进一步降低股票仓位。造成这个局面的主要原因，是本基金对下半年股市的调整性质和幅度认识不足。

由于本基金坚持健康的投资理念和明智的投资策略，本基金的投资组合的表现依旧好于市场表现。在9只30亿规模的封闭式基金中，本基金的年净值增长率为-15.46%，排名第四位。

（四）2002年市场展望

我国加入WTO以后，世界经济形势将对国内经济形势起重要影响。美国等主要经济体正逐步走出经济衰退，出现了一定的复苏迹象。预计这种复苏态势将持续一段时间。这种状况对中国经济发展十分有利。2002年也是中国加入WTO后的第一年，中国政府将逐步兑现入世的承诺。与此同时，国际社会也将兑现承诺，中国经济的国际环境将趋于宽松。这将有利于中国经济的发展。

发展和规范是证券市场两个根本问题。2001年可以说是规范年。监管部门对市场的监管力度明显加强。这当然有利于股市的长远发展。2002年在规范的同时，政府也注意到了稳定的重要性。从目前披露的信息看，监管部门将适当调整监管的方式方法。在推进国有股减持、打击上市公司造假、树立中介机构诚信等问题上，将会更加慎重和现实的措施，充分体现政府稳定社会、稳定经济、稳定股市的意图。

从股市的供求关系看，2002年的股市供求关系将维持在一个大体平衡的局面，一方面，随着股市人气、信心的恢复，新股和增发的节奏将恢复到正常水平，供给将不断增加；另一方面，基金市场的扩容步伐也将加快，商业保险资金扩大入市比例，拓宽入市渠道，社保基金也逐步入市，增量资金的出现，将明显增加股市的需求。本基金管理人认为，只要供求大体平衡，股市就将稳中有升。

作为专业性的基金管理人，我们对证券市场面临的不确定性时刻保持清醒的头脑，同时密切关注国际股市对中国股市的影响。中国股市存在的一些深层次问题并未在去年得到根本解决，稳定发展将成为2002年证券市场的主要特征。本基金管理人对2002年的证券市场持谨慎乐观的态度。从整体上讲，2002年是市场信心恢复年，走势应以箱体震荡整理为主。从控制风险的角度出发，本基金将进行结构调整，在保持一定的国债和现金比例的同时，加大对能源、交通、原材料、通讯等基础行业的投资力度。同时加强组合投资、波段操作的力度。

（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、《金鑫证券投资基金基金契约》和其他有关法律法规的规定，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作基金资产，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，基金投资范围、投资比例、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，本基金管理人以加强公司内控体系建设为重要工作内容，在总结前三年内部监察和风险控制工作的基础上，进一步完善和优化公司的内部监察稽核制度和风险控制体系，提高防范和及时化解投资风险和管理风险的能力，确保公司的规范运作，切实保障基金持有人的利益。本基金管理人依据国家相关法律法规、基金契约和管理制度对基金投资运作和内控流程的完善和执行情况进行持续的监察稽核；对监察稽核中发现的问题及时提示、督促改进并追踪改进效果；定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：一、加强基金投资管理合法合规性的监控。采取了实时监控、现场查看、专项稽核、报表审核和资料查阅等方式，加大监控力度和监察频率，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金持有人的合法权益。二、建立健全全面风险管理体系。完善风险控制指标体系和技术手段，构建风险评估体系和风险预警机制，通过定期的风险报告提供量化的风险评估结果，揭示投资组合的风险暴露程度，及时预警。推行部门风险管理责任制，细化风险控制流程，防范和控制风险。三、结合开放式基金的筹备，完善内部控制制度体系。完善和细化各部门的岗位职责和工作流程，修订和优化了投资决策、研究开发和基金管理、投资交易等各环节管理制度和工作规程，理顺了研究、决策、投资、交易及风险控制的体系运作流程，为规范基金管理的行为提供了制度保障，提高了基金运作效率。四、完善法人治理结构，建立了独立董事制度。独立董事在公司管理重大事项的决策方面已发挥了重要的监督作用。同时董事会还成立了多个专门委员会，进一步发挥董事会的作用。五、加强员工行为准则监察和职业道德教育。通过持续有效的职业道德教育、自律承诺、经常性行为监察和定期考核等，促进员工职业道德素质的提高和遵守法律法规、公司制度的自觉性。六、加强监察稽核人员自身建设。在充实人员、增添设备的基础上，制定了科学详细的工作流程和要求，提高稽核监察人员的业务素质和能力。同时加强监察稽核部门和其他业务部门的交流和沟通，促进监察工作效率的提高。

经持续跟踪监察，本报告期内，本基金的投资管理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；各基金管理小组保持独立运作；本基金运作中没有发生重大违规和损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人将继续以“全心全意为投资人服务”为宗旨，坚持“取信于市场、取信于社会”的价值取向，不断提高内部监察稽核工作的有效性和科学性，加强基金资产的规范运作和风险控制工作，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”）。

2001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。

2001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。

2001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3月25日

五、基金财务报告

(一) 审计报告

金鑫证券投资基金全体基金持有人

安达信·华强会计师事务所（以下简称“我们”）接受委托，审计了金鑫证券投资基金（以下简称“贵基金”）二〇〇一年十二月三十一日的资产负债报告书和二〇〇一年度的收益及分配报告书。编制会计报告书是贵基金管理人的责任，我们的责任是依据我们的审计对该报告书发表意见。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，我们结合贵基金的实际状况，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，上述会计报告书符合证券投资基金的有关制度、办法和规定及贵基金的基金契约，在所有重大方面公允地反映了贵基金二〇〇一年十二月三十一日的财务状况和二〇〇一年度的经营成果，会计处理方法的选用遵循了一贯性原则。

安达信·华强会计师事务所
中国·北京

中国注册会计师：何影帆、陈经纬
2002年1月18日

(二) 基金会计报告书

1、资产负债报告书

资产负债报告书

2001年12月31日

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

序号	项 目	年末数	年初数
1	股票投资—成本	2,138,870,399.07	2,716,692,414.21
2	股票投资—估值增值	-177,601,617.95	756,569,045.14
3	债券投资—成本	728,601,838.80	905,239,283.68
4	债券投资—估值增值	4,586,473.00	3,670,966.32
5	其他投资—成本		
6	其他投资—估值增值		
7	买入返售债券		
8	现金		
9	银行存款	592,701,470.08	618,943,891.64
10	应收股利		
11	应收利息	2,251,006.83	4,767,463.82
12	应收账款	31,464.67	405,038.77
13	应收交易清算款		

14	应收申购款		258,860,000.00
15	其他应收款项	27,411.35	57,933.17
16	基金资产总值	3,289,468,445.85	5,265,206,036.75
17	应付基金管理人报酬	4,134,808.34	5,532,816.88
18	应付基金托管费	689,134.74	922,136.15
19	应付收益		
20	应付账款		903,000.00
21	应付交易清算款	11,959,220.98	66,499,724.38
22	应付佣金	521,131.33	733,807.90
23	其他应付款项	391,131.32	128,415.04
24	应付回购利息	134,794.47	3,873,181.15
25	卖出回购	50,000,000.00	750,100,000.00
26	负债总额	67,830,221.18	828,693,081.50
27	基金单位总额	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
28	未分配净收益	394,653,369.62	676,272,943.79
29	未实现估值增值	-173,015,144.95	760,240,011.46
30	基金资产净值	3,221,638,224.67	4,436,512,955.25
31	单位基金发行总份额	3,000,000,000份	3,000,000,000份
32	每份基金单位资产净值	1.0739	1.4788

2、收益及分配报告书

收益及分配报告书

2001年度

编制单位：国泰基金管理有限公司

单位：元

序号	项 目	本年数	上年数
1	一、基金收入	413,263,615.30	732,644,922.05
2	证券买卖差价收入	355,216,872.01	691,285,908.53
3	其中：股票	343,860,438.05	696,994,895.35
4	债券	11,356,433.96	-5,708,986.82
5	投资收入	42,836,164.46	26,196,484.93
6	其中：股息收入	17,923,574.72	9,188,474.03
7	债券利息收入	24,912,589.74	17,008,010.90
8	回购利息收入	19,200.00	717,494.42
9	其他收入	15,191,378.83	14,445,034.17
10	其中：银行存款利息收入	14,553,377.86	13,093,102.60
11	其他	638,000.97	1,351,931.57
12	二、基金费用	82,883,189.47	73,700,611.63
13	管理人报酬	54,772,071.03	57,968,688.90
14	托管费	9,269,675.74	9,778,767.81
15	回购交易费用	81,790.00	31,237.75
16	回购利息支出	16,421,919.04	5,385,490.68

17	其他费用	2,337,733.66	536,426.49
18	其中：上市年费	60,000.00	60,000.00
19	会计师费	100,000.00	150,000.00
20	信息披露费	320,000.00	320,000.00
21	分红手续费	1,836,000.00	
22	其他	21,733.66	6,426.49
23	三、净收益	330,380,425.83	658,944,310.42
24	四、上期末分配净收益	676,272,943.79	17,328,633.37
25	五、本期已分配净收益	612,000,000.00	
26	六、期末未分配净收益	394,653,369.62	676,272,943.79

(三) 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、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《企业会计准则》，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。
- (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
 - 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；银行间同业市场国债以成本加计以票面面值乘以利率计至估值日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、债券和银行存款；
 - F、每日都对基金资产进行估值。
- (5) 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：交易所上市的债券利息收入在除息日确认应收利息；银行间同业市场国债利息收入为每日计提的应计利息；
- 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。

(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：

- A、以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围；
- B、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；
- C、对基金管理人运用基金资产买卖股票在2001年11月16日前按4‰的税率征收印花税，自2001年11月16日起按2‰的税率征收印花税；
- D、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

- 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。

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

(i)、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	2001年度				2000年度			
	交易量	比例	佣金	比例	交易量	比例	佣金	比例
国泰君安	88,950.62	23.96%	74.75	24.07%	139,857.96	20.03%	115.54	19.93%

(ii)、通过关联人席位进行国债投资买卖年交易量(万元)情况

关联人	2001年度		2000年度	
	交易量	比例	交易量	比例
国泰君安	6,074.95	5.20%	9,390.29	24.25%

(iii)、通过关联人席位进行债券回购年交易量(万元)情况

关联人	2001年度		2000年度	
	交易量	比例	交易量	比例
国泰君安	77,000.00	28.46%	67,350.00	41.39%

(iv)、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

关联人	2001年度		2000年度	
	交易量	利息支出	交易量	利息支出
中国建设银行	242,000.00	827.74	-	-

(3) 基金管理人报酬

基金管理人的报酬由两部分组成，一部分是基金管理费，以基金资产净值的1.5%年费率计提；另一部分是业绩报酬，当基金的可分配净收益率高于同期银行一年定期储蓄利率20%以上，且当年基金资产净值增长率高于同期证券市场平均收益率时，按一定比例计提。具体方法如下：

(i)、基金管理费

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2001年12月31日止，基金应支付基金管理人管理费共54,772,071.03元，其中已支付基金管理人50,637,262.69元，尚余4,134,808.34元未支付。2000年度共计计提57,968,688.90元，已全部支付。

(ii)、管理人业绩报酬

业绩报酬根据基金全年的经营业绩情况，在满足以下几个基本条件下每年计提一次，直接用于奖励基金管理人员：

- A、基金年平均单位资产净值不能低于面值；
- B、基金可分配净收益率超过同期银行一年定期储蓄利率20%以上；
- C、基金资产净值增长率超过证券市场平均收益率；
- D、基金收益分配后每单位资产净值不能低于面值。

在满足以上条件的情况下，基金业绩报酬计算方法为：

$$\text{业绩报酬} = \text{调整后期初资产净值} \times \text{MIN}[M, N] \times 5\%$$

其中：M=基金可分配净收益率-1.2×同期银行一年定期储蓄存款率（如果年内银行利率发生变动，则按时间段进行加权平均调整）；

$N = \text{本期基金资产净值增长率} - \text{证券市场平均收益率}$;

$\text{MIN}[M, N]$ 为 M 、 N 中较小者;

$\text{基金可分配净收益率} = \text{当年可分配净收益} / \text{调整后年初基金资产净值}$;

$\text{本期基金资产净值增长率} = (\text{年末基金资产净值} - \text{调整后年初基金资产净值}) / \text{调整后年初基金资产净值}$

$\text{调整后年初资产净值} = \text{上年度末基金资产净值} - \text{上年度已分配收益}$;

$\text{证券市场平均收益率} = [(\text{当年沪市综指涨跌幅} \times \text{沪市平均总市值} + \text{当年深市综指涨跌幅} \times \text{深市平均总市值}) / (\text{沪市平均总市值} + \text{深市平均总市值})] \times 80\% + \text{同期国债收益率} \times 20\%$;

$\text{沪市平均总市值} = (\text{年初沪市总市值} + \text{年末沪市总市值}) / 2$;

$\text{深市平均总市值} = (\text{年初深市总市值} + \text{年末深市总市值}) / 2$ 。

根据计算, 2001年度可提取业绩报酬1,442,306.14元, 但本基金管理人已决定不计提该项业绩报酬。2000年度未提取业绩报酬。

(4) 基金托管人报酬

(i)、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

(ii)、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;

(iii)、至2001年12月31日止, 基金应支付基金托管人托管费共9,269,675.74元, 其中已支付基金托管人8,580,541.00元, 尚余689,134.74元未支付。2000年度共计提9,778,767.81元, 已全部支付。

5、主要报表项目说明

(1) 应收账款: 2001年12月31日余额为31,464.67元, 系深交所席位交易保证金。

(2) 其他应收款: 2001年12月31日余额为27,411.35元, 系交易所自动扣除, 应由席位券商支付的交易所风险基金。

(3) 其他应付款: 2001年12月31日余额为391,131.32元, 其中预提基金2001年度审计费用100,000元, 预提基金2001年度信息披露费220,000元, 应缴股利税金49,428.44元及暂收席位印花税返回款21,702.88元。

(4) 证券买卖差价收入: 2001年1-12月累计发生额为355,216,872.01元, 其中:

项 目	发 生 额
上海证券交易所挂牌股票	276,301,357.49元
深圳证券交易所挂牌股票	67,559,080.56元
上海证券交易所挂牌债券	7,205,433.96元
银行间同业市场债券	4,151,000.00元
合 计	355,216,872.01元

(四) 流通受限制的证券

1、截至2001年12月31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	*华能国际	2001-11-21	2002-3-6	147,411	1,171,917.45	1,860,326.82	688,409.37	网下申购
2	*深高速	2001-12-11	2002-3-25	629,016	2,302,198.56	4,466,013.60	2,163,815.04	网下申购
3	三佳模具	2001-12-25	2002-1-8	71,000	482,800.00	482,800.00	-	网上申购
4	江西铜业	2001-12-27	2002-1-11	154,000	349,580.00	349,580.00	-	网上申购
	合计				4,306,496.01	7,158,720.42	2,852,224.41	

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。

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。

上述四只股票为基金配售新股、网上申购中签的未上市新股。

3、受限期限

上述“华能国际”、“深高速”(带*号)为已上市未流通的新股，受限期为3个月。

4、估值办法

上述“华能国际”、“深高速”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2001年12月31日按照均价估值，其余未上市流通的二只股票按成本价估值。若流通受限股票中已上市流通的二只股票(带*号)按成本进行估值计算，于2001年12月31日，本基金资产净值将为3,218,786,000.26元，每份基金单位资产净值为1.0729元。

(五) 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	600664	哈药集团	12,978,542	159,636,066.60	4.96%
2	600018	上港集箱	6,898,102	129,960,241.68	4.03%
3	600176	中国化建	10,704,373	101,584,499.77	3.15%
4	000916	华北高速	16,042,357	98,500,071.98	3.06%
5	000786	北新建材	7,088,707	90,522,788.39	2.81%
6	000525	红太阳	10,416,494	86,977,724.90	2.70%
7	000973	佛塑股份	6,336,564	82,438,697.64	2.56%
8	000895	双汇发展	6,075,066	82,013,391.00	2.55%
9	600630	龙头股份	6,853,688	66,823,458.00	2.07%
10	600219	南山实业	4,614,172	63,398,723.28	1.97%
11	600311	荣华实业	4,529,248	60,193,705.92	1.87%
12	600601	方正科技	4,133,730	52,787,732.10	1.64%
13	600320	振华港机	3,382,003	47,517,142.15	1.47%

14	600299	星新材料	3,280,356	47,105,912.16	1.46%
15	600168	武汉控股	3,882,032	41,809,484.64	1.30%
16	600019	宝钢股份	10,063,700	39,248,430.00	1.22%
17	600642	申能股份	2,930,459	38,271,794.54	1.19%
18	000552	甘长风A	4,086,958	38,253,926.88	1.19%
19	000421	南京中北	4,021,358	37,921,405.94	1.18%
20	000919	金陵药业	2,246,092	37,846,650.20	1.17%
21	000406	石油大明	2,717,390	36,521,721.60	1.13%
22	600697	欧亚集团	3,418,859	36,376,659.76	1.13%
23	600321	国栋建设	2,264,746	36,122,698.70	1.12%
24	600866	星湖科技	3,260,430	27,746,259.30	0.86%
25	600016	民生银行	1,874,890	26,885,922.60	0.83%
26	000983	西山煤电	3,005,200	26,085,136.00	0.81%
27	000657	中钨高新	2,387,822	24,546,810.16	0.76%
28	600038	哈飞股份	1,025,062	21,628,808.20	0.67%
29	600008	首创股份	1,589,928	21,575,322.96	0.67%
30	600776	东方通信	1,223,512	21,068,876.64	0.65%
31	000733	振华科技	2,004,044	21,062,502.44	0.65%
32	000710	天兴仪表	1,873,209	17,907,878.04	0.56%
33	600603	兴业房产	1,496,260	16,593,523.40	0.52%
34	600380	太太药业	640,360	15,541,537.20	0.48%
35	000918	亚华种业	981,430	14,466,278.20	0.45%
36	000655	华光陶瓷	1,147,309	14,306,943.23	0.44%
37	600028	中国石化	4,005,000	13,897,350.00	0.43%
38	600895	张江高科	926,638	12,898,800.96	0.40%
39	600104	上海汽车	1,737,888	12,721,340.16	0.39%
40	000961	大连金牛	1,599,325	12,314,802.50	0.38%
41	600498	烽火通信	441,000	10,606,050.00	0.33%
42	600315	上海家化	613,028	9,465,152.32	0.29%
43	600010	钢联股份	1,600,000	9,072,000.00	0.28%
44	600839	四川长虹	1,117,700	8,773,945.00	0.27%
45	000403	三九生化	554,050	8,693,044.50	0.27%
46	000402	金融街	405,577	7,726,241.85	0.24%
47	600236	桂冠电力	614,995	7,668,987.65	0.24%
48	600596	新安股份	452,000	6,685,080.00	0.21%
49	600292	九龙电力	367,890	6,243,093.30	0.19%
50	000565	渝三峡A	600,000	5,886,000.00	0.18%
51	600548	深高速	629,016	4,466,013.60	0.14%
52	600270	外运发展	184,986	4,315,723.38	0.13%
53	000936	华西村	279,940	4,098,321.60	0.13%
54	600568	潜江制药	176,300	3,585,942.00	0.11%
55	600296	兰州铝业	369,200	3,555,396.00	0.11%
56	600263	路桥建设	259,858	3,479,498.62	0.11%

57	000631	兰宝信息	449,763	3,319,250.94	0.10%
58	600391	成发科技	128,000	2,126,080.00	0.07%
59	600506	香梨股份	147,000	1,994,790.00	0.06%
60	600567	山鹰纸业	183,000	1,948,950.00	0.06%
61	600011	华能国际	147,411	1,860,326.82	0.06%
62	600346	冰山橡塑	112,000	1,789,760.00	0.06%
63	600419	新疆天宏	85,000	1,673,650.00	0.05%
64	600523	贵航股份	136,000	1,369,520.00	0.04%
65	000548	湖南投资	139,333	1,325,056.83	0.04%
66	000791	西北化工	126,861	1,129,062.90	0.04%
67	600395	盘江股份	104,000	1,105,520.00	0.03%
68	000553	沙隆达 A	91,161	948,074.40	0.03%
69	600198	大唐电信	38,206	738,904.04	0.02%
70	600566	洪城股份	44,205	717,447.15	0.02%
71	600718	东软股份	31,280	660,946.40	0.02%
72	600520	三佳模具	71,000	482,800.00	0.01%
73	600362	江西铜业	154,000	349,580.00	0.01%
74	600190	锦州港	38,400	327,552.00	0.01%
	合计			1,961,268,781.12	60.88%

(六) 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	600010	钢联股份	1,600,000			
2	600011	华能国际	147,411			
3	600028	中国石化	4,005,000			
4	600190	锦州港		80,000	40,000	81,600
5	600219	南山实业		4,614,172		
6	600292	九龙电力		367,890		
7	600311	荣华实业	153,000	4,515,048		138,800
8	600315	上海家化	84,000	529,028		
9	600321	国栋建设	186,000	2,254,946		176,200
10	600346	冰山橡塑	112,000			
11	600362	江西铜业	154,000			
12	600380	太太药业	454,000	186,360		
13	600391	成发科技	128,000			
14	600395	盘江股份	104,000			
15	600419	新疆天宏	85,000			
16	600498	烽火通信	441,000			
17	600506	香梨股份	147,000			
18	600520	三佳模具	71,000			
19	600523	贵航股份	136,000			

20	600548	深高速			629,016	
21	600566	洪城股份	98,000	121,200		174,995
22	600567	山鹰纸业	183,000			
23	600568	潜江制药	105,000	202,000		130,700
24	600596	新安股份	452,000			
25	600603	兴业房产		3,397,594		1,901,334
26	600630	龙头股份		6,853,688		
27	000402	金融街		405,577		
28	000421	南京中北		4,021,358		
29	000548	湖南投资			139,333	
30	000553	沙隆达 A		127,500		36,339
31	000565	渝三峡 A		600,000		
32	000631	兰宝信息		457,117	144,446	151,800
33	000786	北新建材		7,372,607		283,900
34	000936	华西村		279,940		

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	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	600037	歌华有线		271,000	271,000
2	600086	多佳股份		470,682	470,682
3	600130	波导股份	100,000		100,000
4	600150	ST重机		1,455,910	1,455,910
5	600171	上海贝岭	1,833,609		1,833,609
6	600177	雅戈尔	3,601,174		3,601,174
7	600188	兖州煤业		4,449,369	4,449,369
8	600227	赤天化	471,900		471,900
9	600229	青岛碱业	596,000		596,000
10	600230	沧州大化	475,000		475,000
11	600231	凌钢股份	500,000		500,000
12	600235	民丰特纸	307,627		307,627
13	600240	仕奇实业	439,634		439,634
14	600243	青海华鼎	123,000		123,000
15	600253	天方药业	134,000		134,000
16	600256	广汇股份	594,058		594,058
17	600258	首旅股份	500,600		500,600
18	600259	兴业聚酯	427,000		427,000
19	600266	北京城建	2,371,035	1,494	2,372,529
20	600269	赣粤高速	715,000		715,000
21	600272	开开实业		314,200	314,200
22	600295	鄂尔多斯		130,960	130,960

23	600302	标准股份	113,000		113,000
24	600303	曙光股份	55,000		55,000
25	600306	商业城	80,000		80,000
26	600307	酒钢宏兴	785,000		785,000
27	600309	烟台万华		106,000	106,000
28	600313	中农资源	64,000		64,000
29	600316	洪都航空	101,000		101,000
30	600318	巢东股份	200,000		200,000
31	600326	西藏天路	102,000		102,000
32	600328	兰太实业	70,000		70,000
33	600330	天通股份		48,000	48,000
34	600331	宏达股份		179,000	179,000
35	600332	广州药业		477,553	477,553
36	600333	长春燃气	81,000		81,000
37	600335	中发展		112,000	112,000
38	600336	澳柯玛	105,000		105,000
39	600338	珠峰摩托	69,000		69,000
40	600339	天利高新	98,000		98,000
41	600345	长江通信	552,448		552,448
42	600356	恒丰纸业		34,000	34,000
43	600360	华微电子		71,000	71,000
44	600361	北京华联		147,000	147,000
45	600363	联创光电		138,000	138,000
46	600365	通葡萄酒	127,000		127,000
47	600367	红星发展		138,000	138,000
48	600368	五洲交通	150,000		150,000
49	600372	昌河股份		413,000	413,000
50	600376	天鸿宝业		232,000	232,000
51	600377	宁沪高速		245,000	245,000
52	600378	天科股份	45,000		45,000
53	600381	白唇鹿		61,000	61,000
54	600388	龙净环保	71,000		71,000
55	600389	江山股份		96,000	96,000
56	600390	金瑞科技	129,000		129,000
57	600396	金山股份		95,000	95,000
58	600398	凯诺科技	84,000		84,000
59	600399	抚顺特钢	277,000		277,000
60	600400	红豆股份	74,000		74,000
61	600466	迪康药业		172,000	172,000
62	600500	中化国际	1,096,350		1,096,350
63	600501	航天晨光		137,000	137,000
64	600518	康美药业		56,000	56,000
65	600519	贵州茅台		98,000	98,000

66	600530	交大昂立		96,000	96,000
67	600589	广东榕泰		110,000	110,000
68	600599	浏阳花炮		97,000	97,000
69	600600	青岛啤酒		90,982	90,982
70	600624	复旦复华	1,062,831		1,062,831
71	600637	广电信息		5,759,270	5,759,270
72	600645	望春花		50,000	50,000
73	600662	强生控股		1,430,000	1,430,000
74	600673	成量股份	1,308,016		1,308,016
75	600680	上海邮通	1,228,723		1,228,723
76	600707	彩虹股份	1,967,150		1,967,150
77	600828	成商集团	1,819,320		1,819,320
78	600862	纵横国际	711,187		711,187
79	000070	特发信息	415,842		415,842
80	000301	丝绸股份	630,000		630,000
81	000408	河北华玉	958,361		958,361
82	000531	穗恒运A	479,140		479,140
83	000541	佛山照明	1,464,424		1,464,424
84	000542	TCL通讯	10,000		10,000
85	000618	吉林化工	1,274,826		1,274,826
86	000686	锦州六陆	391,300	68,774	460,074
87	000697	咸阳偏转	957,686		957,686
88	000725	京东方A	651,443		651,443
89	000726	鲁泰A	736,831		736,831
90	000730	环保股份		479,937	479,937
91	000801	四川湖山	4,196,934		4,196,934
92	000869	张裕A	2,113,140		2,113,140
93	000917	电广传媒	981,870		981,870
94	000948	南天信息	1,184,169		1,184,169
95	000959	首钢股份		834,050	834,050
96	000963	华东医药	387,100		387,100
97	000965	天水股份	416,683		416,683
98	000966	长源电力	534,600		534,600
99	000968	神州股份	922,500		922,500
100	000969	安泰科技	376,450		376,450
101	000971	湖北迈亚	326,700		326,700
102	000975	乌江电力	2,887,429	410,667	3,298,096
103	000976	春晖股份	749,520		749,520
104	000977	浪潮信息	386,150		386,150
105	000980	金马股份	340,100		340,100
106	000981	兰光科技	279,900		279,900
107	000998	隆平高科	645,000		645,000

(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	16,461,068.20	0.51%
2	采掘业	77,609,727.60	2.41%
3	制造业	1,279,031,432.03	39.70%
	其中：食品、饮料	142,207,096.92	4.41%
	纺织、服装、皮毛	130,222,181.28	4.04%
	造纸、印刷	3,622,600.00	0.11%
	石油、化学、塑胶、塑料	350,913,248.59	10.89%
	电子	29,836,447.44	0.93%
	金属、非金属	230,039,448.98	7.14%
	机械、设备、仪表	147,833,953.52	4.59%
	医药、生物制品	244,356,455.30	7.59%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	88,184,699.30	2.74%
5	建筑业	3,479,498.62	0.11%
6	交通运输、仓储业	237,569,602.64	7.37%
7	信息技术业	85,862,509.18	2.67%
8	批发和零售贸易业	36,376,659.76	1.13%
9	金融、保险业	26,885,922.60	0.83%
10	房地产业	24,319,765.25	0.75%
11	社会服务业	68,490,773.38	2.13%
12	传播与文化产业		
13	综合类	16,997,122.56	0.53%
	合 计	1,961,268,781.12	60.88%

2、国债及货币资金合计

截止2001年12月31日，金鑫证券投资基金持有国债及货币资金为1,315,853,876.32元（货币资金中含卖出回购融入资金50,000,000.00元），占基金资产净值的40.84%。

国债合计由上市国债市值480,245,311.80元、银行间同业市场国债成本252,943,000.00元、银行间同业市场国债利息1,923,315.42元构成。

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	哈药集团	159,636,066.60	4.96%
2	上港集箱	129,960,241.68	4.03%
3	中国化建	101,584,499.77	3.15%
4	华北高速	98,500,071.98	3.06%
5	北新建材	90,522,788.39	2.81%
6	红太阳	86,977,724.90	2.70%
7	佛塑股份	82,438,697.64	2.56%

8	双汇发展	82,013,391.00	2.55%
9	龙头股份	66,823,458.00	2.07%
10	南山实业	63,398,723.28	1.97%

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、卖出回购、回购利息及其他应收应付款项合计为贷方余额55,484,432.77元，与基金股票市值1,961,268,781.12元和国债及货币资金1,315,853,876.32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2001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	1.00%
其中：国泰君安证券股份有限公司	7,500,000份	0.25%
浙江省国际信托投资公司	7,500,000份	0.25%
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2001年12月31日，本基金共有持有人169,023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	299,078,700	9.97%
2	中国人寿	297,849,600	9.93%
3	平安保险	195,321,600	6.51%
4	中国人保	137,627,000	4.59%
5	中国再保	77,992,600	2.60%
6	上海久事	62,784,600	2.09%
7	浙江杭甬	49,010,000	1.63%
8	南汇信用	22,110,200	0.74%
9	中铁三招	17,100,000	0.57%
10	华电财务	16,000,000	0.53%

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

- 2001年度可提取业绩报酬1,442,306.14元，但本基金管理人已决定不计提该项业绩报酬。
- 2001年3月30日，本基金管理人刊登了《金鑫证券投资基金二000年年度报告》及《金鑫证券投资基金二000年年度收益分配报告》。基金金鑫二000年年度收益分配方案为每100份基金

单位派发现金收益20.40元（二000年派发的收益暂免税），权益登记日为2001年4月6日，除息交易日为2001年4月9日，红利发放日为2001年4月12日。

- 3、2001年5月9日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司公告》。国泰基金管理有限公司于2001年2月21日在上海举行第六次股东会，会议进行了董事会和监事会换届选举，选举了陈勇胜、吴畏、罗新泉、沈强、周栋、张明芝、李春平为第二届董事会董事，选举李予瑾、翁新孟、黄永明为第二届监事会监事。
- 4、2001年8月30日，本基金管理人刊登了《金鑫证券投资基金二00一年中期报告》。
- 5、2001年9月13日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司公告》。为完善公司治理结构，经公司第二届董事会第二次会议和2001年第一次临时股东会审议并选举董辅弼、龚浩成、曹尔阶、吴鹏等四名独立董事。
- 6、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，我们向国泰君安证券股份有限公司、华夏证券有限公司、南方证券有限公司、国通证券有限责任公司、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) 资历雄厚，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。

- 7、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	88,950.62	23.96%	6,074.95	5.20%	77,000.00	28.46%	172,025.57	22.67%
华夏证券有限公司	78,767.27	21.21%	18,654.13	15.96%	99,560.00	36.80%	196,981.40	25.96%
南方证券有限公司	66,914.20	18.02%	-	-	20,000.00	7.39%	86,914.20	11.45%
国通证券有限责任公司	73,391.93	19.76%	2,978.61	2.55%	62,000.00	22.92%	138,370.54	18.24%
平安证券有限责任公司	63,305.69	17.05%	89,162.89	76.29%	12,000.00	4.43%	164,468.58	21.68%
合计	371,329.71	100.00%	116,870.57	100.00%	270,560.00	100.00%	758,760.29	100.00%

关联人及券商名	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安	74.75	24.07%	0.08%
华夏证券有限公司	65.66	21.15%	0.08%
南方证券有限公司	55.40	17.84%	0.08%
国通证券有限责任公司	61.15	19.70%	0.08%
平安证券有限责任公司	53.54	17.24%	0.08%
合计	310.50	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%。

- 8、2002年1月11日，本基金托管人中国建设银行行长、法定代表人由王雪冰变更为张恩照。
- 9、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及基金的会计师事务所无变动情况。

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 1999 年年度报告
- 5、金鑫证券投资基金 2000 年中期报告
- 6、金鑫证券投资基金 2000 年年度报告
- 7、金鑫证券投资基金 2000 年年度收益分配报告
- 8、金鑫证券投资基金 2001 年中期报告
- 9、金鑫证券投资基金 2001 年年度报告
- 10、金鑫证券投资基金 2001 年年度收益分配报告
- 11、报告期内披露的各项公告原件
- 12、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)62531069

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2002 年 3 月 29 日