

安 信 证 券 投 资 基 金

2002 年度中期报告

华安基金管理有限公司

2002 年 8 月 29 日

重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2002 年 8 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: 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

项目	2002 年 1-6 月
基金本期净收益	70,057,191.25 元
单位基金本期净收益	0.0350 元
基金可分配净收益	94,192,250.40 元
单位基金可分配净收益	0.0471 元
期末基金资产总值	2,166,680,963.54 元
期末基金资产净值	2,135,687,517.08 元
期末单位基金资产净值	1.0678 元
基金资产净值收益率	3.43%
本期基金资产净值增长率	4.22%
累计资产净值增长率	126.34%

上述部分指标计算公式:

1. 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
2. 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
3. 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 6 月 30 日, 本基金单位资产净值为 1.0678 元, 比 2001 年底单位资产净值增长 4.22%。上半年基金安信实现净收益达 7,006 万元。

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

上半年回顾

由于 2001 年市场较大程度地释放了系统性风险，2002 年上半年的证券市场，在年初中央金融工作会议“循序渐进、稳步发展、规范监管”方针的指导下，相应进入了温和的平衡市。一系列有利于证券市场长期发展的举措相继出台，表明管理层对发展证券市场的战略性认识又上了一个新的高度，与之相应，投资者信心开始逐步恢复。由于市场环境的变化，市场参与各方的投资理念和投资行为也出现了较为明显的变化：第一，投资者的投资行为日趋理性、成熟，个股差异性开始显现；第二，流动性管理受到机构投资者的高度重视；第三，创新的步伐加快，如合资、QFII、ETFs 等概念的引入与讨论。在管理层维护稳定、促进监管、在发展中解决问题的核心思想支持下，预示 2002 年所形成的新变化将很有可能在一段时间内主导市场的投资理念和行为。

针对上半年的市场新变化，我们在坚持精选个股、集中投资的基础上，加强了投资组合的流动性管理。在整体机会不多的情况下，严格控制投资成本，增加操作的频率。由于对成长性的过于苛求，客观上增加了选股的难度。而调整力度的不足及组合结构没有迎合市场的需求，使得本基金没能取得预期的业绩。在具体操作上，我们重点做了以下工作：

第一，分红和分红后的仓位风险控制。2001 年，基金安信单位分红高达 0.23 元，总额 4.6 亿元的分红占当时基金净值的 18.11%。在年初市场环境仍不明朗、行情持续探底的情况下，基金仓位风险凸现，为此我们采取了减仓策略以控制风险。而两会期间，在我们判断稳定将成为年内证券市场发展主线后，果断增仓，较好的抓住了年初的投资机会。

第二，投资组合的调整和完善。基金安信的运作已达 4 年，在众多基金中已属老基金，一定程度上存在着品种老化的问题，必须进行调整和完善，为下一轮增长储备能量。由于调整力度不够，导致在行情上升时仍有一定的“无效仓位”，削弱了投资组合的上升潜力，特别是 6.24 突发性行情后更为明显。

第三，继续加强国债等债券品种的投资和研究。因受降息预期，上半年国债市场再度成为场外资金追逐的场所，本基金也取得了较好的回报。

下半年展望

我们认为下半年证券市场的运行环境仍将比较平稳。国民经济的平稳增长和机构投资者队伍的不断壮大，将进一步增强市场的信心，上市公司有可能顺利渡过政策调整而形成的盈利低谷，增大个股的投资价值，另外，特定行业的重整将

提供比较大的投资机会。当然，我们将加强对一些制约行情向纵深发展的不利因素的分析判断。

考虑到公司管理的基金资产规模不断扩大，我们将积极探索精选个股加组合投资的投资模式，以期在效益和效率上有所提升。

（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”的公司理念，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。

内部监察工作报告

2002年是我公司规范发展的“整固年”。在上半年里，我们依照公司内部控制的整体要求，继续加强实施了内部风险的控制与防范、业务规范流程的修改与完善、业务合规性的操作与检查等多项公司内部控制整固工作。

本报告期间，基金管理人进一步完善了内部风险控制的组织体系。整合扩大了风险控制委员会组成成员，成员广泛性的增强使得各业务环节可能出现的风险能被及时提出讨论、并商讨解决方案。二会一部的组织架构（风险控制委员会、投资决策委员会和监察稽核部），从制度上确保了公司内部风险控制工作的有序开展。

在报告期内，我们对以下方面着重实施了监察和稽核工作：

一、对基金安信日常投资运作合法性、合规性实施监察

监察稽核人员以现行的法律法规政策、基金契约及公司内部投资管理制度中对基金投资的各项规定为依据，每日对基金交易行为进行事前、事中及事后的监控，即在交易系统中对投资禁止行为进行设置作为事前监控，每日不定时进入交易系统查看交易合规情况作为事中监控，每日交易结束后检查交易结果作为事后监控。监察内容主要包括：基金安信投资遵循既定投资规范与业务流程、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，基金安信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，保障了基金持有人的利益。

二、加强对公司各部门业务规范与流程、内部控制制度完善情况及日常执行情况的稽核工作，完善监察稽核制度建设

公司成立已逾四载，伴随业务拓展，人员激增，特别是随着开放式基金的发行，公司原有规章制度已日渐显现出与公司发展不相适应之处，因此要求各部门对规章制度、业务流程进行大规模的修订和完善，并更新各部门内部控制制度。监察稽核部则通过每月实地检查形式，逐一对各部门规范流程的修改情况进行检查。

结合公司发展的实际情况，监察稽核部在本报告期间，从合法合规角度，对公司各业务部门实施月度例行监察，参与防范化解公司运营、基金运作中可能存在各类风险的工作。当发现违规隐患时，及时通过电话提醒、监察谈话、监察通知、内控通知、每月监察反馈表等多种形式向当事方提出整改意见、并敦促实施与后续跟踪；通过监察稽核报告报送公司管理层和上级监管部门；当发现基金或公司有重大违规行为时，立刻向中国证监会和董事会进行报告。本报告期间未发现基金安信存在重大违规情况。

四. 基金年度中期财务报告

(一) 基金会计报告书（未经审计）

安信证券投资基金
资产负债表
2002 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年 6 月 30 日	2001 年 12 月 31 日
银行存款		253,514,712.92	656,173,350.20
清算备付金		21,192,704.43	22,014,256.85
交易保证金	3(1)	1,000,000.00	1,250,000.00
应收证券清算款	3(2)	-	5,417,238.43
应收股利		-	-
应收利息	3(3)	8,286,267.60	1,685,978.00
其他应收款		-	-
股票投资市值	1(4)	1,262,045,837.60	1,231,312,847.59
其中：股票投资成本	1(6)	1,222,409,673.94	1,211,205,977.99
债券投资市值	1(4)	619,904,421.70	848,514,849.60
其中：债券投资成本	1(6)	618,045,318.68	849,490,838.95
配股权证	1(4)	-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用	3(4)	737,019.29	-
其他资产		-	-
资产总计		2,166,680,963.54	2,766,368,520.67
应付证券清算款	3(5)	26,276,967.94	58,516,615.52
应付管理人报酬		2,503,288.65	3,200,985.29
应付托管费		417,214.79	533,497.56
应付佣金		347,783.20	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	3(7)	198,191.88	-
其他负债		-	-
负债合计		30,993,446.46	264,114,489.79
实收基金		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得		41,495,266.68	19,130,880.25
未分配收益		94,192,250.40	483,123,150.63
持有人权益合计		2,135,687,517.08	2,502,254,030.88
负债及持有人权益总计		2,166,680,963.54	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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年 1-6 月	2001 年 1-6 月
一、收入		93,383,285.24	398,907,653.32
1、股票差价收入	1(5)	30,282,909.70	369,218,572.38
2、债券差价收入	1(5)	40,269,905.77	3,279,230.14
3、债券利息收入	1(5)	13,640,630.52	9,104,502.35
4、存款利息收入	1(5)	3,150,468.15	4,840,392.08
5、股利收入	1(5)	5,295,967.26	11,590,350.82
6、买入返售证券收入	1(5)	513,960.00	128,219.18
7、其他收入	3(8)	229,443.84	746,386.37
二、费用		23,326,093.99	37,876,883.28
1、基金管理人报酬	2(4)	17,014,550.21	24,761,207.69
2、基金托管费	2(4)	2,835,758.38	4,126,867.92
3、卖出回购证券支出		2,144,855.60	5,135,710.17
4、利息支出		-	-
5、其他费用	3(9)	1,330,929.80	3,853,097.50
其中：上市年费		29,753.31	60,000.00
信息披露费		408,603.31	220,000.00
审计费用		149,588.57	100,000.00
三、基金净收益		70,057,191.25	361,030,770.04
加：未实现利得	3(10)	23,376,294.95	-273,307,808.20

四、基金经营业绩	93,433,486.20	87,722,961.84
安信证券投资基金		
收益分配表		
2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日		

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年 1-6 月	2001 年 1-6 月
本期基金净收益		70,057,191.25	361,030,770.04
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	3(10)	1,011,908.52	-
可供分配基金净收益		554,192,250.40	1,519,905,393.80
减：本期已分配基金净收益	1(8)	460,000,000.00	1,150,000,000.00
期末基金净收益		94,192,250.40	369,905,393.80

安信证券投资基金

净值变动表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年 1-6 月
一、期初基金净值		2,502,254,030.88
二、本期经营活动：		
基金净收益		70,057,191.25
未实现利得	3(10)	23,376,294.95
经营活动产生的基金净值变动数		93,433,486.20
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
四、期末基金净值		2,135,687,517.08

(二) 会计报告书附注

1、主要会计政策

(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 6 月 30 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未上市流通的证券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;
- c. 已发行未上市的债券, 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、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。

(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 %。

(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 上海证券有限责任公司	基金托管人 与管理公司属同 一股东*	提取托管费 租用交易席位	基金契约 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 1-6 月的股票交易情况:

关 联 人	1-6 月股票成交量	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
上海证券有限责任公司	168,018,863.34	19.19%	123,314.87	18.98%	0.07%
申银万国证券股份有限公司	114,881,907.01	13.12%	89,896.87	13.83%	0.08%
天同证券有限责任公司	55,551,512.58	6.34%	43,067.65	6.63%	0.08%
合计	<u>338,452,282.93</u>	<u>38.65%</u>	<u>256,279.39</u>	<u>39.44%</u>	

②本基金通过关联人席位 2002 年 1-6 月的债券及回购交易情况:

关 联 人	1-6 月债券成交量	占成交总量 比例	1-6 月回购成交量	占成交总量 比例
上海证券有限责任公司	1,217,779,320.80	34.66%	200,000,000.00	8.47%
天同证券有限责任公司	248,467,658.50	7.07%	-	-

合计	<u>1,466,246,979.30</u>	<u>41.73%</u>	<u>200,000,000.00</u>	<u>8.47%</u>
----	-------------------------	---------------	-----------------------	--------------

(3) 本基金与关联人 2002 年 1-6 月未进行银行间市场债券买卖交易和银行间市场债券回购交易。

(4) 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 1 月 1 日至 6 月 30 日, 管理人收取的基金管理费金额为 17,014,550.21 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 1 月 1 日至 6 月 30 日, 托管人收取的基金托管费金额为 2,835,758.38 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	1,000,000.00	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	-	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>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	120,507.56	220,772.52
债券利息	<u>8,165,760.04</u>	<u>1,465,205.48</u>
合计	<u>8,286,267.60</u>	<u>1,685,978.00</u>

(4) 待摊费用：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：上市年费、信息披露费、审计费用和律师费等。

明细项目	期末数	期初数
上市年费	30,246.69	-
分红手续费	<u>706,772.60</u>	-
合计	<u>737,019.29</u>	

(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	25,096,365.22	58,516,615.52
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	<u>1,180,602.72</u>	-
合计	<u>26,276,967.94</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：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：上市年费、信息披露费、审计费用和律师费等。

明细项目	期末数	期初数
信息披露费	48,603.31	-
审计费	<u>149,588.57</u>	-
合计	<u>198,191.88</u>	

(8) 其他收入：

明细项目	本期数	上期数
新股手续费返还	114,826.70	192,206.49
配股手续费返还	-	41,138.00
债券手续费返还	110,000.00	497,695.00
印花税返还	<u>4,617.14</u>	<u>15,346.88</u>

合计	229,443.84	746,386.37
(9) 其他费用:		
明细项目	本期数	上期数
返售与回购交易费用	53,500.00	14,697.50
上市年费	29,753.31	60,000.00
审计费	149,588.57	100,000.00
信息披露费	408,603.31	220,000.00
红利发放手续费	673,227.40	3,450,000.00
其他费用	16,257.21	8,400.00
合计	1,330,929.80	3,853,097.50

(10) 以前年度损益调整:

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。其主要影响是导致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，利息收入由收到时确认变更为在债券持有期内逐日计提。本基金于 2002 年 1 月 1 日起采用变更后的会计政策，且不对以前各期的会计报表进行追溯调整。

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。此次变更影响数为：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，未实现利得和债券估值增值分别调减人民币 1,011,908.52 元。上述会计政策的变更将不对基金资产净值产生影响。本期基金经营业绩表和基金净值变动表中未实现利得已考虑了此次调整的影响。

明细项目	本期数	上期数
交易所债券价息分离调整	1,011,908.52	-

(三) 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 6 月 30 日估值时，已上市但流通受限的新股估值增值额为 14,370,391.26 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	通海高科	00-07-06	待定	60,000	1,012,800.00	1,012,800.00	待定*
2	招商银行	02-04-01	02-04-09	3,471,109	25,339,095.70	39,709,486.96	上市日起 8 个月
3	安源股份	02-06-20	02-07-02	93,000	557,070.00	557,070.00	上市日起流通
4	泰豪科技	02-06-24	02-07-03	26,000	123,760.00	123,760.00	上市日起流通
5	宏智科技	02-06-27	02-07-09	33,000	286,440.00	286,440.00	上市日起流通

合 计 27,319,165.70 41,689,556.96

*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

序号	分 类	市 值 (元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	1,360,800.00	0.06%
B	采掘业	17,853,528.68	0.84%
C	制造业	791,170,241.76	37.04%
C0	其中：食品、饮料	39,678,457.72	1.86%
C1	纺织、服装、皮毛	277,031,803.08	12.97%
C2	木材、家具	----	----
C3	造纸、印刷	----	----
C4	石油、化学、塑胶、塑料	102,324,602.84	4.79%
C5	电子	58,069,726.00	2.72%
C6	金属、非金属	91,279,823.37	4.27%
C7	机械、设备、仪表	76,970,622.19	3.60%
C8	医药、生物制品	145,815,206.56	6.83%
C99	其他	----	----
D	电力、煤气及水的生产和供应业	119,235,500.61	5.58%
E	建筑业	----	----
F	交通运输、仓储业	135,820,729.91	6.36%
G	信息技术业	53,977,236.84	2.53%
H	批发和零售贸易	62,012,298.94	2.90%
I	金融、保险业	39,709,486.96	1.86%
J	房地产业	----	----
K	社会服务业	40,906,013.90	1.92%
L	传播与文化产业	----	----
M	综合类	----	----
	合 计	<u>1,262,045,837.60</u>	<u>59.09%</u>

2. 债券（不包括国债）合计

截止 2002 年 6 月 30 日，基金持有的债券（不含应收利息）合计为 144,584,190.40 元，占基金资产净值的 6.77%。

3. 国债、货币资金合计

截止 2002 年 6 月 30 日，基金持有的国债（不含应收利息）及货币资金合计为 723,750,680.71 元，占基金资产净值的 33.89%。

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	10,662,500	200,561,625.00	9.39%
2	烟台万华	6,333,365	90,693,786.80	4.25%
3	茉 织 华	4,429,232	76,138,498.08	3.57%
4	同 仁 堂	3,645,774	69,561,367.92	3.26%
5	恒瑞医药	4,855,000	63,551,950.00	2.98%
6	广电信息	3,961,100	58,069,726.00	2.72%
7	中化国际	3,699,171	56,005,448.94	2.62%
8	盐田港 ^A	3,184,807	53,218,124.97	2.49%
9	外运发展	2,780,640	51,719,904.00	2.42%
10	华能国际	3,569,304	51,326,591.52	2.40%
11	中兴通讯	2,013,809	48,250,863.64	2.26%
12	宝钢股份	8,700,000	40,455,000.00	1.89%
13	招商银行	3,471,109	39,709,486.96	1.86%
14	申能股份	2,865,869	38,288,009.84	1.79%
15	双汇发展	2,996,202	37,991,841.36	1.78%
16	许继电气	2,862,036	31,940,321.76	1.50%
17	海螺水泥	3,038,017	24,942,119.57	1.17%
18	强生控股	1,561,560	18,051,633.60	0.85%
19	国电电力	1,100,415	17,661,660.75	0.83%
20	上港集箱	846,800	16,876,724.00	0.79%
21	青旅控股	1,211,725	15,582,783.50	0.73%
22	云铝股份	1,437,655	14,894,105.80	0.70%
23	振华港机	988,200	13,222,116.00	0.62%
24	丽珠集团	1,185,984	12,701,888.64	0.59%
25	中联重科	835,510	12,307,062.30	0.58%
26	海油工程	716,000	12,229,280.00	0.57%
27	威孚高科	1,000,000	11,760,000.00	0.55%
28	招商局 ^A	899,499	11,747,456.94	0.55%
29	华菱管线	1,813,300	10,988,598.00	0.51%
30	内蒙华电	994,170	8,997,238.50	0.42%
31	盐湖钾肥	546,638	8,516,620.04	0.40%
32	巴士股份	1,035,840	7,271,596.80	0.34%
33	上菱电器	536,089	7,060,292.13	0.33%
34	上海能源	413,852	5,624,248.68	0.26%
35	长江通信	218,840	4,427,133.20	0.21%
36	厦门建发	270,938	3,546,578.42	0.17%
37	云 天 化	278,800	3,114,196.00	0.15%
38	广州控股	200,000	2,962,000.00	0.14%
39	中远航运	174,000	2,258,520.00	0.11%
40	江苏舜天	129,953	1,931,101.58	0.09%
41	贵州茅台	45,683	1,686,616.36	0.08%
42	北 大 荒	168,000	1,360,800.00	0.06%

43	通海高科	60,000	1,012,800.00	0.05%
44	安源股份	93,000	557,070.00	0.03%
45	大厦股份	31,000	529,170.00	0.02%
46	黑牡丹	16,000	331,680.00	0.02%
47	宏智科技	33,000	286,440.00	0.01%
48	泰豪科技	26,000	123,760.00	0.01%
合计			1,262,045,837.60	59.09%

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 6 月 30 日，本基金其他应收应付款项为借方余额 5,306,808.37 元，与债券市值 144,584,190.40 元，股票市值 1,262,045,837.60 元和国债及货币资金 723,750,680.71 元合计后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收利息、深交所交易保证金、待摊费用、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。

(五) 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	-	1,991,202	-	805,218
2	威孚高科	-	1,000,000	-	-
3	云铝股份	-	600,000	837,655	-
4	华菱管线	-	300,000	7,406,700	5,893,400
5	宝钢股份	-	8,700,000	-	-
6	招商银行	3,471,109	-	-	-
7	振华港机	-	988,200	-	-
8	大厦股份	31,000	-	-	-
9	安源股份	93,000	-	-	-
10	中远航运	174,000	-	-	-
11	宏智科技	33,000	-	-	-
12	黑牡丹	16,000	-	-	-
13	海油工程	16,000	700,000	-	-
14	海螺水泥	111,000	2,927,017	-	-
15	泰豪科技	26,000	-	-	-
16	北大荒	168,000	-	-	-
17	巴士股份	-	825,600	210,240	-
18	国电电力	-	1,100,415	-	-
19	上菱电器	-	736,089	-	200,000
20	内蒙华电	-	994,170	-	-

新增股票附注：本表中“其他”项目包括“配转送增”。

(六) 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	万 科 ^A	910,200	331,200	1,241,400
2	深能源 ^A	396,003	-	396,003
3	粤电力 ^A	-	1,010,000	1,010,000
4	鲁 泰 ^A	527,273	-	527,273
5	湘计算机	-	344,788	344,788
6	银河科技	-	248,688	248,688
7	法 尔 胜	135,400	-	135,400
8	神火股份	16,700	-	16,700
9	中海发展	-	272,000	272,000
10	中国石化	1,600,000	-	1,600,000
11	兖州煤业	2,012,818	436,400	2,449,218
12	营 口 港	-	60,000	60,000
13	山东基建	-	228,000	228,000
14	精伦电子	-	17,000	17,000
15	江西铜业	130,000	-	130,000
16	宝光股份	125,000	-	125,000
17	金瑞科技	7,000	-	7,000
18	华鲁恒升	-	52,000	52,000
19	宝钛股份	-	49,000	49,000
20	扬农化工	-	15,000	15,000
21	长江股份	-	33,000	33,000
22	西昌电力	-	63,000	63,000
23	香梨股份	105,000	-	105,000
24	天富热电	-	6,000	6,000
25	三佳模具	47,000	280,000	327,000
26	贵航股份	99,000	-	99,000
27	山东药玻	-	34,000	34,000
28	栖霞建设	-	3,000	3,000
29	中软股份	-	18,000	18,000
30	狮头股份	128,000	-	128,000
31	深 高 速	1,406,900	-	1,406,900
32	京能热电	-	98,000	98,000
33	卧龙科技	-	36,000	36,000
34	天地科技	-	31,000	31,000
35	中孚实业	-	36,000	36,000
36	友谊股份	-	190,000	190,000
37	上海医药	680,544	-	680,544

五. 基金持有人结构及前十名持有人

截止 2002 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%
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	中国人保	19,732,991	0.99%
2	金华信托	19,134,523	0.96%
3	投资信托	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	建成租赁	10,955,800	0.55%
7	喻林林	10,722,100	0.54%
8	沈玉芳	9,880,000	0.49%
9	吉林龙源	7,470,000	0.37%
10	李治华	6,712,220	0.34%

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 6 月 30 日基金安信前 100 名持有人名册汇总统计而来。

六. 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. 本基金中期不分配, 纳入年末一次性分配;

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 1-6 月各券商股票、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
招商证券股份有限公司	192,820,036.85	22.02%	143,838.86	22.13%
上海证券有限责任公司	168,018,863.34	19.19%	123,314.87	18.98%
大鹏证券有限责任公司	138,394,063.99	15.80%	97,662.15	15.03%
申银万国证券股份有限公司	114,881,907.01	13.12%	89,896.87	13.83%
国信证券有限责任公司	87,073,148.77	9.94%	66,750.67	10.27%
南方证券股份有限公司	66,595,331.79	7.61%	52,111.66	8.02%
天同证券有限责任公司	55,551,512.58	6.34%	43,067.65	6.63%
光大证券有限责任公司	52,379,790.16	5.98%	33,228.80	5.11%
合 计	<u>875,714,654.49</u>	<u>100.00%</u>	<u>649,871.53</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
上海证券有限责任公司	1,217,779,320.80	34.66%	200,000,000.00	8.47%
大鹏证券有限责任公司	696,183,837.30	19.82%	869,500,000.00	36.84%
光大证券有限责任公司	575,967,532.30	16.39%	393,300,000.00	16.67%
招商证券股份有限公司	526,430,053.20	14.98%	897,300,000.00	38.02%
国信证券有限责任公司	248,742,604.80	7.08%	-	-
天同证券有限责任公司	248,467,658.50	7.07%	-	-
合 计	<u>3,513,571,006.90</u>	<u>100.00%</u>	<u>2,360,100,000.00</u>	<u>100.00%</u>

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. 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

二零零二年八月二十九日