

华安创新证券投资基金
2001 年年度报告

华安基金管理有限公司
2002 年 3 月 29 日

重要提示

本基金的托管人交通银行已于 2002 年 3 月 28 日复核了本报告。

本基金的管理人、托管人愿就本报告中所载资料的真实性、准确性、完整性负责。本报告书中的内容由基金管理人负责解释。

一. 基金简介

- (一) 基金名称: 华安创新证券投资基金
(简称: 华安创新)
- 交易代码: 040001
- 基金发起人: 华安基金管理有限公司
- 基金发行日期: 2001 年 9 月 11 日
- 基金成立日期: 2001 年 9 月 21 日
- 首次募集规模: 5,000,001,124 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: 华安基金管理有限公司
- 注册及办公地址: 上海市浦东南路 360 号
新上海国际大厦 38 楼
(邮编: 200120)
- 国际互联网网址: <http://www.huaan.com.cn>
- 法定代表人: 杜建国
- 总经理: 韩方河
- 信息披露负责人: 冯颖
- 电 话: 021-58881111
- 传 真: 021-58406138
- 客户服务热线: 021-68604666
- (三) 基金托管人: 交通银行
- 注册及办公地址: 上海市仙霞路 18 号 (邮编: 200336)
- 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

电 话：021-62082517

传 真：021-62750005

(四) 会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区沈家弄 325 号

(邮编：200137)

办公地址：上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼

(邮编：200021)

法定代表人：Kent Watson

经办注册会计师：周忠惠、王笑

二. 主要财务指标

项 目	2001/9/21-2001/12/31
基金本期净收益	34,446,822.35 元
单位基金本期净收益	0.0069 元
基金可分配净收益	34,445,977.47 元
单位基金可分配净收益	0.0069 元
期末基金资产总值	5,112,632,207.78 元
期末基金资产净值	5,064,713,018.51 元
单位基金资产净值	1.012 元
基金资产净值收益率	0.69%
本期基金资产净值增长率	1.20%
累计资产净值增长率	1.20%

上述部分指标计算公式:

基金资产净值收益率 = 本期净收益 / 调整后期初基金资产净值

本期基金净值增长率 = (分红或扩募前单位净值/期初单位净值) * (期末单位净值/分红或扩募后单位净值) -1

累计资产净值增长率 = (第 1 年度净值增长率+1) * (第 2 年度净值增长率+1) * (第 3 年度净值增长率+1) * ... * (上年度净值增长率+1) * (本期净值增长率+1) -1

三. 基金管理人报告

基金业绩表现:

华安创新证券投资基金成立于 2001 年 9 月 21 日。截止 2001 年 12 月 31 日, 华安创新单位基金资产净值为 1.012 元, 基金净值增长率为 1.2%, 表现优于同期沪深两市指数 (上证综指下跌 8.91%, 深证综指下跌 9.57%)。本期间华安创新实现净收益为每基金单位 0.0069 元。

基金经理简介:

尚志民先生: 基金投资部总监助理, 工商管理硕士, 7 年证券从业经验, 曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作, 进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员, 基金安顺、基金安瑞基金经理。

刘耀军先生: 美国杜兰大学工商管理硕士, 美国投资管理与研究协会会员, 特许金融分析师 (CFA)。7 年证券从业经历。曾在广发证券、美国所罗门兄弟 (香港) 有限公司研究部、美国环球投资管理公司工作。进入华安基金管理有限公司后曾担任研究发展部高级研究员。

孙正女士: 硕士, 6 年证券从业经历, 曾先后任职于中教信证券交易部、投资银行部、研究发展部。1999 年进入华安基金管理有限公司, 任华安基金管理有限公司北京分公司总经理。

(一) 基金经理工作报告

华安创新作为中国大陆首只开放式基金于 2001 年 9 月成功募集, 并于 2001 年 9 月 21 日正式开始投资运作。虽然至年末仅有 69 个交易日, 但期间沪深两市大盘的跌宕起伏, 使华安创新经受了相当严峻的考验。在公司领导及广大投资者的关心和支持下, 我们本着对投资人认真负责的态度, 精心把握市场时机和建仓节奏, 耐心细致地构建投资组合, 有效回避了系统性风险, 为日后的运作赢得了主动。自 2001 年 9 月 21 日成立运作到 12 月 31 日, 华安创新基金单位净值增幅 1.2%, 同期上证综指下跌 8.91%, 深证综指下跌 9.57%, 而且华安创新的单位净值表现出相当高的稳定性。

华安创新成立之际, 恰逢股票市场在诸多因素影响下展开 2 年多牛市以来的罕见大幅调整。不少投资者对股票市场经过多年快速发展暴露出来的一些深层次问题感到困惑迷茫, 甚至出现了信心危机。应该说 2001 年下半年股市持续时间较长的下跌给所有的投资者上了一堂生动的风险教育课。我们认为市场出现的调整有其内在原因。首先, 2001 年上半年的资金推动特征鲜明的上升行情, 虽然反映了投资者对中国经济增长前景的信心和加快发展证券市场的热情, 但其中不免造成证券资产价格脱离上市公司的基本面因素, 夹杂着部分上市公司、中介机构、机构投资者有违诚信原则的行为, 加上因利益驱使产生的操纵市场现象越来越严重, 所以证券市场本身的内在调整压力巨大。其次, 围绕国有股减持这一错综复杂、牵涉利益面广泛问题的讨论乃至争论, 证券市场相应做出了激烈反映。此外随着管理层对证券市场监管的加强, 部分违规资金遭到清理, 违规现象及行为受到调查和处罚, 市场也不免伴随着震动。当然我们相信从长远的眼光看, 管理层加强监管、改善上市公司质量、优化市场结构、规范投资行为的一系列举措, 有利于夯实市场基础, 改善投资环境, 树立投资者的信心, 有助于市场实现理性的回归, 有利于证券市场持续健康发展。

针对证券市场的一系列变化，我们在制订投资方案、投资策略等方面进行了细致的准备，综合考虑了各类重大影响因素，采取了谨慎而稳健的建仓策略：

1. 在组合资产配置上，大力向国债倾斜，较好地把握了近年来难得的国债市场投资机会，奠定了基金净值稳定增长的坚实基础；

2. 在股票投资的行业配置上相对集中，重点投向能源电力、港口、交通运输等公用事业或基础设施类行业，使组合防御性提高；

3. 在投资品种选择方面，我们依然坚持发扬华安基金管理公司精选个股的投资传统及优势，有效降低了组合的非系统性风险，这从我们组合个股的抗跌性明显强于市场平均水平也得到了验证；

4. 注重投资时机选择，把握好建仓节奏，提高了组合调整的主动性和灵活性。在国内证券市场当前状况下，类似巴菲特那样的绝对价值投资机会相当少，而我们从基本面研究为出发点的投资实际上是做相对价值投资。应该说这种投资环境对投资时机选择能力的要求相当高，这可能也是国内基金经理们不得不面对的一道难题。

在与一些投资者交流沟通的过程中我们发现仍有不少投资者对于华安创新投资方向和范围的理解存在偏差，在这里我们想再次阐述自己的观点。我们认为创新是上市公司竞争力的源泉，创新能力可以使企业竞争优势具有持续性，而企业利润从某种程度上说也是企业创新能力的回报。不论是高新技术产业领域的上市公司还是传统产业领域的上市公司，只要它们在技术创新、管理创新、制度创新等方面的创新因素最终反映在企业的产品上，反映在企业的经营成果上，反映在企业可持续发展过程中，我们认为这类上市公司就具有潜在投资价值。

我们认为在政府各项政策及配套措施的大力支持下，有理由相信 2002 年中国经济仍能保持相对高的增长速度并完成既定目标。我们认为规范与发展将是中国证券市场的主基调，中国证券市场将在稳定的基础上快速发展，证券市场制度体系建设将更加完善，市场参与主体队伍将进一步壮大，金融品种的创新可期，一些历史积累的问题会逐步以稳妥的方式解决。综合各方面因素，我们认为 2002 年是证券市场的调整年或整固年，预计箱体震荡走势将贯穿全年行情始终。在复杂的市场环境下我们将努力发挥专业优势，增强对证券市场中各类规则变化的适应能力，较管理封闭式基金更加注重组合的流动性管理，加强风险控制，建立适当的盈利预期，提高主动操作的水平。

我们幸运地成为国内第一批开放式基金的管理人，深感肩负的责任重大。一方面国内基金行业的大发展形势需要开放式基金这类新品种的成功运作经验，众多第一批国内开放式基金投资者对我们的信赖和获得良好投资回报的殷切期望也时刻鞭策和鼓舞着我们，另一方面管理开放式基金是对国内基金业管理水平和综合实力的考验和挑战。我们将不懈努力，争取以良好的业绩回报投资者。

（二）内部监察报告

1. 基金运作合规性声明

本报告期间，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《开放式证券投资基金试点办法》、《华安创新证券投资基金基金契约》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，遵循“忠诚理财、智慧回报”的公司理念，在严格控制风险的基础上，为持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为存在。基金投资组合符合有关法规及基金契约的规定。

2. 内部监察工作报告

2001 年度中, 伴随公司基金管理规模逐步扩大、公司组织结构逐步完善、新业务开发速度加快, 公司对全方位的合法合规性运作提出了更高的要求, 这不仅要求严格遵循现有法律法规制度, 更需要根据现代企业制度的要求规范完善公司业务流程规则与内部风险控制体系, 树立全员风险防范、控制意识。

在过去的一年里, 监察稽核部与各业务部门紧密配合, 共同建立公司风险防范体系; 监察稽核部自身也积极吸取境外合作伙伴风险控制先进经验, 不断对现有监察工作方式和工作内容进行调整和完善, 主要表现在完善监察规则与程序、调整监察手段、提高监察效率等诸多方面。

在报告期内, 我们对以下方面着重实施了监察:

(1) 对华安创新证券投资基金日常投资运作合法性、合规性的监察。

为加强公司风险监控, 防范投资违规风险, 维护公司良好的市场形象, 根据《暂行办法》、《试点办法》及其他规定对投资行为进行每日检查, 重点对基金投资比例、席位分配比例、投资决策和交易制度执行情况进行检查, 发现异常情况时及时报管理层并反馈给相关投资部人员, 要求解释和纠正。迄今为止, 未发现华安创新证券投资基金的投资运作中存在违规行为。

(2) 建立电脑应用系统权限管理

随着业务发展, 特别是开放式基金的推出, 公司新增了基金注册与过户登记等应用系统。为加强对信息的控管, 在华安创新开放式基金发行前, 我们确定了员工权限开通、变更和取消的程序, 并在信息技术部及相关业务部门的配合下, 我们对基金交易、基金核算、基金注册与过户登记、客户关系管理等各应用系统的明细权限进行了集中整理, 确定了每位员工在系统中的明细权限。

(3) 加强法律工作力量

随着开放式基金的推出, 基金公司将每天与基金投资者发生业务往来, 使基金管理公司可能面临的民事法律纠纷的可能性也相应增加。为此, 我们聘请了知名律师事务所担任公司的常年法律顾问, 有效地防范了法律风险。此外, 我们还充实了内部的法律专业人员, 相信今后能更好地理解有关法律法规及监管政策, 进一步加强公司管理与基金合规性运作。

(4) 加强风险的事前防范工作

通过参与开放式基金的筹备过程, 我们意识到及早介入公司业务, 有利于了解业务全貌, 发现掌握风险点, 尽早制订风险防范方法。制定公司应急计划, 开展应急计划演习是风险事前防范的另一表现形式。去年, 以监察稽核部牵头, 公司各业务部门分别制订了本部门应急计划。我们还分部门进行了应急演习。2002 年, 我们将进一步加强对应急计划的修订和演习。

四. 托管人报告

2001 年度, 华安创新证券投资基金 (以下简称 “华安创新基金”) 的托管人——交通银行, 严格遵守《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》等有关规定, 依据《华安创新证券投资基金基金契约》和《华安创新证券投资基金托管协议》中的条款, 认真履行基金托管人的各项职责, 安全保管华安创新基金的所有资产, 做好华安创新基金的投资监管和清算核算工作, 切实维护广大基金持有人的合法权益, 未发生任何损害基金持有人利益的事件和行为。

2001 年度, 基金管理人遵守了《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》、基金契约和其它有关法规的规定, 基金托管人未发现基金管理人在投资运作中有损害基金持有人利益的行为。基金托管人确认, 由基金管理人在 2001 年度编制和披露的华安创新基金每日资产净值、每周资产净值公告、每季度投资组合公告、年度财务报告等有关基金信息是合法、真实和完整的。

五. 基金年度财务报告

(一) 审计报告

审 计 报 告

普华永道审字(2002)第 168 号

华安创新证券投资基金全体持有人：

我们接受委托，审计了华安创新证券投资基金（以下简称“华安创新基金”）2001 年 12 月 31 日的资产负债表、2001 年 9 月 21 日（基金成立日）至 2001 年 12 月 31 日止期间的经营业绩表和基金净值变动表。这些会计报表由华安创新基金管理人华安基金管理有限公司负责，我们的责任是对这些会计报表发表审计意见。我们的审计是根据《中国注册会计师独立审计准则》的规定进行的。在审计过程中，我们结合华安创新基金的实际情况，实施了包括抽查会计记录等我们认为必要的审计程序。

我们认为，上述载于第 2 页至第 12 页的华安创新基金会计报表符合中华人民共和国《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算办法》、《华安创新证券投资基金基金契约》和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的实务操作规定，在所有重大方面公允地反映了华安创新基金 2001 年 12 月 31 日的财务状况及 2001 年 9 月 21 日（基金成立日）至 2001 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师 周忠惠
注册会计师 王 笑

2002 年 3 月 8 日

(二) 基金会计报告书

1. 资产负债报告书

		单位：人民币元
资 产	附注	2001年12月31日
银行存款		52,534,905.35
清算备付金		2,102,198,885.97
交易保证金		250,000.00
应收利息	3(2)	10,872,224.44
应收申购款		3,476,550.60
股票投资市值	1(3)	858,152,978.80

其中：股票投资成本		831,925,420.88
债券投资市值	1(4)	2,083,747,773.60
其中：债券投资成本		2,081,814,081.25
待摊费用	3(3)	1,398,889.02
资产合计		5,112,632,207.78

负债与基金持有人权益

负债：

应付证券清算款		21,250,997.92
应付赎回款		17,877,289.89
应付赎回费		38,819.08
应付管理人报酬		6,416,666.72
应付托管费		1,069,444.45
应付佣金		615,971.21
其他应付款		500,000.00
预提费用		150,000.00
负债合计		47,919,189.27

基金持有人权益：

实收基金	1(9) 3(4)	5,002,284,701.00
未实现利得	3(6)	27,982,340.04
未分配收益	1(11)	34,445,977.47
持有人权益合计		5,064,713,018.51

(基金单位净值：人民币1.012元)

负债及基金持有人权益合计 **5,112,632,207.78**

2. 基金经营业绩及收益分配报告书

单位：人民币元

2001年9月21日-2001年12月31日

收入：

股票差价收入	1(3)	13,190,458.37
债券差价收入	1(4)	11,429,175.24
债券利息收入	1(5)	13,034,197.26
存款利息收入	1(5)	15,060,991.19
买入返售证券收入	1(5)	898,606.25
其他收入	3(5)	6,914,997.52
收入合计		60,528,425.83

费用：

基金管理人报酬	1(6)	20,834,058.04
基金托管费	1(7)	3,472,342.96
卖出回购证券支出	1(8)	808,412.50
其他费用		966,789.98
其中：信息披露费		265,000.00
审计费用		150,000.00
费用合计		26,081,603.48

基金净收益 **34,446,822.35**

加：未实现估值增值变动数	1(3)(4)	28,161,250.27
基金经营业绩		62,608,072.62
本期基金净收益		34,446,822.35
本期申购基金单位的损益平准金	1(10)	260,453.40
本期赎回基金单位的损益平准金	1(10)	(261,298.28)
可供分配基金净收益		34,445,977.47
减：本期已分配基金净收益	1(11)	0.00
期末未分配净收益		34,445,977.47

3. 基金净值变动报告书

单位：人民币元

2001年9月21日-2001年12月31日

期初基金净值	5,000,001,124.00
本期经营活动	
基金净收益	34,446,822.35
未实现估值增值变动数	28,161,250.27
经营活动产生的基金净值变动数	62,608,072.62
本期基金单位交易	
基金申购款	40,922,669.77
基金赎回款	(38,818,847.88)
基金单位交易产生的基金净值变动数	2,103,821.89
本期向持有人分配收益	0.00
期末基金净值	5,064,713,018.51

(三) 会计报告书附注

1. 主要会计政策

(1) 会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本会计期间为 2001 年 9 月 21 日 (基金成立日)至 2001 年 12 月 31 日止。

(2) 记帐原则和计价基础

本基金的会计核算以权责发生制为记帐原则，除股票投资和债券投资按市值计价外，其余均以历史成本为计价基础。

(3) 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帐。

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逐日结转。

股票包括上市交易股票和未上市交易股票。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；由于配股和增发形成的未上市股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

（4）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；买入银行同业间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帐，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。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入；卖出银行同业间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逐日结转。

上市流通债券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。未上市流通债券按成本估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

（5）收入确认

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 证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日、银行同业间市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时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确认。

③ 债券利息收入于债券实际持有期内按债券票面价值与票面利率逐日计提。

④ 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提。

⑤ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认。

⑥ 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。

（6）基金管理人报酬

基金管理人报酬为按《华安创新证券投资基金基金契约》的规定计提的基金管理人的管理费。基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率逐日计提，按月支付。

（7）基金托管费

基金托管费为按《华安创新证券投资基金基金契约》的规定计提的基金托管人的托管费。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率逐日计提，按月支付。

（8）卖出回购证券支出

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

（9）实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额。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。

（10）损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金单位时，申购或赎回款项中包含的按基金未分配净收益占基金净值比例计算的一部分金额。损益平准金于基金申购确认日及基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配收益。

（11）基金的收益分配原则

- ① 每一基金单位享有同等分配权。
- ② 本基金收益以现金形式分配，但投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金单位净值自动转为基金单位进行再投资。
- ③ 红利分配时所发生的银行转帐或其他手续费应由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册与过户登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的基金单位净值自动转为基金单位，不足一份基金单位的，四舍五入。
- ④ 基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益不分配。
- ⑤ 基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金当年亏损，则不进行收益分配。
- ⑥ 基金收益分配后，每基金单位净值不能低于面值。

本期间，由于本基金运作时间较短，暂不分配。可分配净收益结转 2002 年度分配。

(12) 主要税项

根据财税字[1998]55 号文及[2001]年 61 号文《财政部、国家税务总局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，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
 - ② 基金买卖股票、债券的差价收入，在 2003 年 12 月 31 日前暂免征收营业税。
 - ③ 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。
 - ④ 基金买卖股票按成交额的 0.4% 缴纳证券（股票）交易印花税。
- 自 2001 年 11 月 16 日起，证券（股票）交易印花税税率下调为 0.2%。

2. 关联交易

(1) 关联人、关系、交易性质及法律依据列示

关 联 人	关 系	交易性质	法律依据
华安基金管理有限公司	基金管理人 基金发起人 基金注册与过户登记人 基金销售机构	提取管理费	基金契约
交通银行	基金托管人 基金代销机构	提取托管费	基金契约
申银万国证券股份有限公司	基金管理人的股东	租用交易席位	席位使用协议
东方证券有限责任公司	基金管理人的股东	租用交易席位	席位使用协议

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

关联人	2001 年 9 月 21 日（基金成立日） 至 2001 年 12 月 31 日止期间						
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		佣金		
	本期成交量	占本期成交总量的比例	本期成交量	占本期成交总量的比例	佣金	占本期佣金总量的比例	平均佣金比率
申银万国证券股份有限公司	139,489,467.44	16.45%	-	-	109,153.69	17.72%	0.08%

东方证券 有限责任公司	226,198,183.37	26.68%	222,885,746.70	6.70%	181,325.20	29.44%	0.08%
合计	365,687,650.81	43.13%	222,885,746.70	6.7%	290,478.89	47.16%	0.08%

(3) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额

① 基金管理人的报酬

支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理费 20,834,058.04 元。

② 基金托管费

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 3,472,342.96 元。

③ 银行存款余额

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管。2001 年 12 月 31 日本基金在交通银行的银行存款余额为 52,534,905.35 元。

本期内本基金存在交通银行的银行存款产生的利息收入为 9,554,410.83 元。

3. 主要报表项目说明

(1) 本基金募集设立发生发行费用共计 1,948,134.00 元，明细如下：

发行信息披露费	1,648,134.00
律师费	200,000.00
会计师费	100,000.00
合计	1,948,134.00

本基金设立募集期认购资金所产生的利息收入共计 446,415.84 元。

(2) 应收利息

应收债券利息	9,977,173.53
应收清算备付金利息收入	829,462.46
应收银行存款利息收入	65,588.45
合计	10,872,224.44

(3) 待摊费用

根据《华安创新证券投资基金发行公告》的约定，本基金设立募集所发生的法定信息披露费、律师费及会计师费等费用由成立后的基金承担，并在一年内摊销。

本基金设立募集期发生的该类费用共计 1,948,134.00 元，列入待摊费用并从本基金成立日起，按 12 个月逐日摊销，截止于年末的摊销后余额为 1,398,889.02 元。

(4) 实收基金

	基金单位数	实收基金
本期认购	5,000,001,124	5,000,001,124.00
本期申购	40,800,362	40,800,362.00

	5,040,801,486	5,040,801,486.00
减：本期赎回	38,516,785	38,516,785.00
期末数	5,002,284,701	5,002,284,701.00

(5) 其他收入

其他收入主要包括本基金设立募集期认购资金所产生的利息收入、按基金赎回款 0.4%计算的赎回基金补偿收入和因新股申购及国债认购而产生手续费返还款项。

国债认购手续费返还	6,270,000.00
基金设立募集期认购资金所产生的利息收入	446,415.84
赎回基金补偿收入	155,275.44
新股申购手续费返还	43,306.24
合计	6,914,997.52

(6) 未实现利得

未实现估值增值变动数	28,161,250.27
本期申购基金单位的未实现利得平准金	(138,145.63)
本期赎回基金单位的未实现利得平准金	(40,764.60)
期末未实现利得	27,982,340.04

(四) 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

1. 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转让。

本基金截至 2001 年 12 月 31 日止流通受限制的股票情况如下：

股票名称	申购确认日期	上市日期	可流通日期	申购价格	年末估价	申购股数	成本	市值
华能国际	2001/11/20	2001/12/6	2002/03/06	7.95	12.57	237,370	1,887,091.50	2,983,740.90
深高速	2001/12/11	2001/12/25	2002/03/25	3.66	7.05	8,592,364	31,448,052.24	60,576,166.20
三佳模具	2001/12/24	2002/01/08	2002/01/08	6.80	6.80	197,000	1,339,600.00	1,339,600.00
江西铜业	2001/12/26	2002/01/11	2002/01/11	2.27	2.27	1,389,000	3,153,030.00	3,153,030.00
宝光股份	2001/12/27	2002/01/16	2002/01/16	2.76	2.76	600,000	1,656,000.00	1,656,000.00
合计							39,483,773.74	69,708,537.10

2. 本基金认购国债，从国债认购日至国债上市日期间，暂无法流通。

国债名称	发行日期	上市日期	可流通日期	认购价格	年末估价	认购数量	成本	市值
21国债(15)	2001/12/18	2002/01/04	2002/01/04	100.00	100.00	7,000,000	700,000,000	700,000,000

(五) 基金投资组合

1. 按行业分类的投资组合

序号	分 类	市 值 (元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	4,023,000.00	0.08%
B	采掘业	67,684,957.41	1.34%
C	制造业	358,451,563.53	7.08%
C0	其中：食品、饮料	56,635,872.64	1.12%
C1	纺织、服装、皮毛	38,147,361.78	0.75%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	118,874,392.12	2.35%
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	17,038,685.00	0.34%
C7	机械、设备、仪表	63,539,174.80	1.25%
C8	医药、生物制品	64,216,077.19	1.27%
C99	其他	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	204,278,898.44	4.03%
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	158,864,753.44	3.14%
G	信息技术业	40,530,457.86	0.80%
H	批发和零售贸易	1,707,839.00	0.03%
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	22,611,509.12	0.45%
合 计		858,152,978.80	16.94%

2. 债券（不包括国债）合计

截止 2001 年 12 月 31 日，基金未持有债券（不包括国债）。

3. 国债、货币资金合计

截止 2001 年 12 月 31 日，基金持有的国债及货币资金合计为 4,227,207,740.53 元，占基金资产净值的 83.46%。

4. 基金投资股票明细

序号	股票名称	股数（股）	市值（元）	占基金净值比例
1	深能源 A	11,943,891	113,108,647.77	2.23%
2	烟台万华	3,194,824	77,570,326.72	1.53%
3	华能国际	5,912,170	74,315,976.90	1.47%
4	盐田港 A	4,985,088	73,380,495.36	1.45%
5	深 高 速	8,592,364	60,576,166.20	1.20%
6	上菱电器	4,759,715	60,543,574.80	1.20%
7	云 天 化	3,965,429	40,843,918.70	0.81%
8	中兴通讯	1,727,641	40,530,457.86	0.80%
9	鲁 泰 A	2,363,394	32,780,274.78	0.65%

10	燕京啤酒	2,811,325	29,687,592.00	0.59%
11	中国石化	7,985,800	27,551,010.00	0.54%
12	上海机场	2,972,326	24,908,091.88	0.49%
13	兖州煤业	2,348,639	24,684,195.89	0.49%
14	同 仁 堂	1,158,416	22,647,032.80	0.45%
15	亚泰集团	3,158,032	22,611,509.12	0.45%
16	恒瑞医药	1,305,849	22,134,140.55	0.44%
17	东阿阿胶	1,710,819	19,434,903.84	0.38%
18	草原兴发	1,974,972	18,051,244.08	0.36%
19	广州控股	1,100,867	16,854,273.77	0.33%
20	上海能源	1,146,124	15,449,751.52	0.31%
21	新 钢 钒	1,983,665	13,885,655.00	0.27%
22	双汇发展	644,934	8,796,899.76	0.17%
23	茉 织 华	318,900	5,367,087.00	0.11%
24	香梨股份	300,000	4,023,000.00	0.08%
25	江西铜业	1,389,000	3,153,030.00	0.06%
26	农 产 品	129,775	1,707,839.00	0.03%
27	宝光股份	600,000	1,656,000.00	0.03%
28	三佳模具	197,000	1,339,600.00	0.03%
29	盐湖钾肥	31,070	460,146.70	0.01%
30	伊利股份	5,032	100,136.80	0.00%
合计			858,152,978.80	16.94%

5. 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			卖出
		一级市场申购	二级市场买入	其他	
1	深能源 A		13,171,679		1,227,788
2	烟台万华		3,194,824		
3	华能国际	237,370	5,674,800		
4	盐田港 A		4,985,088		
5	深 高 速	8,592,364			
6	上菱电器		4,759,715		
7	云 天 化		3,965,429		
8	中兴通讯		1,727,641		
9	鲁 泰 A		2,363,394		
10	燕京啤酒		2,811,325		
11	中国石化		7,985,800		
12	上海机场		2,972,326		
13	兖州煤业		2,678,777		330,138
14	同 仁 堂		1,158,416		
15	亚泰集团		3,158,032		
16	恒瑞医药		1,305,849		
17	东阿阿胶		1,710,819		
18	草原兴发		1,974,972		
19	广州控股		1,100,867		
20	上海能源		1,146,124		
21	新 钢 钒		1,983,665		
22	双汇发展		644,934		
23	茉 织 华		668,900		350,000

24	香梨股份	642,000			342,000
25	江西铜业	1,389,000			
26	农 产 品		129,775		
27	宝光股份	600,000			
28	三佳模具	197,000			
29	盐湖钾肥		31,070		
30	伊利股份		5,032		

注：其它项包括送股、配股、转增、增发、债转股。

6. 本期剔除股票

序号	股票名称	期初结余	本期增加	本期卖出
1	成发科技		480,000	480,000
2	山鹰纸业		329,000	329,000

7. 报告附注

(1) 报告项目的计价方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日的收盘价计算，已发行未上市股票采用成本价计算。

(2) 本基金不存在购入成本已超过基金资产净值 10%的股票。

(3) 截止 2001 年 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 20,647,700.82 元，股票市值 858,152,978.80 元、国债及货币资金 4,227,207,740.53 元合计与其相抵减后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收申购款、应收利息、其他应收款、待摊费用、应付赎回款、应付赎回费、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、其他应付款以及预提费用。

六. 重要事项揭示

1. 本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。

2. 华安基金管理公司于 2001 年 8 月 16 日获中国证券监督管理委员会证监基金字[2001]33 号《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》，同意由华安基金管理有限公司发起设立华安创新证券投资基金。本基金于 2001 年 9 月 11 日起向社会公众公开发行。

3. 本基金首次募集基金单位 5,000,001,124 份，于 2001 年 9 月 21 日正式成立，并由普华永道中天会计师事务所有限公司分别于 2001 年 9 月 19 日出具了《华安创新证券投资基金个人投资者认购资金到位情况的审验报告》，2001 年 9 月 21 日出具了《华安创新证券投资基金机构投资者认购资金到位情况的审验报告》和《华安创新证券投资基金验资报告》对本基金首次发行募集净资本予以验证。

4. 本基金经过 3 个月的闭锁期，于 2001 年 12 月 21 日起开始办理日常申购赎回业务。同时，本基金规模自 2001 年 12 月 21 日起不再受 50 亿份基金单位的限制。个人投资者申购本基金不再受 30 万元上限的限制。与机构投资者一样，单一个人投资者累计持有份额不可以超过 5 亿份。

5. 本基金通过华安基金管理有限公司和交通银行有关网点进行交易，自 2002 年 2 月 4 日起也可以通过中国银行的有关网点进行交易。

6. 本期间，由于本基金运作时间较短，暂不分配。可分配净收益结转 2002 年度分配。

7. 本会计期间内各券商交易成交量及佣金情况如下：

① 股票交易情况：

券商名称	年成交量	占年成交 总量比例	年佣金	占年佣金 总量比例
国泰君安证券股份有限公司	115,020,947.65	13.57%	77,742.24	12.62%
海通证券有限公司	102,330,625.65	12.07%	72,610.00	11.79%
申银万国证券股份有限公司	139,489,467.44	16.45%	109,153.69	17.72%
广发证券有限责任公司	96,321,020.31	11.36%	52,029.16	8.45%
大鹏证券有限责任公司	168,496,701.15	19.87%	123,110.92	19.98%
东方证券有限责任公司	226,198,183.37	26.68%	181,325.20	29.44%
合 计	847,856,945.57	100%	615,971.21	100%

② 国债及回购交易情况：

券商名称	国债年成交量	占年成交 总量比例	回购年成交量	占年成交 总量比例
国泰君安证券股份有限公司	1,188,867,233.70	35.72%	274,900,000.00	8.58%
海通证券有限公司	146,494,062.60	4.40%	713,000,000.00	22.26%
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-
广发证券有限责任公司	1,689,691,766.80	50.76%	1,005,700,000.00	31.40%
大鹏证券有限责任公司	80,641,730.10	2.42%	1,209,300,000.00	37.76%
东方证券有限责任公司	222,885,746.70	6.70%	-	-
合 计	3,328,580,539.90	100%	3,202,900,000.00	100%

七. 备查文件目录

1. 中国证监会批准华安创新证券投资基金设立的文件。
2. 《华安创新证券投资基金基金契约》、《华安创新证券投资基金招募说明书》、《华安创新证券投资基金发行公告》、《华安创新证券投资基金成立公告》、《华安创新证券投资基金申购、赎回公告》。
3. 《华安创新证券投资基金托管协议》。
4. 华安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
5. 华安创新证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注。
6. 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、投资组合公告及其他临时公告。

华安基金管理有限公司

2002 年 3 月 29 日