国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(原金鼎证券投资基金) 2007年半年度报告摘要

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

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。本半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2007年8月21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。

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金系原封闭式基金——金鼎证券投资基金转型而来。2007年3月9日金鼎证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过，后获中国证监会2007年3月27日证监基金字[2007]88号文核准。在获得上海证券交易所上证债字[2007]22号文件同意后，从2007年4月11日起金鼎证券投资基金终止上市，并自金鼎证券投资基金终止上市之日起，基金名称更名为国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金，由《金鼎证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》生效。

本报告中，原金鼎证券投资基金报告期自2007年1月1日至2007年4月10日止，国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金自2007年4月11日至2007年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

二、基金简介

（一）基金基本情况

1、基金名称：国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(转型后)
基金简称：金鼎价值
交易代码：519021
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2007年4月11日
报告期末基金份额总额：14,180,550,977.52份
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

2、基金名称：原金鼎证券投资基金（转型前）
基金简称：基金金鼎
交易代码：500021
基金运作方式：契约型封闭式
基金合同生效日：2000年5月16日
报告期末基金份额总额：500,000,000份
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

（二）基金产品说明

1、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

（1）投资目标：本基金为价值精选混合型基金，以量化指标分析为基础，在严密的风险控制前提下，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。

（2）投资策略：

A、大类资产配置

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。

B、股票资产投资策略

本基金以量化分析为基础，从上市公司的基本面分析入手，建立基金的一、二级股票池。根据股票池中个股的估值水平和α值，运用组合优化模型，积极创建并持续优化基金的股票组合，在有效控制组合总体风险的前提下，谋求超额收益。

C、债券资产投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

（3）业绩比较基准：65%上证综合指数收益率+35%上证国债指数收益率。

（4）风险收益特征：本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

2、原金鼎证券投资基金

（1）投资目标：本基金是以属于朝阳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。

对股票一级市场、二级市场、债券市场的收益率之间的关系进行分析，对证券市场总体风险收益状况作出评估；同时根据宏观政策面与资金面等综合因素的实际情况，预测股票市场和债券市场的预期收益率、股票与债券投资风险/收益比，定期确定和调整相应的资产配置比例。

根据行业企业景气指数、上市公司的行业基本面数据筛选朝阳行业。利用预期主营业务收入复合增长率、主营业务利润复合增长率等指标筛选成长型股票，以相对价值优选基金投资股票。

（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
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
信息披露负责人：尹东
联系电话：010-67595104
传真：010-66275853
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》
登载半年度报告正文的管理人网址：http://www.gtfund.com
半年度报告置备地点：上海市延安东路700号港泰广场22-23楼
北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

三、主要财务指标及基金净值表现

（一）各主要财务指标

	转型后(自2007年4月11日至2007年6月30日止)	转型前(自2007年1月1日至2007年4月10日止)
基金本期净收益	43,835,020.72元	252,412,118.07元
加权平均基金份额本期净收益	0.0044元	0.5048元
期末可供分配基金收益	1,284,381,371.84元	66,172,487.71元
期末可供分配基金份额收益	0.0906元	0.1323元
期末基金资产净值	15,160,416,764.11元	745,905,630.57元
期末基金份额净值	1.069元	1.4918元
基金加权平均净值收益率	0.42%	26.63%
本期基金份额净值增长率	17.85%	27.53%
基金份额累计净值增长率	17.85%	141.24%

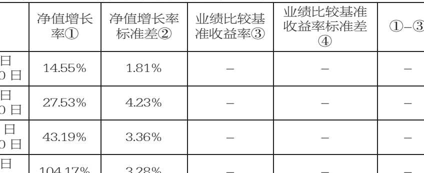
注：所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（二）国泰金鼎价值精选混合型基金净值表现（自2007年4月11日至2007年6月30日止）

1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	2.10%	1.90%	-4.75%	1.88%	6.85%	0.02%
自基金成立起至今	17.85%	1.71%	6.71%	1.62%	11.14%	0.09%

2、国泰金鼎价值精选混合型基金自合同生效日以来累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图



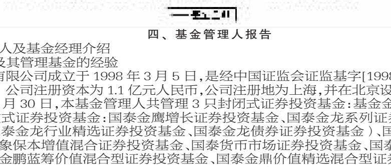
（三）原金鼎证券投资基金净值表现(自基金成立日2000年5月16日至2007年4月10日)

1、原金鼎证券投资基金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
2007年3月1日-2007年4月10日	14.55%	1.81%	-	-	-	-
2007年1月1日-2007年4月10日	27.53%	4.23%	-	-	-	-
2006年10月1日-2007年4月10日	43.19%	3.36%	-	-	-	-
2006年4月1日-2007年4月10日	104.17%	3.28%	-	-	-	-
2004年4月1日-2007年4月10日	103.65%	2.65%	-	-	-	-
自基金合同生效起至2007年4月10日	141.24%	2.33%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

2、原金鼎证券投资基金累计净值增长率历史走势图(2000年5月16日至2007年4月10日)



四、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理介绍

1、基金管理人及其管理基金的经验

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2007年6月30日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛，以及9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、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由原封闭式基金基金金鼎转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金。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

崔海峰，男，货币银行学硕士，9年证券从业经历。1999年加盟国泰基金管理有限公司，先后任研究开发部副经理、基金金鑫基金经理助理、基金管理部副总监，2003年1月至2004年1月任基金金盛基金经理，2003年12月至2006年7月担任国泰金龙行业精选基金基金经理，2006年7月起担任基金金泰基金经理，2007年3月起兼任基金金鼎基金经理。

（二）基金运作管理合规性声明

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，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）2007年上半年证券市场与投资管理回顾

上半年国内股票市场经历了明显的三个阶段，板块轮动也很明显，但整体上处于震荡上升的态势。

经过2006年下半年的大幅单边上涨之后，2007年1至2月份市场进入震荡波动阶段，大部分有业务缺陷的企业表现突出，处于典型的补涨行情。随着季报行情的展开，3至5月份的市场开始以急跌慢涨的方式呈现大幅上扬的态势。一方面，以资产注入、整体上市为预期的价值创造深入到大部分有业务缺陷的企业中；同时，以高增长为理由的价值重估继续泛滥到各类行业，不仅消费品行业泡沫化，周期类企业也在增长的理由中泡沫化；并且在人民币升值预期不断强化下，要素资产的价值重估深入演绎，地产、金融股权、自然资源的重估在不断表现。

股指大幅上扬后，几乎所有的板块和上市公司自2006年下半年来都有所表现，大部分所谓估值洼地的重心普遍上移，大幅度的震荡也随之而来。这个阶段最明显的是政府的风险提示和紧缩政策，尽管尽力市场化，但已经是很密集和紧迫。这个阶段金融板块和蓝筹优势企业相对表现良好。

本基金在一季度立足原有组合，保留原有组合的优势企业，结合阶段性热点和中长线投资行业，对组合进行了较大的调整。一季度本基金净值表现基本跟上市场平均水平。围绕宏观经济高速增长和人民币升值的主题我们重点投资了中信证券和浦发银行等，阶段性重点投资了民生银行、吉林敖东和辽宁成大等，取得了较好的投资效果；围绕优势制造业的投资主题我们重点投资了同方股份、烟台万华、星新材料和特变电工等；围绕资产注入我们重点投资了中钨高新和首旅股份等。

本基金于本报告期内完成了封转开进程，并进行了持续销售，因此，二季度处于类似新基金的建仓过程中，并基本按照中性偏多的判断进行仓位控制。

本基金现阶段在行业布局上，主要对作为人民币升值主线的金融、地产行业进行了主要布局。不过，地产行业上的配置仍相对不足，本基金将等待适当机会进行增持。同时，我们也对其他几大类资产进行了均衡配置，包括制造类中主要配置了机械、化工、医药、电子信息技术行业；消费类中主要配置了饮食、商业行业；资源类的大宗商品中主要配置煤炭、有色、钢铁、造纸行业等。

（四）2007年下半年证券市场与投资管理展望

展望下一阶段的市场趋势，尽管估值压力和业绩增长预期都将受到考验，但市场表现出相对的谨慎还是有利于市场在未来走得更远些。下半年走势还是取决于业绩增长，上市公司盈利的超预期增长可能成为化解短期估值压力和长期增长潜力这对矛盾的最好理由。

在行业板块选择上，本基金的投资主线并没有改变，依旧倾向于人民币升值背景下的资产资源要素类企业、内需升级下的消费类和服务类企业以及经济结构升级下的优势制造类企业。具体看，食品饮料、金融、通信设备及服务、有色金属、汽车和煤炭行业的投资机会较大，同时可以关注估值最低的钢铁行业和盈利增长较快但可能会受到政策调控的房地产行业。

在投资主题方面，本基金将继续关注整体上市和资产注入、节能减排环保、奥运等主题。

在组合策略上，本基金将结合流动性，把握中线优势企业的基本配置和阶段性投资板块的平衡配置，尤其将积极尝试行业性投资机会。

五、基金托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》和《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金托管协议》，托管国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（以下简称金鼎价值基金）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在金鼎价值基金的托管过程中，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金鼎价值基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

由金鼎价值基金管理人-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真实、准确和完整。

六、国泰金鼎价值基金财务会计报告(未经审计)

（一）基金会计报表

1、资产负债表

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金
2007年6月30日资产负债表

单位：元

		2007年6月30日
资　产		
银行存款		4,187,943,792.26
清算备付金		95,640,087.19
交易保证金		975,299.29
应收股利		883,290.74
应收利息		3,442,121.74
应收申购款		170,579,039.07
其他应收款		999.90
股票投资市值		10,767,288,517.65
其中：股票投资成本		9,817,116,844.19
债券投资市值		172,079,894.30
其中：债券投资成本		172,438,817.19
权证投资市值		-
其中：权证投资成本		-
资产总计		15,398,833,042.14
负债及持有人权益		
负债：		
应付证券清算款		154,065,033.03
应付赎回款		52,854,290.21
应付赎回费		199,201.68
应付管理人报酬		17,342,639.30
应付托管费		2,904,238.70
应付佣金		10,564,902.41
其他应付款		307,452.40
预提费用		178,520.30
负债合计		238,416,278.03
持有人权益：		
实收基金		8,622,704,434.69
未实现利得		5,253,330,957.58
未分配收益		1,284,381,371.84
持有人权益合计		15,160,416,764.11
负债及持有人权益总计		15,398,833,042.14

2、经营业绩表

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金
2007年4月11日(合同生效日)至2007年6月30日
经营业绩表

单位：元

项目		2007年4月11日至2007年6月30日
一、收入		85,619,473.19
1、股票差价收入		39,722,844.73
2、债券差价收入		722,721.60
3、权证差价收入		-
3、债券利息收入		1,132,545.14
4、存款利息收入		9,141,371.16
5、股利收入		32,451,852.05
6、买入返售证券收入		413,812.00
7、其他收入		2,034,326.51
二、费用		41,784,452.47
1、基金管理人报酬		34,637,786.30
2、基金托管费		5,772,964.38
3、卖出回购证券支出		315,773.85
4、其他费用		1,057,927.94
其中：上市年费		
信息披露费		66,575.52
审计费用		48,875.76
三、基金净收益		43,835,020.72
加：未实现利得		770,079,607.71
四、基金经营业绩		813,914,628.43

3、基金收益分配表

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金
2007年4月11日(合同生效日)至2007年6月30日
基金收益分配表

单位：元

项目		2007年4月11日至2007年6月30日
本期基金净收益		43,835,020.72
加：期初基金净收益		66,172,487.71
加：本期损益平准金		1,174,373,863.41
可供分配基金净收益		1,284,381,371.84
减：本期已分配基金净收益		-
期末基金净收益		1,284,381,371.84

4、基金净值变动表

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金
2007年4月11日(合同生效日)至2007年6月30日
基金净值变动表

单位：元

项　目	2007年4月11日至2007年6月30日
一、期初基金净值	745,905,630.57
二、本期经营活动：	
基金净收益	43,835,020.72
未实现利得	770,079,607.71
经营活动产生的基金净值变动数	813,914,628.43
三、本期基金份额交易：	
基金申购款	14,845,335,841.39
基金赎回款	-1,244,739,336.28
基金份额交易产生的基金净值变动数	13,600,596,505.11
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	15,160,416,764.11

（二）基金会计报表附注

1、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》、《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监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2007年4月11日至2007年6月30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：本基金的记账基础为权责发生制。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收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向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收盘价估值。

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收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。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市场交易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估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易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估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

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收盘价估值；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，基金管理人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：

①股票投资：买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。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时冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

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。本基金尚未发生主动投资权证交易。

(7) 待摊费用的摊销方法：在实际受益期间按直线法摊销。

(8) 收入的确认和计量：

①股票差价收入：于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

②债券差价收入：于卖出成交日确认。银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

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适用情况下应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：按存款的本金与适用利率逐日计提。

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：按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(9) 费用的确认和计量：

①基金管理人报酬：按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。

②基金托管费：按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

③卖出回购证券支出：按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(10)实收基金：实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

(11)基金份额拆分会计政策：基金份额拆分日，按拆分前的基金份额数及确定的拆分比例，计算增加的基金份额数，再"实收基金"科目的"数量"栏进行记录。

(12)未实现利得：未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值和未实现利得平准金。未实现利得平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(13)损益平准金：损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益。

(14)基金的收益分配政策：

本基金收益分配应遵循下列原则：

a) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

b) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；

c) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。

d) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益可进行分配，本基金收益每年最多分配6次，每年基金收益分配比例不低于当年可分配收益的90%；

e) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

f) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

g) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

h) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入，自2004年1月1日起继续免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，自2005年6月13日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%(此前按100%）计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4)基金买卖股票在2007年5月30日前按照1‰的税率缴纳股票交易印花税，自2007年5月30日起按3‰的税率征收印花税。

3、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、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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	基金管理人的股东、基金代销机构
上海爱建信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	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）

	2007年4月11日至2007年6月30日			
	股票投资		债券投资	
	成交金额	比例	成交金额	比例
国泰君安	2,137,011,544.05	16.65%	-	-
	2007年4月11日至2007年6月30日			
	债券回购		交易佣金	
	成交金额	比例	金额	比例
国泰君安	-	-	1,711,373.61	16.51%

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）

本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易。

(4) 基金管理人报酬

① 基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

② H=E×1.5%/当年天数

③ H为每日应支付的管理人报酬

④ 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。

⑤ 在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共34,637,786.30元，其中已支付基金管理人17,295,147.00元，尚余17,342,639.30元未支付。

(5) 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×0.25%/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；并于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

⑥ 本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共5,772,964.38元，其中已支付基金托管人2,868,725.68元，尚余2,904,238.70元未支付。

(6) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行同业存款利率计息。基金托管人于2007年6月30日保管的银行存款余额为4,187,943,792.26元。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为8,975,875.79元。

(7) 基金各关联方投资本基金的情况

①本基金管理人本报告期末持有本基金的情况

	2007年6月30日	
	持有基金份额	占总份额比例
国泰基金管理有限公司	22,954,576份	0.16%

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22,954,576份，较2006年末增持了8,996,612份，此增加的份额为基金拆分所致。

②本基金管理人主要股东及其控制的机构在本报告期末持有本基金情况：

	2007年6月30日	
	持有基金份额	占总份额比例
国泰君安证券股份有限公司	2,175,576份	0.02%

4、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2007年6月30日止基金持有的流通转让受限制的股票资产明细如下：

序	名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	备注
1	交通银行	2007/4/27	2007/8/16	5,902,000	46,625,800.00	64,862,980.00	网下申购
2	中国远洋	2007/6/20	2007/9/26	1,797,600	15,243,648.00	32,824,176.00	网下申购
	合计				61,869,448.00	97,687,156.00	

②估值方法

上述股票为基金网下申购的新股，截止本报告期末均已上市，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2007年6月30日按市场收盘价进行估值。

③流通受限期限及原因

上述股票为基金网下申购的新股，截止本报告期末均已上市，但本基金持有部分未流通。受限期限均为三个月。

(2) 流通转让受限的债券

本基金截至2007年6月30日，未持有流通受限制的债券。

七、金鼎证券投资基金财务会计报告(未经审计)

（一）基金会计报表

1、资产负债表

金鼎证券投资基金
2007年4月10日资产负债表

单位：元

		2007年4月10日	2006年12月31日
资　产			
银行存款		53,296,812.73	99,552,190.08
清算备付金		2,715,296.53	1,096,189.40
交易保证金		975,299.29	390,741.00
应收证券清算款		-	3,232,448.04
应收利息		3,140,782.17	1,979,693.09
股票投资市值		635,553,275.09	676,543,395.63
其中：股票投资成本		455,074,444.24	469,232,823.57
债券投资市值		171,693,129.20	178,548,299.70
其中：债券投资成本		172,438,817.19	178,761,859.87
权证投资市值		-	-
其中：权证投资成本		-	-
待摊费用		953,560.98	-
资产总计		868,328,155.99	961,342,956.94
负债及持有人权益			
负债：			
应付证券清算款		48,525.00	8,111,090.82
应付管理人报酬		364,929.40	1,060,537.10
应付托管费		60,821.56	176,756.19
应付佣金		1,439,290.91	415,632.80
应付利息		102,756.15	58,996.10
其他应付款		307,572.40	307,562.40
卖出回购证券款		120,000,000.00	90,000,000.00
预提费用		98,630.00	355,000.00
负债合计		122,422,525.42	100,485,575.41
持有人权益：			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		179,733,142.86	207,097,011.89
未分配收益		66,172,487.71	153,760,369.64
持有人权益合计		745,905,630.57	860,857,381.53
负债及持有人权益总计		868,328,155.99	961,342,956.94

期末基金份额净值：2007年4月10日为1.4918元，2006年12月31日为1.7217元。

2、经营业绩表

金鼎证券投资基金
2007年1月1日至4月10日经营业绩表

单位：元

项目		2007年1月1日至4月10日	2006年1-6月
一、收入		257,908,526.47	138,342,450.20
1、股票差价收入		256,503,477.08	130,667,896.42
2、债券差价收入		-1,108,000.00	-6,295.88
3、权证差价收入		396,904.83	985,257.54
4、债券利息收入		1,633,189.89	1,819,040.19
5、存款利息收入		139,743.99	111,532.66
6、股利收入		343,210.68	4,765,019.27
7、其他收入		-	-
二、费用		5,496,408.40	5,822,442.48
1、基金管理人报酬		3,961,478.09	4,629,980.18
2、基金托管费		660,246.29	771,663.30
3、卖出回购证券支出		527,972.64	198,759.12
4、其他费用		346,711.38	222,039.88
其中：上市年费		20,000.00	29,752.78
信息披露费		82,192.00	148,767.52
审计费用		16,877.02	29,752.78
三、基金净收益		252,412,118.07	132,520,007.72
加：未实现利得		-27,363,869.03	170,470,995.01
四、基金经营业绩		225,048,249.04	302,991,002.73

3、基金收益分配表

金鼎证券投资基金
2007年1月1日至4月10日收益分配表

单位：元

项目		2007年1月1日至4月10日	2006年1-6月
本期基金净收益		252,412,118.07	132,520,007.72
加：期初基金净收益		153,760,369.64	-17,544,799.35
加：本期损益平准金		-	-
可供分配基金净收益		406,172,487.71	114,975,208.37
减：本期已分配基金净收益		340,000,000.00	-
期末基金净收益		66,172,487.71	114,975,208.37

4、基金净值变动表

金鼎证券投资基金
2007年1月1日至4月10日净值变动表

单位：元

项　目	2007年1月1日至4月10日	2006年1-6月
一、期初基金净值	860,857,381.53	504,062,270.41
二、本期经营活动：		
基金净收益	252,412,118.07	132,520,007.72
未实现利得	-27,363,869.03	170,470,995.01
经营活动产生的基金净值变动数	225,048,249.04	302,991,002.73
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	-340,000,000.00	-
五、期末基金净值	745,905,630.57	807,053,273.14

（二）基金会计报表附注

1、基金简介

金鼎证券投资基金（以下简称"本基金"）是由建业基金、沈阳公众基金、陕建基金三只基金清理规范合并而成的契约型封闭式证券投资基金。经中国证券监督管理委员会《关于同意建业基金、沈阳公众基金、陕建基金合并规范为金鼎证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》（证监基金字[2000]51号文）批准，上述三只基金于2000年5月16日办理了资产及负债的移交手续，本基金的发行规模为232,748,084份基金单位，由国泰君安证券股份有限公司（以下简称"国泰君安"）和国泰基金管理有限公司作为本基金发起人，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，存续期为10年。

本基金经上海证券交易所（以下简称"上交所"）（上证上字[2000]第51号文）审核同意，于2000年8月4日在上交所挂牌交易。

经中国证券监督管理委员会《关于同意建业基金、沈阳公众基金、陕建基金合并规范为金鼎证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》（证监基字[2000]51号文）批准，本基金于2000年10月19日基金总份额由232,748,084份基金份额扩募至5亿份基金单位，存续期延长5年至2007年5月31日。

根据《证券投资基金法》和基金合同的有关规定，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

本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

3、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4)基金买卖股票在2007年5月30日前按照1‰的税率缴纳股票交易印花税，自2007年5月30日起按3‰的税率征收印花税。

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
万联证券有限责任公司	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）

	2007年1月1日至2007年4月10日				2006年1-6月			
	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	612,465,788.42	34.29%	19,169,200.00	54.27%	371,840,033.16	25.46%	19,119,285.50	33.24%
	2007年1月1日至2007年4月10日				2006年1-6月			
	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	80,000,000.00	15.84%	493,923.26	34.32%	10,000,000.00	11.76%	294,621.27	25.04%
	2007年1月1日至2007年4月10日				2006年1-6月			
	权证投资				权证投资			
	成交金额		比例		成交金额		比例	
国泰君安	21,698,206.48		72.89%		-		-	

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）

	2007年1月1日至2007年4月10日			2006年1-6月		
	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
中国建设银行	-	40,000,000.00	28,931.51	-	-	-

(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：

② H=E×1.5%/当年天数

③ H为每日应支付的管理人报酬

④ 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3,961,478.09元，其中已支付基金管理人3,596,548.69元，尚余364,929.40元未支付。2006年1-6月共计提管理费4,629,980.18元，已全部支付。

(5) 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×0.25%/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660,246.29元，其中已支付基金托管人599,424.73元，尚余60,821.56元未支付。2006年1-6月共计提托管费771,663.30元，已全部支付。

(6) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行同业存款利率计息。基金托管人于2007年4月10日保管的银行存款余额为53,296,812.73元(2006年6月30日：45,436,647.25元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为122,074.05元(2006年1-6月：100,545.73元)。

(7) 基金各关联方投资本基金的情况

①本基金管理人本报告期末(2007年4月10日)及2006年6月30日持有本基金的情况

	2007年4月10日		2006年6月30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
国泰基金管理有限公司	13,957,964份	2.79%	2,354,200份	0.47%

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(2007年4月10日)及2006年6月30日持有本基金情况：

	2007年4月10日		2006年6月30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	2,645,800份	0.53%	2,645,800份	0.53%

5、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2007年4月10日止基金持有的流通转让受限制的股票资产明细如下：

A、因股权分置改革方案实施阶段而停牌：

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价(元)	复牌日期	复牌开盘单价(元)	数量(股)	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
000895	双汇发展	2006-6-1	31.02	2007-6-29	57.88	2,512,975	34,413,643.42	77,952,484.50

B、因新股认购获配而流通受限：

股票代码	股票名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	备注
601318	中国平安	2007-2-14	2007-6-1	46,620	1,575,756.00	2,462,468.40	网下申购
	合计				1,575,756.00	2,462,468.40	

②估值方法

上述A类股票已上市，但本基金持有的部分因股权分置改革方案实施阶段而停牌。在编制本报表时，根据有关规定，在2007年4月10日按"停牌前估价"进行估值。

上述B类股票为基金网下申购的新股，截止本报告期末已上市，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2007年4月10日按市场均价进行估值。

③流通受限期限及原因

上述A类股票截至2007年4月10日因股权分置改革而暂时停牌，改类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。

上述B类股票为基金网下申购的新股，截止本报告期末已上市，但本基金持有部分未流通。受限期限为三个月。

(2) 流通转让受限的债券

本基金截至2007年4月10日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额120,000,000.00元(2006年6月30日：20,000,000.00元)，于2007年4月26日全部到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

八、基金投资组合报告(未经审计)

（一）国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

1、2007年6月30日基金资产组合情况

分　类	市值(元)	占总资产比例
股票	10,767,288,517.65	69.92%
债券	172,079,894.30	1.12%
权证	-	-
银行存款和清算备付金	4,283,583,879.45	27.82%
其他资产	175,880,750.74	1.14%
合　计	15,398,833,042.14	100.00%

2、2007年6月30日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	39,997,274.10	0.26%
2	采掘业	571,328,292.80	3.77%
3	制造业	4,772,774,523.50	31.48%
	其中：食品、饮料	830,003,354.06	5.47%
	木材、家具	29,171,310.60	0.19%
	造纸、印刷	149,687,219.88	0.99%
	石油、化学、塑胶、塑料	986,593,695.26	6.51%
	电子	5,942,250.22	0.04%
	金属、非金属	792,802,631.75	5.23%
	机械、设备、仪表	1,493,905,352.41	9.85%
	医药、生物制品	484,668,709.32	3.20%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	198,209,217.12	1.31%
5	建筑业	-	-
6	交通运输、仓储业	528,625,176.00	3.49%
7	信息技术业	670,314,205.05	4.42%
8	批发和零售贸易	590,850,105.10	3.90%
9	金融、保险业	2,376,717,389.28	15.68%
10	房地产业	639,345,247.60	4.22%
11	社会服务业	351,710,815.14	2.32%
12	传播与文化产业	27,416,271.96	0.18%
13	综合类	-	-
	合　计	10,767,288,517.65	71.02%

3、2007年6月30日按市值占基金资产净值比例排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	600036	招商银行	27,499,872	675,946,853.76	4.46%
2	600309	烟台万华	11,767,045	630,242,930.20	4.16%
3	600030	中信证券	10,000,000	529,700,000.00	3.49%
4	601166	兴业银行	10,000,000	350,900,000.00	2.31%
5	000002	万科A	16,863,759	322,435,072.08	2.13%
6	600009	上海机场	8,100,000	307,881,000.00	2.03%
7	000069	华侨城A	7,175,277	285,576,024.60	1.88%
8	000895	双汇发展	4,914,396	284,543,528.40	1.88%
9	600219	南山铝业	12,203,900	276,906,491.00	1.83%
10	600100	同方股份	7,945,176	272,519,536.80	1.80%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本管理人网站的半年度报告正文。

4、股票投资组合的重大变动

(1)报告期内累计买入价值前20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)	占期末净值比例
1	600036	招商银行	568,061,371.11	3.75%
2	600030	中信证券	528,343,360.90	3.49%
3	600309	烟台万华	512,899,648.46	3.38%
4	601166	兴业银行	407,776,043.51	2.69%
5	600009	上海机场	305,609,720.93	2.02%
6	000069	华侨城A	257,171,336.61	1.70%
7	002024	苏宁电器	252,002,275.43	1.66%
8	000002	万科A	251,973,276.42	1.66%
9	600100	同方股份	234,170,384.10	1.54%
10	601318	中国平安	234,100,801.82	1.54%
11	600519	贵州茅台	231,197,942.64	1.53%
12	600219	南山铝业	224,266,872.61	1.48%
13	600320	振华港机	215,565,109.12	1.42%
14	600015	华夏银行	214,882,087.82	1.42%
15	601006	大秦铁路	210,360,081.45	1.39%
16	600123	兰花科创	208,593,346.83	1.38%
17	000709	唐钢股份	195,251,871.61	1.29%
18	000858	五粮液	184,678,628.20	1.22%
19	000063	中兴通讯	184,268,728.41	1.22%
20	601628	中国人寿	174,492,954.47	1.15%

(2)报告期内累计卖出价值前20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)	占期末净值比例
1	600058	五矿发展	139,664,711.68	0.92%
2	000089	深圳机场	124,076,408.78	0.82%
3	601166	兴业银行	97,924,879.67	0.65%
4	000060	中金岭南	82,765,927.84	0.55%
5	600153	建发股份	68,246,016.17	0.45%
6	601006	大秦铁路	61,140,508.08	0.40%
7	600015	华夏银行	60,331,263.89	0.40%
8	600642	申能股份	57,074,529.82	0.38%
9	000709	唐钢股份	56,636,680.48	0.37%
10	000748	长城信息	49,121,660.21	0.32%
11	600122	宏图高科	45,551,214.29	0.30%
12	600009	上海机场	40,324,162.41	0.27%
13	000910	大亚科技	39,926,623.22	0.26%
14	600748	上实发展	39,373,796.55	0.26%
15	600000	浦发银行	35,879,071.08	0.24%
16	000402	金融街	35,552,807.44	0.23%
17	600160	巨化股份	34,039,072.42	0.22%
18	600111	稀土高科	32,631,145.40	0.22%
19	600030	中信证券	29,247,560.15	0.19%
20	002037	久联发展	27,951,820.18	0.18%

(3)报告期内买入股票的成本总额：11,120,824,756.86元
报告期内卖出股票的收入总额：1,800,012,102.08元

5、2007年6月30日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	172,079,894.30	1.14%
	合　计	172,079,894.30	1.14%

6、2007年6月30日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	20国债(10)	45,722,950.00	0.30%
2	21国债(3)	36,075,786.00	0.24%
3	02国债(14)	31,533,637.50	0.21%
4	20国债(4)	25,037,233.00	0.17%
5	21国债(15)	21,507,418.80	0.14%

7、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	975,299.29
应收股利	883,290.74
应收利息	3,442,121.74
应收申购款	170,579,039.07
其他应收款	999.90
合计	175,880,750.74

(4)报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

(5)本报告期末本基金未持有权证。

(6)本报告期内本基金未发生过权证投资。

(7)本报告期内，未投资资产支持证券。

(下转A94版)