

安信证券投资基金

二零零一年度中期报告

华安基金管理有限公司

二零零一年八月三十日

重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2001 年 8 月 29 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
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)

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

(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：赵 跃
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、吴蓉

二. 主要财务指标

项目	2001 年 1-6 月
基金本期净收益	361,030,770.04 元
单位基金本期净收益	0.1805 元
基金可分配净收益	369,905,393.80 元
单位基金可分配净收益	0.1850 元
期末基金资产总值	2,926,455,034.28 元
期末基金资产净值	2,869,570,045.62 元
期末单位基金资产净值	1.4348 元
基金资产净值收益率	12.98%
本期基金资产净值增长率	3.21%
累计资产净值增长率	149.05%

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

本期基金资产净值增长率=(分红前单位净值/调整前期初单位净值)*(期末单位净值/分红后单位净值)-1

累计资产净值增长率=(1998 年度净值增长率+1)*(1999 年度净值增长率+1)*(2000 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

本基金业绩表现

截止到 2001 年 6 月 30 日, 本基金单位资产净值为 1.4348 元, 比 2000 年底单位净值增长了 3.21%。上半年安信实现可分配收益达 36,103 万元。

基金经理简介

王国卫先生, 基金经理, 总经理助理, 基金投资部总监, 硕士学历。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;

林彤彤先生, 基金经理, 工商管理硕士 (MBA), 10 年银行、证券从业经历, 曾就职于中国银行漳州分行信贷管理处, 担任基金经理前为华安基金管理有限公司研究发展部研究员。

（一）基金经理工作报告

上半年回顾

在经历了罕见的 2000 年大牛市之后，受多种因素的综合影响，2001 年上半年的行情一波三折，但 6 月份上证综指再度创下历史最高点 2245 点。与此同时，沪深指数出现差异，沪强深弱的格局再次形成。随着 B 股对境内投资者开放，上半年 B 股对两市综合指数的拉动作用开始显现，综合指数很难再象以前一样真实反映 A 股的走势，B 股市场的扩容和超级大盘股的陆续上市，将加剧综合指数的失真度。因此，我们认为改革现行指数编制方法和推出全国统一指数及各类分类指数是必要和迫切的。

上半年我们对投资组合进行了较大的结构调整。增持的行业包括：医药和化工新材料，我们判断，行业中的个别企业经过前几年的技术积累和市场开拓，将进入加速发展阶段；因我国加入 WTO 而受益的行业，如以出口为主的服装加工业、港口运输业和服务业。减持的行业主要是行业周期发生变化、经营环境恶化的行业。安信基金已逐步完成又一次新陈代谢，新品种不仅对上半年的净值增长贡献较大，也使安信未来的增长潜力得到改善。这种调整仍将继续。我们以辨证的眼光看待上市公司增发新股，欢迎经营优良的公司通过增发募集资金以进一步提升竞争力，适时参与认购增发有利于低交易成本建仓。

应该承认，相比而言，上半年在对部分重仓品种的调整方面力度明显不够，这使得我们在操作中显得较为被动，影响了上半年的基金业绩表现，值得我们深思并吸取教训。对上市公司的基本面判断和个股的操作技巧都需要有很大的提高。

下半年展望

2001 年是管理层推进市场化较为激进的一年，市场监管力度加强，历史遗留问题加快处理。但证券市场长期以来一直存在的问题依然没能得到有效的解决，如高企不下的市盈率；国有股、法人股的流通问题；投资工具的匮乏；市场规范与发展的矛盾等等，解决上述问题可能在短期需要承受很大的痛苦，但对长期的市场发展是绝对有利的。加强监管和加大对违规行为的打击力度将有助于改善市场结构，真正保护合法经营的投资者。

下半年的行情演变，我们认为会在加强市场监管、国有股高价减持、查处违规资金等外界因素的影响下出现一次主动性调整，市场风险将得到一定程度的释放，大盘将会进入一个震荡及结构调整期，市场重心较上半年有所下移。

根据以上对行情的判断，下半年的股市将表现为以股价结构调整为特征的盘整行情，指数大幅上涨的情况不会出现，因此如何较好地把握个股投资机会就显得更为重要。必须引起注意的是，随着越来越多的基金管理公司成立和发起设立新的基

金品种，以基金为代表的机构投资者对市场的引导作用将再次增强，市场结构调整的速度会加快。

结合上半年操作中的经验教训，我们将采取以下的操作策略：

1. 严格控制股票持仓水平，将防范风险意识摆在首位。
2. 继续坚持中长期投资的理念，同时对上市公司的价值判断应从不同的角度进行更为全面的分析。
3. 继续坚持“以基本业绩为基础的成长性投资”的选股标准，跳出“科技股=高成长”的误区，同时挖掘各个行业中的成长型公司。
4. 高度关注加入世贸组织对宏观经济以及上市公司的深远影响，并从中寻找投资机会，多数行业在入关之后所发生的结构性调整将会超乎我们目前的想象。

总体而言，港口运输、医药化工、新材料、房地产等行业将成为我们的关注重点，我们也将密切关注电子信息业的变化情况。从市场角度出发，下半年我们在把握市场机遇的同时也将更加注意顺应市场形势的变化，争取给投资者较为满意的回报。

（二） 内部监察报告

基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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”公司理念，在严格控制风险的基础上，为基金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约定。

内部监察工作报告

控制与防范基金运作风险是基金管理公司生存与发展的基础，因此风险控管制度的建设与完善是 2001 年度上半年本基金管理人开展内部监察工作的重点。

依据海外合作伙伴对我公司各业务流程风险管理的建议、同时结合公司发展的实际情况，我们着重在：内部监察检查制度建设、公司各业务应急计划演习、各软硬件系统风险防范等方面进行了大量工作。监察稽核部对公司各业务部门完善业务流程及其流程遵循情况实施月度例行监察；通过基金交易监控管理系统对基金投资运作合规性进行实时抽查；通过深入各业务部门共计5轮的系统测试，对业务系统运行的稳定性、安全性进行检查。当发现违规隐患时，及时通过监察谈话、每月监察反馈表、监察通知向当事方提出整改措施、并敦促实施，同时通过每月监察稽核报告报送公司管理层和上级监管部门。

在报告期内，我们对以下方面着重实施了监察：

1. 对安信基金日常投资运作合法性、合规性实施监察
监察稽核员以现行的法律法规、基金契约和公司内部管理制度中对基金交易行

为的各项规定为依据，以实地查看、系统跟踪、材料调阅、人员询问、个股抽查为手段，监察安信基金投资遵循既定投资流程、基金投资组合及个股投资各项比例控制情况以及在日常投资交易中具体投资操作行为的合规性情况。

在本报告期内，安信基金日常投资运作基本符合法律和法规规定、公司投资运作程序，没有发现违规交易行为。

2. 建立公司各部门内部控制制度，完善监察稽核制度建设

公司的风险是各部门风险的积聚与汇总，因而控制公司运作风险必需从各部门的风险管理源头抓起。在监察稽核部的协助下，每一部门对各自业务流程中的风险点进行排查、制订相应控制方法、落实风险点负责人员，并在此基础上建立了各部门的内部控制制度。监察稽核部在各部门内部控制制度的基础上，完善了公司监察稽核程序，形成定期与不定期检查相结合的监察制度，使公司的风险控管有章可循、处罚有法可依。

3. 完善公司应急计划、加强对应用系统危机处理的应变能力

公司应急计划是专门针对在日常业务运作过程中可能发生各类导致重大危害的危机的应急处理程序。应急计划的制订旨在当发生危机事件时，能迅速反应、协调行动，最大限度地减少危机对公司业务可能造成的损失。监察稽核部已会同公司各部门对应急计划进行了大规模模拟演习，使公司员工熟知、掌握应急技巧。此外，监察部还专门针对应用系统开展了系统瘫痪演习，培训员工面对系统故障等特急情况时的从容处置能力。

四.基金财务报告

(一) 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	期初数	期末数
股票投资—成本：		2,058,603,497.54	1,577,077,242.45
股票投资—估值增值：		771,046,179.24	499,463,636.19
债券投资—成本：		860,058,564.52	747,487,815.44
债券投资—估值增值：		1,926,280.78	201,015.63
买入返售证券：		-	-
银行存款：		344,861,410.91	55,061,959.76
应收股利：		-	2,251,636.92
应收利息：	1	5,222,053.93	6,742,986.94
应收帐款：	2	517,386,784.24	36,918,740.95
其他应收款项：	3	311,800.88	1,250,000.00
基金资产总值：		4,559,416,572.04	2,926,455,034.28
应付管理费及业绩报酬：		9,196,266.39	3,549,352.29
应付基金托管费：		819,099.17	591,558.72
应付帐款：	4	56,431,370.82	10,481,038.77
卖出回购证券：		560,000,000.00	40,000,000.00

应付佣金：		822,039.51	926,440.41
其他应付款项：	5	300,712.37	1,336,598.47
负债总额：		627,569,488.26	56,884,988.66
基金单位总额：		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配净收益：		1,158,874,623.76	369,905,393.80
未实现估值增值：		772,972,460.02	499,664,651.82
基金资产净值：		3,931,847,083.78	2,869,570,045.62
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：		1.9659	1.4348
调整后每份基金单位资产净值：		1.3909	1.4348

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	2001 年 1-6 月	2000 年 1-6 月
在除息日确认的股息收入：		11,590,350.82	3,599,298.52
债券利息收入：		9,104,502.35	2,741,998.11
股票买卖价差收入：		369,218,572.38	786,278,501.20
债券买卖价差收入：		3,279,230.14	1,287,814.06
其他收入：	6	5,714,997.63	7,942,921.79
基金管理费：		24,761,207.69	27,576,997.98
基金托管费：		4,126,867.92	4,596,166.43
应由基金承担的其他费用：	7	8,988,807.67	4,192,860.69
基金净收益：		361,030,770.04	765,484,508.58
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：		369,905,393.80	767,907,890.93

(二) 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) 记帐原则：权责发生制。

(3) 记帐本位币：人民币。

(4) 基金资产的估值方法：

上市证券（包括已上市但根据有关规定流通受限的配售新股）以计算日市场平均价为准；该日无交易的，以最近一日平均价计算。

未上市的股票以发行价计算。

未上市国债及银行存款和交易备付金以本金加计至估值日为止的应计利息额计算。

如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定基金资产价值时，基金管理人依据主管机关的有关规定办理。

估值对象为基金所拥有的股票，国债和银行存款。

每日均对基金资产进行估值。

（5）收入的确认政策：

证券买卖差价收入：在交易日成交，按实际成交价与帐面成本的差额确认。

股息收入：在被投资股票股权除息日确认。

债券利息收入：a.已上市国债在被投资国债除息日确认。b.未上市，在银行间债券市场交易的国债在持有期间内以本金按帐面利率确认利息收入。

其他收入：在实际收到时确认。

（6）证券交易的成本计价方法：

证券交易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：

根据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》，对基金税收有如下规定：

以发行基金方式募集资金不征收营业税。

对基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税。

对基金买卖股票按照4‰的税率征收印花税。

对基金从证券市场中取得的收入，暂免征所得税。

（8）基金的收益分配政策：

基金收益分配比例不低于基金净收益的90%。

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。

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。

基金投资当年亏损，则不进行收益分配。

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 银行间回购交易	基金契约 回购交易合同

上海国际信托投资公司	管理公司发起人 租用交易席位	席位使用协议
山东证券有限责任公司	基金发起人 管理公司发起人 租用交易席位	席位使用协议
申银万国证券股份有限公司	基金发起人 管理公司发起人 租用交易席位	席位使用协议

(2) 通过关联人席位交易情况：

本基金通过关联人席位 2001 年 1-6 月的股票交易情况：

关 联 人	1-6 月成交量	占成交总量 比例	1-6 月佣金	占佣金总 量比例	平均佣 金比率
上海国际信托投资公司	384,312,821.41	16.92%	309,106.63	16.95%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	506,118,107.98	22.28%	404,603.39	22.19%	0.08%
山东证券有限责任公司	178,601,325.75	7.86%	146,413.13	8.03%	0.08%

本基金通过关联人席位 2001 年 1-6 月的国债及回购交易情况：

关 联 人	1-6 月国债成交量	占成交总量 比例	1-6 月回购成交量	占成交总量 比例
上海国际信托投资公司	192,272,748.70	19.76%	135,600,000.00	39.04%
申银万国证券股份有限公司	262,513,946.50	26.97%	65,000,000.00	18.72%
山东证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

(3) 本基金与关联人进行的银行间回购交易情况：

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	-	-	4,060,000,000.00	3,592,427.40

(4) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额：

基金管理人的报酬

本基金应给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人报酬

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 1 月 1 日至 6 月 30 日，管理人收取的基金管理费金额为 24,761,207.69

元。

基金托管费

本基金应给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 1 月 1 日至 6 月 30 日，托管人收取的基金托管费金额为 4,126,867.92 元。

3、主要报表项目说明

(1) 应收利息 2001 年 6 月 30 日余额为人民币 6,742,986.94 元。由以下两项组成：银行存款和交易备付金利息为 153,274.08 元；国债利息为 6,589,712.86 元。

(2) 应收帐款 2001 年 6 月 30 日余额为人民币 36,918,740.95 元，是上海应收交易清算资金 36,918,740.95 元。

(3) 其他应收款项 2001 年 6 月 30 日余额为人民币 1,250,000.00 元，是深圳证券交易所交易保证金 1,250,000.00 元。

(4) 应付帐款 2001 年 6 月 30 日余额为人民币 10,481,038.77 元，是上海应付交易清算资金 10,481,038.77 元。

(5) 其他应付款项 2001 年 6 月 30 日余额为人民币 1,336,598.47 元，由以下两项组成：应付券商席位保证金 1,293,552.09 元；卖出回购证券款所计提的应付回购利息 43,406.38 元。

(6) 其他收入 2001 年 1-6 月发生额为人民币 5,714,997.63 元，由以下三项组成：银行存款和交易备付金利息收入 4,840,392.08 元；回购利息收入 128,219.18 元；其他收入 746,386.37 元。

(7) 应由基金承担的其他费用 2001 年 1-6 月发生额为人民币 8,988,807.67 元，由以下七项组成：交易费用 14,697.50 元；回购利息支出 5,135,710.17 元；上市年费 60,000.00 元；会计师费 100,000.00 元；信息披露费 220,000.00 元；2000 年度红利发放手续费 3,450,000.00 元；其他费用 8,400.00 元。

(三) 本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的与配售的新股。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 6 月 30 日估值时，已上市但流通受限的新股估值增值额为 109,214,700.00 元。

序号	股票名称	发行日期	上市日期	数量	成本	市价	流通受限期
1	上港集箱	00-6-28	00-7-19	9,170,000	109,856,600.00	219,071,300.00	00-7-11 起 1 年
2	通海高科	00-7-6	待定	60,000	1,012,800.00	1,012,800.00	待定
3	交大昂立	01-6-18	01-7-2	55,000	757,350.00	757,350.00	01-7-2
4	昌河股份	01-6-20	01-7-6	205,000	1,492,400.00	1,492,400.00	01-7-6
合 计					113,119,150.00	222,333,850.00	

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。

(四) 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	13,774,058.80	0.48%
采掘业	67,613,242.56	2.36%
制造业	982,868,534.29	34.25%
其中：纺织、服装、皮毛	298,068,151.37	10.39%
造纸、印刷	5,325,562.80	0.18%
石油、化学、塑胶、塑料	203,150,476.68	7.08%
电子	1,012,800.00	0.04%
金属、非金属	70,106,400.00	2.44%
机械、设备、仪表	134,939,723.27	4.70%
医药、生物制品	257,088,560.17	8.96%
其他	13,176,860.00	0.46%
电力、煤气及水的生产和供应业	64,461,224.25	2.25%
建筑业	5,744,310.00	0.20%
交通运输、仓储业	310,078,365.64	10.80%
信息技术业	552,408,889.57	19.25%
批发和零售贸易	38,458,617.96	1.34%
金融、保险业	----	----
房地产业	20,421,250.00	0.71%
社会服务业	20,712,385.57	0.72%
传播与文化产业	----	----
综合类	----	----
合 计	2,076,540,878.64	72.36%

2. 债券 (不包括国债) 合计

截至 2001 年 6 月 30 日，基金持有的债券合计为 4,792,445.40 元，占基金资产净值的 0.17%。

3. 国债、货币资金合计

截至 2001 年 6 月 30 日，基金持有的国债及货币资金合计为 830,985,760.47 元，占基金资产净值的 28.96%。

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	东方电子	20,460,087	352,936,500.75	12.30%
2	上港集箱	9,170,000	219,071,300.00	7.63%
3	海欣股份	8,129,938	196,419,302.08	6.85%

4	广电信息	7,381,134	154,265,700.60	5.38%
5	烟台万华	4,664,154	147,946,964.88	5.16%
6	恒瑞医药	5,332,998	112,472,927.82	3.92%
7	同仁堂	4,924,118	101,584,554.34	3.54%
8	茉织华	3,250,632	80,095,572.48	2.79%
9	外运发展	2,540,726	72,131,211.14	2.51%
10	法尔胜	4,368,000	70,106,400.00	2.44%
11	中原油气	3,811,344	67,613,242.56	2.36%
12	申能股份	3,871,545	64,461,224.25	2.25%
13	青岛海尔	3,059,107	51,974,227.93	1.81%
14	许继电气	2,841,794	48,623,095.34	1.69%
15	盐湖钾肥	2,272,148	40,557,841.80	1.41%
16	上海医药	2,420,973	39,631,328.01	1.38%
17	中化国际	2,042,412	38,458,617.96	1.34%
18	中联重科	1,000,000	32,850,000.00	1.14%
19	大唐电信	1,062,068	27,050,871.96	0.94%
20	金地集团	775,000	20,421,250.00	0.71%
21	盐田港A	1,203,050	18,875,854.50	0.66%
22	长江通信	456,799	18,153,192.26	0.63%
23	上海强生	997,091	16,471,943.32	0.57%
24	亚星化学	663,000	14,645,670.00	0.51%
25	雅戈尔	1,000,000	13,660,000.00	0.48%
26	新太科技	598,906	11,858,338.80	0.41%
27	金瑞科技	231,000	8,870,400.00	0.31%
28	鲁泰A	527,273	7,893,276.81	0.28%
29	中铁二局	309,000	5,744,310.00	0.20%
30	福建南纸	304,010	4,341,262.80	0.15%
31	国栋建设	163,000	4,306,460.00	0.15%
32	青旅控股	232,353	4,240,442.25	0.15%
33	天药股份	72,000	2,642,400.00	0.09%
34	荣华实业	94,000	1,915,720.00	0.07%
35	昌河股份	205,000	1,492,400.00	0.05%
36	通海高科	60,000	1,012,800.00	0.04%
37	新疆天宏	34,000	984,300.00	0.03%
38	交大昂立	55,000	757,350.00	0.03%
39	华微电子	100	2,624.00	0.00%
合计			2,076,540,878.64	72.36%

5.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	同仁堂	-	3,907,251	1,016,867	-
2	福建南纸	-	304,010	-	-
3	外运发展	-	2,409,676	131,050	-
4	荣华实业	94,000	-	-	-

5	亚星化学	163,000	500,000	-	-
6	国栋建设	163,000	-	-	-
7	华微电子	91,000	100	-	91,000
8	金地集团	775,000	-	-	-
9	新疆天宏	34,000	-	-	-
10	天药股份	72,000	-	-	-
11	中铁二局	309,000	-	-	-
12	茉织华	-	2,211,834	1,038,798	-
13	上海强生	-	997,091	-	-
14	青岛海尔	-	-	4,097,851	1,038,744
15	盐田港A	-	1,213,050	-	10,000
16	昌河股份	205,000	-	-	-
17	交大昂立	55,000	-	-	-

新增股票附注：本表中“其他”项目包括“配转送增”。

6. 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	首创股份	1,190,000	-	1,190,000
2	民生银行	904,000	-	904,000
3	宝钢股份	-	8,405,000	8,405,000
4	歌华有线	-	285,000	285,000
5	上海汽车	2,432,999	213,000	2,645,999
6	波导股份	558,347	-	558,347
7	莲花味精	-	1,208,161	1,208,161
8	长城电工	2,409,130	-	2,409,130
9	万杰高科	1,225,900	-	1,225,900
10	沧州大化	10,000	-	10,000
11	首旅股份	300,000	-	300,000
12	北京城建	-	10,000	10,000
13	海正药业	-	10,000	10,000
14	赣粤高速	229,800	-	229,800
15	开开实业	-	314,200	314,200
16	鄂尔多斯	-	130,960	130,960
17	星新材料	1,425,750	-	1,425,750
18	上海家化	-	150,000	150,000
19	振华港机	1,175,212	-	1,175,212
20	天通股份	-	201,000	201,000
21	广州药业	-	116,477	116,477
22	中发展	-	84,000	84,000
23	联创光电	-	158,000	158,000
24	红星发展	-	343,000	343,000
25	宁沪高速	-	183,000	183,000
26	天科股份	-	95,000	95,000
27	白唇鹿	-	40,000	40,000
28	龙净环保	262,000	-	262,000

29	盘江股份	-	123,000	123,000
30	金山股份	-	79,000	79,000
31	昆明制药	114,000	-	114,000
32	特精股份	-	40,000	40,000
33	康美药业	-	46,000	46,000
34	天威保变	-	92,000	92,000
35	潜江制药	-	71,000	71,000
36	广东榕泰	-	78,000	78,000
37	南京医药	-	140,000	140,000
38	龙电股份	-	3,705,262	3,705,262
39	新亚股份	-	1,523,235	1,523,235
40	上菱电器	2,485,725	-	2,485,725
41	春兰股份	8,000	-	8,000
42	星湖科技	2,300,000	30,000	2,330,000
43	中兴通讯	-	480,327	480,327
44	中信海直	175,000	-	175,000
45	佛山照明	675,632	-	675,632
46	湖南投资	-	195,067	195,067
47	泰山石油	5,460,939	650,000	6,110,939
48	京东方A	-	361,912	361,912
49	环保股份	12,509,700	137,130	12,646,830
50	锌业股份	2,071,638	-	2,071,638
51	超声电子	500,050	-	500,050
52	兰光科技	186,600	-	186,600

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 6 月 30 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 42,749,038.89 元，债券市值 4,792,445.40 元，股票市值 2,076,540,878.64 元、国债及货币资金 830,985,760.47 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：应收股利、应收利息、其他应收款、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金以及应付回购利息、应付卖出回购债券款、其他应付款等。

五.基金持有人结构及前十名持有人

截止 2001 年 6 月 30 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%
山东证券有限责任公司	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	129,575,300	6.48%
2	平安保险	71,276,100	3.56%
3	久事公司	45,628,000	2.28%
4	中国再保	29,885,600	1.49%
5	投资信托	18,000,000	0.90%
6	财政证券	13,000,000	0.65%
7	华安基金	12,000,000	0.60%
8	中保人寿	10,000,000	0.50%
9	古象涂料	8,154,700	0.41%
10	浙江巨化	7,766,500	0.39%

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.本基金中期不分配，纳入年末一次性分配；
- 3.2001 年 1-6 月各券商股票、国债及回购交易情况和佣金情况如下：

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
上海国际信托投资公司	384,312,821.41	16.92%	309,106.63	16.95%
申银万国证券股份有限公司	506,118,107.98	22.28%	404,603.39	22.19%
山东证券有限责任公司	178,601,325.75	7.86%	146,413.13	8.03%
国通证券有限责任公司	610,175,366.68	26.86%	486,756.71	26.70%
光大证券有限公司	227,192,578.88	10.00%	184,486.07	10.12%

南方证券有限公司	28,071,547.96	1.23%	23,018.34	1.26%
国信证券有限公司	337,428,059.82	14.85%	268,821.68	14.75%

国债及回购交易情况:

券 商	国债成交量	占成交总量 比例	回购成交量	占成交总量比例
上海国际信托投资公司	192,272,748.70	19.76%	135,600,000.00	39.04%
申银万国证券股份有限公司	262,513,946.50	26.97%	65,000,000.00	18.72%
山东证券有限责任公司	-	-	-	-
国通证券有限责任公司	358,468,986.50	36.83%	146,700,000.00	42.24%
光大证券有限公司	156,675,052.20	16.10%	-	-
南方证券有限公司	-	-	-	-
国信证券有限公司	3,348,400.00	0.34%	-	-

七．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 2000 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

二零零一年八月三十日