

金盛证券投资基金

2005 年年度报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇〇六年三月二十七日

金盛证券投资基金 2005 年年度报告

一、重要提示及目录

（一）重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于2006年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（二）目录

内容	页码
一、重要提示及目录.....	1
二、基金简介.....	2
三、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	4
四、基金管理人报告.....	6
五、基金托管人报告.....	8
六、审计报告.....	9
七、财务会计报告.....	10
八、基金投资组合报告.....	20
九、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	24
十、重大事件揭示.....	25
十一、备查文件目录.....	27

二、基金简介

（一）基金名称：金盛证券投资基金

基金简称：基金金盛

交易代码：184703

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2000年4月26日

报告期末基金份额总额：500,000,000份

基金合同存续期：至2009年11月30日止

基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：2000年6月30日

（二）基金产品说明

（1）投资目标：本基金是以涉及新兴产业的上市公司为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。

（2）投资策略：根据国家宏观经济环境决定投资的总体策略；根据利率的走势和通货膨胀预期决定本基金的债券投资比例；根据国家的产业政策以及行业发展的状况决定行业投资战略；根据对上市公司的价值分析和其在行业中的竞争优势分析选择所要投资的股票。

本基金在行业资产配置中坚持相对集中的投资策略，挖掘具有良好发展态势的行业，将资产权重的较大部分配置到处于起步或成长阶段的行业。

（3）业绩比较基准：无。

（4）风险收益特征：承担较高风险，获取较高的超额收益。

（三）基金管理人

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

邮政编码：200122

办公地址：上海市延安东路700号港泰广场22-23楼

邮政编码：200001

法定代表人：陈勇胜

信息披露负责人：丁昌海

联系电话：021-23060282

传真：021-23060283

电子邮箱：xinxipilu@gtfund.com

（四）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司
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：郭树清
信息披露负责人：尹东
联系电话：010-67597420
传真：010-66212639
电子邮箱：yindong@ccb.cn

（五）信息披露情况

信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载年度报告正文的管理人网址：<http://www.gtfund.com>
年度报告置备地点：上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼
北京市西城区金融大街 25 号

（六）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 8 楼

（七）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
办公地址：广东省深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

三、 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一) 各主要财务指标

	2005年	2004年	2003年
基金本期净收益	-20,139,108.72元	81,878,248.56元	11,780,467.96元
基金份额本期净收益	-0.0403元	0.1638元	0.0236元
期末可供分配基金收益	-20,091,035.04元	948,066.00元	-30,930,182.56元
期末可供分配基金份额收益	-0.0402元	0.0019元	-0.0619元
期末基金资产净值	525,232,171.63元	509,828,831.06元	545,833,830.87元
期末基金份额净值	1.0505元	1.0197元	1.0917元
基金加权平均净值收益率	-4.00%	14.27%	2.47%
本期基金份额净值增长率	3.20%	2.60%	31.12%
基金份额累计净值增长率	15.08%	11.51%	8.69%

注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 基金净值表现

1、基金金盛净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

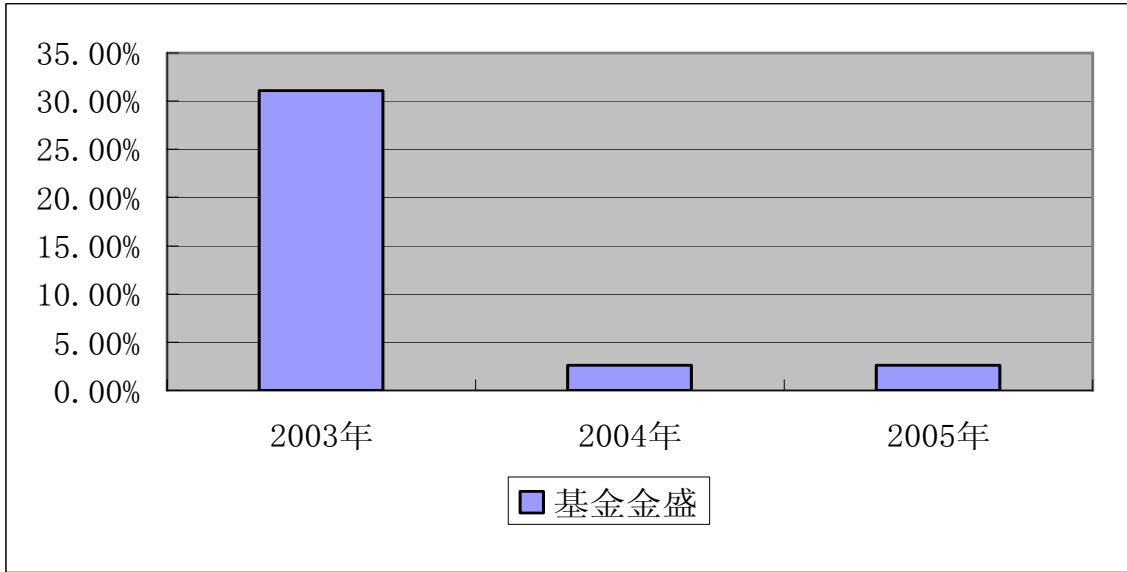
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.12%	1.15%	-	-	-	-
过去六个月	7.97%	1.32%	-	-	-	-
过去一年	3.20%	2.12%	-	-	-	-
过去三年	38.83%	2.09%	-	-	-	-
过去五年	6.75%	2.03%	-	-	-	-
自基金成立起至今	15.08%	2.03%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

2、基金金盛净值增长率历史走势图



3、基金金盛净值增长率历年对比图



(三) 收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2005年	0.018元	2004年度收益分配
2004年	1.000元	2004年度收益分配
2003年	-	
合计	1.018元	

四、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理介绍

1、基金管理人介绍

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日，是经中国证监会证监基字[1998]5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京设有分公司。

截至2005年12月31日，本基金管理人共管理4只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛、基金金鼎，以及5只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰金象保本增值混合证券投资基金以及国泰货币市场证券投资基金等。另外，本基金管理人于2004年获得社保基金委托资产管理人资格，目前受托管理社保基金投资组合。

2、基金经理介绍

王雄辉，男，经济学硕士，9年证券从业经历。曾任南开大学教师，国泰基金管理有限公司研究开发部行业研究员，金泰基金基金经理助理，金泰基金基金经理，投资决策委员会秘书，理财部投资经理。

（二）基金管理合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，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。

报告期内本基金未发生任何损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障了投资人的合法权益。

（三）2005年证券市场与投资管理回顾

本基金2005年度净值增长率为3.20%。

2005年A股市场最主要的特征是股权分置改革的进程带动市场行情的发展：一方面，从初期股改前景不明朗的最低点到后期对股改有较稳定预期的高点，股指的上涨幅度和对价的平均水平基本相符，对价好像是送给市场的一个红包；另一方面，尤其是在三、四季度，股权分置改革具体方案的进退犹疑相应地带动市

场热情的高涨和低落，股改进程中的波折和权证、私有化等新的解决方案的出现带动了指数的涨跌。

除了一季度在少数业绩优良的二线蓝筹股带动下走出一波年报行情外，2005年对于经济基本面的判断似乎退居影响市场走势的次要因素。二季度宏观经济减速一度成为市场共识，但随着时间推移和境外相关市场的表现，这方面不再成为困扰，具有持续竞争力的优势企业仍然是市场主要的关注点。而在人民币汇率制度改革、国有大型银行加快改制上市的背景下，房地产、金融等行业的显眼表现成为2005年重要的行业特征。

本基金在2005年坚持了既定的价值判断原则，组合总体布局几乎没有大的变化，侧重于消费、服务行业，在商业零售、金融等行业上获取了比较大的收益，一些策略性的决策如G股阶段性减持、组合增加进攻性成分等也取得了正面的效果。2005年的不足主要体现在，一是少数重点品种一季度投资损失较大，一定程度上影响了全年的业绩和表现；二是基本放弃了对看法存在分歧的房地产行业的深入研究，错过了最为抢眼的行业机会；第三点也是最主要的一点，是由于坚持对竞争力强的企业的价值判断，而忽略了在市场低迷阶段普遍存在的价值低估现象，也就是说很多竞争力平平的企业价值被大大低估，程度甚至甚于被普遍关注的优势企业，而在市场上涨时这类企业可能机会更大，这也是价值投资的新课程。

（四）2006年证券市场与投资管理展望

2006年股改仍将持续并基本完成，这一方面将掀开中国证券市场的新篇章，另一方面是一年来一个影响市场的重要事件的结束。2006年A股市场的表现会好于2005年，自2001年以来的趋势性下跌将会结束，但市场的振荡幅度和频率会加大，经济基本面居于影响市场走势的次要因素的局面将改变。宏观经济持续向好，制度变革给市场带来机遇和挑战。

本基金将继续坚持价值投资理念，并丰富和深化价值投资策略，在重点投资具有持续竞争力企业的同时，加强对一般企业的价值判断，力争抓住更多的投资机会。除了从企业价值判断的角度构建组合以外，人民币持续升值和世界经济环境变化带来的地产、资源类企业的投资机会，也将是本基金2006年的重要投资主题。

（五）内部监察报告

本报告期内，本基金管理人在完善内部控制制度和流程体系的同时，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实。在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

- 1、开展对公司各项业务的日常监察业务，对公司内部不当业务行为和风险隐患做到及时发现、及时查处，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规。

- 2、进一步优化公司内控体系，更新完善内控制度和业务流程，推动全员自

我风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

2006年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和风险控制工作的科学性和实效性，并在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法权益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

五、基金托管人报告

中国建设银行根据《金盛证券投资基金基金合同》和《金盛证券投资基金托管协议》，托管金盛证券投资基金（以下简称基金金盛）。

本报告期，中国建设银行在基金金盛的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，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，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、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基金金盛投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

由基金金盛管理人——国泰基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

六、 审计报告

金盛证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的金盛证券投资基金（以下简称“基金金盛”）2005年12月31日的资产负债表以及2005年度的经营业绩表和基金净值变动表。这些会计报表的编制基金金盛的基金管理人国泰基金管理有限公司的责任，我们的责任是在实施审计工作的基础上对这些会计报表发表意见。

我们按照中国注册会计师独立审计准则计划和实施审计工作，以合理确信会计报表是否不存在重大错报。审计工作包括在抽查的基础上检查支持会计报表金额和披露的证据，评价基金管理人在编制会计报表时采用的会计政策和作出的重大会计估计，以及评价会计报表的整体反映。我们相信，我们的审计工作为发表意见提供了合理的基础。

我们认为，上述会计报表符合国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《金盛证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定，在所有重大方面公允反映了基金金盛2005年12月31日的财务状况以及2005年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师：汪棣

中国·上海市
2006年3月3日

注册会计师：薛竞

七、财务会计报告

(一) 基金会计报表

1、资产负债表

资产负债表
2005年12月31日

单位：元

资 产	附注	2005年12月31日	2004年12月31日
银行存款		28,919,257.70	16,413,447.61
清算备付金		356,735.62	—
交易保证金		390,741.00	—
应收证券清算款		2,477,363.56	525,432.26
应收利息	5(1)	1,020,869.91	691,259.75
股票投资市值	5(2)	383,859,550.52	373,882,851.12
其中：股票投资成本		338,902,523.14	363,554,239.35
债券投资市值	5(2)	114,274,264.33	124,211,382.73
其中：债券投资成本		113,908,085.04	125,659,229.44
权证投资市值		—	—
其中：权证投资成本		—	—
资产总计		531,298,782.64	515,724,373.47
负债及持有人权益			
负债：			
应付证券清算款		3,982,919.25	3,832,463.87
应付管理人报酬		643,864.94	713,236.95
应付托管费		107,310.83	118,872.83
应付佣金	5(3)	140,210.33	258,663.10
应付收益		283,104.68	283,104.68
其他应付款	5(4)	549,200.98	299,200.98
预提费用	5(5)	360,000.00	390,000.00
负债合计		6,066,611.01	5,895,542.41
持有人权益：			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		45,323,206.67	8,880,765.06
未分配收益		-20,091,035.04	948,066.00
持有人权益合计		525,232,171.63	509,828,831.06
负债及持有人权益总计		531,298,782.64	515,724,373.47

2、经营业绩表

经营业绩表
2005年度

单位：元

项目	附注	2005年度	2004年度
一、收入		-10,844,188.15	92,776,995.40
1、股票差价收入	5(6)	-20,108,420.15	79,110,395.65
2、债券差价收入	5(7)	-157,340.56	5,257,831.91
3、权证差价收入		3,190,875.53	-
4、债券利息收入		446,507.73	3,301,670.31
5、存款利息收入		230,375.66	523,273.19
6、股利收入		5,542,559.56	4,467,174.12
7、买入返售证券收入		-	5,000.00
8、其他收入	5(8)	11,254.08	111,650.22
二、费用		9,294,920.57	10,898,746.84
1、基金管理人报酬		7,569,774.58	8,629,352.57
2、基金托管费		1,261,629.06	1,438,225.49
3、卖出回购证券支出		16,345.20	200,250.68
4、其他费用	5(9)	447,171.73	630,918.10
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		300,000.00	300,000.00
审计费用		60,000.00	100,000.00
三、基金净收益		-20,139,108.72	81,878,248.56
加：未实现利得		36,442,441.61	-67,883,248.37
四、基金经营业绩		16,303,332.89	13,995,000.19

3、基金收益分配表

基金收益分配表
2005年度

单位：元

项目	附注	2005年度	2004年度
本期基金净收益		-20,139,108.72	81,878,248.56
加：期初基金净收益		948,066.00	-30,930,182.56
加：本期损益平准金		-	-
可供分配基金净收益		-19,191,042.72	50,948,066.00
减：本期已分配基金净收益	5(10)	899,992.32	50,000,000.00
期末基金净收益		-20,091,035.04	948,066.00

4、基金净值变动表

基金净值变动表
2005年度

单位：元

项 目	2005年度	2004年度
一、期初基金净值	509,828,831.06	545,833,830.87
二、本期经营活动：		
基金净收益	-20,139,108.72	81,878,248.56
未实现利得	36,442,441.61	-67,883,248.37
经营活动产生的基金净值变动数	16,303,332.89	13,995,000.19
三、本期基金份额交易：		
基金申购款	-	-
基金赎回款	-	-
基金份额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	-899,992.32	-50,000,000.00
五、期末基金净值	525,232,171.63	509,828,831.06

(二) 基金会计报表附注

1、基金简介

金盛证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原广州珠江投资基金管理有限公司管理的珠江投资基金按照有关法律、法规清理规范而成。基金上市申请经《关于广东省原有投资基金清理规范总体方案的批复》(证监基金字[1999]41号文)、《关于同意珠江投资基金规范为珠江证券投资基金并申请上市的批复》(证监基金字[2000]39号文)和深圳证券交易所证上[2000]79号文审核同意,于2000年6月30日在深圳证券交易所挂牌交易。

经中国证券监督管理委员会(证监基金字[2000]40号文)批准,本基金于2000年9月8日基金单位总份额由233,640,000份扩募至500,000,000份,存续期延长至2009年11月30日。有关基金设立等文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。

根据《证券投资基金管理暂行办法》和证监基金字[2000]40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、主要会计政策、会计估计及其变更

(1) 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、2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》及中国证券监督管理委员会允许的基金行业的实务操作约定而编制。

(2) 会计年度：为公历每年1月1日至12月31日。本报告期为2005年1月1日至2005年12月31日。

(3) 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) 记账基础和计价原则：本基金的会计核算以权责发生制为记账基础，除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

(5) 基金资产的估值原则：

①股票投资：上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值。

②债券投资：证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值。未上市流通和银行间同业市场交易的债券按成本估值。

③权证投资：从获赠确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易均价估值；未上市交易的权证投资（包括配股权证）按公允价值估值。

④实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

⑤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。

(6) 证券投资的成本计价方法：

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。

①股票投资：买入股票按成交日应支付的全部价款（包括成交总额和相关费用）入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。卖出股票时采用移动加权平均法逐日结转成本。

②债券投资：买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核

算。卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

- ③权证投资：获赠权证（包括配股权证）在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。本基金至今尚未发生主动投资权证的交易。

(7) 待摊费用的摊销方法和摊销期限：

待摊费用核算已经发生的、影响基金份额净值小数点后第五位，应分摊计入本期和以后各期的费用。在实际受益期间（一年内）按直线法摊销，并以实际支出减去累计摊销后的净额列示。

(8) 收入确认和计量：

- 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权证差价收入：于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其相关费用的差额确认。
- ④债券利息收入：按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。
- ⑤存款利息收入：按本金与适用的利率逐日计提的利息确认。
- ⑥股利收入：按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。
- ⑦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。
- ⑧其他收入：在实际收到时确认。

(9) 费用的确认和计量：

- ①基金管理人报酬：按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提入账。
- ②基金托管费：按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提入账。
- ③卖出回购证券支出：在该证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。
- ④其他费用：发生的其他费用如果影响基金份额净值小数点后第五位的，即发生的其他费用大于基金净值十万分之一，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。发生的其他费用如果不影响基金份额净值小数点后第五位的，即发生的其他费用小于基金净值十万分之一，应于发生时直接计入基金损益。

(10) 基金的收益分配政策：

- ①每一基金单位享有同等分配权。
- ②收益分配比例不低于基金净收益的90%。
- ③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。
- ④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。

⑤基金投资当年亏损，则不进行收益分配。

3、主要税项

(1) 印花税

根据财税字[2005]11号《财政部 国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》，对基金管理人运用基金资产买卖股票在2005年1月23日前按2%的税率征收印花税，自2005年1月24日起按1%的税率征收印花税。

(2) 营业税

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55号文、财税字[2001]61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》以及财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税；自2004年1月1日起，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税。

(3) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55号文《关于证券投资基金税收问题的通知》以及财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》，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；自2004年1月1日起，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

(4) 股息红利个人所得税

根据财税字[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》，自2005年6月13日起，基金取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计入个人应纳税所得额。

(5) 根据财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

4、关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

关联方名称	关联关系
国泰基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
上海国有资产经营有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
上海爱建信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
浙江省国际信托投资有限公司	基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
上海仪电控股(集团)公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易(单位:元)

2005年				2004年			
股票投资		债券投资		股票投资		债券投资	
成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例	成交金额	比例

国泰君安	121,453,968.14	12.62%	12,032,600.00	20.37%	348,256,847.85	21.43%	1,947,893.70	3.15%
------	----------------	--------	---------------	--------	----------------	--------	--------------	-------

	2005年				2004年			
	债券回购		交易佣金		债券回购		交易佣金	
	成交金额	比例	金额	比例	成交金额	比例	金额	比例
国泰君安	5,000,000.00	20.00%	99,082.47	12.74%	-	-	280,168.45	21.42%

注：根据本基金管理人与关联方签订的席位租赁协议，对关联方席位发生的交易佣金计算方式等同于其他证券公司，该佣金比例达到了关联方在席位租赁期内为本基金提供证券综合研究和信息服务相对应的水平。

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易（单位：元）

	2005年				2004年			
	债券投资		债券回购		债券投资		债券回购	
	成交金额		成交金额	利息支出	成交金额		成交金额	利息支出
建设银行	-		20,020,000.00	7,026.20	-		180,120,000.00	81,306.68

(4) 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费

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；并于次月前两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7,569,774.58元，其中已支付基金管理人6,925,909.64元，尚余643,864.94元未支付。

2004年共计提管理费8,629,352.57元，已全部支付。

(5) 基金托管费

- 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费

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；并于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

- ③本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共1,261,629.06元，其中已支付基金托管人1,154,318.23元，尚余107,310.83元未支付。

2004年共计提托管费1,438,225.49元，已全部支付。

(6) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于2005年12月31日保管的银行存款余额为28,919,257.70

元(2004年: 16,413,447.61元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为219,742.39元(2004年: 523,273.19元)。

(7) 各关联方投资本基金情况

①本基金管理人本报告期末及2004年12月31日持有本基金的情况

	2005年12月31日		2004年12月31日	
	基金份额	占总份额比例	基金份额	占总份额比例
国泰基金管理有限公司	2,307,692份	0.46%	2,307,692份	0.46%

注: 截止本报告期末, 本基金管理人持有的基金份额系本基金扩募时本基金管理人作为基金发起人认购的份额。报告期内所持有的基金份额无变动。

②本基金管理人主要股东及其控制的机构在本报告期末及2004年12月31日持有本基金情况如下:

	2005年12月31日		2004年12月31日	
	持有基金份额	占总份额比例	持有基金份额	占总份额比例
国泰君安证券股份有限公司	2,692,308份	0.54%	2,692,308份	0.54%

5、重要会计报表项目说明(单位: 元)

(1) 应收利息:

	2005年12月31日	2004年12月31日
应收银行存款利息	8,494.42	21,028.71
应收清算备付金利息	176.55	-
应收债券利息	1,012,129.30	670,231.04
应收权证保证金利息	69.64	-
合计	1,020,869.91	691,259.75

(2) 投资估值增值按投资类别分别列示如下:

	2005年12月31日	2004年12月31日
股票投资	44,957,027.38	10,328,611.77
债券投资	366,179.29	-1,447,846.71
合计	45,323,206.67	8,880,765.06

(3) 应付佣金:

	2005年12月31日	2004年12月31日
海通证券股份有限公司	62,025.78	60,931.93
申银万国证券股份有限公司	46,156.55	63,830.44
兴业证券股份有限公司	19,265.77	45,614.54
国泰君安证券股份有限公司	12,762.23	21,492.69
渤海证券有限责任公司	-	66,793.50
合计	140,210.33	258,663.10

(4) 其他应付款：

	2005年12月31日	2004年12月31日
应付券商保证金	250,000.00	-
应付股利收入的税金	251,490.08	251,490.08
应付债券利息的税金	35,540.40	35,540.40
其他	12,170.50	12,170.50
合计	549,200.98	299,200.98

(5) 预提费用：

	2005年12月31日	2004年12月31日
预提审计费用	60,000.00	90,000.00
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
合计	360,000.00	390,000.00

(6) 股票差价收入：

	2005年	2004年
卖出股票成交总额	489,866,029.04	858,440,358.07
减：卖出股票成本总额	509,563,396.72	778,610,502.88
应付佣金总额	411,052.47	719,459.54
股票差价收入	-20,108,420.15	79,110,395.65

注：本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计2,133,855.10元(2004年：无)，已全额冲减股票投资成本。

(7) 债券差价收入：

	2005年	2004年
卖出债券成交总额	82,244,214.34	43,901,163.75
减：卖出债券成本总额	80,752,071.70	38,437,702.75
应收利息总额	1,649,483.20	205,629.09
债券差价收入	-157,340.56	5,257,831.91

(8) 其他收入：

	2005年	2004年
新股中签手续费返还	7,366.70	61,581.09
债券认购手续费返还	-	34,922.16
配股手续费返还	-	14,018.47
其他	3,887.38	1,128.50
合计	11,254.08	111,650.22

(9) 其他费用：

	2005年	2004年
信息披露费	300,000.00	300,000.00

审计费用	60,000.00	100,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
红利手续费	2,686.49	149,249.99
交易费用	413.98	1,593.85
债券账户服务费	18,840.00	14,220.00
银行间交易手续费	5,231.26	5,854.26
合计	447,171.73	630,918.10

(10) 本期已分配基金净收益：

	2005年	2004年
收益分配金额	899,992.32	50,000,000.00
累计收益分配金额	899,992.32	50,000,000.00

6、流通转让受限制的基金资产

(1) 流通转让受限的股票

①截至2005年12月31日止基金持有的因股权分置改革而停牌的股票明细如下：

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价(元)	复牌日期	复牌开盘单价(元)	数量(股)	年末成本总额(元)	年末估值总额(元)
方案沟通协商阶段停牌：								
600036	G 招 行	05/12/19	6.61	06/01/04	7.23	3,311,650	20,030,859.94	21,890,006.50
000839	G 国 安	05/12/19	10.50	06/01/04	11.26	1,400,000	14,829,895.89	14,700,000.00
合 计							34,860,755.83	36,590,006.50

②估值方法

上述两只股票已上市，但本基金持有的部分因股权分置改革而停牌。在编制本报表时，根据有关规定，在2005年12月31日按“停牌前估价”进行估值。

③受限期限

本基金截至2005年12月31日止持有上述两只因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

(2) 流通转让受限的债券

截止本报告期末本基金未持有流通转让受限的债券。

八、基金投资组合报告

(一) 基金资产组合情况

分 类	市值(元)	占总资产比例
股票	383,859,550.52	72.25%
债券	114,274,264.33	21.51%
权证	-	-
银行存款及清算备付金	29,275,993.32	5.51%
应收证券清算款	2,477,363.56	0.47%
其他资产	1,411,610.91	0.27%
合 计	531,298,782.64	100.00%

(二) 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	7,281,000.00	1.39%
2	采掘业	11,822,000.00	2.25%
3	制造业	110,617,129.88	21.06%
	其中：食品、饮料	41,415,810.90	7.89%
	石油、化学、塑胶、塑料	13,683,144.18	2.61%
	金属、非金属	16,225,000.00	3.09%
	医药、生物制品	39,293,174.80	7.48%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	32,503,064.28	6.19%
5	建筑业	15,862,138.22	3.02%
6	交通运输、仓储业	43,070,112.50	8.20%
7	信息技术业	61,995,450.00	11.80%
8	批发和零售贸易	26,795,846.40	5.10%
9	金融、保险业	21,890,006.50	4.17%
10	房地产业	-	-
11	社会服务业	21,436,107.00	4.08%
12	传播与文化产业	20,287,181.19	3.86%
13	综合类	10,299,514.55	1.96%
	合 计	383,859,550.52	73.08%

(三) 基金投资的所有股票明细(按市值占基金资产净值比例排序)

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	000895	双汇发展	1,959,970	25,420,810.90	4.84%
2	000063	G 中 兴	825,000	23,009,250.00	4.38%
3	600036	G 招 行	3,311,650	21,890,006.50	4.17%
4	600037	G 歌 华	1,353,381	20,287,181.19	3.86%
5	600900	G 长 电	2,900,000	20,184,000.00	3.84%
6	600009	上海机场	1,326,475	19,605,300.50	3.73%
7	600085	G 同仁堂	1,375,000	19,208,750.00	3.66%
8	000538	云南白药	828,592	17,110,424.80	3.26%
9	600519	贵州茅台	350,000	15,995,000.00	3.05%
10	600970	中材国际	1,018,109	15,862,138.22	3.02%
11	000839	G 国 安	1,400,000	14,700,000.00	2.80%
12	600694	大商股份	803,712	13,823,846.40	2.63%
13	600328	兰太实业	2,214,101	13,683,144.18	2.61%
14	600406	国电南瑞	860,000	13,046,200.00	2.48%
15	600050	中国联通	4,000,000	11,240,000.00	2.14%
16	600019	G 宝 钢	2,300,000	9,407,000.00	1.79%
17	600028	中国石化	2,000,000	9,380,000.00	1.79%
18	600628	新 世 界	1,400,000	8,988,000.00	1.71%
19	600054	G 黄 山	900,000	8,334,000.00	1.59%
20	600018	G 上 港	700,000	7,945,000.00	1.51%
21	002023	海特高新	886,700	7,412,812.00	1.41%
22	600075	新疆天业	900,000	7,281,000.00	1.39%
23	600585	G 海 螺	700,000	6,818,000.00	1.30%
24	600834	G 申地铁	1,176,406	6,329,064.28	1.21%
25	600011	华能国际	1,000,000	5,990,000.00	1.14%
26	000662	G 索芙特	799,927	5,319,514.55	1.01%
27	000916	华北高速	1,400,000	5,152,000.00	0.98%
28	600350	山东基建	1,307,700	5,113,107.00	0.97%
29	600832	G 明 珠	400,000	4,980,000.00	0.95%
30	600741	巴士股份	1,200,000	4,104,000.00	0.78%
31	002024	苏宁电器	200,000	3,984,000.00	0.76%
32	600611	大众交通	700,000	3,885,000.00	0.74%
33	600276	恒瑞医药	200,000	2,974,000.00	0.57%
34	600386	北京巴士	750,000	2,955,000.00	0.56%
35	600547	山东黄金	200,000	2,442,000.00	0.46%

(四) 股票投资组合的重大变动

1、累计买入价值占期初基金资产净值前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初净值比例
1	600050	中国联通	26,286,960.18	5.16%

2	600970	中材国际	21,870,698.69	4.29%
3	600019	G 宝 钢	20,084,668.76	3.94%
4	600011	华能国际	20,052,013.86	3.93%
5	600519	贵州茅台	18,491,240.50	3.63%
6	600694	大商股份	15,689,369.06	3.08%
7	600037	G 歌 华	15,196,509.06	2.98%
8	000839	G 国 安	14,829,895.89	2.91%
9	000538	云南白药	14,697,630.29	2.88%
10	600104	G 上 汽	14,092,092.38	2.76%
11	600276	恒瑞医药	14,033,032.03	2.75%
12	002023	海特高新	12,843,524.01	2.52%
13	000039	中集集团	12,438,728.31	2.44%
14	600328	兰太实业	12,087,603.84	2.37%
15	600309	烟台万华	11,899,715.05	2.33%
16	600036	G 招 行	10,609,440.86	2.08%
17	000898	G 鞍 钢	10,346,734.07	2.03%
18	600031	G 三 一	10,310,840.28	2.02%
19	600628	新 世 界	9,683,600.13	1.90%
20	600585	G 海 螺	9,481,286.32	1.86%

2、累计卖出价值占期初基金资产净值前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	占期初净值比例
1	600019	G 宝 钢	21,574,529.88	4.23%
2	002024	苏宁电器	20,933,535.09	4.11%
3	600104	G 上 汽	20,664,039.61	4.05%
4	600036	G 招 行	20,469,127.09	4.01%
5	000488	晨鸣纸业	18,940,368.34	3.72%
6	000039	中集集团	18,469,314.32	3.62%
7	600096	云 天 化	18,450,140.90	3.62%
8	600018	G 上 港	15,698,132.05	3.08%
9	600276	恒瑞医药	15,217,888.58	2.98%
10	600900	G 长 电	15,104,882.57	2.96%
11	600011	华能国际	14,628,535.00	2.87%
12	600028	中国石化	13,932,154.95	2.73%
13	000983	G 西 煤	13,304,363.28	2.61%
14	600050	中国联通	13,216,620.70	2.59%
15	600004	G 穗机场	12,859,051.38	2.52%
16	600031	G 三 一	12,307,660.37	2.41%
17	600309	烟台万华	11,609,134.44	2.28%
18	000400	G 许 继	10,253,590.39	2.01%
19	600694	大商股份	9,671,479.33	1.90%
20	600009	G 沪机场	8,986,976.74	1.76%

3、报告期内买入股票的成本总额：487,045,535.61元

报告期内卖出股票的收入总额：489,866,029.04元

(五) 按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国家债券	93,978,264.33	17.89%
2	金融债券	20,296,000.00	3.86%
	合计	114,274,264.33	21.76%

(六) 按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	银行间00国债12	41,453,333.33	7.89%
2	02国债(14)	25,295,780.00	4.82%
3	05农发04	20,296,000.00	3.86%
4	21国债(3)	9,199,800.00	1.75%
5	02国债(10)	6,946,100.00	1.32%

(七) 报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

3、其他资产的构成如下：

分类	市值(元)
交易保证金	390,741.00
应收利息	1,020,869.91
合计	1,411,610.91

4、报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

5、本报告期内投资权证明细如下：

(1) 因股权分置改革被动持有

权证代码	权证名称	配售日期	配售数量(份)	成本(元)
580000	宝钢JTB1	2005/8/18	332,330	0.00
合计			332,330	0.00

(2) 本报告期内无主动投资的权证。

(八) 本基金管理人运用固有资金投资本基金情况

截止本报告期末，本基金管理人运用固有资金投资本基金的基金份额为

2,307,692份，系本基金扩募时本基金管理人作为基金发起人认购的份额。报告期内所持有的基金份额无变动。

九、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

基金份额持有人户数：12,356

平均每户持有人基金份额：40,466.17份

（二）持有人结构

	持有的基金份额（份）	占总份额比例
机构投资者	285,375,408	57.08%
个人投资者	214,624,592	42.92%
合计	500,000,000	100.00%

（三）前十名持有人

序号	持有人姓名	期末持有数（份）	持有比例
1	人寿集团	44,071,784	8.81%
2	人寿保险	36,136,410	7.23%
3	信诚人寿	34,370,334	6.87%
4	太平洋保险	16,648,789	3.33%
5	泰康人寿	15,811,853	3.16%
6	社保一零九	14,421,350	2.88%
7	再保险集团	10,733,260	2.15%
8	平安保险	9,621,657	1.92%
9	中宏人寿	7,490,094	1.50%
10	天安保险	7,455,820	1.49%

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

十、重大事件揭示

- 1、2005 年 1 月 27 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配华电国际 A 股公告》。公司所管理的金盛证券投资基金参加了华电国际电力股份有限公司 A 股发行。此次发行的副主承销商国泰君安证券股份有限公司是本公司非控股股东之一。
- 2、2005 年 3 月 16 日，中国建设银行股份有限公司第一届董事会第四次会议和 2005 年第一次临时股东大会在北京召开，会议批准张恩照先生因个人原因辞去中国建设银行股份有限公司董事长、董事。
- 3、2005 年 3 月 25 日，中国建设银行股份有限公司 2005 年第二次临时股东大会和第一届董事会第六次会议在北京召开。临时股东大会和董事会会议经过审议，选举郭树清先生为中国建设银行股份有限公司董事、董事长。
- 4、2005 年 3 月 30 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《金盛证券投资基金 2004 年度收益分配公告》，收益分配方案为向全体持有人每 10 份基金单位派发现金收益 0.018 元。
- 5、2005 年 4 月 28 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《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 2005 年 5 月 9 日起，由上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31-32 楼迁至上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼。
- 6、2005 年 4 月 28 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配宝山钢铁股份有限公司增发新股》。本基金参加了宝山钢铁股份有限公司增发新股。此次发行的副主承销商国泰君安证券股份有限公司是本公司非控股股东之一。
- 7、2005 年 5 月 14 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《国泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经国泰基金管理有限公司第三届董事会第七次会议审议通过，并报经中国证监会批准，何斌先生不再担任公司副总经理职务。
- 8、2005 年 6 月 17 日，中国建设银行股份有限公司和美国银行在北京共同宣布，双方签署了关于战略投资与合作的最终协议。根据协议，美国银行将分阶段对中国建设银行股份有限公司进行投资，最终持有股权可达到 19.9%。
- 9、2005 年 7 月 1 日，中国建设银行股份有限公司和淡马锡旗下的全资子公司亚洲金融控股私人有限公司（简称“亚洲金融”）在京签署了关于战略投资的最终协议。根据协议，淡马锡将通过“亚洲金融”对中国建设银行股份有限公司进行股权投资。
- 10、2005 年 8 月 1 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《关于公司董事变更的公告》，何伟先生当选为公司董事，符学东先生不再担任公司董事职务。
- 11、2005 年 8 月 23 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金运用基金资产投资权证的公告》，就基金资产投资权证的相关事宜进行了公告。
- 12、2005 年 10 月 27 日，中国建设银行股份有限公司在香港联合交易所正式挂牌上市。

13、2005年10月31日，根据工作需要，中国建设银行股份有限公司解聘江先周基金托管部总经理职务，由基金托管部副总经理罗中涛暂时主持基金托管部日常工作。2006年3月14日，罗中涛被聘任为中国建设银行基金托管部总经理。

14、2006年1月13日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于公司股东股权转让的公告》，经国泰基金管理有限公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本公司股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司。

15、基金租用席位的选择标准是：

- (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。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），经公司同意并报董事会批准。

16、报告期内，基金租用证券公司专用席位的有关情况如下： 单位：元

券商名称	席位数量	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例
渤海证券有限责任公司	1	124,444,220.87	12.93%	7,793,947.64	13.20%
国泰君安证券股份有限公司	2	121,453,968.14	12.62%	12,032,600.00	20.37%
申银万国证券股份有限公司	2	276,737,369.24	28.75%	29,542,176.64	50.01%
海通证券股份有限公司	2	245,698,094.92	25.53%	9,699,486.55	16.42%
兴业证券股份有限公司	2	194,125,534.65	20.17%	-	-
合计	9	962,459,187.82	100.00%	59,068,210.83	100.00%

券商名称	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
渤海证券有限责任公司	-	-	101,963.23	13.10%
国泰君安证券股份有限公司	5,000,000.00	20.00%	99,082.47	12.74%
申银万国证券股份有限公司	10,000,000.00	40.00%	226,314.51	29.09%
海通证券股份有限公司	10,000,000.00	40.00%	197,091.88	25.34%
兴业证券股份有限公司	-	-	153,445.26	19.73%
合计	25,000,000.00	100.00%	777,897.35	100.00%

注：在本报告期内，基金无新增租用专用交易席位。

17、报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为60,000.00元，目前的审计机构自本基金成立起一直提供审计服务。

18、报告期内，未召开基金份额持有人大会；无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项；基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管

部门稽查或处罚的情况。

十一、 备查文件目录

- 1、关于同意设立金盛证券投资基金的批复
- 2、金盛证券投资基金合同
- 3、金盛证券投资基金托管协议
- 4、金盛证券投资基金各年度半年度报告、年度报告及收益分配公告
- 5、报告期内披露的各项公告
- 6、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

备查文件存放地点：本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市延安东路 700 号港泰广场 23 楼

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区金融大街 25 号

投资者查阅方式：可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 33134688, 400-8888-688

客户投诉电话：(021) 23060279

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2006 年 3 月 27 日