

安信证券投资基金

2002 年年度报告

华安基金管理有限公司

2003 年 3 月 29 日

重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2003 年 3 月 26 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: 上海市浦东新区浦东南路 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) 66107333
 传 真：(010) 66106904

(四) 会计师事务所：安永大华会计师事务所有限责任公司
 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、曹勤

二. 主要财务指标

(单位：人民币元)

项目	2002 年度	2001 年度	2000 年度
基金本期净收益	24,130,192.19	474,248,526.87	1,156,451,241.41
单位基金本期净收益	0.0121	0.2371	0.5782
基金可分配净收益	-161,675,823.15	483,123,150.63	1,158,874,623.76
单位基金可分配净收益	-0.0808	0.2416	0.5794
期末基金资产总值	1,844,745,025.88	2,766,368,520.67	4,559,416,572.04
期末基金资产净值	1,838,324,176.85	2,502,254,030.88	3,931,847,083.78
期末单位基金资产净值	0.9192	1.2511	1.9659
基金资产净值收益率	1.18%	17.05%	46.50%
本期基金资产净值增长率	-10.28%	-10.00%	48.52%
累计资产净值增长率	94.85%	117.17%	141.30%

上述部分指标计算公式：

1. 基金可分配净收益 = 期末基金净收益 + MIN [0, 期末未实现利得]
2. 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
3. 本期基金资产净值增长率 = (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
4. 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) * ... * (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

本基金业绩表现

截止 2002 年 12 月 31 日，本基金单位资产净值为 0.9192 元，基金净值增长率

为-10.28%，表现优于两市指数（上证综指下跌 17.52%，深综指下跌 18.32%）。

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%
2002	0.9192	-10.28%	0.000	-17.52%	-18.32%
累计		94.85%	1.167	-2.98%	-9.16%
*复合增长率（R）		14.27%		-0.60%	-1.90%

* $(1+R)^{\text{成立年数}} - 1 = \text{累计增长率}$

基金经理简介

王国卫先生，基金经理，经济学硕士。9 年证券从业经历，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。5 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

2002 年投资总结

2002 年本基金净值为负增长，净值增长率为-10.28%，同期上证指数下跌 17.52%，深综指下跌 18.32%。虽然本基金净值增长实现了对指数的大幅超越，但给投资者造成了绝对的亏损，相比前几年的高额分红，我们和投资者一样不满意。

近几年来，证券管理部门一直致力于证券市场的规范化、市场化和国际化。围绕这一目标，2002 年继续出台了一系列规章制度。我们认为，长期看有利于中国证券市场长期稳定健康发展的，但短期必然要承担转轨过程中的阵痛，因为规范化打击了做庄机构和某些上市公司，导致旧的盈利模式瓦解；市场化有可能短期扩大了套利者的队伍，事实上增加国内投资者的成本；国际化使得投资者的视野得以扩大，学会了比较。

2002 年在全球经济陷入整体衰退的背景下，中国宏观经济继续保持良好的运行态势，全年 GDP 突破 10 万亿元，增长速度高达 8%。然而作为经济晴雨表的证券市场却未能与之遥相呼应，其走势与经济发展的大好形势产生了严重背离，指数创下三年以来新低、累计跌幅达 40%。指数下跌是综合因素共同作用的结果，既有对过去的矫正，也有对未来可能发生变化的恐惧。但需要指出的是，政策变化对市场的影响是显而易见的，国有股减持阶段性方案披露形成了市场底，而停止国有股减持却形成了市场顶，对同一事物的理解，投资者之间有差异，投资者和监管者之间也有差异。

我们对本基金 2002 年的投资进行了检讨。我们认为，“精选个股、集中投资”

的策略是符合大资金运作要求的策略。但在具体操作上，对流动性的管理和市场时机的判断明显欠缺。正是这两方面的原因直接导致本基金年初形成的优势在 6.24 行情后出现根本性转变。流动性不足使得投资组合结构调整存在难度，特别是在市场总体交易清淡的情况下，变现的难度更大，冲击成本会更高；而时机把握欠妥更使我们失去了兑现收益和调整的机会，事后看，2002 年的机会并不多。同时，我们意识到，随着机构投资者队伍的不断扩大，资产配置的重要性越来越高，本基金需要在这方面着力提高。虽然经过努力，第四季度基金业绩出现明显回升，但被动的局面没有明显改善。

2003 年市场展望

我们对 2003 年的证券市场是相对乐观的。我们认为，经过两年的下跌，市场风险在相当程度上得以有效释放，2003 年将是“复苏临近、温和增长”的一年。我们的理由是：第一，尽管一些历史遗留问题短期内还难以解决，但证券市场和宏观经济的背离是不会持久的，背离的出现就意味着机会的出现。如果没有 GDP 翻两番的大背景，证券市场就没有今天这样的规模；如果宏观经济能持续向好，我们就没有理由对证券市场长期悲观。第二，我们相信管理层的市场管理能力将不断提高，政策变化对市场的冲击力将弱化。证券监管将按照“坚持改革力度、发展速度与市场可承受程度相统一”的政策主基调进行。第三，上市公司经营业绩经过 2001 年规范整顿和 2002 年税收影响后，将逐步恢复到正常的增长状态，业绩增长的速度将超过 GDP 的增速。第四，股票定价结构性失衡问题有望改善和扭转。长期以来，大盘蓝筹股定位相对偏低，而小盘股、业绩不佳个股定位相对偏高，因此单从某些指标上看，中国证券市场不具投资价值。我们相信，随着机构投资者不断增多，特别是 QFII 资金和理念的输入，结构性失衡问题有望改善，这种影响是深远的。

2003 年市场环境逐步趋暖，我们将增加组合的进攻性、流动性，强化资产配置。综合判断，金融、港口、电力、汽车、机械制造和电子元器件将有较好的投资机会。

（二） 内部监察报告

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作基金资产，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。

内部监察工作报告

本报告期内，我们遵照有关法律法规、基金契约和内部规章进行了持续的内部监察稽核工作，主要开展了以下工作：

一、对基金安信日常投资运作合法性、合规性的检察

为加强对投资交易行为的监控，我们坚持严格按照《证券投资基金管理暂行办法》、《安信证券投资基金基金契约》及其他有关规定，对基金投资比例、新股申购、

交易行为、席位交易量分配等进行每日检查及定期检查，并在发现问题的第一时间及时通报基金经理和公司管理层，采取措施加以解决。迄今为止，未发现基金安信的投资运作存在重大违规行为。

二、加强员工职业道德教育和风险防范培训

随着公司人员的增加、基金投资风格的多样化、基金业务的创新，公司的运作风险也随之增大。为此，我们除了在招聘时特别关注员工对风险防范的态度外，对于新进员工，我们都要求其参加入司监察培训，向其介绍相关主要规定并要求书面承诺遵守。对于离职人员，我们除要求其完成业务和资料交接外，还要求其签署《离职承诺书》，承诺不泄露公司投资交易技术运作等各方面的非公开信息。此外，为提高各部门的风险防范技术，我们邀请外部专家为全体员工开设《证券犯罪及其应对策略》等方面的讲座。

三、加强法律事务管理

在公司内部充实了法律人员并聘请了常年法律顾问后，公司法务工作力量得以大大加强。为保护基金持有人等有关各方的合法权益，对于新基金的所有法律文件，律师均进行了详细审查，并在审查后出具法律意见书。此外，我们加强了公司对外签署合同的审查工作，有效降低了法律风险和诉讼风险。

四、继续加强对公司运作规章与业务流程遵循情况的检查工作，提高紧急事件应变能力

通过实地检查与部门自查相结合的方式，监察稽核人员在本年度里对所有业务部门进行了深入的实地检查，及时发现制度流程遵循方面的漏洞，给予被检查部门合理的改进建议，确保公司整体业务的平稳运行。为做好监察工作，更好地了解新产品、新业务方案 and 实际运作机制，我们还积极参与事前讨论，包括新产品、新业务的开发讨论，新业务、新品种推出前的风险评估等，了解其中隐含的风险点，以便更好地有针对性地采取预防措施。

此外，公司通过继续完善应急计划、开展系统恢复备份演习，不断提高公司及员工面对紧急事件的应急与快速处理能力。

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。

2002 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 2002 年度内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、基金中期报告等公告信息进行了复核，认为安信证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2002 年度内所编制和披露的基金信息是准确、真实、完整的。

中国工商银行基金托管部
2003 年 3 月 26 日

五、 基金年度财务报告

（一）审计报告

审 计 报 告

安永大华业字（2003）第 395 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2002年12月31日的资产负债表和2002年度经营业绩表、基金净值变动表以及基金收益分配表。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《证券投资基金会计核算办法》以及证券投资基金相关法规、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2002年12月31日的财务状况和2002年度的经营业绩及基金净值变动情况，会计处理方法的选用遵循了一贯性原则。

安永大华会计师事务所有限责任公司

中国注册会计师：吕秋萍

中国注册会计师：曹 勤

中国 上海 昆山路 146 号

2003 年 2 月 12 日

（二）基金会计报告书

安信证券投资基金
资产负债表

2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
银行存款		38,457,668.73	656,173,350.20
清算备付金		8,337,254.23	22,014,256.85
交易保证金	3(1)	750,000.00	1,250,000.00
应收证券清算款	3(2)	7,767,833.81	5,417,238.43
应收股利		-	-
应收利息	3(3)	4,356,039.90	1,685,978.00
其他应收款	3(4)	30,000.00	-
股票投资市值	1(4)	1,214,825,366.31	1,231,312,847.59
其中：股票投资成本	1(7)	1,423,174,188.33	1,211,205,977.99
债券投资市值	1(4)	570,220,862.90	848,514,849.60
其中：债券投资成本	1(7)	571,813,115.37	849,490,838.95
配股权证	1(4)	-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用	1(5)	-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,844,745,025.88	2,766,368,520.67
应付证券清算款	3(5)	1,877,943.36	58,516,615.52
应付管理人报酬		2,365,715.18	3,200,985.29
应付托管费		394,285.87	533,497.56
应付佣金		282,904.62	296,953.17
应付利息		-	316,438.25
应付收益		-	-
其他应付款	3(6)	1,250,000.00	1,250,000.00
卖出回购证券款		-	200,000,000.00
预提费用	1(5)	250,000.00	-
	3(7)		
其他负债		-	-
负债合计		6,420,849.03	264,114,489.79
实收基金	3(8)	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	3(9)	-209,941,074.49	19,130,880.25
未分配收益		48,265,251.34	483,123,150.63
持有人权益合计		1,838,324,176.85	2,502,254,030.88
负债及持有人权益总计		1,844,745,025.88	2,766,368,520.67

安信证券投资基金
经营业绩表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年	2001 年
一、收入		68,073,407.71	539,830,971.81
1、股票差价收入	1(6)	-1,187,158.42	459,542,496.08
2、债券差价收入	1(6)	28,916,830.63	34,242,081.79
3、债券利息收入	1(6)	23,961,438.01	20,456,909.78
4、存款利息收入	1(6)	4,662,390.33	10,202,734.42
5、股利收入	1(6)	10,896,577.31	13,796,451.05
6、买入返售证券收入	1(6)	513,960.00	292,019.18
7、其他收入	3(10)	309,369.85	1,298,279.51
二、费用		43,943,215.52	65,582,444.94
1、基金管理人报酬	2(5)	31,972,730.02	43,974,965.35
2、基金托管费	2(5)	5,328,788.32	7,329,160.98
3、卖出回购证券支出		4,238,024.56	10,152,904.61
4、利息支出		-	-
5、其他费用	3(11)	2,403,672.62	4,125,414.00
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		580,000.00	460,000.00
审计费用		260,000.00	100,000.00
三、基金净收益		24,130,192.19	474,248,526.87
加：未实现利得		-228,060,046.22	-753,841,579.77
四、基金经营业绩		-203,929,854.03	-279,593,052.90

安信证券投资基金
收益分配表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年	2001 年
本期基金净收益		24,130,192.19	474,248,526.87
加：期初基金净收益		483,123,150.63	1,158,874,623.76
加：以前年度损益调整	1(10)	1,011,908.52	-
可供分配基金净收益		508,265,251.34	1,633,123,150.63
减：本期已分配基金净收益	1(9)	460,000,000.00	1,150,000,000.00
期末基金净收益		48,265,251.34	483,123,150.63

安信证券投资基金
净值变动表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年	2001 年
一、期初基金净值		2,502,254,030.88	3,931,847,083.78
二、本期经营活动：			
基金净收益		24,130,192.19	474,248,526.87
未实现利得		-228,060,046.22	-753,841,579.77
经营活动产生的基金净值变动数		-203,929,854.03	-279,593,052.90
三、本期向持有人分配收益：			
向持有人分配收益产生的基金净值变动数		-460,000,000.00	-1,150,000,000.00
四、期末基金净值		1,838,324,176.85	2,502,254,030.88

(三) 会计报告书附注

1、主要会计政策和会计政策变更

(1) 会计年度：公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日。

(2) 记账原则：权责发生制。

(3) 记账本位币：人民币；记账单位：元。

(4) 基金资产的估值方法：

①上市流通的股票和国债，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（平均价）估值；上市流通的可转换债券和企业债券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（平均价）扣除债券起息日或上次除息日至估值日的利息后的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价估值。

②未上市流通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在银行间债券市场交易的债券以及未上市的债券按成本估值。

④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。

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。

(5) 待摊费用和预提费用的核算方法:

①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,如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和律师费用等,待摊费用在实际发生时入帐,在受益期内平均摊销。

②预提费用核算预计将发生的、影响基金单位净值小数点后第五位,应预提计入本期的费用,如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和律师费用等,预提费用在预计发生时入帐。

(6) 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、应收利息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:在债券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。

(7) 证券交易的成本计价方法:

①买入股票时,于成交日按应支付的全部价款(包括成交价格和相关费用)计入股票投资成本,出售时按移动加权平均法结转成本。

②买入上市债券时,于成交日按应支付的全部价款扣除债券起息日或上次除息日至购买日的利息后记入债券投资成本,出售时按移动加权平均法结转成本。

③买入非上市债券时,于实际支付价款日按支付的全部价款扣除债券起息日或上次除息日至购买日的利息后记入债券投资成本,出售时按移动加权平均法结转成本。

(8) 税项:

依据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55号文《关于证券投资基金税收问题的通知》的有关规定: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;对基金管理人运用基金买卖股票按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‰

(9) 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。

(10) 会计政策变更及其影响:

中华人民共和国财政部于 2001 年 11 月 11 日颁布了《证券投资基金会计核算办法》, 本基金从 2002 年 1 月 1 日起执行该办法。其主要影响为证交所交易债券的成本计价方法及利息收入确认方法的变更: 成本计价方法由含息成本变更为不含息成本, 利息收入确认方法由债券除息日确认变更为在债券持有期内逐日计提。按照新的会计政策, 本基金于 2002 年 1 月 1 日对有关科目进行调整, 具体为: 应收利息调增人民币 7,141,617.42 元, 债券投资成本调减人民币 6,129,708.90 元, 两者差额人民币 1,011,908.52 元计入以前年度损益调整科目; 同时, 未实现利得和债券投资市值分别调减人民币 1,011,908.52 元。上述会计政策的变更不影响 2002 年初基金资产净值。

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
上海证券有限责任公司	与管理公司属同 一股东*	租用交易席位	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 2002 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
申银万国证券股份有限公司	202,843,457.25	12.26%	158,728.88	12.84%	0.078%

上海证券有限责任公司	168,018,863.34	10.16%	123,314.87	9.98%	0.073%
天同证券有限责任公司	76,828,794.27	4.64%	57,193.69	4.63%	0.074%
合计	<u>447,691,114.86</u>	<u>27.06%</u>	<u>339,237.44</u>	<u>27.45%</u>	

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
申银万国证券股份有限公司	948,618,761.34	26.16%	756,969.85	26.49%	0.080%
上海证券有限责任公司	498,783,192.19	13.75%	400,791.31	14.02%	0.080%
天同证券有限责任公司	178,601,325.75	4.92%	146,413.13	5.12%	0.082%
合计	<u>1,626,003,279.28</u>	<u>44.83%</u>	<u>1,304,174.29</u>	<u>45.63%</u>	

②本基金通过关联人席位 2002 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	1,217,779,320.80	19.20%	200,000,000.00	5.18%
天同证券有限责任公司	375,010,861.20	5.91%	204,800,000.00	5.31%
申银万国证券股份有限公司	11,374,968.00	0.18%	-	-
合计	<u>1,604,165,150.00</u>	<u>25.29%</u>	<u>404,800,000.00</u>	<u>10.49%</u>

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%
合计	<u>667,666,626.00</u>	<u>12.26%</u>	<u>374,600,000.00</u>	<u>26.94%</u>

(3) 本基金与关联人 2002 年末进行银行间市场债券买卖交易 (2001 年: 无)。

(4) 本基金与关联人 2002 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	-	-	380,000,000.00	734,279.56

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提，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。

2002 年管理人收取的基金管理费金额为 31,972,730.02 元（2001 年：43,974,965.35 元）。

②基金托管费

本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 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提，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。

2002 年托管人收取的基金托管费金额为 5,328,788.32 元（2001 年：7,329,160.98 元）。

3、主要报表项目说明（单位：人民币元）

(1) 交易保证金：

明细项目	期末数	期初数
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 交易保证金	750,000.00	1,250,000.00

(2) 应收证券清算款:

明细项目	期末数	期初数
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	7,767,833.81	5,417,238.43
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	-	-
合计	<u>7,767,833.81</u>	<u>5,417,238.43</u>

(3) 应收利息:

明细项目	期末数	期初数
银行存款和清算备付金利息	58,874.73	220,772.52
债券利息	<u>4,297,165.17</u>	<u>1,465,205.48</u>
合计	<u>4,356,039.90</u>	<u>1,685,978.00</u>

(4) 其他应收款:

明细项目	期末数	期初数
应收券商费用	30,000.00	-

(5) 应付证券清算款:

明细项目	期末数	期初数
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	-	58,516,615.52
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	<u>1,877,943.36</u>	-
合计	<u>1,877,943.36</u>	<u>58,516,615.52</u>

(6) 其他应付款:

明细项目	期末数	期初数
券商代垫交易保证金	1,250,000.00	1,250,000.00

(7) 预提费用:

明细项目	期末数	期初数
信息披露费	120,000.00	-
审计费	<u>130,000.00</u>	-
合计	<u>250,000.00</u>	

(8) 实收基金:

实收基金结构	原始投入资金	比例(%)
(1) 发起人投入资金	60,000,000.00	3.00
其中: 上海国际信托投资公司	36,000,000.00	1.80
天同证券有限责任公司	12,000,000.00	0.60
华安基金管理有限公司	12,000,000.00	0.60
(2) 社会募集资金	<u>1,940,000,000.00</u>	<u>97.00</u>
合计	<u>2,000,000,000.00</u>	<u>100.00</u>

实收基金经大华会计师事务所有限公司以“华业字(98)第 837 号”验资报告验证。

(9) 未实现利得:

明细项目	本期数	上期数
股票投资未实现利得	-208,348,822.02	20,106,869.60
债券投资未实现利得	<u>-1,592,252.47</u>	<u>-975,989.35</u>
合计	<u>-209,941,074.49</u>	<u>19,130,880.25</u>

(10) 其他收入:

明细项目	本期数	上期数
新股手续费返还	194,752.71	246,696.70
配股手续费返还	-	41,138.00
债券手续费返还	110,000.00	980,415.00
印花税返还	<u>4,617.14</u>	<u>30,029.81</u>
合计	<u>309,369.85</u>	<u>1,298,279.51</u>

(11) 其他费用:

明细项目	本期数	上期数
交易所返售与回购交易费用	93,285.41	34,597.50
上市年费	60,000.00	60,000.00
审计费	260,000.00	100,000.00
信息披露费	580,000.00	460,000.00
红利发放手续费	1,380,000.00	3,450,000.00
其他费用	<u>30,387.21</u>	<u>20,816.50</u>
合计	<u>2,403,672.62</u>	<u>4,125,414.00</u>

(四) 流通转让受限的基金资产

本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的新股。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。2002 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 1,092,737.74 元。

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	中国联通	02-09-26	02-10-09	2,665,214	6,129,992.20	7,222,729.94	上市日起 6 个月
2	中信证券	02-12-24	03-01-06	586,000	2,637,000.00	2,637,000.00	上市日起流通
3	皖通高速	02-12-26	03-01-07	373,000	820,600.00	820,600.00	上市日起流通
合 计					<u>9,587,592.20</u>	<u>10,680,329.94</u>	

注：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。

(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	984,480.00	0.05%
B	采掘业	59,862,846.12	3.26%
C	制造业	777,120,706.21	42.27%
C0	其中：食品、饮料	63,920,054.85	3.48%
C1	纺织、服装、皮毛	200,750,833.20	10.92%
C2	木材、家具	----	----
C3	造纸、印刷	8,515,212.65	0.46%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	148,656,504.12	8.09%
C5	电子	26,651,275.00	1.45%
C6	金属、非金属	96,905,311.94	5.27%
C7	机械、设备、仪表	91,947,805.32	5.00%
C8	医药、生物制品	139,773,709.13	7.60%
C99	其他	----	----
D	电力、煤气及水的生产和供应业	54,336,883.19	2.96%
E	建筑业	1,774,560.00	0.10%
F	交通运输、仓储业	128,675,402.07	7.00%
G	信息技术业	19,577,230.37	1.06%
H	批发和零售贸易	92,637,824.52	5.04%
I	金融、保险业	39,076,538.35	2.12%
J	房地产业	11,068,248.06	0.60%
K	社会服务业	29,710,647.42	1.62%
L	传播与文化产业	----	----
M	综合类	----	----
合 计		<u>1,214,825,366.31</u>	<u>66.08%</u>

2. 债券（不包括国债）合计

截止 2002 年 12 月 31 日,基金持有的债券(不含应收利息)合计为 191,501,340.80 元, 占基金资产净值的 10.42%。

3. 国债、货币资金合计

截止 2002 年 12 月 31 日,基金持有的国债（不含应收利息）及货币资金合计为 431,404,335.51 元, 占基金资产净值的 23.47%。

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	12,795,000	168,510,150.00	9.17%
2	烟台万华	6,736,410	75,178,335.60	4.09%
3	中化国际	6,705,303	59,274,878.52	3.22%
4	恒瑞医药	5,392,884	55,492,776.36	3.02%
5	同 仁 堂	3,179,822	55,201,709.92	3.00%
6	宝钢股份	11,120,200	45,704,022.00	2.49%
7	盐田港 A	2,717,317	40,243,464.77	2.19%
8	招商银行	4,471,109	36,439,538.35	1.98%
9	双汇发展	3,300,000	34,056,000.00	1.85%
10	茉 织 华	3,053,095	32,240,683.20	1.75%
11	振华港机	2,925,288	30,920,294.16	1.68%
12	外运发展	1,871,019	30,329,217.99	1.65%
13	海螺水泥	4,300,000	27,520,000.00	1.50%
14	丽珠集团	3,099,479	27,120,441.25	1.48%
15	上海机场	2,900,000	26,187,000.00	1.42%
16	广电信息	2,408,500	26,180,395.00	1.42%
17	珠海中富	3,313,433	25,546,568.43	1.39%
18	许继电气	2,912,036	22,713,880.80	1.24%
19	华能国际	2,000,000	22,380,000.00	1.22%
20	扬子石化	3,950,777	18,489,636.36	1.01%
21	国电电力	2,400,354	17,306,552.34	0.94%
22	招商局 A	1,781,589	15,980,853.33	0.87%
23	海油工程	1,081,251	15,159,139.02	0.82%
24	申能股份	1,518,169	14,650,330.85	0.80%
25	兖州煤业	1,781,615	14,520,162.25	0.79%
26	强生控股	1,687,300	13,397,162.00	0.73%
27	三 爱 富	1,234,000	13,277,840.00	0.72%
28	威孚高科	1,342,628	12,862,376.24	0.70%
29	云铝股份	1,523,555	12,310,324.40	0.67%
30	上菱电器	1,029,603	11,305,040.94	0.61%
31	华菱管线	2,300,000	10,971,000.00	0.60%
32	中原油气	1,114,534	10,365,166.20	0.56%
33	五 粮 液	880,000	10,225,600.00	0.56%

34	上海能源	981,427	10,177,397.99	0.55%
35	青旅控股	1,061,725	10,086,387.50	0.55%
36	光明乳业	835,767	9,469,240.11	0.51%
37	中国联通	3,375,595	9,147,862.45	0.50%
38	华联商厦	1,174,548	8,867,837.40	0.48%
39	辽河油田	1,200,972	8,731,066.44	0.47%
40	中远航运	953,083	8,596,808.66	0.47%
41	华泰股份	678,503	8,515,212.65	0.46%
42	中兴通讯	655,202	8,491,417.92	0.46%
43	厦门建发	808,102	8,129,506.12	0.44%
44	万 科 A	836,939	8,009,506.23	0.44%
45	青岛啤酒	869,851	6,819,631.84	0.37%
46	巴士股份	1,161,772	6,227,097.92	0.34%
47	红星发展	293,367	5,447,825.19	0.30%
48	中联重科	583,033	5,282,278.98	0.29%
49	华联超市	396,940	4,961,750.00	0.27%
50	益民百货	499,400	4,934,072.00	0.27%
51	盐湖钾肥	340,923	4,588,823.58	0.25%
52	江苏舜天	306,359	3,284,168.48	0.18%
53	云 天 化	366,432	3,217,272.96	0.17%
54	新 世 界	450,800	3,128,552.00	0.17%
55	北京巴士	252,804	3,117,073.32	0.17%
56	新 黄 浦	339,483	3,058,741.83	0.17%
57	上海汽车	441,200	3,013,396.00	0.16%
58	宇通客车	216,879	2,678,455.65	0.15%
59	中信证券	586,000	2,637,000.00	0.14%
60	格力电器	287,777	2,345,382.55	0.13%
61	上港集箱	136,400	2,272,424.00	0.12%
62	伊利股份	105,273	1,863,332.10	0.10%
63	张 裕 A	101,798	1,486,250.80	0.08%
64	中国凤凰	300,000	1,464,000.00	0.08%
65	长江通信	100,000	1,260,000.00	0.07%
66	上海建工	150,000	1,219,500.00	0.07%
67	上海航空	173,000	1,127,960.00	0.06%
68	北 大 荒	168,000	984,480.00	0.05%
69	通化东宝	109,920	910,137.60	0.05%
70	神火股份	84,486	909,914.22	0.05%
71	模塑科技	74,600	851,932.00	0.05%
72	皖通高速	373,000	820,600.00	0.04%
73	天 士 力	42,100	755,274.00	0.04%
74	湘电股份	70,000	699,300.00	0.04%
75	中天科技	65,000	677,950.00	0.04%
76	腾达建设	58,000	555,060.00	0.03%
77	法拉电子	36,000	470,880.00	0.03%

78	华阳科技	28,000	332,640.00	0.02%
79	康缘药业	21,000	293,370.00	0.02%
80	方兴科技	23,000	269,100.00	0.01%
81	时代新材	19,000	261,630.00	0.01%
82	厦门钨业	8,531	130,865.54	0.01%
83	迪马股份	7,000	127,400.00	0.01%
84	第一投资	6,000	57,060.00	0.00%
合计			1,214,825,366.31	66.08%

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（或最近交易日）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 2002 年 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为借方余额 593,134.23 元，与债券（不包括国债）市值 191,501,340.80 元、股票市值 1,214,825,366.31 元和国债及货币资金 431,404,335.51 元相加后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收利息、深交所交易保证金、其他应收款、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、预提费用以及其他应付款等。

(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	丽珠集团	-	4,014,697	-	915,218
2	中国凤凰	-	300,000	-	-
3	威孚高科	-	1,342,628	-	-
4	格力电器	-	596,126	-	308,349
5	珠海中富	-	3,367,133	-	53,700
6	模塑科技	-	-	74,600	-
7	云铝股份	-	685,900	837,655	-
8	辽河油田	-	1,450,928	-	249,956
9	五 粮 液	-	880,000	-	-
10	扬子石化	-	3,950,777	-	-
11	张 裕 A	-	101,798	-	-
12	华菱管线	-	1,020,663	7,406,700	6,127,363
13	中原油气	-	1,224,534	-	110,000
14	上海机场	-	3,160,741	-	260,741
15	皖通高速	373,000	-	-	-
16	宝钢股份	-	11,120,200	-	-
17	中信证券	586,000	-	-	-
18	招商银行	3,471,109	1,493,870	-	493,870

19	中国联通	6,070,214	-	-	2,694,619
20	宇通客车	-	216,879	-	-
21	上海汽车	-	911,200	-	470,000
22	上海建工	-	230,000	-	80,000
23	华泰股份	-	678,503	-	-
24	振华港机	-	3,020,288	-	95,000
25	红星发展	-	293,367	-	-
26	北京巴士	-	272,804	-	20,000
27	湘电股份	70,000	-	-	-
28	中远航运	174,000	1,141,183	-	362,100
29	时代新材	19,000	-	-	-
30	腾达建设	58,000	-	-	-
31	第一投资	6,000	-	-	-
32	中天科技	65,000	-	-	-
33	华阳科技	28,000	-	-	-
34	天士力	41,000	6,100	-	5,000
35	厦门钨业	14,000	-	-	5,469
36	方兴科技	23,000	-	-	-
37	康缘药业	21,000	-	-	-
38	法拉电子	36,000	-	-	-
39	迪马股份	7,000	-	-	-
40	海油工程	16,000	1,145,251	-	80,000
41	海螺水泥	111,000	4,918,252	-	729,252
42	上海航空	273,000	-	-	100,000
43	光明乳业	214,000	721,767	-	100,000
44	北大荒	168,000	-	-	-
45	青岛啤酒	-	1,005,601	-	135,750
46	新世界	-	460,800	40,000	50,000
47	华联商厦	-	1,252,690	-	78,142
48	三爱富	-	1,160,580	153,420	80,000
49	新黄浦	-	339,483	-	-
50	巴士股份	-	951,532	210,240	-
51	国电电力	-	1,532,064	868,290	-
52	益民百货	-	656,200	-	156,800
53	华联超市	-	396,940	-	-
54	上菱电器	-	1,158,600	71,003	200,000
55	通化东宝	-	109,920	-	-
56	伊利股份	-	70,273	135,000	100,000

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	深能源A	396,003	-	396,003

2	粤电力A	-	1,010,000	1,010,000
3	鲁 泰 A	527,273	-	527,273
4	湘计算机	-	344,788	344,788
5	银河科技	-	248,688	248,688
6	吉电股份	-	228,000	228,000
7	法 尔 胜	135,400	-	135,400
8	通海高科	60,000	-	60,000
9	中海发展	-	272,000	272,000
10	中国石化	1,600,000	-	1,600,000
11	广州控股	1,228,309	200,000	1,428,309
12	营 口 港	-	60,000	60,000
13	大厦股份	-	31,000	31,000
14	山东基建	-	228,000	228,000
15	亚宝药业	-	22,000	22,000
16	旭光股份	-	14,000	14,000
17	精伦电子	-	17,000	17,000
18	承德钒钛	-	115,000	115,000
19	江西铜业	130,000	-	130,000
20	华冠科技	-	26,000	26,000
21	宝光股份	125,000	-	125,000
22	金瑞科技	7,000	-	7,000
23	安源股份	-	93,000	93,000
24	华鲁恒升	-	52,000	52,000
25	宝钛股份	-	49,000	49,000
26	扬农化工	-	15,000	15,000
27	长江股份	-	33,000	33,000
28	科达机电	-	7,000	7,000
29	宏智科技	-	33,000	33,000
30	西昌电力	-	63,000	63,000
31	香梨股份	105,000	-	105,000
32	天富热电	-	6,000	6,000
33	黑 牡 丹	-	16,000	16,000
34	国药股份	-	41,000	41,000
35	海龙科技	-	77,000	77,000
36	贵州茅台	804,554	105,000	909,554
37	三佳模具	47,000	280,000	327,000
38	贵航股份	99,000	-	99,000
39	长园新材	-	10,000	10,000
40	菲达环保	-	28,000	28,000
41	山东药玻	-	34,000	34,000
42	豫光金铅	-	36,000	36,000
43	栖霞建设	-	3,000	3,000
44	中软股份	-	18,000	18,000
45	狮头股份	128,000	-	128,000

46	深 高 速	1,406,900	-	1,406,900
47	科大创新	-	11,000	11,000
48	太行股份	-	47,000	47,000
49	裕丰股份	-	28,000	28,000
50	金自天正	-	13,000	13,000
51	江西长运	-	11,000	11,000
52	信 雅 达	-	6,000	6,000
53	精达股份	-	6,000	6,000
54	京能热电	-	98,000	98,000
55	黄海股份	-	41,000	41000
56	卧龙科技	-	36,000	36,000
57	八一钢铁	-	186,000	186,000
58	天地科技	-	31,000	31,000
59	金晶科技	-	14,000	14,000
60	新华医疗	-	7,000	7,000
61	泰豪科技	-	26,000	26,000
62	龙溪股份	-	29,000	29,000
63	大连圣亚	-	17,000	17,000
64	中孚实业	-	36,000	36,000
65	友谊股份	-	190,000	190,000
66	上海医药	680,544	-	680,544
67	内蒙华电	-	994,170	994,170

六． 基金持有人结构及前十名持有人

截止 2002 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	中海信托	21,094,652	1.05%
2	中国人保	19,732,991	0.99%
3	上海国投	18,000,000	0.90%
4	长江证券	12,959,500	0.65%
5	华安基金	12,000,000	0.60%
6	沈玉芳	9,880,000	0.49%
7	云天股份	6,342,400	0.32%
8	天同证券	6,000,000	0.30%
9	辛岩	5,990,000	0.30%
10	潘振禄	5,591,700	0.28%

注：上述有关持有人数据是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司传送的截止 2002 年 12 月 31 日基金安信前 100 名持有人名册统计得出。

七. 重要事项揭示

1. 本基金管理人、托管人在本期内未发生任何诉讼事项；

2. 本基金本期不分配；

3. 华安基金管理有限公司第二届董事会以书面表决方式审议通过,同意聘请尚健先生担任公司副总经理职务。上述事项已按规定报经中国证监会证监基金字[2002]17 号文核准任职资格和中共上海市金融工作委员会沪金融工委干[2002]3 号文同意；

4. 本基金原聘请的会计师事务所为“大华会计师事务所有限公司”。经中国财政部（财会[2001]1020 号）与外经贸部（资审字[2001]0086 号）批准，原大华会计师事务所与安永会计师事务所合作组成的安永大华会计师事务所已于二零零二年一月二十八日在上海正式成立并领得相关的营业执照。二零零二年四月八日，经中国财政部和中国证券监督管理委员会同意，“将原大华会计师事务所证券许可证中会计事务所名称变更为安永大华会计师事务所”。由于上述变更事项，本基金的会计师事务所由变更后的“安永大华会计师事务所有限责任公司”继任。

5. 2002 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
大鹏证券有限责任公司	332,508,470.75	20.10%	248,254.91	20.09%
招商证券股份有限公司	311,918,147.93	18.85%	230,899.47	18.69%

海通证券股份有限公司	221,953,048.32	13.41%	170,115.66	13.77%
申银万国证券股份有限公司	202,843,457.25	12.26%	158,728.88	12.84%
上海证券有限责任公司	168,018,863.34	10.16%	123,314.87	9.98%
国信证券有限责任公司	125,923,536.68	7.61%	96,992.12	7.85%
光大证券有限责任公司	116,420,326.53	7.04%	73,329.65	5.93%
南方证券股份有限公司	98,185,052.64	5.93%	76,830.91	6.22%
天同证券有限责任公司	76,828,794.27	4.64%	57,193.69	4.63%
合 计	<u>1,654,599,697.71</u>	<u>100.00%</u>	<u>1,235,660.16</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
光大证券有限责任公司	1,453,415,252.20	22.92%	743,300,000.00	19.26%
招商证券股份有限公司	1,300,466,446.30	20.51%	1,171,800,000.00	30.36%
上海证券有限责任公司	1,217,779,320.80	19.20%	200,000,000.00	5.18%
大鹏证券有限责任公司	1,044,124,469.70	16.47%	869,500,000.00	22.53%
海通证券股份有限公司	590,218,989.10	9.31%	610,000,000.00	15.81%
天同证券有限责任公司	375,010,861.20	5.91%	204,800,000.00	5.31%
国信证券有限责任公司	348,958,427.50	5.50%	60,000,000.00	1.55%
申银万国证券股份有限公司	11,374,968.00	0.18%	-	-
合 计	<u>6,341,348,734.80</u>	<u>100.00%</u>	<u>3,859,400,000.00</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. 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

华安基金管理有限公司

二零零三年三月二十九日