

安信证券投资基金

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

本基金的托管人中国工商银行已于 2002 年 3 月 27 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: 安信证券投资基金
(简称: 基金安信)

交易代码: 500003
基金发起人: 上海国际信托投资公司
天同证券有限责任公司
(原山东证券有限责任公司)
华安基金管理有限公司
基金发行日期: 1998 年 6 月 16 日
基金成立日期: 1998 年 6 月 22 日
基金单位总份额: 20 亿份基金单位
基金类型: 契约型封闭式
基金存续期: 15 年
基金上市地点: 上海证券交易所
基金上市日期: 1998 年 6 月 26 日

(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)

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
国际互联网网址: <http://www.huaan.com.cn>

(三) 基金托管人: 中国工商银行
注册及办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号
(邮编: 100032)
法定代表人: 姜建清

托管部负责人：周月秋
 信息披露负责人：刘长江
 电 话：010-66106878
 传 真：010-66106904

(四) 会计师事务所：大华会计师事务所有限公司
 注册及办公地址：上海市昆山路 146 号
 法定代表人：汤云为
 经办注册会计师：吕秋萍、曹培青

二. 主要财务指标

(单位：人民币元)

项目	2001 年度	2000 年度	1999 年度
基金本期净收益	474,248,526.87	1,156,451,241.41	642,376,261.69
单位基金本期净收益	0.2371	0.5782	0.3212
基金可分配净收益	483,123,150.63	1,158,874,623.76	642,423,382.35
单位基金可分配净收益	0.2416	0.5794	0.3212
期末基金资产总值	2,766,368,520.67	4,559,416,572.04	3,206,840,495.63
期末基金资产净值	2,502,254,030.88	3,931,847,083.78	3,127,246,935.40
期末单位基金资产净值	1.2511	1.9659	1.5636
基金资产净值收益率	17.05%	46.50%	30.15%
	新指标	新指标 旧指标	新指标 旧指标
本期基金资产净值增长率	-10.00%	48.52% 58.08%	46.74% 46.79%
累计资产净值增长率	117.17%	141.30% 132.79%	62.47% 60.56%

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

计算公式有变动的指标：

1、本期基金资产净值增长率：

新指标 = (分红前单位净值 / 期初单位净值) * (期末单位净值 / 分红后单位净值) - 1

旧指标 = (期末单位基金资产净值 - 调整后期初单位基金资产净值) / 调整后期初单位基金资产净值

2、累计资产净值增长率：

新指标 = (第 1 年度净值增长率+1) * (第 2 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

旧指标 = (期末基金单位净值+累计分红) / 基金单位面值

三. 基金管理人报告

本基金业绩表现

截止 2001 年 12 月 31 日，本基金单位资产净值为 1.2511 元，基金净值增长率

为-10.00%，表现优于两市指数（上证综指下跌 20.62%，深综指下跌 25.13%）。本年度基金安信实现收益为每基金单位 0.2371 元，每基金单位分红 0.23 元。

年度	年末单位资产净值（元）	本期净值增长率	每基金单位分红（元）	同期上证综指涨跌	同期深综指涨跌
1998.6.22-12.31	1.1072	10.72%	0.042	-18.05%	-19.65%
1999	1.5636	46.74%	0.320	19.18%	16.96%
2000	1.9659	48.52%	0.575	51.73%	58.07%
2001	1.2511	-10.00%	0.230	-20.62%	-25.13%
累计		<u>117.17%</u>	<u>1.167</u>	<u>17.63%</u>	<u>11.22%</u>

基金经理简介

王国卫先生，基金经理，硕士学位。8 年证券从业经验，曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作。现任华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部总监，基金安信和基金安久的基金经理。

李玲女士，基金经理，经济学学士，在读研究生。4 年证券从业经历，曾在金华信托投资股份有限公司投资管理部、证大投资管理有限公司投资部工作。2000 年进入华安基金管理有限公司投资部任交易员。现任基金安信和基金安久的基金经理。

（一）基金经理工作报告

2001 年是新世纪的第一年，中国股市进入了前所未有的规范调整阶段，是名副其实的监管年。虽然大调整的直接动因是国有股减持、清理违规资金、上市公司信任危机等综合因素的共同作用，但我们认为更深层次的原因在于，面对入世后国际资本的冲击以及环境的转变，中国资本市场需要先行进行结构性变革。

应该承认，十年来证券市场取得了长足的进展，在促进国有企业改革、推动经济结构调整、优化社会资源配置等方面都发挥了重要作用，证券市场的成绩是举世公认的。但是另一方面，我们也无须回避一些客观存在的问题：制度缺陷、公司治理不健全、缺少诚信、逃避监管等等。非常不幸的是，这些问题在牛市环境中肆意孳生，特别是在资金推动型行情中，个股的投机性达到极致，证券市场的价格发现功能和真实性被严重扭曲。

问题的集中暴露给 2001 年整个市场造成重大的心理打击，并迫使管理层密集出台了若干政策措施加以规范监管。在多种因素综合作用下，全年两市综指下跌了 22.88%，给我们的操作带来了相当大的难度和考验，并着实上了一堂生动的风险教育课。但我们始终相信，从长期看，证券市场是理性的，短期的扭曲会通过时间来纠正，股票价格必然要围绕它的价值波动。因此，虽然我们遭受了挫折，但我们仍然坚持价值投资、长期投资的理念。

回顾 2001 年，市场存在的大机会相当有限。而作为基金经理，我们一直在尽力领先市场捕捉可能的获利机会。由于去年是市场由强转弱的一年，我们在操作策略上做了相应的调整：

1、果断清除投资组合中的问题股，降低个股对组合的负面影响。问题股的出现，表明我们在上市公司基本分析方面还存在很多不足，今后将加强对上市公司非经济因素的分析和把握。

2、不断调整投资组合，防止组合资产老化。上半年增加了纺织服装、港口运输等行业的投资，这些行业将因我国加入 WTO 而长期受益，下半年在总体减仓的同时增加了电力、煤炭等能源类股票的投资，这类股票既有防御性功能，也会因业绩稳定、优良而受到机构投资者的重点关注。

3、高度重视对新发和增发股票的研究和投资。把握机会，适时参与认购增发是大资金低成本建仓的一个重要途径。

展望 2002 年，加入 WTO 的中国证券市场仍将处于更深层次的变革中。市场监管者、市场参与者、投资策略等诸多方面将进行更深层次的理念更新，可以判断，新的一年也将是一个寻找与国际接轨的全新投资理念的探索年。我们在充满信心的同时也保持了一分谨慎，今年证券市场仍可能以调整为主基调。调整表现在三个方面：第一，投资者心理调整。经历了 2001 年的大洗礼之后，信心的恢复和诚信的建立都需要时间。第二，上市公司的调整。从外部环境看，入世的影响持续而深远。2001 年是中国加入 WTO 的第一年，很多企业将感觉到，评论和亲身参与的体会是不同的。如同证券市场上投资理念碰撞一样，企业的经营理念也将受到碰撞，对这种影响认识的差异将反映企业把握机会和因变应变的能力。从内部环境看，经过 2001 年的风波，上市公司必须在公司治理、信息披露、规范运作等方面调整提高，税制改革的不确定性使部分上市公司短期经营受到影响。第三，监管取向的调整。在稳定是发展的基础的前提下，监管将成为市场快速发展的手段，对待矛盾和问题的态度及解决方式都可能新的变化，稳定、规范、发展三者的协调将成为监管的目标。

基于以上判断，2002 年基金安信总的操作原则是：把握市场时机，控制建仓成本，做好结构调整，积极增加主动操作。

（二） 内部监察报告

一、 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、《安信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。

二、 内部监察工作报告

2001 年度中，伴随着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、对基金安信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《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，未发现基金安信的投资运作中存在重大违规行为。

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交往，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。2001 年，由监察稽核部牵头，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

本托管人——中国工商银行，依据《安信证券投资基金基金契约》与《安信证券投资基金托管协议》，托管安信证券投资基金。

2001 年度，在对安信证券投资基金的托管过程中，本托管人严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对安信证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，没有发生任何损害基金持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为托管人所应尽的义务。

本托管人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对安信证券投资基金的投资组合进行了监督，认为华安基金管理有限公司在安信证券投资基金的投资运作、基金资产净值及单位基金资产净值的计算上，遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，没有发现任何损害基金持有人利益的行为。

本托管人依法对安信证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2001 年度所编制和披露的安信证券投资基金资产净值公告、基金投资组合公告、基金年度报告等公告信息进行了核查，认为安信证券投资基金管理人——华安基金管

理有限公司在 2001 年度内所编制和披露的基金信息是合法、真实和完整的。

中国工商银行基金托管部
2002 年 3 月 25 日

五. 基金年度财务报告

(一) 审计报告

审 计 报 告

华业字（2002）第 576 号

安信证券投资基金全体基金持有人：

我们接受委托，审计了贵基金 2001 年 12 月 31 日的资产负债表及 2001 年度收益及收益分配表。这些会计报表由贵基金的管理人负责，我们的责任是对这些会计报表发表审计意见。我们的审计是依据中国注册会计师独立审计准则进行的。在审计过程中，我们结合贵基金的实际情况，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，上述会计报表符合证券投资基金及其财务会计的相关法规、制度和《安信证券投资基金基金契约》的有关规定，在所有重大方面公允地反映了贵基金 2001 年 12 月 31 日的财务状况以及 2001 年度的经营成果，会计处理方法的选用遵循了一贯性原则。

大华会计师事务所有限公司

中国注册会计师：吕秋萍

中国注册会计师：曹培青

中国 上海 昆山路 146 号

2002 年 2 月 5 日

(二) 基金会计报告书

资产负债报告书

资产负债主要项目期初数、期末数如下：

项 目	说明	期末数	期初数
股票投资—成本：		1,211,205,977.99	2,058,603,497.54
股票投资—估值增值：		20,106,869.60	771,046,179.24
债券投资—成本：		849,490,838.95	860,058,564.52
债券投资—估值增值：		-975,989.35	1,926,280.78

买入返售证券:		-	-
银行存款和清算备付金:		678,187,607.05	344,861,410.91
应收股利:		-	-
应收利息:	1	1,685,978.00	5,222,053.93
应收账款:	2	5,417,238.43	517,386,784.24
其他应收款项:	3	1,250,000.00	311,800.88
基金资产总值:		2,766,368,520.67	4,559,416,572.04
应付管理费及业绩报酬:		3,200,985.29	9,196,266.39
应付基金托管费:		533,497.56	819,099.17
应付账款:	4	58,516,615.52	56,431,370.82
卖出回购证券:		200,000,000.00	560,000,000.00
应付佣金:		296,953.17	822,039.51
其他应付款项:	5	1,566,438.25	300,712.37
负债总额:		264,114,489.79	627,569,488.26
基金单位总额:		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配净收益:		483,123,150.63	1,158,874,623.76
未实现估值增值:		19,130,880.25	772,972,460.02
基金资产净值:		2,502,254,030.88	3,931,847,083.78
基金单位发行总份额:		2,000,000,000	2,000,000,000
每份基金单位资产净值:		1.2511	1.9659
调整后每份基金单位资产净值:		1.2511	1.3909

收益及收益分配报告书

收益及收益分配主要项目本期数、上期数如下:

项 目	说明	本期数	上期数
在除息日确认的股息收入:		13,796,451.05	6,515,906.32
债券利息收入:		20,456,909.78	12,076,964.58
股票买卖价差收入:		459,542,496.08	1,204,044,276.52
债券买卖价差收入:		34,242,081.79	885,961.13
其他收入:	6	11,793,033.11	14,487,974.02
管理费及业绩报酬:		43,974,965.35	60,621,590.82
其中: 基金管理费:		43,974,965.35	56,339,919.58
业绩报酬:		-	4,281,671.24
基金托管费:		7,329,160.98	9,389,986.70
应由基金承担的其他费用:	7	14,278,318.61	11,548,263.64
基金净收益:		474,248,526.87	1,156,451,241.41

上年末未分配净收益:	1,158,874,623.76	642,423,382.35
本期已分配收益:	1,150,000,000.00	640,000,000.00
期末未分配净收益:	<u>483,123,150.63</u>	<u>1,158,874,623.76</u>

(三) 会计报告书附注

1、主要会计政策

(1) 会计期间: 公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。

(2) 记账原则: 权责发生制。

(3) 记账本位币: 人民币。

(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 (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; 如果市价低于配股价, 按配股价估值。

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。

⑤如有新增事项, 按国家最新规定估值。

(5) 收入的确认政策:

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, 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和相关费用的差额入账; 卖出非上市债券, 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股息收入: 在被投资股票股权除息日确认, 并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

④债券利息收入: 已上市债券在被投资债券除息日确认, 按实际持有期间以票面价值与票面利率计算的金额确认利息收入; 未上市债券、在银行间债券市场交易的债券在持有期间内逐日计提, 按票面价值与票面利率计算的金额确认利息收入。

⑤买入返售证券收入: 在证券持有期内采用直线法逐日计提, 按计提的金额确认收入。

⑥利息收入: 按本金与适用的利率逐日计提确认, 计提对象为银行存款和清算备付金。

⑦其他收入: 在实际收到时确认。

(6) 证券的成本计价方法:

证券在取得时按实际成本计价，出售时按移动加权平均法计价。

(7) 税项:

依据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金有关税收问题的通知》的有关规定，对基金管理人运用基金资产买卖股票按 4‰ 的税率征收印花税，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，暂不征收企业所得税，在 2000 年底前暂免征收营业税。

依据财政部、国家税务总局的财税字[2001]61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》的有关规定，对“基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，在 2000 年底前暂免征收营业税”的优惠政策，予以延期 3 年，即延长到 2003 年 12 月 31 日止。

自 2001 年 11 月 16 日起证券交易印花税下调为 2‰。

(8) 基金的收益分配政策:

- ①基金收益分配比例不低于可供分配基金净收益的 90%。
- ②基金收益分配采取现金方式，每年分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成。
- ③基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配。
- ④基金投资当年亏损，则不进行收益分配。
- ⑤每一基金单位享有同等分配权。

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	提取管理费	基金契约
中国工商银行	基金托管人	提取托管费	基金契约
上海证券有限责任公司	与管理公司属同 一股东*	银行间回购交易 租用交易席位	回购交易合同 席位使用协议
天同证券有限责任公司	管理公司发起人 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
申银万国证券股份有限公司	管理公司发起人	租用交易席位	席位使用协议

*注：同一股东为上海国际信托投资公司，系基金发起人和基金管理公司发起人。

(2) 通过关联人席位交易情况:

①本基金通过关联人席位 2001 年的股票交易情况:

关 联 人	股票年成交量	占成交总 量比例	年佣金	占佣金总量 比例	平均佣 金比率
上海证券有限责任公司	498,783,192.19	13.75%	400,791.31	14.02%	0.08%

申银万国证券股份有限公司	948,618,761.34	26.16%	756,969.85	26.49%	0.08%
天同证券有限责任公司	178,601,325.75	4.92%	146,413.13	5.12%	0.08%
合计	<u>1,626,003,279.28</u>	<u>44.83%</u>	<u>1,304,174.29</u>	<u>45.63%</u>	

本基金通过关联人席位 2000 年的股票交易情况:

关 联 人	股票年成交量	占成交总量比例	年佣金	占佣金总量比例	平均佣金比率
上海证券有限责任公司	583,746,012.74	13.11%	476,919.41	13.01%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	635,493,871.55	14.27%	527,278.40	14.39%	0.08%
天同证券有限责任公司	378,889,241.13	8.51%	316,234.84	8.63%	0.08%
合计	<u>1,598,129,125.42</u>	<u>35.89%</u>	<u>1,320,432.65</u>	<u>36.03%</u>	

②本基金通过关联人席位 2001 年的债券及回购交易情况:

关 联 人	债券年成交量	占成交总量比例	回购年成交量	占成交总量比例
上海证券有限责任公司	224,846,925.10	4.13%	165,600,000.00	11.91%
申银万国证券股份有限公司	442,819,700.90	8.13%	209,000,000.00	15.03%
天同证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	<u>667,666,626.00</u>	<u>12.26%</u>	<u>374,600,000.00</u>	<u>26.94%</u>

本基金通过关联人席位 2000 年的债券及回购交易情况:

关 联 人	债券年成交量	占成交总量比例	回购年成交量	占成交总量比例
上海证券有限责任公司	1,150,500,146.40	35.61%	645,000,000.00	55.65%
申银万国证券股份有限公司	220,381,415.40	6.82%	180,000,000.00	15.53%
天同证券有限责任公司	282,091,149.90	8.73%	5,000,000.00	0.43%
合计	<u>1,652,972,711.70</u>	<u>51.16%</u>	<u>830,000,000.00</u>	<u>71.61%</u>

(3) 本基金与关联人 2001 年末进行银行间市场债券买卖交易。

(4) 本基金与关联人 2001 年进行的银行间市场债券回购交易情况:

关 联 人	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行	-	-	5,360,000,000.00	5,475,975.23

(5) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额:

①基金管理费

本基金应支付基金管理人管理费, 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:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日的基金资产净值

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, 由基金托管人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。

2001 年基金管理人收取的管理费金额为 43,974,965.35 元。2000 年基金管理人收取的管理费金额为 56,339,919.58 元。

②基金管理人业绩报酬

本基金在本会计年度按照《安信证券投资基金基金契约》规定的计提方法和比例以及中国证监会的有关规定, 可以计提管理人业绩报酬人民币 8,999,275.32 元。考虑到基金安信本年度基金净值为负增长, 为切实维护基金持有人的利益, 本管理人主动放弃提取该部分业绩报酬。

$$\text{业绩报酬} = \text{调整后年初基金资产净值} \times \text{Min}\{M, N\} \times 5\%$$

其中:

$$\text{调整后年初基金资产净值} = \text{本期期初基金资产净值} - \text{上期收益分配};$$

M = 基金可分配净收益率 - 1.2*同期银行一年定期储蓄存款利率 (如果年内银行利率发生变动, 则按时间段进行加权平均调整);

$$N = \text{基金资产净值增长率} - \text{证券市场平均收益率};$$

Min{M,N}为 M、N 中较小者;

$$\text{基金可分配收益率} = (\text{当期可分配净收益} - \text{该年度已卖出配售新股实现收益}) / \text{调整后年初基金资产净值};$$

$$\text{当期可分配净收益} = \text{当期净收益} + \text{以前年度未分配收益} - \text{未实现资本利得损失};$$

$$\text{基金资产净值增长率} = (\text{期末基金资产净值} - \text{调整后年初基金资产净值} - \text{该年度配售新股对基金净值的影响}) / \text{调整后年初基金资产净值};$$

$$\text{本年度已卖出配售新股实现收益} = (\text{基金可流通日上市均价} - \text{配售成本}) \times \text{已卖出配售新股数量}$$

$$\text{本年度配售新股对基金净值的影响} = (\text{基金可流通日上市均价} - \text{配售成本或年初估价}) \times \text{配售新股数量}$$

华安基金管理有限公司在计算 2000 年业绩报酬过程中, 考虑到政策性配售新股对基金净值和收益的贡献, 已主动将此部分所产生的影响扣除。2001 年本基金不再享受政策性配售新股的优惠。

$$\text{证券市场平均收益率} = [(\text{当年深综指涨跌幅} \times \text{深市平均总市值} + \text{当年沪综指涨跌幅} \times \text{沪市平均总市值}) / (\text{深市平均总市值} + \text{沪市平均总市值})] \times 80\% + \text{同}$$

期国债平均收益率*20%；

深市平均总市值=（年末深市总市值 + 年初深市总市值）/2

沪市平均总市值=（年末沪市总市值 + 年初沪市总市值）/2

2000 年度基金支付的用于奖励基金管理业绩的业绩报酬金额为 4,281,671.24 元。

③基金托管费

本基金应支付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的 2.5‰的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

2001 年托管人收取的基金托管费金额为 7,329,160.98 元。2000 年托管人收取的基金托管费金额为 9,389,986.70 元。

3、主要报表项目说明

（1） 应收利息 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 1,685,978.00 元。由以下两项组成：应收银行存款和交易备付金利息为 220,772.52 元；应收国债利息为 1,465,205.48 元。

（2） 应收账款 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 5,417,238.43 元，是应收上海交易清算资金 5,417,238.43 元。

（3） 其他应收款项 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 1,250,000.00 元，是应收深圳证券交易所交易保证金 1,250,000.00 元。

（4） 应付账款 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 58,516,615.52 元，是应付上海交易清算资金 58,516,615.52 元。

（5） 其他应付款项 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 1,566,438.25 元，由以下两项组成：应付券商席位保证金 1,250,000.00 元；卖出回购证券款所计提的应付回购利息 316,438.25 元。

（6） 其他收入 2001 年发生额为人民币 11,793,033.11 元，由以下三项组成：银行存款和交易备付金利息收入 10,202,734.42 元；回购利息收入 292,019.18 元；其他收入 1,298,279.51 元。

（7） 应由基金承担的其他费用 2001 年发生额为人民币 14,278,318.61 元，由以下七项组成：交易费用 34,597.50 元；回购利息支出 10,152,904.61 元；上市年费 60,000.00 元；会计师费 100,000.00 元；信息披露费 460,000.00 元；2000 年度红利发放手续费 3,450,000.00 元；其他费用 20,816.50 元。

（四） 本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的新股和承购的债券。在估值时如果该新股还未上市，则按成本计价；如已上市，则按当日平均价计价。2001 年 12 月 31 日估值时，已上市但流通受限的新股估值增值额为 5,385,168.65 元。

1、流通受限的新股

序号	股票名称	申购 确定日期	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
----	------	------------	------	----	----	----	-------

1	通海高科	00-07-06	待定	60,000	1,012,800.00	1,012,800.00	待定*
2	华能国际	01-11-20	01-12-06	116,795	928,520.25	1,473,952.90	上市日起 3 个月
3	深 高 速	01-12-11	01-12-25	1,406,900	5,149,254.00	9,988,990.00	上市日起 3 个月
4	三佳模具	01-12-24	02-01-08	47,000	319,600.00	319,600.00	上市日起流通
5	江西铜业	01-12-26	02-01-11	130,000	295,100.00	295,100.00	上市日起流通
6	宝光股份	01-12-27	02-01-16	125,000	345,000.00	345,000.00	上市日起流通
合 计					<u>8,050,274.25</u>	<u>13,435,442.90</u>	

*注：1) 具体流通日期由该股票的上市公司另行发布公告决定。

2) 上表只包括持有股票中流通受限部分，同一个股票已流通部分未包括在内。

2、流通受限的债券

序号	债券名称	发行日期	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
1	21 国债 15	01-12-18	02-01-04	1,000,000	100,000,000.00	100,000,000.00	上市日起流通

(五) 基金投资组合

1、按行业分类的投资组合

分 类	市值 (元)	占净值比例
农、林、牧、渔业	1,424,850.00	0.06%
采掘业	43,258,563.72	1.73%
制造业	736,560,833.12	29.44%
其中：食品、饮料	31,177,817.50	1.24%
纺织、服装、皮毛	311,437,323.80	12.45%
木材、家具	----	----
造纸、印刷	----	----
石油、化学、塑胶、塑料	146,374,283.60	5.85%
电子	----	----
金属、非金属	2,951,954.00	0.12%
机械、设备、仪表	46,727,442.00	1.87%
医药、生物制品	197,732,832.22	7.90%
其他	159,180.00	0.01%
电力、煤气及水的生产和供应业	91,579,250.49	3.66%
建筑业	----	----
交通运输、仓储业	203,769,653.69	8.14%
信息技术业	96,910,895.45	3.87%
批发和零售贸易	25,114,063.12	1.00%

金融、保险业	----	----
房地产业	12,032,844.00	0.48%
社会服务业	20,661,894.00	0.83%
传播与文化产业	----	----
综合类	----	----
合 计	<u>1,231,312,847.59</u>	<u>49.21%</u>

2. 债券（不包括国债）合计

截至 2001 年 12 月 31 日，基金持有的债券合计为 5,759,010.20 元，占基金资产净值的 0.23%。

3. 国债、货币资金合计

截至 2001 年 12 月 31 日，基金持有的国债及货币资金合计为 1,469,309,274.84 元，占基金资产净值的 58.72%。

4. 基金投资股票明细

序号	名 称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	海欣股份	13,494,907	226,849,386.67	9.07%
2	烟台万华	5,146,168	124,125,572.16	4.96%
3	同 仁 堂	5,277,242	104,964,343.38	4.19%
4	恒瑞医药	4,933,154	84,159,607.24	3.36%
5	茉 织 华	4,592,332	77,243,024.24	3.09%
6	上港集箱	3,977,332	74,932,934.88	2.99%
7	外运发展	2,800,828	65,343,317.24	2.61%
8	广电信息	3,861,100	56,217,616.00	2.25%
9	盐田港 A	3,384,807	50,061,295.53	2.00%
10	华能国际	3,112,904	39,284,848.48	1.57%
11	贵州茅台	804,554	31,176,467.50	1.25%
12	申能股份	2,300,000	30,038,000.00	1.20%
13	中联重科	1,706,900	24,715,912.00	0.99%
14	中化国际	1,601,312	22,146,144.96	0.89%
15	中兴通讯	939,191	21,854,974.57	0.87%
16	兖州煤业	2,012,818	21,215,101.72	0.85%
17	许继电气	1,850,000	20,350,000.00	0.81%
18	广州控股	1,228,309	18,498,333.54	0.74%
19	长江通信	572,799	17,825,504.88	0.71%
20	盐湖钾肥	1,184,448	17,600,897.28	0.70%
21	上海能源	1,200,700	16,245,471.00	0.65%
22	强生控股	1,091,560	12,170,894.00	0.49%
23	万 科 A	910,200	12,032,844.00	0.48%
24	深 高 速	1,406,900	9,988,990.00	0.40%
25	上海医药	680,544	8,608,881.60	0.34%
26	青旅控股	700,000	8,491,000.00	0.34%
27	鲁 泰 A	527,273	7,344,912.89	0.29%

28	中国石化	1,600,000	5,552,000.00	0.22%
29	云天化	452,122	4,647,814.16	0.19%
30	深能源 A	396,003	3,758,068.47	0.15%
31	招商局 A	299,923	3,443,116.04	0.14%
32	江苏舜天	149,964	2,840,318.16	0.11%
33	香梨股份	105,000	1,424,850.00	0.06%
34	狮头股份	128,000	1,423,360.00	0.06%
35	法尔胜	135,400	1,233,494.00	0.05%
36	通海高科	60,000	1,012,800.00	0.04%
37	贵航股份	99,000	996,930.00	0.04%
38	宝光股份	125,000	345,000.00	0.01%
39	三佳模具	47,000	319,600.00	0.01%
40	江西铜业	130,000	295,100.00	0.01%
41	神火股份	16,700	245,991.00	0.01%
42	金瑞科技	7,000	159,180.00	0.01%
43	厦门建发	10,000	127,600.00	0.01%
44	双汇发展	100	1,350.00	0.00%
合计			<u>1,231,312,847.59</u>	<u>49.21%</u>

5. 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市场平均价计算, 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 204,127,101.75 元, 债券市值 5,759,010.20 元, 股票市值 1,231,312,847.59 元、国债及货币资金 1,469,309,274.84 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: 应收利息、其他应收款、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、应付回购利息、应付卖出回购债券款以及其他应付款。

(六) 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场申购	二级市场买入	其他	
1	万科 A	-	1,120,200	-	210,000
2	招商局 A	-	499,923	-	200,000
3	深能源 A	-	396,003	-	-
4	中兴通讯	-	1,077,271	480,327	618,407
5	盐田港 A	-	4,065,853	-	681,046
6	双汇发展	-	100	-	-
7	神火股份	-	16,700	-	-
8	华能国际	116,795	2,996,109	-	-
9	中国石化	3,001,500	-	-	1,401,500
10	同仁堂	-	5,204,328	1,016,867	943,953
11	云天化	-	452,122	-	-

12	广州控股	-	1,228,309	-	-
13	厦门建发	-	10,000	-	-
14	兖州煤业	-	2,012,818	-	-
15	外运发展	-	3,062,018	131,050	392,240
16	江苏舜天	-	150,000		36
17	江西铜业	130,000	-	-	-
18	宝光股份	125,000	-	-	-
19	香梨股份	105,000	-	-	-
20	上海能源	-	1,500,700	-	300,000
21	贵州茅台	118,000	702,959	-	16,405
22	三佳模具	47,000	-	-	-
23	贵航股份	99,000	-	-	-
24	狮头股份	128,000	-	-	-
25	深 高 速	1,406,900	-	-	-
26	茉 织 华	-	3,553,534	1,038,798	-
27	强生控股	-	1,197,091	99,709	205,240

新增股票附注：本表中“其他”项目包括“配转送增”。

（七） 本期剔除股票

序号	股票名称	期初结存	本期增加	本期卖出
1	中信海直	175,000	-	175,000
2	佛山照明	675,632	-	675,632
3	湖南投资	-	195,067	195,067
4	泰山石油	5,460,939	650,000	6,110,939
5	东方电子	26,690,760	756,404	27,447,164
6	京东方 A	361,912	-	361,912
7	环保股份	12,509,700	137,130	12,646,830
8	锌业股份	2,071,638	-	2,071,638
9	超声电子	500,050	-	500,050
10	五 粮 液	-	155,000	155,000
11	中原油气	3,611,344	1,144,268	4,755,612
12	兰光科技	186,600	-	186,600
13	首创股份	1,190,000	-	1,190,000
14	民生银行	904,000	-	904,000
15	宝钢股份	8,405,000	-	8,405,000
16	歌华有线	-	285,000	285,000
17	上海汽车	2,432,999	213,000	2,645,999
18	波导股份	558,347	-	558,347
19	福建南纸	-	304,010	304,010
20	雅 戈 尔	8,800,000	-	8,800,000
21	莲花味精	-	1,208,161	1,208,161
22	长城电工	2,409,130	-	2,409,130
23	大唐电信	6,674,208	-	6,674,208
24	万杰高科	1,225,900	-	1,225,900
25	沧州大化	10,000	-	10,000

26	首旅股份	300,000	-	300,000
27	北京城建	-	10,000	10,000
28	海正药业	-	10,000	10,000
29	赣粤高速	229,800	-	229,800
30	开开实业	-	314,200	314,200
31	鄂尔多斯	-	130,960	130,960
32	星新材料	1,425,750	-	1,425,750
33	荣华实业	-	94,000	94,000
34	上海家化	-	150,000	150,000
35	亚星化学	-	663,000	663,000
36	振华港机	1,175,212	-	1,175,212
37	国栋建设	-	163,000	163,000
38	天房发展	-	127,000	127,000
39	天通股份	201,000	-	201,000
40	广州药业	-	116,477	116,477
41	中发展	-	84,000	84,000
42	华微电子	-	91,100	91,100
43	北京华联	-	78,000	78,000
44	联创光电	-	158,000	158,000
45	红星发展	-	343,000	343,000
46	昌河股份	-	205,000	205,000
47	宁沪高速	183,000	-	183,000
48	天科股份	95,000	-	95,000
49	白唇鹿	-	40,000	40,000
50	金地集团	-	775,000	775,000
51	龙净环保	262,000	-	262,000
52	成发科技	-	89,000	89,000
53	盘江股份	-	123,000	123,000
54	金山股份	-	79,000	79,000
55	江汽股份	-	367,000	367,000
56	新疆天宏	-	34,000	34,000
57	昆明制药	114,000	-	114,000
58	华纺股份	-	275,000	275,000
59	特精股份	-	40,000	40,000
60	天药股份	-	72,000	72,000
61	康美药业	-	46,000	46,000
62	中铁二局	-	309,000	309,000
63	交大昂立	-	55,000	55,000
64	天威保变	-	92,000	92,000
65	洪城股份	-	128,000	128,000
66	山鹰纸业	-	194,000	194,000
67	潜江制药	-	71,000	71,000
68	广东榕泰	-	78,000	78,000
69	新安股份	-	136,000	136,000
70	青岛海尔	-	4,117,851	4,117,851

71	南京医药	-	140,000	140,000
72	龙电股份	2,315,789	1,389,473	3,705,262
73	新太科技	1,109,198	-	1,109,198
74	新亚股份	-	1,523,235	1,523,235
75	上菱电器	2,485,725	-	2,485,725
76	春兰股份	8,000	-	8,000
77	星湖科技	2,300,000	30,000	2,330,000

六. 基金持有人结构及前十名持有人

截止 2001 年 12 月 31 日, 本基金发起人持有的基金份额为 0.36 亿基金单位, 占基金发行总份额的 1.8%, 其中:

发 起 人	持有份额(单位)	占总份额比例
上海国际信托投资公司	18,000,000	0.90%
其中: 未上市流通份额	18,000,000	0.90%
华安基金管理有限公司	12,000,000	0.60%
其中: 未上市流通份额	6,000,000	0.30%
天同证券有限责任公司	6,000,000	0.30%
其中: 未上市流通份额	6,000,000	0.30%

社会公众持有的基金份额为 19.64 亿基金单位, 占基金发行总份额的 98.2%。

本基金前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例如下:

序 号	名 称	持有份额(单位)	占总份额比例
1	中国人寿	131,972,100	6.60%
2	平安保险	45,685,800	2.28%
3	上海久事	40,740,800	2.04%
4	中国再保	29,885,600	1.49%
5	久事公司	19,231,300	0.96%
6	投资信托	18,000,000	0.90%
7	中保人寿	17,137,100	0.86%
8	中再保险	15,424,900	0.77%
9	再 保 险	15,366,000	0.77%
10	斯特咨询	13,700,000	0.69%

七. 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. 2001 年 9 月 20 日本基金管理人发布《关于调整基金经理的公告》：因工作需要，经董事会同意，从 2001 年 9 月 20 日起对本基金基金经理做如下调整：聘任李玲女士担任本基金基金经理，林彤彤先生不再担任本基金基金经理，王国卫先生继续担任本基金基金经理。

3. 2001 年各券商股票、债券及回购交易情况和佣金情况如下：

① 股票交易情况与佣金情况：

券 商	成交量	占成交总量 比例	佣金	占佣金总量 比例
申银万国证券股份有限公司	948,618,761.34	26.16%	756,969.85	26.49%
国通证券有限责任公司	630,617,641.69	17.39%	503,415.99	17.62%
上海证券有限责任公司	498,783,192.19	13.75%	400,791.31	14.02%
国信证券有限责任公司	461,110,597.35	12.72%	369,051.14	12.91%
大鹏证券有限责任公司	394,393,443.46	10.88%	270,950.26	9.48%
南方证券股份有限公司	267,331,741.06	7.37%	210,244.43	7.36%
光大证券有限责任公司	247,002,916.93	6.81%	199,988.05	7.00%
天同证券有限责任公司	178,601,325.75	4.92%	146,413.13	5.12%
合 计	<u>3,626,459,619.77</u>	<u>100.00%</u>	<u>2,857,824.16</u>	<u>100.00%</u>

② 债券及回购交易情况：

券 商	债券成交量	占成交总量 比例	回购成交量	占成交总量 比例
大鹏证券有限责任公司	4,130,939,900.60	75.84%	869,100,000.00	62.51%
申银万国证券股份有限公司	442,819,700.90	8.13%	209,000,000.00	15.03%
国通证券有限责任公司	369,048,123.50	6.78%	146,700,000.00	10.55%
上海证券有限责任公司	224,846,925.10	4.13%	165,600,000.00	11.91%
光大证券有限责任公司	156,675,052.20	2.88%	0.00	0.00%
国信证券有限责任公司	122,239,392.20	2.24%	0.00	0.00%
南方证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
天同证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合 计	<u>5,446,569,094.50</u>	<u>100.00%</u>	<u>1,390,400,000.00</u>	<u>100.00%</u>

八. 备查文件目录

1. 中国证监会批准安信证券投资基金设立的文件。
2. 《安信证券投资基金基金契约》。
3. 《安信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. 安信证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注。
6. 安信证券投资基金 2001 年度收益分配公告。
7. 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