

华安创新证券投资基金

2002 年中期报告

华安基金管理有限公司

2002 年 8 月 30 日

重要提示

本基金的托管人交通银行已于 2002 年 8 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	2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日
基金本期净收益	160,264,312.95 元
单位基金本期净收益	0.0354 元
基金可分配净收益	82,424,998.50 元
单位基金可分配净收益	0.0182 元
期末基金资产总值	5,128,053,261.03 元
期末基金资产净值	4,750,236,472.58 元
单位基金资产净值	1.050 元
基金资产净值收益率	3.16%
本期基金资产净值增长率	6.01%
累计资产净值增长率	7.28%

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：

2002 年上半年，华安创新基金单位净值增幅为 6.01%，同期上证指数上升了 5.27%，深圳综指上升了 6.52%，两个市场平均上涨 5.90%。华安创新以 0.11 个百分点的微弱优势跑赢大盘，实现了资产增值。从 2001 年 9 月 21 日正式开始投资运作以来，华安创新基金净值增长了 7.28%。在红利分配方面，基金上半年以 2002 年 6 月 14 日实收基金单位数为基数，向全体基金持有人按每 10 份基金单位派发现金红利 0.22 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，8 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）。8 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：经济学硕士，7 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

上半年的股票市场在重重分歧和矛盾中反复振荡，市场情绪两极分化。年初我们通过股票仓位控制降低基金的系统风险，减小了市场下跌时的基金净值损失。从 5 月份起，我们认识到，管理层不断强调市场的稳定、发展、规范，在市场扩容等敏感问题上体现了尊重市场的取向，市场环境进一步改善。基于以上认识，我们在市场下跌过程中稳步提高股票仓位，尽管在 6 月底的井喷行情中有所收获，但在上半年的操作中也有不少遗憾和失误：

1. 下跌中增仓速度较慢，面对突发行情，未能在相对低位完成预期建仓计划；
2. 个股选择上严格乃至过于谨慎，建仓股票数量还不够多，影响了建仓速度；
3. 在选股上强调防御性，不少股票在跌势中较抗跌，但在涨势中表现不突出；
4. 国债资产配置上有一定失误，未充分分享上半年国债市场的收益；

我们对下半年证券市场谨慎看好，操作上将更加积极。

继降印花税、降息、调整交易佣金、恢复二级市场市值配售等一系列稳定市场的措施之后，6 月 23 日国务院决定停止通过国内证券市场减持国有股，在一定程度上降低了市场的系统风险。我们认为基金作为专业投资者，在系统风险下降的市场中应有所作为，积极地通过组合投资分享行业和上市公司的增长。另外，停止向国内证券市场减持国有股，也将开辟国有股向外资等多种经济成份转让的途径，将上市公司并购和重组向广度和深度推进。

国内上半年 GDP 增长 7.8% 超出预期，令投资人受到鼓舞。在全球经济恢复和内需形成部分热点的背景下，汽车、机械、化工、造纸等不少行业的销售和利润出现了较快的增长。我们相信下半年宏观经济将继续支持证券市场稳步健康发展。当然，股票持续一年的调整使投资者信心受到了较大影响，需要一个恢复的

过程。在资金面上，我们认为目前基金业加速发展，为市场提供了稳定的增量资金。酝酿中的社保基金、保险资金和 QFII 入市，也将为市场开辟新的资金渠道。以上这些机构投资者对上市公司基本面的注重，有助于市场的投资理念进一步向价值推动型发展，流动性强的绩优成长性股票将更受青睐。当然，提高直接融资比例，发展资本市场，需要在货币市场和资本市场之间建立合法的连接渠道，我们在这方面早日有制度突破。我们认为加入 WTO 后，中国资本市场的发展前景将更加光明。即使在完全开放的资本市场，不同市场间由于经济增长和改革潜力不同、资金成本不同、以及持股成本的影响，市盈率会有很大的差异。我们如果忽视了经济增长和改革深化给中国资本市场带来的潜力，用一些不具可比性的简单数字来衡量中国市场的投资价值，可能会丧失通过证券投资分享中国经济成长的机会。

我们认为下半年国内股票市场将呈现平衡偏强的格局，值得关注的热点板块是外资并购和行业重整板块、经营业绩增长的行业和公司，以及新指数成份股。在投资风格上，我们将继续坚持组合投资、适度集中，以最大限度地分享创新类上市公司的成长潜力。同时，我们也将加强对行业和个股的前瞻性判断，适度平衡各行业和个股的投资比例，根据个股和行业基本面以及股价变化积极操作，继续探索投资方法和程序上的创新，如提高投资的时效性、灵活性，在精选个股无法充分分享行业成长的情况下，尝试更分散化的行业或板块组合投资。另外，从受托关系的责任和义务出发，我们也将更积极地代表基金投资者维护股东权益。

作为中国大陆第一只开放式基金的管理人，我们每天要直面为投资者创造财富的压力。我们将一如既往全身心地为广大投资者服务，争取取得更良好的投资回报。

（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、《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”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、对华安创新基金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：华安创新基金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，华安创新的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的各类风险的工作。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。本检查期间未发现华安创新证券投资基金存在重大违规情况。

四、基金财务报告

（一）基金会计报告书（未经审计）

1. 资产负债报告书

项 目	附注	2002 年6 月30 日	2001 年12 月31 日
银行存款		158,709,124.40	52,534,905.35
清算备付金		674,893,452.78	2,102,198,885.97
交易保证金		784,652.16	250,000.00
应收股利		395,478.11	--
应收利息	3(1)	21,598,156.16	10,872,224.44
应收申购款		1,337,186.75	3,476,550.60
股票投资市值		2,594,094,538.52	858,152,978.80
其中：股票投资成本		2,447,670,195.67	831,925,420.88
债券投资市值		1,675,804,516.70	2,083,747,773.60
其中：债券投资成本		1,673,411,468.59	2,081,814,081.25
待摊费用	3(2)	436,155.45	1,398,889.02
资产合计		<u>5,128,053,261.03</u>	<u>5,112,632,207.78</u>
应付证券清算款		49,728,464.18	21,250,997.92
应付赎回款		318,697,091.55	17,877,289.89
应付赎回费		353,361.56	38,819.08
应付管理人报酬		5,948,037.67	6,416,666.72

应付托管费		991,339.64	1,069,444.45
应付佣金		1,465,589.79	615,971.21
其他应付款		500,000.00	500,000.00
预提费用		132,904.06	150,000.00
负债合计		<u>377,816,788.45</u>	<u>47,919,189.27</u>
实收基金	3(3)	4,524,958,849.00	5,002,284,701.00
未实现利得	3(5)	142,852,625.08	27,982,340.04
未分配收益		82,424,998.50	34,445,977.47
持有人权益合计		<u>4,750,236,472.58</u>	<u>5,064,713,018.51</u>
基金份额		4,524,958,849	5,002,284,701
每份基金单位资产净值		1.050	1.012

2. 基金经营业绩报告书

项 目	附注	2002 年1 月1 日至 2002 年6 月30 日
股票差价收入	1(3)	84,714,142.19
债券差价收入	1(4)	53,588,694.25
股利收入		15,593,899.96
债券利息收入	1(5)	26,396,746.26
存款利息收入	1(5)	15,914,806.26
买入返售证券收入	1(5)	3,253,665.00
其他收入	3(4)	5,049,425.52
收入合计		<u>204,511,379.44</u>
基金管理人报酬	1(6)	36,802,813.74
基金托管费	1(7)	6,133,802.37
卖出回购证券支出		--
其他费用		1,310,450.38
其中：信息披露费		178,520.30
审计费用		74,383.76
费用合计		<u>44,247,066.49</u>
基金净收益		<u>160,264,312.95</u>
加：未实现估值增值变动数	1(3)(4)	120,656,140.69
基金经营业绩		280,920,453.64

3. 收益分配报告书

项 目	附注	2002 年1 月1 日至 2002 年6 月30 日
本期基金净收益		160,264,312.95
加：期初未分配收益		34,445,977.47
加：本期申购基金单位的损益平准金	1(10)	8,274,191.49
减：本期赎回基金单位的损益平准金	1(10)	17,194,482.47
可供分配基金净收益		185,789,999.44

减：本期已分配基金净收益	1(11)	103,365,000.94
期末未分配净收益		82,424,998.50

4. 基金净值变动报告书

项 目	附注	2002 年1 月1 日至 2002 年6 月30 日
一、期初基金净值		5,064,713,018.51
二、本期经营活动：		
基金净收益		160,264,312.95
未实现估值增值变动数		120,656,140.69
经营活动产生的基金净值变动数		280,920,453.64
三、本期基金单位交易：		
基金申购款		415,917,670.67
基金赎回款		-907,949,669.30
基金单位交易产生的基金净值变动数		-492,031,998.63
四、本期向持有人分配收益		-103,365,000.94
五、期末基金净值		4,750,236,472.58

(二) 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 2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 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。

(12) 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55 号文及[2001] 61 号文《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 0.2%缴纳证券（股票）交易印花税。

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

① 本基金通过关联人席位的股票成交量

关 联 人	交易量	占总交易量比例	佣金	占总佣金比例	平均佣金比例
申银万国证券股份有限公司	285,551,590.68	9.77%	221,910.58	10.18%	0.08%
东方证券有限责任公司	118,972,861.38	4.07%	93,097.08	4.27%	0.08%
合 计	404,524,452.06	13.84%	315,007.66	14.45%	0.08%

② 本基金通过关联人席位的债券和回购成交量

关 联 人	债券交易量	比例	回购交易量	比例
申银万国证券股份有限公司	245,783,257.20	2.11%	500,000,000.00	8.29%
东方证券有限责任公司	--	--	--	--
合 计	245,783,257.20	2.11%	500,000,000.00	8.29%

(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 36,802,813.74 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 6,133,802.37 元。

3. 主要报表项目说明

(1) 应收利息

项 目	2002 年 6 月 30 日
应收债券利息	21,072,878.95
应收清算备付金利息	485,834.01
应收银行存款利息	39,443.20
合 计	21,598,156.16

(2) 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 2002 年 6 月 30 日的摊销后余额为 436,155.45 元。

(3) 实收基金

	基金单位数	实收基金
期初数	5,002,284,701	5,002,284,701.00
加：本期申购	403,215,881	403,215,881.00
减：本期赎回	880,541,733	880,541,733.00
期末数	4,524,958,849	4,524,958,849.00

(4) 其他收入

其他收入主要包括按基金赎回款 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。

项 目	2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日
国债认购手续费返还	924,000.00
赎回基金补偿收入	3,631,799.54
新股申购手续费返还	493,625.98
合 计	5,049,425.52

(5) 未实现利得

项 目	2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日
期初未实现利得	27,982,340.04
加: 本期未实现估值增值变动数	120,656,140.69
加: 本期申购基金单位的未实现利得平准金	4,427,598.18
减: 本期赎回基金单位的未实现利得平准金	10,213,453.83
期末未实现利得	142,852,625.08

(三) 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

基金获配新股, 从新股获配日至新股上市日或在规定期间内, 为流通受限而不能自由转让的资产。

根据中国证监会的政策规定, 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账户, 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的申购协议的规定, 在约定期限内不能自由转让。

根据中国证监会 2002 年 5 月 20 日公布的“关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知”, 证券投资基金(包括开放式基金)可以参与申购和配售。

本基金截止 2002 年 6 月 30 日流通受限股票情况如下:

股票名称	申购确认日	上市日期	数量	成 本	市 值	流通受限期
招商银行	2002-4-1	2002-4-9	6,687,996	48,822,370.80	77,246,353.80	2002-4-9 起 8 个月
安源股份	2002-6-20	2002-7-2	74,000	443,260.00	443,260.00	2002-7-2 起流通
宏智科技	2002-6-27	2002-7-9	27,000	234,360.00	234,360.00	2002-7-9 起流通
泰豪科技	2002-6-24	2002-7-3	23,000	109,480.00	109,480.00	2002-7-3 起流通
合 计				49,609,470.80	78,033,453.80	

(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	67,763,949.25	1.43%
B	采掘业	121,440,163.59	2.56%
C	制造业	1,207,870,000.86	25.42%
C0	其中: 食品、饮料	143,198,070.50	3.01%
C1	纺织、服装、皮毛	54,724,670.26	1.15%
C2	木材、家具	205,080.00	0.00%
C3	造纸、印刷	57,636,867.58	1.21%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	152,537,818.00	3.21%
C5	电子	85,340,012.67	1.80%
C6	金属、非金属	239,674,232.87	5.05%
C7	机械、设备、仪表	383,502,571.65	8.07%
C8	医药、生物制品	91,050,677.33	1.92%
C99	其他	--	--
D	电力、煤气及水的生产和供应业	403,998,450.97	8.50%

E	建筑业	24,880,200.91	0.52%
F	交通运输、仓储业	345,734,046.88	7.28%
G	信息技术业	85,044,133.50	1.79%
H	批发和零售贸易	44,228,256.28	0.93%
I	金融、保险业	77,246,353.80	1.63%
J	房地产业	4,139,220.00	0.09%
K	社会服务业	180,286,055.04	3.80%
L	传播与文化产业	--	--
M	综合类	31,463,707.44	0.66%
合 计		2,594,094,538.52	54.61%

2、债券（不包括国债）合计

截止 2002 年 6 月 30 日，基金持有债券（不含应收利息）20,620,000.00 元，占基金资产净值的 0.43%。

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 2,439,058,629.70 元，占基金资产净值的 51.35%。

4. 基金投资股票明细

序号	股票名称	数 量	市 值	占净值比例
1	深能源A	24,126,971	258,399,859.41	5.44%
2	威孚高科	15,307,132	178,328,087.80	3.75%
3	巴士股份	21,207,228	150,571,318.80	3.17%
4	华能国际	8,603,344	124,748,488.00	2.63%
5	盐田港A	6,762,443	112,932,798.10	2.38%
6	宝钢股份	22,887,840	106,199,577.60	2.24%
7	上海机场	8,500,000	87,380,000.00	1.84%
8	烟台万华	6,107,912	86,549,113.04	1.82%
9	大显股份	11,363,517	85,340,012.67	1.80%
10	中兴通讯	3,554,475	84,809,773.50	1.79%
11	上菱电器	6,375,786	84,415,406.64	1.78%
12	招商银行	6,687,996	77,246,353.80	1.63%
13	吉林森工	6,611,117	67,763,949.25	1.43%
14	双汇发展	4,673,068	60,282,577.20	1.27%
15	赣粤高速	4,572,798	58,806,182.28	1.24%
16	上海能源	3,978,692	54,189,785.04	1.14%
17	海油工程	3,020,715	51,261,533.55	1.08%
18	云天化	4,380,420	49,235,920.80	1.04%
19	同仁堂	2,499,991	47,974,827.29	1.01%
20	宇通客车	2,751,433	40,913,808.71	0.86%
21	新钢钒	5,263,653	38,372,030.37	0.81%
22	云铝股份	3,494,472	36,097,895.76	0.76%
23	江汽股份	2,675,144	34,776,872.00	0.73%
24	华泰股份	1,990,601	31,610,743.88	0.67%

25	亚泰集团	4,023,492	31,463,707.44	0.66%
26	鲁 泰A	2,092,052	30,230,151.40	0.64%
27	南京水运	2,513,767	29,637,312.93	0.62%
28	燕京啤酒	2,791,053	28,747,845.90	0.61%
29	恒瑞医药	2,128,306	27,667,978.00	0.58%
30	晨鸣纸业	1,872,383	26,026,123.70	0.55%
31	海螺水泥	3,112,468	25,428,863.56	0.54%
32	上海建工	2,004,851	24,880,200.91	0.52%
33	华菱管线	3,703,452	22,368,850.08	0.47%
34	五 粮 液	1,362,096	21,357,665.28	0.45%
35	首创股份	1,474,748	20,882,431.68	0.44%
36	中远航运	1,590,450	20,755,372.50	0.44%
37	申达股份	1,700,374	18,517,072.86	0.39%
38	内蒙华电	2,021,708	18,235,806.16	0.38%
39	厦门建发	1,350,303	17,661,963.24	0.37%
40	中牧股份	1,553,566	17,135,832.98	0.36%
41	中原油气	1,501,300	15,988,845.00	0.34%
42	外运发展	848,274	15,726,999.96	0.33%
43	一汽四环	1,197,900	15,021,666.00	0.32%
44	草原兴发	1,612,986	14,500,744.14	0.31%
45	江苏舜天	959,901	14,206,534.80	0.30%
46	振华港机	1,000,000	13,510,000.00	0.28%
47	丽珠集团	1,200,000	13,104,000.00	0.28%
48	中化国际	753,432	11,542,578.24	0.24%
49	许继电气	1,001,785	11,320,170.50	0.24%
50	中集集团	603,515	10,682,215.50	0.22%
51	盐湖钾肥	646,164	10,144,774.80	0.21%
52	招商局A	707,200	9,193,600.00	0.19%
53	大众交通	739,724	8,832,304.56	0.19%
54	红星发展	264,532	6,608,009.36	0.14%
55	北京巴士	429,843	6,348,781.11	0.13%
56	茉 织 华	318,900	5,465,946.00	0.12%
57	深圳机场	300,000	4,953,000.00	0.10%
58	万 科A	300,000	3,963,000.00	0.08%
59	国电电力	161,876	2,614,297.40	0.06%
60	中联重科	161,500	2,403,120.00	0.05%
61	东阿阿胶	194,092	2,303,872.04	0.05%
62	天地科技	85,000	2,182,800.00	0.05%
63	伊利股份	57,100	1,173,405.00	0.02%
64	中孚实业	32,000	524,800.00	0.01%
65	黑 牡 丹	25,000	511,500.00	0.01%
66	农 产 品	25,000	444,500.00	0.01%
67	安源股份	74,000	443,260.00	0.01%
68	大厦股份	22,000	372,680.00	0.01%
69	宏智科技	27,000	234,360.00	0.00%

70	美克股份	12,000	205,080.00	0.00%
71	栖霞建设	9,000	176,220.00	0.00%
72	泰豪科技	23,000	109,480.00	0.00%
73	上海汽车	10,000	77,900.00	0.00%
	合 计		2,594,094,538.52	54.61%

5. 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场认购	二级市场买入	其他	
1	万 科 A		500,000		200,000
2	招商局A		1,623,066		915,866
3	中集集团		603,515		
4	深圳机场		300,000		
5	中联重科		161,500		
6	许继电气		1,001,785		
7	晨鸣纸业		1,872,383		
8	丽珠集团		1,200,000		
9	威孚高科		15,307,132		
10	云铝股份		1,520,000	1,974,472	
11	五 粮 液		1,287,096	75,000	
12	华菱管线		5,038,902	4,937,800	6,273,250
13	中原油气		1,721,300		220,000
14	首创股份		1,474,748		
15	宝钢股份		24,391,086		1,503,246
16	招商银行	6,687,996			
17	宇通客车		2,751,433		
18	南京水运		3,394,377		880,610
19	上海汽车		10,000		
20	厦门建发		1,651,916		301,613
21	上海建工		2,204,851		200,000
22	吉林森工		6,674,045		62,928
23	中牧股份		1,783,566		230,000
24	赣粤高速		4,790,617		217,819
25	外运发展		706,895	141,379	
26	江苏舜天		959,901		
27	华泰股份		1,990,601		
28	振华港机		1,100,000		100,000
29	大厦股份	22,000			
30	美克股份		10,000	2,000	
31	红星发展		264,532		
32	北京巴士		727,580		297,737
33	安源股份	74,000			
34	江汽股份		2,895,144		220,000
35	中远航运	229,000	1,361,450		
36	中化国际		753,432		

37	宏智科技	27,000			
38	黑 牡 丹	25,000			
39	栖霞建设	9,000			
40	天地科技	85,000			
41	海油工程	35,000	2,985,715		
42	海螺水泥	204,000	5,218,468		2,310,000
43	泰豪科技	23,000			
44	中孚实业	32,000			
45	大众交通		991,597		251,873
46	申达股份		1,831,974		131,600
47	巴士股份		16,890,228	4,908,014	591,014
48	一汽四环		1,197,900		-
49	大显股份		10,015,866	3,585,811	2,238,160
50	国电电力		161,876		
51	内蒙华电		2,102,908		81,200

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	期初结存	本期增加	本期卖出
1	湘计算机		2,758,304	2,758,304
2	银河科技		310,860	310,860
3	中海发展		715,000	715,000
4	中国石化	7,985,800	4,000,000	11,985,800
5	广州控股	1,100,867	270,766	1,371,633
6	兖州煤业	2,348,639	689,420	3,038,059
7	营 口 港		120,000	120,000
8	山东基建		491,000	491,000
9	精伦电子		27,000	27,000
10	江西铜业	1,389,000		1,389,000
11	鑫新股份		2,000	2,000
12	宝光股份	600,000		600,000
13	华鲁恒升		52,000	52,000
14	宝钛股份		139,000	139,000
15	扬农化工		19,000	19,000
16	长江股份		23,000	23,000
17	西昌电力		68,000	68,000
18	香梨股份	300,000		300,000
19	天富热电		16,000	16,000
20	三佳模具	197,000		197,000
21	山东药玻		44,000	44,000
22	中软股份		31,000	31,000
23	深 高 速	8,592,364		8,592,364
24	京能热电		120,000	120,000
25	卧龙科技		32,000	32,000
26	北 大 荒		337,000	337,000

27	金丰投资	3,200,000	3,200,000
28	中远发展	778,000	778,000
29	申能股份	5,360,000	5,360,000
30	兆维科技	400,600	400,600
31	友谊股份	380,000	380,000

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 2002 年 6 月 30 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 303,536,695.64 元。股票市值 2,594,094,538.52 元、债券市值（不含国债）20,620,000.00 元、国债及货币资金 2,439,058,629.70 元合计与其相减后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收股利、应收利息、应收基金申购款、待摊费用、应付基金赎回款、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。

五、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。
- 3、本基金于 2002 年 6 月 17 日公告实施分红，截止 2002 年 6 月 14 日本基金已实现的可分配收益为 10,785.75 万元，以 2002 年 6 月 14 日实收基金单位为基数，每 10 份基金单位派发现金红利 0.22 元，除息日为 2002 年 6 月 24 日。
- 4、本基金申购费率自 2002 年 6 月 10 日起调整如下：
 - 1) 单笔申购金额低于 100 万元（不含 100 万元）的，申购费率为申购金额的 1.50%；
 - 2) 单笔申购金额高于 100 万元（含 100 万元），且低于 1000 万元（不含 1000 万元）的，申购费率为申购金额的 1.20%；
 - 3) 单笔申购金额高于 1000 万元（含 1000 万元）的，申购费率不高于申购金额的 1.00%。
- 5、本基金于 2002 年 6 月 10 日起正式推出“定期定额投资计划”业务。详细情况参阅《华安基金管理有限公司开放式基金定期定额业务规则》。
- 6、中国银行从 2002 年 2 月 4 日开始成为本基金的销售代理人。
- 7、交通银行从 2002 年 4 月开始新增 27 个城市分行代销本基金。
- 8、国泰君安证券股份有限公司从 2002 年 8 月 2 日开始成为本基金的销售代理人。
- 9、华夏证券有限公司从 2002 年 8 月 5 日开始成为本基金的销售代理人。
- 10、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	成交量	占总成交 总量比例	佣金	占总佣金 总量比例
------	-----	--------------	----	--------------

国泰君安证券股份有限公司	449,095,199.91	15.36%	334,798.86	15.36%
海通证券股份有限公司	671,779,388.93	22.97%	486,999.89	22.34%
申银万国证券股份有限公司	285,551,590.68	9.77%	221,910.58	10.18%
广发证券有限责任公司	343,335,346.77	11.74%	257,345.21	11.81%
大鹏证券有限责任公司	114,886,242.59	3.93%	58,200.97	2.67%
东方证券有限责任公司	118,972,861.38	4.07%	93,097.08	4.27%
中国民族国际信托投资公司	257,952,416.27	8.82%	201,852.64	9.26%
平安证券有限责任公司	239,833,529.95	8.20%	187,673.78	8.61%
大通证券有限责任公司	442,788,082.62	15.14%	337,687.56	15.49%
合 计	2,924,194,659.10	100.00%	2,179,566.57	100.00%

② 债券及回购交易情况:

券商名称	债券成交量	占总成交 总量比例	回购成交量	占总成交 总量比例
国泰君安证券股份有限公司	1,493,132,386.50	12.81%	941,000,000.00	15.59%
海通证券股份有限公司	3,755,066,242.90	32.22%	2,229,000,000.00	36.93%
申银万国证券股份有限公司	245,783,257.20	2.11%	500,000,000.00	8.29%
广发证券有限责任公司	1,852,566,613.10	15.90%	554,100,000.00	9.18%
大鹏证券有限责任公司	2,037,329,033.40	17.48%	1,562,900,000.00	25.90%
东方证券有限责任公司	-	-	-	-
中国民族国际信托投资公司	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-
大通证券有限责任公司	2,268,974,064.70	19.47%	248,000,000.00	4.11%
合 计	11,652,851,597.80	100.00%	6,035,000,000.00	100.00%

六、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》、《华安创新证券投资基金公开说明书》2002 年第 1 号。
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开放式基金定期定额业务规则》。
5. 华安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
6. 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。
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 8 月 30 日