

# 国泰金鹰增长证券投资基金 2003 年中期报告

## 重要提示

本基金的托管人交通银行已于 2003 年 8 月 26 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，本报告书中的内容均由本基金管理人负责解释。

本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本基金的销售文件。

## 一、基金简介

### (一) 基金名称：国泰金鹰增长证券投资基金（简称：国泰金鹰增长）

基金代码：020001

基金发起人：国泰基金管理有限公司

基金发行日期：2002 年 4 月 16 日

基金成立日期：2002 年 5 月 8 日

首次募集规模：2, 226, 366, 461. 68 份

基金类型：契约型开放式

基金存续期：无限期

### (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：交通银行

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

邮政编码：200120

法定代表人：方诚国

托管部负责人：谢红兵

信息披露负责人：江永珍

联系地址：上海市银城中路 188 号

联系电话：021-58408846

传真：021-58408836

(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：上海市浦东新区东昌路 568 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

联系人：陈兆欣

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

基金本期净收益	-169,321,833.08元
单位基金本期净收益	-0.0709元
基金可分配净收益	-177,983,149.79元
单位基金可分配净收益	-0.0745元
期末基金资产总值	2,218,492,733.37元
期末基金资产净值	2,211,074,237.58元
单位基金资产净值	0.926元
基金资产净值收益率	-7.37%
本期基金资产净值增长率	5.47%
基金累计资产净值增长率	-7.40%

(二) 主要财务指标计算公式

基金可分配净收益 = 期末未分配收益 - 期末未实现利得损失

基金资产净值收益率 = 基金本期净收益 / 期初基金资产净值

本期基金资产净值增长率 = 期末单位净值 / 期初单位净值 - 1

基金累计资产净值增长率 = (2002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

<p>投资目标</p>	<p>在保证基金资产安全前提下，主要通过投资增长型上市公司，分享中国经济增长成果，实现基金资产的中长期增值，同时确保基金资产必要的流动性，将投资风险控制在较低的水平。</p>
<p>投资范围</p>	<p>本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资重点是利润或收入具有良好增长潜力的增长型上市公司，这部分投资比例将不低于本基金股票资产的80%。</p>
<p>投资理念</p>	<p>价格终将反映价值。</p>
<p>投资策略</p>	<p>本基金投资策略：资产配置和行业配置采用自上而下的方法；股票选择采用自下而上的方法。基金组合投资的基本范围：股票资产25%-75%；债券资产55%-20%；现金资产20%-5%。其中中长期投资占股票投资比例的80%以上；短期投资占股票投资比例不超过20%。</p> <p>股票投资方面，本基金重点投资于主营业务收入或利润具有良好增长潜力的增长型上市公司，从基本面分析入手选择增长型股票。具有以下全部和部分特点的公司将是本基金积极关注的对象：①公司所处的行业增长前景明朗，公司在该行业内具有一定的行业地位，或者具有明显竞争优势和实力，能充分把握行业发展的机遇；②经营业务中至少有一项突出的产品或服务，依靠商业模式和管理水平取胜；③公司主营业务收入或利润增长较快；④财务状况趋于良性，具有合理的现金流状况；⑤公司管理层敬业负责，经营规范，具有敏锐的商业触觉和创新精神。</p> <p>本基金通过对上市公司所处行业增长性及其在行业中的竞争地位、公司商业模式、核心竞争能力、企业资本扩张能力、战略重组等多方面的因素进行综合评估；以上市公司过去两年的主营业务收入和利润增长以及未来两至三年的预期增长性为核心，综合考察上市公司的增长性及其可靠性和可持续性。在此基础上本基金将进一步考量其股价所对应的市盈率、市净率等与市场（行业）平均水平，以及增长性相比是否合理，结合资本市场的具体情况，适时作出具体的投资决策。</p> <p>债券投资方面，本基金可投资于国债、金融债和企业债等（包括可转换债）。按照基金总体资产配置计划，以满足流动性需求为前提，提高基金的收益水平。</p> <p>本基金将在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响水平、各品种的收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素。通过宏观经济分析、相对价值分析建立由不同类型、不同期限债券品种构成的组合。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>本基金以上证A股指数作为衡量基金业绩的比较基准。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金追求中性偏低的风险收益，通过组合投资于增长型股票，力争实现基金单位资产净值在大盘上涨时增幅不低于比较基准上涨幅度的65%，大盘下跌时基金单位资产净值跌幅不高于比较基准跌幅的60%；年度内基金单位资产净值的标准差小于比较基准的标准差。</p>

## （二）基金经理介绍

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

## （三）2003年上半年证券市场与投资管理回顾

### 1、上半年证券市场回顾

上半年股市呈现局部牛市特征，行情以“价值加成长”为主线展开。进入景气周期的行业以及具备良好未来预期的行业，如：汽车、金融、钢铁、港口机场、电力、石化等，受到资金的追捧。大盘、绩优、蓝筹股普遍受到机构投资者的青睐，而市盈率偏高、成长性不足、价格高估的行业及个股则整体呈现阴跌态势，部分品种迭创新低。

自2001年以来，机构投资者一直在摸索适合阳光资金的盈利模式。有没有盈利模式，有没有赚钱效应，是决定市场能否吸引资金的关键所在。我们欣喜地看到，整个基金业初步回答了这个问题。上半年，不同风险偏好的持有人各自获得了不等的收益。与单纯资金推动的投资相比，研究驱动的组合投资带来了较小风险下的稳定收益。因此，新的基金和新的投资品种具备了比过去更加扎实的价值基础和更加持续的吸引力。

### 2、上半年基金投资回顾

本基金年初的组合以次新股、中小盘股为主，持股较为分散，平均市盈率较高，行业特征不明显，在“核心资产”上的配置明显不足。为此，本基金在2003年上半年进行了较大力度的结构调整，对组合中不符合价值投资方向、价格明显高估的次新、重组、中小盘股等资产进行了不懈地减持，同时根据研究部门对行业景气度的分析和盈利预测，重点增持了金融、电力、石化、汽车、港口机场等价值增长板块中的龙头品种。上半年所进行的结构调整大部分是在所减持的股票价格不断走低而所增持的股票价格不断走强的状况下完成的，为此使本基金的净值增长率相应受到一些影响。但这也为下半年本基金业绩的稳定增长奠定了必要的基础。

债券投资方面，本基金管理小组致力于从长期投资的视野出发，寻求良好的风险回报格局。上半年较准确地把握了国债市场的发展趋势，久期管理效果明显。除了非典期间阶段性参与了新债认购以外，大部分时间保持了较低的组合久期，同时可转换债券投资风格稳健，效果良好。

## （四）2003年下半年市场及投资管理展望

下半年从宏观经济层面看，经济仍将保持持续增长，新一轮的景气周期正在形成，GDP仍能保持8%的增长速度；从微观层面看，上市公司业绩在2003年有所提升，主要行业龙头公司估值水平与国际市场接近；从政策面看，国有股问题、货币政策、汇率政策的不确定性依然存在；从资金面看，主流板块前期涨幅较高，使得外围资金观望气氛较浓，相对高位进场意愿不强烈，而下半年市场扩容压力较大，即使考虑新发基金等入场资金，增量资金也较为有限。由此本基金管理小组认为03年下半年市场整体仍将呈现平衡市格局，市场内部的结构调整仍将继续，机构投资者倾向于选择股价相对内在价值有更高的折扣的策略来抵御风险，这无疑加大了选股的难度。在操作中本基金管理小组将继续坚持价值增长的投资理念，依靠研究的支持，精选子行业和个股，兢兢业业，力争给持有人带来满意的回报。

债券投资方面，汇率政策在近期进行调整的可能性不大；紧缩型货币政策将持续一段时间。如果目前管理层的“窗口指导”不能有效控制投资的迅速增长以及银行的大量

快速放贷，则偏于紧缩的政策倾向可能会引发较严格的信贷紧缩。可转换债券方面，发行及交易总体将保持目前比较活跃的格局。因此，本基金在货币政策不明朗因素消除以前，债券投资方面将基本保持低久期资产配置格局。同时将积极参与新券发行，因为新券具有较好的流动性，如果定价合适，上市后存在一定的获利空间，所以本基金将选择地在合适时间、合适价位参与新发品种投资，并加大对企业债券一级市场的参与力度；同时继续保持稳健的可转换债券投资策略。

## （五）内部监察报告

### 1、基金运作合法合规性声明

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、《开放式证券投资基金试点办法》等有关法律法规的规定，严格遵守基金契约约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等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。

经持续监察稽核，本基金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基金资产、与公司资产之间严格分开、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。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，并通过稳健经营、规范运作、规避风险、提高收益，保护了基金持有人的合法权益。

### 2、内部监察工作报告

本报告期内，公司稽核监察部门独立地开展对基金投资管理和内部管理的合规性监察，并注重公司内部控制体系的建设与完善，对发现的问题及时提出改进建议、并跟踪改进措施的落实情况，同时定期向主管机关和董事长报送监察稽核报告。

本基金管理人采取的主要监察稽核措施包括：

①加强对基金投资管理合规性的监控。监察稽核部门在总结经验的基础上，进一步加强基金管理监察工作的实效性和系统性。做好对日常投资交易的实时监控，及时记录、分析交易情况，并对异常现象予以提示。同时对投资交易制度和流程的执行情况进行定期检查，确保基金投资交易的合规性。通过实时监控、专项稽核、报表审核和资料查阅等方式，有效防范基金投资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。

②完善公司内部控制体系。通过聘请国际著名咨询机构进行管理咨询，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。同时根据证监会颁布的《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》，对公司内控大纲、员工守则、紧急应变制度等基本内部控制制度进行了修订和完善，初步形成了以公司章程、基本控制制度和标准业务流程为三个层次的内部控制制度体系，并通过日常监察稽核，保障内部控制措施的落实。

③加强对投资风险的量化评估和控制。公司从国外引进的风险管理系统采用先进的风险分析方法，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。公司在风险管理系统生成数据的基础上，进行深入分析和提炼，对各基金面临的投资风险进行定量监控，形成定期的风险报告，为投资决策委员会和基金经理的决策提供风险建议和提示。

④进一步明确公司所管理的封闭式基金的产品特性。本着对投资人负责的原则，遵循基金契约的约定，在2002年基金年报的基金产品说明书中，进一步明确了基金的投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、业绩比较标准等要素。

⑤加强对员工行为和职业素质的监察。公司修订了《员工自律承诺书》和《基金管理岗位人员自律承诺书》，补充了随着业务发展出现的新要求，部署全体员工认真学习并签署承诺，并通过日常监察，不断提高员工遵纪守法的自觉性和职业道德素质的提高。

⑥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，加强专业技能培训力度，不断提升稽核监察和风险管理人员的业务素质和能力。

本基金管理人承诺将继续以“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，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

2003年上半年，交通银行在国泰金鹰增长证券投资基金的托管业务中，严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》及其实施准则的规定，依据《国泰金鹰增长证券投资基金基金契约》和《国泰金鹰增长证券投资基金托管协议》中的条款和其他有关规定，依法安全保管了基金的全部资产，勤勉尽责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。

2003年上半年，按照《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》及实施准则、基金契约、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人——国泰基金管理有限公司在国泰金鹰增长证券投资基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值、基金单位净值和其他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。

2003年上半年，由国泰金鹰增长证券投资基金的管理人——国泰基金管理有限公司编制并经交通银行基金托管部复核审查的有关国泰金鹰增长证券投资基金的信息披露合法、真实、完整。

交通银行基金托管部

2003年8月25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  
2003年6月30日

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	107,580,832.73	32,653,834.26	应付证券清算款	12,070,981.28	
清算备付金	200,279,885.68	19,820,176.68	应付赎回款	666,428.37	476,037.09
交易保证金	500,000.00	750,000.00	应付赎回费	34,103.40	60,583.49
应收证券清算款	3,560,663.32	31,779,563.47	应付管理人报酬	3,022,322.24	2,900,795.53
应收股利			应付托管费	503,720.37	483,465.94
应收利息	7,218,666.96	6,982,403.96	应付佣金	437,256.41	2,653,244.64
应收申购款	36,445.00	3,940.00	应付利息		
其他应收款		100,000,000.00	应付收益		
股票投资市值	1,299,036,512.09	1,440,871,323.79	未交税金		
其中：股票投资成本	1,627,521,852.92	1,477,925,496.68	其他应付款	735,257.61	739,291.21
债券投资市值	696,964,487.21	585,631,491.21	卖出回购证券款		
其中：债券投资成本	705,101,548.88	587,634,176.49	短期借款		
配股权证			预提费用	1,378,600.00	105,077.89
买入返售证券			其他负债		
待摊费用			负债合计	18,848,669.68	7,418,495.79
其他资产			持有人权益：		
			实收基金	2,615,281,780.24	2,389,057,387.37
			未实现利得	-348,847,372.50	-46,663,782.14
			未分配收益	29,894,415.57	-131,319,367.65
			持有人权益合计	2,296,328,823.31	2,211,074,237.58
资产总计	2,315,177,492.99	2,218,492,733.37	负债及持有人权益 总计	2,315,177,492.99	2,218,492,733.37

附注：基金单位净值0.926元

## 2、经营业绩表

### 经营业绩表 2003年1-6月

单位：元

项目	2003年1-6月
一、收入	-148,289,960.47
1、股票差价收入	-175,409,139.31
2、债券差价收入	-1,685,549.39
3、债券利息收入	10,690,559.06
4、存款利息收入	2,649,428.51
5、股利收入	13,252,562.75
6、买入返售证券收入	15,006.00
7、其他收入	2,197,171.91
二、费用	21,031,872.61
1、基金管理人报酬	17,647,943.73
2、基金托管费	2,941,323.96
3、卖出回购证券支出	302,466.00
4、利息支出	
5、其他费用	140,138.92
其中：上市年费	
信息披露费	49,588.57
审计费用	69,588.57
三、基金净收益	-169,321,833.08
加：未实现利得	297,565,544.33
四、基金经营业绩	128,243,711.25

## 3、基金收益分配表

### 基金收益分配表 2003年1-6月

单位：元

项目	2003年1-6月
本期基金净收益	-169,321,833.08
加：期初基金净收益	29,894,415.57
加：本期损益平准金	8,108,049.86
可供分配基金净收益	-131,319,367.65
减：本期已分配基金净收益	
期末基金净收益	-131,319,367.65



#### 4、基金净值变动表

基金净值变动表  
2003年1-6月

单位：元

项目	金额
一、期初基金净值	2,296,328,823.31
二、本期经营活动：	
基金净收益	-169,321,833.08
未实现利得	297,565,544.33
经营活动产生的基金净值变动数	128,243,711.25
三、本期基金单位交易：	
基金申购款	308,775,528.86
基金赎回款	-522,273,825.84
基金单位交易产生的基金净值变动数	-213,498,296.98
四、本期向持有人分配收益：	
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	
五、期末基金净值	2,211,074,237.58

### (二) 基金会计报表附注

#### 1、基金简介

国泰金鹰增长证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》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[2002]12号文）批准，于2002年5月8日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期为无限期，首次发行规模为22.26亿份基金单位。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行。

根据《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》和证监基字[2002]12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2003年1月1日至2003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：
- ①任何上市流通的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价估值。
  - ②未上市的股票应区分以下情况处理：
    - a. 配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；
    - b. 首次公开发行的股票，按成本估值。
  - ③配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按市价高于配股价的差额估值；如果市价等于或低于配股价，则估值额为零。
  - ④如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理公司应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。
  - ⑤如有新增事项，按国家最新规定估值。
- (5) 基金的主要收入确认政策：
- ①股票差价收入：于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。
  - ②债券差价收入：卖出上市债券，应于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；卖出非上市债券，应于实际收到价款时确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。
  - ③债券利息收入：为债券持有期内按债券票面价值与票面利率逐日计提的利息。
  - ④存款利息收入：按本金与适用的利率逐日计提的利息确认，计提对象为银行存款和清算备付金。
  - ⑤股利收入：在除息日确认股利收入，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。
  - ⑥买入返售证券收入：在证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。
  - ⑦其他收入：在实际收到时确认。
- (6) 证券成本的计价方法：  
证券投资按取得时的实际成本计价，出售成本按移动加权平均法计算。
- (7) 税项说明：  
根据财税字[1998]55号及财税字[2001]61号《关于证券投资基金税收问题的通知》，主要税项规定如下：
- ①以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围。
  - ②基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，至2003年12月31日前暂免征收营业税。
  - ③对基金管理人运用基金资产买卖股票按2‰的税率征收印花税。
  - ④对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (8) 基金的收益分配政策：
- ①每份基金单位享有同等分配权；
  - ②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；
  - ③如果基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
  - ④基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值；
  - ⑤全年合计的基金收益分配比例不得低于基金年度净收益的90%；

- ⑥在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每半年至少分配一次，但若成立不满3个月可不进行当期收益分配，中期分配应在基金会计年度前6个月结束后的3个月内完成，年度分配在基金会计年度结束后的3个月内完成；
- ⑦基金持有人可以选择取得现金或将所获得红利再投资于本基金，选择采取红利再投资形式的，分红资金按权益登记日的基金单位资产净值转成相应的基金单位；
- ⑧法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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
国泰基金管理有限公司	基金发起人	发行基金	基金契约	基金直销机构
	基金管理人	提取管理费	基金契约	
交通银行	基金托管人	提取托管费	基金契约	基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司 (以下简称“国泰君安”)	基金管理人股东	出租交易席位	基金契约	基金代销机构
	席位出租人		席位使用协议	

##### (2) 通过关联人席位交易及与关联人进行交易情况

###### ①通过关联人席位进行股票买卖2003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	91,192.35	19.06%	73.53	19.08%

###### ②通过关联人席位进行债券投资买卖2003年1-6月交易量(万元)情况

关联人	交易量	比例
国泰君安	14,775.92	8.89%

###### ③通过关联人席位进行债券回购2003年1-6月交易量(万元)情况

关联人	交易量	比例
国泰君安	5,000.00	10.19%

###### ④与关联人进行债券回购年交易量(万元)及利息支出(万元)情况 2003年1-6月未与关联人进行债券回购交易

###### ⑤与关联人进行国债买卖年交易量(万元)情况 2003年1-6月未与关联人进行国债买卖交易

##### (3) 基金管理人报酬

###### ①基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

- ②基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。
- ③在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共17,647,943.73元，其中已支付基金管理人14,747,148.20元，尚余2,900,795.53元未支付。

(4) 基金托管人报酬

- ①基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：  

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$
 H为每日应支付的托管人报酬  
 E为前一日的基金资产净值

- ②基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。
- ③在本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共2,941,323.96元，其中已支付基金托管人2,457,858.02元，尚余483,465.94元未支付。

5、主要报表项目说明

- (1) 应收利息：2003年6月30日余额为6,982,403.96元，系应收银行存款和清算备付金利息124,599.15元及应收债券利息6,857,804.81元。
- (2) 其他应付款：2003年6月30日余额为739,291.21元，系应缴股利税金239,291.21元及暂收券商(申银万国)支付的席位保证金500,000.00元。
- (3) 预提费用：2003年6月30日余额为105,077.89元，系预提基金2003年度审计费用49,588.57元，信息披露费49,588.57元及债券托管账户维护费5,900.75元。
- (4) 其他收入：2003年1—6月累计发生额为2,197,171.91元，包括基金赎回费收入2,089,096.22元，新股中签及债券承购手续费返还67,819.66元，及其他收入40,256.03元。
- (5) 卖出回购证券支出：2003年1—6月累计发生额为302,466.00元，系卖出回购证券在融资期限内逐日计提的利息支出。
- (6) 应由基金承担的其他费用：2003年1—6月累计发生额为140,138.92元，包括基金信息披露费49,588.57元，审计费用69,588.57元，回购交易费用4,770.33元及其他费用16,191.45元。
- (7) 实收基金：

	基金单位数
期初份额：	2,615,281,780.24
本期申购：	321,528,838.55
本期赎回：	547,753,231.42
期末份额：	2,389,057,387.37

(8) 未实现利得：

期初数	-348,847,372.50元
未实现估值减值变动数	297,565,544.33元
本期申购基金单位的未实现损失平准金	6,073,133.62元
本期赎回基金单位的未实现损失平准金	-1,455,087.59元
期末余额	-46,663,782.14元

### (三) 流通受限制的证券

1、截至2003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)	备注
1	三一重工	2003-6-23	2003-7-3	39,000	606,840.00	二级市场配售
2	北方天鸟	2003-6-24	2003-7-4	24,000	230,400.00	二级市场配售
3	瑞贝卡	2003-6-30	2003-7-10	13,000	135,200.00	二级市场配售
	合计				972,440.00	

#### 2、流通受限原因

基金获配新股，从新股获配日至新股上市日或以下规定期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。

根据中国证券监督管理委员会的政策规定，2000年5月18日起新股发行时不再单独向基金配售新股。基金可使用以基金名义开设的股票帐户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者参与认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在约定期限内不能自由流通。

根据中国证券监督管理委员会证监发行字[2002]54号文《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》，自2002年5月20日起，恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股市值参与配售，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、估值办法

上述未上市流通的三只股票按成本价估值。

### (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	数量	市值	占净值比例
1	600036	招商银行	9,822,422	111,189,817.04	5.03%
2	600050	中国联通	33,530,979	107,969,752.38	4.88%
3	600104	上海汽车	6,859,331	81,557,445.59	3.69%
4	600205	山东铝业	6,880,406	79,262,277.12	3.58%
5	600011	华能国际	5,303,550	78,757,717.50	3.56%
6	600019	宝钢股份	14,482,075	74,003,403.25	3.35%
7	000895	双汇发展	4,958,354	65,053,604.48	2.94%
8	600004	白云机场	7,091,371	61,624,013.99	2.79%
9	600028	中国石化	15,919,709	59,539,711.66	2.69%
10	000866	扬子石化	8,434,458	55,245,699.90	2.50%
11	600009	上海机场	4,425,797	47,090,480.08	2.13%
12	000542	TCL 通讯	2,869,069	46,192,010.90	2.09%
13	000778	新兴铸管	4,163,124	45,502,945.32	2.06%

14	000088	盐田港 A	2,124,407	43,040,485.82	1.95%
15	000630	铜都铜业	5,546,271	40,376,852.88	1.83%
16	000027	深能源 A	4,988,980	40,261,068.60	1.82%
17	600642	申能股份	3,107,474	36,792,492.16	1.66%
18	600002	齐鲁石化	6,699,590	35,842,806.50	1.62%
19	000400	许继电气	3,990,806	34,919,552.50	1.58%
20	600710	常林股份	3,789,373	28,988,703.45	1.31%
21	000800	一汽轿车	2,999,923	28,769,261.57	1.30%
22	600308	华泰股份	2,611,978	28,444,440.42	1.29%
23	600460	士兰微	1,552,807	26,816,976.89	1.21%
24	000037	深南电 A	1,671,342	22,563,117.00	1.02%
25	600585	海螺水泥	2,881,992	22,393,077.84	1.01%
26	600740	山西焦化	2,139,996	20,629,561.44	0.93%
27	600000	浦发银行	943,982	11,016,269.94	0.50%
28	000903	云内动力	888,793	10,372,214.31	0.47%
29	000513	丽珠集团	1,112,954	10,161,270.02	0.46%
30	000680	山推股份	1,019,107	10,160,496.79	0.46%
31	000520	中国凤凰	1,740,001	10,092,005.80	0.46%
32	000883	三环股份	1,455,050	9,486,926.00	0.43%
33	600584	长电科技	746,082	9,161,886.96	0.41%
34	000825	太钢不锈	1,697,939	8,540,633.17	0.39%
35	600609	金杯汽车	1,017,304	7,650,126.08	0.35%
36	600520	三佳模具	494,140	4,807,982.20	0.22%
37	600016	民生银行	463,842	4,624,504.74	0.21%
38	600302	标准股份	433,573	4,379,087.30	0.20%
39	600166	福田汽车	308,847	4,286,796.36	0.19%
40	600741	巴士股份	786,864	4,099,561.44	0.19%
41	600686	厦门汽车	326,183	3,738,057.18	0.17%
42	600033	福建高速	201,445	1,659,906.80	0.08%
43	600018	上港集箱	107,217	1,276,954.47	0.06%
44	000528	桂柳工 A	81,049	808,058.53	0.04%
45	000725	京东方 A	73,853	748,869.42	0.03%
46	600031	三一重工	39,000	606,840.00	0.03%
47	600435	北方天鸟	24,000	230,400.00	0.01%
48	600439	瑞贝卡	13,000	135,200.00	0.01%
	合计			1,440,871,323.79	65.17%

(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	600000	浦发银行		2,191,736	1,000,000	2,247,754
2	600002	齐鲁石化		6,718,161		18,571
3	600004	白云机场	601,000	12,760,876		6,270,505
4	600009	上海机场		7,510,647		3,084,850
5	600016	民生银行		499,935		36,093
6	600018	上港集箱		530,097		422,880
7	600031	三一重工	39,000			
8	600033	福建高速		2,230,000	201,445	2,230,000
9	600205	山东铝业		9,145,306		2,264,900
10	600308	华泰股份		3,068,697	683,485	1,140,204
11	600435	北方天鸟	24,000			
12	600439	瑞贝卡	13,000			
13	600460	士兰微	9,000	1,656,314		112,507
14	600520	三佳模具		275,259	220,207	1,326
15	600584	长电科技	49,000	700,000		2,918
16	600585	海螺水泥		2,911,889		29,897
17	600642	申能股份		3,506,511		399,037
18	600686	厦门汽车		329,239		3,056
19	600710	常林股份		4,584,768		795,395
20	600741	巴士股份		4,675,178		3,888,314
21	000027	深能源 A		6,365,426		1,376,446
22	000037	深南电 A		1,674,779		3,437
23	000513	丽珠集团		1,803,899		690,945
24	000520	中国凤凰		2,071,225		331,224
25	000528	桂柳工 A		899,996		818,947
26	000542	TCL 通讯		3,161,116		292,047
27	000630	铜都铜业		7,772,507		2,226,236
28	000680	山推股份		1,717,600		698,493
29	000725	京东方 A		74,453		600
30	000778	新兴铸管		8,327,432		4,164,308
31	000800	一汽轿车		2,999,923		
32	000825	太钢不锈		2,223,800		525,861
33	000866	扬子石化		8,453,027		18,569
34	000883	三环股份		2,053,247	175,263	773,460
35	000895	双汇发展		4,965,487		7,133

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	600005	武钢股份		1,894,610	1,894,610
2	600008	首创股份	2,804,377		2,804,377
3	600012	皖通高速	414,000		414,000
4	600026	中海发展	800,000		800,000
5	600030	中信证券	874,000		874,000
6	600039	四川路桥		123,000	123,000
7	600063	皖维高新	3,221,347		3,221,347
8	600066	宇通客车	1,570,869		1,570,869
9	600071	凤凰光学	750,910		750,910
10	600085	同仁堂		179,186	179,186
11	600100	清华同方		162,400	162,400
12	600105	永鼎光缆	1,021,486		1,021,486
13	600130	波导股份		84,199	84,199
14	600133	东湖高新	1,460,515		1,460,515
15	600163	福建南纸	397,076		397,076
16	600170	上海建工	4,079,895	599,891	4,679,786
17	600177	雅戈尔		560,000	560,000
18	600183	生益科技		147,985	147,985
19	600188	兖州煤业		1,499,910	1,499,910
20	600189	吉林森工	117,700		117,700
21	600195	中牧股份	3,320,712		3,320,712
22	600202	哈空调	803,380		803,380
23	600203	福日股份	633,069		633,069
24	600210	紫江企业	334,493		334,493
25	600213	亚星客车	837,066		837,066
26	600215	长春经开	3,111,260		3,111,260
27	600223	万杰高科	2,277,970		2,277,970
28	600236	桂冠电力		1,025,521	1,025,521
29	600242	华龙集团	2,204,291		2,204,291
30	600251	冠农股份		19,000	19,000
31	600260	凯乐科技	300,696		300,696
32	600261	浙江阳光	1,200,553		1,200,553
33	600269	赣粤高速	2,909,947	300,000	3,209,947
34	600273	华芳纺织		94,000	94,000
35	600276	恒瑞医药		63,993	63,993
36	600283	钱江水利	862,829		862,829
37	600291	西水股份		119,000	119,000
38	600298	安琪酵母	678,891		678,891
39	600313	*ST中农	2,159,446		2,159,446



40	600315	上海家化	1,307,902		1,307,902
41	600318	巢东股份	2,313,864		2,313,864
42	600320	振华港机	1,932,823		1,932,823
43	600323	南海发展	2,645,827		2,645,827
44	600327	大厦股份		17,000	17,000
45	600336	澳柯玛		47,000	47,000
46	600343	航天动力		73,000	73,000
47	600345	长江通信	605,883		605,883
48	600350	山东基建		8,472,649	8,472,649
49	600355	精伦电子	1,473,937		1,473,937
50	600359	新农开发	611,214		611,214
51	600361	华联综超	33,874		33,874
52	600362	江西铜业	3,024,744	8,190,811	11,215,555
53	600370	三房巷		41,000	41,000
54	600375	星马汽车		17,000	17,000
55	600386	北京巴士	2,000,825		2,000,825
56	600388	龙净环保	1,875,949		1,875,949
57	600390	金瑞科技	683,861		683,861
58	600392	太工天成		12,000	12,000
59	600400	红豆股份	619,728		619,728
60	600408	安泰集团		65,000	65,000
61	600409	三友化工		124,000	124,000
62	600418	江淮汽车	2,393,047	1,656,300	4,049,347
63	600428	中远航运	165,475		165,475
64	600433	冠豪高新		50,000	50,000
65	600436	片仔癀		18,000	18,000
66	600459	贵研铂业		20,000	20,000
67	600481	双良股份		81,000	81,000
68	600488	天药股份	43,280		43,280
69	600490	中科合臣		19,000	19,000
70	600498	烽火通信	1,734		1,734
71	600500	中化国际	669,515		669,515
72	600502	安徽水利		47,000	47,000
73	600506	香梨股份	1,558,739		1,558,739
74	600508	上海能源	3,064,057		3,064,057
75	600511	国药股份	32,000		32,000
76	600512	腾达建设	63,000		63,000
77	600513	联环药业		6,000	6,000
78	600515	第一投资	2,005,978		2,005,978
79	600519	贵州茅台		9,000	9,000
80	600521	华海药业		12,000	12,000
81	600526	菲达环保	186,673		186,673

82	600531	豫光金铅	828,236		828,236
83	600535	天士力	1,000	246,733	247,733
84	600536	中软股份	1,068,835		1,068,835
85	600537	海通集团		44,000	44,000
86	600538	北海国发		28,000	28,000
87	600552	方兴科技	23,000		23,000
88	600555	茉织华	2,531,493		2,531,493
89	600559	裕丰股份	25,000		25,000
90	600562	高淳陶瓷		13,000	13,000
91	600563	法拉电子	42,000		42,000
92	600569	安阳钢铁		3,414,500	3,414,500
93	600573	惠泉啤酒		58,000	58,000
94	600575	芜湖港		28,000	28,000
95	600576	庆丰股份		47,000	47,000
96	600580	卧龙科技	2,181,067	119,739	2,300,806
97	600583	海油工程	77,910		77,910
98	600591	上海航空	1,056,096	900,000	1,956,096
99	600597	光明乳业	478,140		478,140
100	600600	青岛啤酒		170,969	170,969
101	600611	大众交通		27,782	27,782
102	600616	第一食品	624,116		624,116
103	600618	氯碱化工		3,000	3,000
104	600635	大众公用	1,380,282		1,380,282
105	600643	爱建股份		60,000	60,000
106	600649	原水股份		1,669,999	1,669,999
107	600662	强生控股	758,768		758,768
108	600688	上海石化		1,430,000	1,430,000
109	600717	天津港	100,000		100,000
110	600742	一汽四环		2,335,467	2,335,467
111	600761	安徽合力	934,105		934,105
112	600777	新潮实业	658,454		658,454
113	600780	通宝能源	16,270		16,270
114	600812	华北制药		310,908	310,908
115	600820	隧道股份		695,700	695,700
116	600824	益民百货	3,131,999		3,131,999
117	600839	四川长虹		591,743	591,743
118	600875	东方电机		157,318	157,318
119	600887	伊利股份	1,000	643,985	644,985
120	000001	深发展A		3,778,278	3,778,278
121	000006	深振业A	1,282,190		1,282,190
122	000016	深康佳A		80,000	80,000
123	000024	招商局A	681,900		681,900

124	000406	石油大明	2,543,098	216,140	2,759,238
125	000422	湖北宜化	2,093,778		2,093,778
126	000426	富龙热力	845,394		845,394
127	000503	海虹控股		774,354	774,354
128	000531	穗恒运A	2,441,422		2,441,422
129	000541	佛山照明		1,270,941	1,270,941
130	000547	闽福发A	1,863,517		1,863,517
131	000576	广东甘化	2,066,886		2,066,886
132	000597	东北药		2,230,000	2,230,000
133	000598	蓝星清洗	1,033,728		1,033,728
134	000612	焦作万方	340,974	921,862	1,262,836
135	000615	湖北金环		224,751	224,751
136	000617	石油济柴	615,615		615,615
137	000631	兰宝信息	1,684,478		1,684,478
138	000726	鲁泰A		241,370	241,370
139	000755	山西三维	1,063,464		1,063,464
140	000759	武汉中百	4,251,825		4,251,825
141	000789	江西水泥	4,237,929		4,237,929
142	000811	烟台冰轮	1,143,178		1,143,178
143	000815	美利纸业	1,410,354		1,410,354
144	000820	金城股份	795,693		795,693
145	000859	国风塑业	940,159		940,159
146	000862	吴忠仪表	693,990		693,990
147	000877	天山股份		253,125	253,125
148	000910	大亚科技	751,573		751,573
149	000916	华北高速		592,215	592,215
150	000919	金陵药业	1,490,790		1,490,790
151	000922	阿继电器	1,621,635		1,621,635
152	000926	福星科技	1,201,315		1,201,315
153	000956	中原油气		20,000	20,000
154	000957	中通客车	1,082,688		1,082,688
155	000966	长源电力	2,536,214	599,920	3,136,134
156	000987	广州友谊	1,135,378		1,135,378

## (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		
2	采掘业	59,539,711.66	2.69%
3	制造业	763,173,459.27	34.52%
	其中：食品、饮料	65,053,604.48	2.94%
	纺织、服装、皮毛	135,200.00	0.01%
	造纸、印刷	28,444,440.42	1.29%
	石油、化学、塑胶、塑料	121,810,073.64	5.51%
	电子	36,727,733.27	1.66%
	金属、非金属	270,079,189.58	12.21%
	机械、设备、仪表	230,761,947.86	10.44%
	医药、生物制品	10,161,270.02	0.46%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	178,374,395.26	8.07%
5	建筑业		
6	交通运输、仓储业	154,691,841.16	7.00%
7	信息技术业	154,161,763.28	6.97%
8	批发和零售贸易		
9	金融、保险业	126,830,591.72	5.74%
10	房地产业		
11	社会服务业	4,099,561.44	0.19%
12	传播与文化产业		
13	综合类		
	合 计	1,440,871,323.79	65.17%

### 2、债券（不含国债）合计

截止2003年6月30日，国泰金鹰增长证券投资基金持有债券(不含应计利息)合计为102,699,259.50元，占基金资产净值的4.64%。

### 3、国债、货币资金合计

截止2003年6月30日，国泰金鹰增长证券投资基金持有国债(不含应计利息)及货币资金合计为567,185,806.12元（货币资金中含当日证券清算款31,779,563.47元），占基金资产净值的25.65%。

### 4、占基金资产净值前十名的股票

序号	名 称	市 值(元)	占净值比例
1	招商银行	111,189,817.04	5.03%
2	中国联通	107,969,752.38	4.88%
3	上海汽车	81,557,445.59	3.69%
4	山东铝业	79,262,277.12	3.58%
5	华能国际	78,757,717.50	3.56%
6	宝钢股份	74,003,403.25	3.35%

7	双汇发展	65,053,604.48	2.94%
8	白云机场	61,624,013.99	2.79%
9	中国石化	59,539,711.66	2.69%
10	扬子石化	55,245,699.90	2.50%

5、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收盘价，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、应收申购款、应付管理费、托管费、佣金、预提费用、应付赎回款、应付赎回费及其他应收应付款项合计为借方余额100,317,848.17元，与基金股票市值1,440,871,323.79元、债券(不含国债)合计102,699,259.50元、国债及货币资金合计567,185,806.12元相加后等于基金资产净值。

六、重要事项揭示

- 1、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，经国泰基金管理公司第二届董事会第九次会议审议批准，公司决定聘任吕俊先生为金鹰增长基金基金经理，张以杰先生、徐学标先生、黄刚先生不再担任金鹰增长基金基金经理。
- 2、2003年6月27日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司关于股东出资转让的公告》。经本基金管理人2003年第一次临时股东会审议通过，并报中国证监会证监基金字[2003]47号文批准，本基金管理人股东国泰君安将其所持本基金管理人19%的出资转让给上海国有资产经营有限公司。转让完成后，本基金管理人股东及其出资比例为：上海国有资产经营有限公司19%、国泰君安11%、上海爱建信托投资有限责任公司20%、浙江省国际信托投资公司20%、宏源证券20%、中国电力财务有限公司10%。
- 3、2003年6月30日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司关于调低国泰金鹰增长证券投资基金赎回费率的公告》。为降低广大国泰金鹰增长证券投资基金（以下简称“本基金”）投资人的赎回费用，根据《国泰金鹰增长证券投资基金基金契约》和《国泰金鹰增长证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人决定调低本基金的赎回费率。自二零零三年七月三日起，基金持有人在赎回所持有的本基金基金份额时，赎回部分基金份额持有期未满一年的，赎回费率为0.5%；持有期超过一年（包括一年）的，赎回费率调低为0.2%。“持有期”指自基金份额认购/申购确认日至赎回申请日的期间。赎回费用用于支付基金注册登记等费用。
- 4、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2003年度向国泰君安、汉唐证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司（以下简称“申银万国”）、兴业证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、中富证券有限责任公司、中国国际金融有限公司这八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情况稳定；
  - (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。

- 5、在报告期内，关联人及席位券商股票、债券、回购的交易量及佣金(单位为万元)情况为：

关联人及券商名	股票交易量	比例	债券交易量	比例	回购交易量	比例	证券交易量	比例
国泰君安	91,192.35	19.06%	14,775.92	8.89%	5,000.00	10.19%	110,968.27	16.00%
汉唐证券有限责任公司	73,882.35	15.44%	37,784.28	22.73%			111,666.63	16.10%
申银万国	80,290.52	16.78%	7,541.18	4.54%			87,831.70	12.66%
兴业证券股份有限公司	26,789.28	5.60%	680.13	0.41%			27,469.41	3.96%
平安证券有限责任公司	27,572.00	5.76%	6,920.20	4.16%	5,000.00	10.19%	39,492.20	5.69%
银河证券有限责任公司	46,377.35	9.69%	9,582.65	5.77%			55,960.00	8.07%
中富证券有限责任公司	28,134.96	5.88%	21,400.88	12.88%	13,070.00	26.63%	62,605.84	9.02%
中国国际金融有限公司	104,228.34	21.79%	67,500.43	40.62%	26,000.00	52.99%	197,728.77	28.50%
合计	478,467.15	100.00%	166,185.67	100.00%	49,070.00	100.00%	693,722.82	100.00%

关联人及券商名	佣金	比例	平均佣金比率
国泰君安	73.53	19.08%	0.08%
汉唐证券有限责任公司	60.24	15.64%	0.08%
申银万国	62.83	16.31%	0.08%
兴业证券股份有限公司	20.96	5.44%	0.08%
平安证券有限责任公司	22.49	5.84%	0.08%
银河证券有限责任公司	37.95	9.85%	0.08%
中富证券有限责任公司	22.73	5.90%	0.08%
中国国际金融有限公司	84.54	21.94%	0.08%
合计	385.27	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。

- 6、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。

## 七、备查文件目录

- 1、关于同意设立国泰金鹰增长证券投资基金的批复
- 2、国泰金鹰增长证券投资基金契约
- 3、国泰金鹰增长证券投资基金托管协议
- 4、国泰金鹰增长证券投资基金年度报告
- 5、国泰金鹰增长证券投资基金代销协议
- 6、报告期内披露的各项公告
- 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。

客户服务中心电话：(021)68674688

投资人投诉电话：(021) 50819801

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2003年8月29日