

金泰证券投资基金

2004 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：中国工商银行

送出日期：二〇〇五年三月三十日

金泰证券投资基金 2004 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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于2005年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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、主要财务指标和基金净值表现	4
四、基金管理人报告	6
五、基金托管人报告	9
六、审计报告	9
七、财务会计报告	10
八、基金投资组合报告	19
九、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人	23
十、重大事件揭示	24
十一、备查文件目录	26

二、基金简介

(一) 基金名称：金泰证券投资基金

基金简称：基金金泰

交易代码：500001

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1998年3月27日

报告期末基金份额总额：2,000,000,000份

基金合同存续期：至2013年3月26日止

基金份额上市交易的证券交易所：上海证券交易所

上市日期：1998年4月7日

(二) 基金产品说明

(1) 投资目标：本基金是平衡型基金，并以价值型和成长型股票为投资重点；投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求长期稳定的投资收益。

(2) 投资策略：本基金投资时，根据宏观经济环境及其对证券市场的影响，决定投资策略；根据货币政策的变化、利率的走势，决定国债在投资组合中的比例；根据对行业及地区经济发展状况的深入研究，决定股票投资重点；根据对上市公司的调查研究，确定具体的股票投资组合。

本基金的股票投资将以中长期投资为主。在充分研究的前提下，主要投资于价值型和成长型股票中被低估的股票，以实现基金资产的稳定增值。

在股票投资组合中，将保留一定比例的短期投资。短期投资主要根据市场变化，相机抉择，灵活投资，在防范风险的前提下，增加基金的收益。

为保证基金资产的流动性和收益性，在国债投资组合中，长期国债和短期国债将保持适当的比例。

在不违反《证券投资基金法》及基金合同有关规定的前提下，基金管理人可根据具体情况，对基金投资组合进行调整。

(3) 风险收益特征：承担中等风险、获取中等的超额收益。

(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

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

信息披露负责人：丁昌海

联系电话：021-58319999

传真：021-50816885

电子邮箱：xinxipilu@gtfund.com

(四) 基金托管人

名称：中国工商银行
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码：100032
法定代表人：姜建清
信息披露负责人：庄为
联系电话：010-66107333
传真：010-66106904
电子邮箱：custodian@icbc.com.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》
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：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场
31-32 楼
北京市西城区复兴门内大街 55 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上海分公司
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(一) 各主要财务指标

单位：元

	2004年	2003年	2002年
基金本期净收益	258,180,968.83	-213,486,691.72	-160,598,651.43
基金份额本期净收益	0.1291	-0.1067	-0.0803
期末可供分配基金收益	72,304,199.66	-174,613,467.97	-289,802,045.67
期末可供分配基金份额收益	0.0362	-0.0873	-0.1449
期末基金资产净值	2,072,304,199.66	2,084,531,862.69	1,710,197,954.33
期末基金份额净值	1.0362	1.0423	0.8551
基金加权平均净值收益率	11.92%	-11.50%	-8.31%
本期基金份额净值增长率	-0.59%	21.89%	-14.52%
基金份额累计净值增长率	66.93%	67.91%	37.76%

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、基金金泰净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

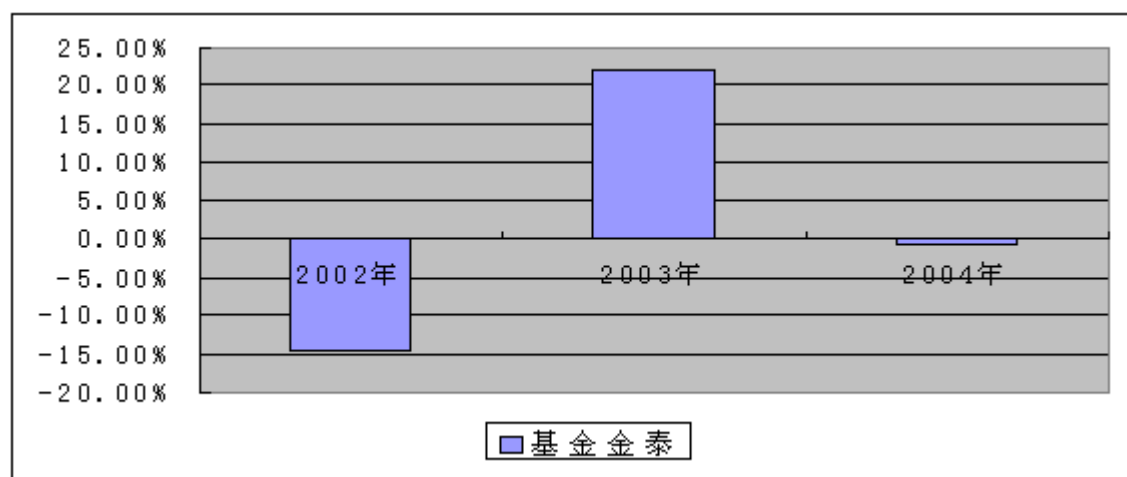
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.80%	1.49%	-	-	-	-
过去六个月	0.60%	2.16%	-	-	-	-
过去一年	-0.59%	2.17%	-	-	-	-
过去三年	3.59%	1.95%	-	-	-	-
过去五年	24.70%	2.13%	-	-	-	-
自基金成立起至今	66.93%	2.16%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

2、基金金泰累计净值增长率历史走势图



3、基金金泰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
2004年	-	
2003年	-	
2002年	0.160元	2001年度收益分配
合计	0.160元	

注：2004 年度收益分配方案为：向全体持有人每 10 份基金单位派发现金收益 0.350 元。权益登记日为 2005 年 4 月 6 日，除息交易日为 2005 年 4 月 7 日，红利发放日为 2005 年 4 月 12 日。具体详见《金泰证券投资基金 2004 年度收益分配公告》。

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基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币。目前本基金管理人共管理四只封闭式基金，四只开放式基金，其中一只为系列基金（包括两只子基金），其基本情况如下：

封闭式基金	成立日期	基金份额总额	托管银行
金泰基金	1998年3月27日	20亿份	中国工商银行
金鑫基金	1999年10月21日	30亿份	中国建设银行
金盛基金	2000年4月26日	5亿份	中国建设银行
金鼎基金	2000年5月16日	5亿份	中国建设银行

开放式基金	基金成立日期	基金份额总额 (2004年12月31日)	托管银行
金鹰增长基金	2002年5月8日	916,115,497.69	交通银行
金龙债券基金	2003年12月5日	85,452,402.64	上海浦东发展银行
金龙行业精选基金	2003年12月5日	518,390,148.80	上海浦东发展银行
金马稳健回报基金	2004年6月18日	977,345,001.33	中国建设银行
金象保本增值基金	2004年11月10日	656,041,649.47	中国银行

2、基金经理介绍

黄刚，男，经济学硕士，9年证券期货从业经历。曾就职于上海金属交易所、上海期货交易所。2000年加盟国泰基金管理有限公司，先后任研究开发部经理、市场部经理、金鹰增长基金基金经理。

黄焱，男，金融学硕士，9年证券从业经历。曾就职于平安集团投资管理中心、深圳和利投资发展公司、中期国际期货公司深圳公司，2003年1月加盟国泰基金管理有限公司，担任金泰基金基金经理助理，2004年4月起主持金泰基金的主要投资管理工作，并于2005年1月起任金泰基金基金经理。

(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》及其实施准则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）2004年证券市场与投资管理回顾

回顾2004年的股票市场，可以发现这是自2001年以来熊市的延续。而市场表现出来的结构特征却很好地反应了我国宏观经济的变化和预期。

在2003年宏观经济走势强劲之后，2004年开始进入宏观调控阶段，经济增长的动力受到了一定的遏制。相应股市也很快对宏观经济的转变做出了反应，自今年4月以来，市场处于持续调整之中，其中受宏观调控影响较大的周期性行业成为最主要的下跌力量。

在不利的宏观格局下，市场只能选择一些受宏观周期影响较小的行业和个股，作为股市下跌的避风港。故2004年消费类行业中的龙头个股成为了市场的亮点。

2004年本基金总体上较早地认识到了市场的主要特征，有意识地提高组合的集中度，并将仓位由1季度的75%以上下降到了下半年的70%以下。

在行业配置方面，本基金较早调整了周期性投资品行业和消费品行业的比例，在投资品行业中逐步向抗周期风险能力较强的龙头企业集中，并在消费品行业中选择具有核心竞争力的优势企业适时建仓。从事后看，2004年个股选择对基金金泰的净值增长起了最关键的作用。本基金重点增加配置的中集集团、西山煤电、鲁泰A、中兴通讯、贵州茅台等都为净值增长作出了较大的贡献。

回顾过去几年的证券市场，本基金认为，2001年开始的市场调整虽然给投资人带来了很大的损失和心理压力，但本轮调整以来，中国证券市场发生的积极变化，却远大于2001年之前股市创立10年以来的贡献。

（四）2005年证券市场与投资管理展望

2005年的宏观格局与03、04年最大的不同是——今年没有明确的宏观方向。03年宏观强劲增长，有很明确的向上方向；04年宏观调控来势迅猛，明确指明了向下调整的方向。而05年，宏观调控仍将继续，但政府和市场都更加强调软着陆的可能性和必要性。这也许注定了2005年的证券市场会是一个多变的市場。

正因为2005年缺乏明确的宏观方向，因此证券市场也很难寻找到很明确的投资方向（比如2003年的大宗物资和2004年的消费升级）。所以，本基金比较认同2005年的主题投资策略。本基金认为，其中最有可能成为持续投资主题的就是“人民币汇率形成机制的调整及其带来的相关产业格局的调整”，而其它的所谓主题，最终可能仅仅演化为一些板块的轮动，对于机构投资人而言则不能过分深陷其中。

在主题投资策略的指导下，本基金2005年重点关注的行业主要是资产价值和盈利比重可能上升的不可贸易行业，以及新汇率机制形成后比较优势更加明显的行业，具体行业包括交通运输、造纸、电力设备等。

对于股票市场的整体方向，本基金认为在经历了近4年的调整后，中国的股票市场估值已经非常接近于国际水平了，中国的证券市场至少从主流上已经具有一定的投资价值了，而真正大机会的出现往往需要的是先向后退出一一定的空间。因此，对于市场的向下破位，应当以积极的眼光来看待。随着指数的逐渐下移，

困扰市场的最棘手问题——国有股全流通问题的解决将越来越容易，这样市场出现转机的机会也就越来越大。预测市场的底部非常困难，而且也不一定有必要，但本基金的判断是，指数探底的幅度越深，2005年出现历史大底的机会也就越大，对于长期投资的机构投资者而言，在指数探底的过程中买入股票，输掉的只可能是时间。

最后，A股市场在经历了前几年价值理念的不断演进和深入后，2005年同一行业内个股价值的差异化，将可能成为价值理念演进的新方向。即使同一行业中的企业，核心净值策略和能力，管理水平，治理结构、公司透明度等因素的不同都将给公司股票的估值带来巨大的差异。相信，2005年将是个股选择精细化的一年。

（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、注意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月活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

2005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

2004年度，本托管人在对金泰投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，2004年度金泰证券投资基金管理人——国泰管理有限公司在投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对金泰证券投资基金管理人——国泰基金管理有限公司在2004年度所编制和披露的金泰证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容具有真实、准确和完整性。

中国工商银行资产托管部

2005年3月16日

六、审计报告

金泰证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的金泰证券投资基金(以下简称“基金金泰”)2004年12月31日的资产负债表及2004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是基金金泰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》、《金泰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泰2004年12月31日的财务状况以及2004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
2005年2月4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
2004年12月31日

单位：元

资 产	附注	2004年12月31日	2003年12月31日
银行存款		147,330,308.54	23,776,054.91
交易保证金		750,000.00	750,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	5(1)	6,557,969.59	7,362,236.94
股票投资市值	5(2)	1,420,508,349.02	1,521,616,249.34
其中：股票投资成本		1,426,195,650.59	1,271,567,060.40
债券投资市值	5(2)	503,401,146.45	536,262,858.94
其中：债券投资成本		508,977,146.08	527,166,717.22
资产总计		2,078,547,773.60	2,089,767,400.13
负债及持有人权益			
负债：			
应付证券清算款		891,174.13	-
应付管理人报酬		2,659,093.96	2,547,093.64
应付托管费		443,182.35	424,515.61
应付佣金	5(3)	385,890.54	666,487.63
其他应付款	5(4)	1,564,232.96	1,492,940.56
预提费用	5(5)	300,000.00	104,500.00
负债合计		6,243,573.94	5,235,537.44
持有人权益：			
实收基金		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得		-11,263,301.20	259,145,330.66
未分配收益		83,567,500.86	-174,613,467.97
持有人权益合计		2,072,304,199.66	2,084,531,862.69
负债及持有人权益总计		2,078,547,773.60	2,089,767,400.13

2、经营业绩表

经营业绩表
2004年度

单位：元

项目	附注	2004年度	2003年度
一、收入		298,081,702.71	-179,891,309.34
1、股票差价收入	5(6)	265,405,230.06	-219,457,537.17
2、债券差价收入	5(7)	-6,087,414.52	1,262,303.18
3、债券利息收入		17,213,449.86	18,369,882.30
4、存款利息收入		2,356,784.71	2,518,998.36
5、股利收入		18,751,436.70	17,249,518.13
6、买入返售证券收入		232,111.00	-
7、其他收入	5(8)	210,104.90	165,525.86
二、费用		39,900,733.88	33,595,382.38
1、基金管理人报酬		32,548,918.56	27,814,055.09
2、基金托管费		5,424,819.72	4,635,675.85
3、卖出回购证券支出		1,523,835.66	840,965.48
4、其他费用	5(9)	403,159.94	304,685.96
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		200,000.00	100,000.00
审计费用		100,000.00	100,000.00
三、基金净收益		258,180,968.83	-213,486,691.72
加：未实现利得		-270,408,631.86	587,820,600.08
四、基金经营业绩		-12,227,663.03	374,333,908.36

3、基金收益分配表

基金收益分配表
2004年度

单位：元

项目	2004年度	2003年度
本期基金净收益	258,180,968.83	-213,486,691.72
加：期初基金净收益	-174,613,467.97	38,873,223.75
加：本期损益平准金	-	-
可供分配基金净收益	83,567,500.86	-174,613,467.97
减：本期已分配基金净收益	-	-
期末基金净收益	83,567,500.86	-174,613,467.97

4、基金净值变动表

基金净值变动表
2004年度

单位：元

项 目	2004年度	2003年度
一、期初基金净值	2,084,531,862.69	1,710,197,954.33
二、本期经营活动：		
基金净收益	258,180,968.83	-213,486,691.72
未实现利得	-270,408,631.86	587,820,600.08
经营活动产生的基金净值变动数	-12,227,663.03	374,333,908.36
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	-	-
五、期末基金净值	2,072,304,199.66	2,084,531,862.69

(二) 基金会计报表附注

1、基金简介

金泰证券投资基金(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”)、上海爱建信托投资有限责任公司、浙江省国际信托投资公司和中国电力财务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合同发起，经中国证券监督管理委员会(证监基字[1998]7号文)《关于同意金泰证券投资基金设立的批复》批准，于1998年3月27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20亿份基金单位。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行。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。

本基金于1998年4月7日在上交所挂牌交易。根据《证券投资基金法》和《证券投资基金运作管理办法》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2004年1月1日至2004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。

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证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价计算得到的净价估值。

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如有新增事项，按国家最新规定估值。

(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，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：买入债券按成交日应支付的全部价款入账，应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。卖出债券的成本采用移动加权平均法逐日结转。买入央行票据和零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。

(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、影响基金单位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。
- 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。

(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单位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单位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

基金管理人运用基金买卖股票按照0.2%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、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	基金管理人
中国工商银行	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	基金发起人、基金管理人的股东
浙江省国际信托投资有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
金通证券股份有限公司	基金管理人的股东的控股子公司
上海仪电控股（集团）公司	基金管理人的股东(2004年6月23日起)
宏源证券股份有限公司	基金管理人的原股东(2004年6月23日之前)

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）

	2004年				2003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	742,434,197.71	18.38%	157,350,637.26	38.30%	671,629,074.97	17.19%	311,367,536.80	24.29%
金通证券	598,104,828.17	14.80%	63,700,849.30	15.51%	451,281,773.58	11.55%	89,471,309.90	6.98%
上海爱建	269,962,923.34	6.68%	13,592,751.60	3.31%	323,532,505.47	8.28%	47,785,456.30	3.73%

	2004年				2003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	340,000,000.00	17.80%	587,270.64	18.17%	-	-	539,631.24	17.15%
金通证券	490,000,000.00	25.65%	478,070.27	14.79%	-	-	360,793.48	11.46%
上海爱建	140,000,000.00	7.33%	213,897.92	6.62%	170,000,000.00	26.20%	259,687.81	8.25%

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，该佣金比例符合并反映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)

	2004年			2003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
工商银行	-	180,000,000.00	95,424.66	-	380,351,605.48	351,605.48

(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32,548,918.56元，其中已支付基金管理人29,889,824.60元，尚余2,659,093.96元未支付。2003年共计提管理费27,814,055.09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；并于次月前五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5,424,819.72元，其中已支付基金托管人4,981,637.37元，尚余443,182.35元未支付。2003年共计提托管费4,635,675.85元，已全部支付。

5、重要会计报表项目说明 (单位：元)

(1) 应收利息：

	2004年12月31日	2003年12月31日
应收银行存款利息	53,299.60	11,855.67
应收债券利息	6,504,669.99	7,350,381.27
合计	6,557,969.59	7,362,236.94

(2) 投资估值增值按投资类别分别列示如下：

	2004年12月31日	2003年12月31日
股票投资	-5,687,301.57	250,049,188.94
债券投资	-5,575,999.63	9,096,141.72
合计	-11,263,301.20	259,145,330.66

(3) 应付佣金：

	2004年12月31日	2003年12月31日
申银万国证券股份有限公司	104,412.09	207,895.69
国泰君安证券股份有限公司	101,331.05	35,544.26
国信证券有限责任公司	75,329.91	23,667.04
上海爱建信托投资公司	51,136.41	20,321.60
海通证券股份有限公司	29,507.59	271,092.48
金通证券股份有限公司	24,173.49	107,966.56
合计	385,890.54	666,487.63

(4) 其他应付款：

	2004年12月31日	2003年12月31日
应付股利收入的税金	1,139,501.76	1,139,501.76
应付债券利息的税金	174,731.20	103,438.80
其他	250,000.00	250,000.00
合计	1,564,232.96	1,492,940.56

(5) 预提费用：

	2004年12月31日	2003年12月31日
预提审计费用	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	200,000.00	-
预提债券账户维护费	-	4,500.00
合计	300,000.00	104,500.00

(6) 股票差价收入：

	2004年	2003年
卖出股票成交总额	2,143,681,783.55	1,958,299,635.67
减：卖出股票成本总额	1,876,482,127.93	2,176,109,556.26
应付佣金总额	1,794,425.56	1,647,616.58
股票差价收入	265,405,230.06	-219,457,537.17

(7) 债券差价收入：

	2004年	2003年
卖出债券成交总额	366,211,568.26	942,350,545.50
减：卖出债券成本总额	367,441,552.80	927,879,224.12
应收利息总额	4,857,429.98	13,209,018.20
债券差价收入	-6,087,414.52	1,262,303.18

(8) 其他收入：

	2004年	2003年
新股中签手续费返还	108,822.06	136,513.88

债券认购手续费返还	81,123.90	8,036.00
配股手续费返还	15,888.32	-
其他	4,270.62	20,975.98
合计	210,104.90	165,525.86

(9) 其他费用：

	2004年	2003年
信息披露费	200,000.00	100,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
交易所回购交易费用	22,146.10	5,508.96
债券帐户服务费	14,940.00	23,290.50
联网服务费	1,000.00	-
过户费	3,073.84	-
持有人查询费	500.00	-
转托管手续费	1,500.00	13,000.00
银行手续费	-	2,886.50
合计	403,159.94	304,685.96

6、流通转让受限制的基金资产

(1) 截至2004年12月31日止基金持有的流通转让受限制的基金资产明细如下：

序	名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)
1	振华港机	2004-12-22	2005-1-31	180,000	1,575,000.00	1,657,800.00
2	金地集团	2004-12-31	2005-1-6	1,478,146	13,273,751.08	14,692,771.24
	合计			1,658,146	14,848,751.08	16,350,571.24

(2) 估值方法

上述“振华港机”、“金地集团”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2004年12月31日按市场均价估值。

(3) 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。

此外，根据中国证监会证监发行字[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》及其配套规定，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票市值参与配售,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。

(4) 受限期限

上述“振华港机”受限期限为1个月。

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	1,420,508,349.02	68.34%
债券	503,401,146.45	24.22%
银行存款	147,330,308.54	7.09%
其他资产	7,307,969.59	0.35%
合 计	2,078,547,773.60	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		
2	采掘业	126,900,381.08	6.12%
3	制造业	643,526,691.10	31.06%
	其中:食品、饮料	90,978,586.05	4.39%
	纺织、服装、皮毛	47,233,855.59	2.28%
	造纸、印刷	65,430,343.89	3.16%
	石油、化学、塑胶、塑料	54,724,202.62	2.64%
	电子	40,668,122.91	1.96%
	金属、非金属	123,928,726.43	5.98%
	机械、设备、仪表	141,872,686.07	6.85%
	医药、生物制品	73,043,162.96	3.52%
	其他制造业	5,647,004.58	0.27%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	127,844,799.41	6.17%
5	建筑业		
6	交通运输、仓储业	268,257,307.41	12.94%
7	信息技术业	111,926,323.93	5.40%
8	批发和零售贸易	38,773,883.30	1.87%
9	金融、保险业	72,067,386.52	3.48%
10	房地产业	29,445,796.24	1.42%
11	社会服务业	1,439,812.99	0.07%
12	传播与文化产业	325,967.04	0.02%
13	综合类		
	合 计	1,420,508,349.02	68.55%

(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	600009	上海机场	5,322,320	80,899,264.00	3.90%
2	600050	中国联通	24,745,275	75,967,994.25	3.67%
3	600028	中国石化	15,854,388	69,283,675.56	3.34%
4	600036	招商银行	8,254,354	69,171,486.52	3.34%
5	000400	许继电气	7,626,765	65,818,981.95	3.18%
6	000895	双汇发展	5,002,694	62,033,405.60	2.99%
7	600019	宝钢股份	10,076,077	60,758,744.31	2.93%
8	000983	西山煤电	3,890,392	57,616,705.52	2.78%
9	000488	晨鸣纸业	5,424,671	57,447,265.89	2.77%
10	600900	长江电力	5,916,432	52,005,437.28	2.51%
11	600642	申能股份	7,370,507	49,972,037.46	2.41%
12	600029	南方航空	8,168,172	42,637,857.84	2.06%
13	600018	上港集箱	2,703,576	41,067,319.44	1.98%
14	600085	同仁堂	1,944,934	40,940,860.70	1.98%
15	600026	中海发展	4,301,735	39,403,892.60	1.90%
16	000866	扬子石化	3,373,352	36,837,003.84	1.78%
17	000726	鲁泰A	3,636,673	34,584,760.23	1.67%
18	000063	中兴通讯	1,284,401	34,010,938.48	1.64%
19	600519	贵州茅台	789,773	28,945,180.45	1.40%
20	600104	上海汽车	5,802,636	28,026,731.88	1.35%
21	600780	通宝能源	5,468,779	25,867,324.67	1.25%
22	000890	法尔胜	5,673,315	24,849,119.70	1.20%
23	600628	新世界	4,259,975	24,452,256.50	1.18%
24	600276	恒瑞医药	1,929,850	24,045,931.00	1.16%
25	000625	长安汽车	3,844,513	22,144,394.88	1.07%
26	600207	安彩高科	2,444,789	19,240,489.43	0.93%
27	000039	中集集团	800,000	18,000,000.00	0.87%
28	000088	盐田港A	1,409,829	17,073,029.19	0.82%
29	600585	海螺水泥	2,062,039	16,826,238.24	0.81%
30	000002	万科A	2,810,100	14,753,025.00	0.71%
31	600383	金地集团	1,478,146	14,692,771.24	0.71%
32	600115	东方航空	3,179,824	14,182,015.04	0.68%
33	600031	三一重工	806,837	13,942,143.36	0.67%
34	600020	中原高速	1,816,500	13,333,110.00	0.64%
35	600177	雅戈尔	2,342,574	12,368,790.72	0.60%
36	000100	TCL集团	3,075,542	11,225,728.30	0.54%
37	600825	华联超市	1,332,268	10,857,984.20	0.52%
38	600360	华微电子	974,394	10,201,905.18	0.49%
39	600096	云天化	815,534	8,587,573.02	0.41%
40	600594	益佰制药	347,557	8,056,371.26	0.39%

41	600308	华泰股份	668,040	7,983,078.00	0.39%
42	600591	上海航空	1,121,935	7,606,719.30	0.37%
43	600269	赣粤高速	1,072,000	7,289,600.00	0.35%
44	600302	标准股份	1,163,900	6,122,114.00	0.30%
45	000731	四川美丰	548,505	5,879,973.60	0.28%
46	600210	紫江企业	1,581,794	5,647,004.58	0.27%
47	600033	福建高速	650,000	4,764,500.00	0.23%
48	000920	南方汇通	594,360	4,160,520.00	0.20%
49	600631	百联股份	530,420	3,463,642.60	0.17%
50	600426	华鲁恒升	254,192	3,299,412.16	0.16%
51	600030	中信证券	490,000	2,895,900.00	0.14%
52	600406	国电南瑞	145,872	1,947,391.20	0.09%
53	600320	振华港机	180,000	1,657,800.00	0.08%
54	000778	新兴铸管	198,100	1,563,009.00	0.08%
55	000612	焦作万方	428,633	1,500,215.50	0.07%
56	600138	中青旅	186,263	1,439,812.99	0.07%
57	000898	鞍钢新轧	75,044	421,747.28	0.02%
58	600037	歌华有线	15,456	325,967.04	0.02%
59	600273	华芳纺织	72,996	280,304.64	0.01%
60	002001	新和成	9,000	120,240.00	0.01%
61	600005	武钢股份	2,360	9,652.40	0.00%

(四) 股票投资组合的重大变动

1、累计买入价值前20名股票明细

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	000100	TCL 集团	111,223,519.68	5.34%
2	600050	中国联通	83,487,222.99	4.01%
3	000400	许继电气	74,695,418.13	3.58%
4	600028	中国石化	65,886,812.88	3.16%
5	600005	武钢股份	62,626,743.40	3.00%
6	000488	晨鸣纸业	62,428,728.25	2.99%
7	000983	西山煤电	60,192,814.99	2.89%
8	000039	中集集团	54,320,686.62	2.61%
9	600029	南方航空	50,877,664.11	2.44%
10	600036	招商银行	50,813,521.55	2.44%
11	000726	鲁 泰 A	50,687,306.65	2.43%
12	600098	广州控股	50,632,843.40	2.43%
13	000920	南方汇通	49,486,499.05	2.37%
14	000956	中原油气	45,997,588.76	2.21%
15	000625	长安汽车	42,817,365.50	2.05%
16	600519	贵州茅台	39,520,092.99	1.90%
17	000503	海虹控股	38,853,016.88	1.86%

18	600207	安彩高科	38,136,607.82	1.83%
19	000088	盐田港A	36,413,338.72	1.75%
20	000063	中兴通讯	36,210,922.90	1.74%

2、累计卖出价值前20名股票明细

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	000100	TCL 集团	207,803,775.34	9.97%
2	000039	中集集团	85,770,669.77	4.11%
3	600005	武钢股份	79,415,147.28	3.81%
4	600362	江西铜业	78,650,863.57	3.77%
5	000581	威孚高科	62,271,585.02	2.99%
6	600019	宝钢股份	61,622,339.17	2.96%
7	600050	中国联通	59,947,849.78	2.88%
8	600011	华能国际	59,606,370.22	2.86%
9	600688	上海石化	56,968,481.69	2.73%
10	600026	中海发展	55,906,724.30	2.68%
11	600009	上海机场	54,425,038.49	2.61%
12	000866	扬子石化	53,137,173.81	2.55%
13	600098	广州控股	51,944,112.82	2.49%
14	600104	上海汽车	51,365,698.67	2.46%
15	000956	中原油气	44,922,994.82	2.16%
16	000503	海虹控股	42,701,523.86	2.05%
17	000800	一汽轿车	40,797,203.12	1.96%
18	600188	兖州煤业	40,305,778.18	1.93%
19	600028	中国石化	40,164,593.03	1.93%
20	600018	上港集箱	38,404,673.86	1.84%

3、报告期内买入股票的成本总额：2,190,193,407.75元

报告期内卖出股票的收入总额：2,143,681,783.55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	412,632,839.47	19.91%
2	金融债券	29,991,000.00	1.45%
3	可转换债券	60,777,306.98	2.93%
	合 计	503,401,146.45	24.29%

(六) 基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	21国债(3)	116,307,292.00	5.61%
2	银行间00国债07	72,975,000.00	3.52%
3	04国债(5)	64,601,500.00	3.12%

4	02国债(14)	42,467,088.00	2.05%
5	04国农02	29,991,000.00	1.45%

(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	750,000.00
应收利息	6,557,969.59
合 计	7,307,969.59

4、处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市 值(元)	占净值比例
100177	雅戈转债	6,184,337.60	0.30%
100795	国电转债	3,305,779.60	0.16%
126301	丝绸转 2	4,773,000.00	0.23%
110037	歌华转债	1,044,556.90	0.05%
110317	营港转债	2,589,632.10	0.12%
110418	江淮转债	916,821.60	0.04%

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：130,403

平均每户持有人基金份额：15,337.07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	822,796,877.00	41.14%
个人投资者	1,177,203,123.00	58.86%
合计	2,000,000,000.00	100.00%

(三) 前十名持有人

序号	持有人姓名	期末持有数	持有比例
1	人寿集团	157,666,759	7.88%
2	人寿股份	156,163,178	7.81%
3	中国太保	134,841,897	6.74%
4	中国人保财	81,794,327	4.09%
5	平安保险	62,029,382	3.10%
6	久事公司	25,471,188	1.27%
7	泰康人寿	17,207,510	0.86%
8	再保险	16,515,399	0.83%
9	国泰君安	16,500,000	0.83%
10	鑫苏创业	10,694,564	0.53%

十、重大事件揭示

- 1、2004年4月30日本公司刊登《国泰基金管理有限公司关于重要岗位人员变更的公告》。经国泰基金管理有限公司董事会审议通过，并报经中国证监会审核批准：选举周志平、张和之同志为公司董事，罗新泉、沈强、周栋同志不再担任公司董事职务；选举黄明达、李芝樑同志为公司监事，李予瑾、翁新孟同志不再担任公司监事职务；聘任何斌、陈甦同志为公司副总经理。
- 2、2004年6月23日，本基金管理人刊登了《国泰基金管理有限公司关于公司股东股权转让的公告》。经本基金管理人股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字[2003]154号文批准，本公司股东宏源证券股份有限公司将其所持有的本公司20%股权分别转让给现有股东国泰君安证券股份有限公司15%和上海国有资产经营有限公司5%；国泰君安证券股份有限公司将所持有的本公司2%股权转让给上海仪电控股（集团）公司。本次股权转让后，本公司股东及出资比例为：上海国有资产经营有限公司24%，国泰君安证券股份有限公司24%，上海爱建信托投资有限责任公司20%，浙江省国际信托投资有限责任公司20%，中国电力财务有限公司10%，上海仪电控股（集团）公司2%。
- 3、2004年10月15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修改封闭式基金基金合同的公告》，就金泰证券投资基金修改基金合同的内容进行了公告。
- 4、2005年1月26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调整基金经理的临时公告》，经国泰基金管理有限公司董事会审议批准，黄刚先生担任社保委托投资的基金经理，不再担任金泰证券投资基金的基金经理，由黄焱先生担任金泰证券投资基金的基金经理。
- 5、根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同，本基金将进行2004年度收益分配。2004年度收益分配方案为：向全体持有人每10份基金单位派发现金收益0.350元。权益登记日为2005年4月6日，除息交易日为2005年4月7日，红利发放日为2005年4月11日。具体详见《金泰证券投资基金2004年度收益分配公告》。

6、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。

7、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
国泰君安证券股份有限公司	2	742,434,197.71	18.38%	157,350,637.26	38.30%
上海爱建信托投资有限责任公司	2	269,962,923.34	6.68%	13,592,751.60	3.31%
国信证券有限公司	2	540,495,708.63	13.38%	24,716,605.40	6.02%
申银万国证券股份有限公司	2	1,167,884,963.61	28.91%	52,524,931.97	12.79%
海通证券股份有限公司	1	721,480,629.96	17.86%	98,928,330.75	24.08%
金通证券股份有限公司	2	598,104,828.17	14.80%	63,700,849.30	15.51%
合计	11	4,040,363,251.42	100.00%	410,814,106.28	100.00%

券商名称	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
国泰君安证券股份有限公司	340,000,000.00	17.80%	587,270.64	18.17%
上海爱建信托投资有限责任公司	140,000,000.00	7.33%	213,897.92	6.62%
国信证券有限公司	180,000,000.00	9.42%		13.44%
申银万国证券股份有限公司	100,000,000.00	5.24%	933,722.45	28.89%
海通证券股份有限公司	660,000,000.00	34.55%	584,175.82	18.08%
金通证券股份有限公司	490,000,000.00	25.65%	478,070.27	14.79%
合计	1,910,000,000.00	100.00%	3,231,539.64	100.00%

- 8、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100,000.00元，目前的审计机构已提供审计服务的年限为三年。
- 9、报告期内，未召开基金份额持有人大会；基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动；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、关于同意设立金泰证券投资基金的批复
- 2、金泰证券投资基金合同
- 3、金泰证券投资基金托管协议
- 4、金泰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——上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31-32 楼。

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) 68674688, 400-8888-688

客户投诉电话：(021) 50819801

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2005 年 3 月 30 日