

华安创新证券投资基金

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

本基金的托管人交通银行已于 2003 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: 华安创新证券投资基金
(简称: 华安创新)

交易代码: 040001

深交所行情代码: 160401

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)

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: 交通银行
注册地址: 上海市仙霞路 18 号
办公地址: 上海市银城中路 188 号 (邮编: 200120)
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： 021-58408846
传 真： 021-58408836

(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： 肖峰、陈玲

二、主要财务指标

项 目	2002 年	2001 年 9 月 21 日 至 2001 年 12 月 31 日
基金本期净收益	83,628,608.46 元	34,446,822.35 元
单位基金本期净收益	0.0178 元	0.0069 元
基金可分配净收益	-392,686,270.79 元	34,445,977.47 元
单位基金可分配净收益	-0.0838 元	0.0069 元
期末基金资产总值	4,346,068,589.34 元	5,112,632,207.78 元
期末基金资产净值	4,292,754,580.21 元	5,064,713,018.51 元
单位基金资产净值	0.916 元	1.012 元
基金资产净值收益率	1.69%	0.69%
本期基金资产净值增长率	-7.51%	1.20%
累计资产净值增长率	-6.40%	1.20%

上述部分指标计算公式：

基金可分配净收益 = 期末基金未分配收益 + MIN[0,期末未实现利得]

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

2002 年华安创新基金单位净值跌幅为 7.51%，同期上证指数下跌 17.52%，深圳综指下跌 18.32%。华安创新基金于 2002 年上半年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。尽管华安创新以相当大的优势跑赢大盘，并在基金同行中保持了相对较好的排名，但却没有达到资产增值的目标，出现了绝对损失。

2002 年是我国证券市场历史上罕见的大调整年，国内股票市场参与者普遍损失惨重，而国内基金也是呈现全行业亏损。作为基金经理，我们在接受一场严峻考验的同时，也深深体会了中国股票市场的系统性风险。在一个主要进行相对价值投资和没有风险对冲机制的市场里，相关政策研判、时机抉择、股票仓位控制远远超过了组合投资分散风险对基金绩效的影响。可以并不夸张的认为“6.24”行情是 2002 年投资成败的一个重要分水岭，而我们在此次行情中的研判失误成为华安创新全年业绩滑坡的重要原因。

- 1、在“6.24”行情之前，尽管华安创新采取了稳步建仓的策略，但突如其来的政策变化打乱了原先的计划。由于事先对政策面信息的把握和解读不到位、不深刻，心理上准备明显不足，所以面对重大政策出台，应对不够冷静，结果导致此后失去了在同行中的领先优势。“6.24”以后市场并没象我们期望的那样有一波像样行情，让华安创新陷入被动境地。这种患得患失的状态延续至 9 月底，错失了纠正失误的良好时机。
- 2、在第四季度的操作中，我们认识到市场调整时期会延长，开始采取减仓措施，尤其是对组合中部分基本面出现问题的大品种进行了果断处理，避免了更大损失。经过艰苦、耐心的努力，华安创新逐步缩小了与同行的差距。

我们认为 GDP 的持续增长是支持中国资本市场长期向好的原动力。对中国今后经济发展的良好预期使我们相信 2003 年的证券市场将稳步健康发展。虽然经过超过 1 年半的股市调整，投资者信心受到了较大影响，需要一个恢复的过程，但在管理层强调“推进证券市场改革开放和稳定发展”；坚持改革的力度、发展的速

度与市场的承受程度统一的背景下，我们相信一些困扰证券市场长期发展的将会得到谨慎、渐进、妥善的解决。

我们认为结构调整是 2003 年乃至今后一段时期内证券市场的主旋律。这种结构调整不仅体现在宏观经济及其行业层面上，也体现在上市公司自身产业结构、产品结构、治理结构、股权结构方面。与此相对应的是证券市场运行特征和投资者盈利模式的变化，如股票二级市场价格由供求关系决定向价值与供求共同决定转变；股票高成交量、高换手率向平稳成交量、平稳换手率转变；股价由大幅波动向正常波动及围绕上市公司基本面波动转变；股市的齐涨共跌现象难以经常出现，投资者收益由单一的市场差价向同时获取红利和差价转变；二级市场从单一的资金推动型向以相对投资价值为主的价值与资金共同推动型演变。

上述的结构调整将促使证券市场资源优化配置功能得到更好体现和加强。国民经济的持续健康发展和证券市场规模的逐步壮大，使一批相当数量的上市公司作为各行各业的优秀代表和行业龙头涌现出来，构成了我国证券市场上的蓝筹股群体。随着我国证券市场投资者基础构成由散户为主向机构投资者主流过渡，蓝筹股将成为投资理念长期化、理性化的机构投资者日益重视的投资对象，也是吸引市场资金的主要群体。

我们坚持认为行业景气度和上市公司的基本面最终会反映到二级市场股票价格中。因此，我们将积极关注在近年国家加大投资、启动内需相关领域以及景气度加快提升行业内的上市公司，努力发现投资机会。我们将发挥研究优势及主动型基金的优势，适度加大组合行业配置的倾斜力度，在股指波动空间减小的预期下力争扩大基金收益。

华安创新基金作为中国大陆第一只开放式基金，自诞生以来恰逢中国股市的大调整，身为基金管理人我们肩负投资者的重托，经历了严峻的考验。相信经过熊市洗礼，我们在基金运作管理上将更加成熟，过去的经验和教训也是我们宝贵的财富。

在此，对过去一年中与我们站在一起的华安创新基金投资者表示深深的歉意和谢意。我们将以加倍努力和良好的业绩回报你们的信任。

（二）内部监察报告

1、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、《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。

2、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：

1) 对华安创新日常投资运作合法性、合规性的检查

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》、《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》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，未发现华安创新的投资运作存在重大违规行为。

2) 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。

3) 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。

4) 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

2002 年度，交通银行作为华安创新证券投资基金的托管人，严格遵守《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》及其实行准则的规定，依据《华安创新证券投资基金基金契约》和《华安创新证券投资基金托管协议》中的条款，就以下各事项报告如下：

- 1、本托管人认真履行了基金托管人的各项职责，安全保管华安创新基金的所有资产；
- 2、本托管人认真完成了华安创新证券投资基金的投资监管和清算核算工作；
- 3、本托管人妥善保管了基金所有会计帐册和重大合同，切实维护基金持有人的合法权益，未发生任何损害基金持有人利益的事件和行为。

2002 年度，交通银行作为华安创新证券投资基金的托管人，对基金管理人的各项行为监管报告如下：

- 1、未发现基金管理人在投资运作中有损害基金持有人利益的行为。
- 2、由基金管理人编制和披露的 2002 年度华安创新证券投资基金每日资产净值公告、每季度投资组合公告、中期财务报告和年度财务报告是合法、真实和完整的。

五、基金财务报告

(一) 审计报告

审 计 报 告

普华永道审字(2003)第 124 号

华安创新证券投资基金全体持有人：

我们接受委托，审计了华安创新证券投资基金（以下简称“华安创新基金”）2002 年 12 月 31 日的资产负债表及 2002 年度的经营业绩表和基金净值变动表。这些会计报表由华安创新基金管理人华安基金管理有限公司负责，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，我们结合华安创新基金的实际情况，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，载于第 2 页至第 12 页的上述华安创新基金会计报表符合中华人民共和国企业会计准则、《证券投资基金会计核算办法》、《华安创新证券投资基金基金契约》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定，在所有重大方面公允地反映了华安创新基金 2002 年 12 月 31 日的财务状况及 2002 年度的经营成果和净值变动情况，会计方法的选用遵循了一贯性原则。

普华永道中天
会计师事务所有限公司
2003 年 1 月 22 日

注册会计师 肖 峰
注册会计师 陈 玲

(二) 基金会计报告书

1. 资产负债报告书

项 目	附注	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		119,414,302.77	52,534,905.35
清算备付金		745,349,406.22	2,102,198,885.97
交易保证金		1,304,879.14	250,000.00
应收股利		--	--
应收利息	3(1)	7,623,045.76	10,872,224.44
应收申购款		71,708.00	3,476,550.60

股票投资市值		2,412,703,574.35	858,152,978.80
其中：股票投资成本		2,833,540,056.56	831,925,420.88
债券投资市值		1,059,581,673.10	2,083,747,773.60
其中：债券投资成本		1,061,738,698.97	2,081,814,081.25
待摊费用	3(2)	--	1,398,889.02
其他应收款		20,000.00	--
资产合计		<u>4,346,068,589.34</u>	<u>5,112,632,207.78</u>
负债：			
应付证券清算款		43,250,207.49	21,250,997.92
应付赎回款		1,710,537.27	17,877,289.89
应付赎回费		105,741.52	38,819.08
应付管理人报酬		5,674,823.57	6,416,666.72
应付托管费		945,803.91	1,069,444.45
应付佣金		850,895.37	615,971.21
其他应付款		500,000.00	500,000.00
预提费用		276,000.00	150,000.00
负债合计		<u>53,314,009.13</u>	<u>47,919,189.27</u>
所有者权益：			
实收基金	3(3)	4,685,440,851.00	5,002,284,701.00
未实现利得	1(10)3(6)	-407,364,130.26	27,982,340.04
未分配收益		14,677,859.47	34,445,977.47
持有人权益合计		<u>4,292,754,580.21</u>	<u>5,064,713,018.51</u>
基金份额		4,685,440,851	5,002,284,701
每份基金单位资产净值		0.916	1.012

2. 基金经营业绩报告书

项 目	附注	2002年	2001年9月21日 至2001年12月31日
收入：			
股票差价收入	1(3)	54,094,721.06	13,190,458.37
债券差价收入	1(4)	6,305,962.46	11,429,175.24
债券利息收入	1(5)	45,979,786.64	13,034,197.26
存款利息收入	1(5)	21,797,430.00	15,060,991.19
股利收入	1(5)	31,755,641.22	--
买入返售证券收入	1(5)	3,456,665.00	898,606.25
其他收入	3(4)	7,399,167.65	6,914,997.52
收入合计		<u>170,789,374.03</u>	<u>60,528,425.83</u>
费用：			
基金管理人报酬	1(6)	72,818,768.43	20,834,058.04
基金托管费	1(7)	12,136,461.44	3,472,342.96

卖出回购证券支出	1(8)	182,536.00	808,412.50
其他费用	3(5)	2,022,999.70	966,789.98
其中：信息披露费		340,000.00	265,000.00
审计费用		150,000.00	150,000.00
费用合计		<u>87,160,765.57</u>	<u>26,081,603.48</u>
基金净收益		<u>83,628,608.46</u>	<u>34,446,822.35</u>
加：未实现估值增值变动数	1(3)(4)	-451,154,758.35	28,161,250.27
基金经营业绩		<u>-367,526,149.89</u>	<u>62,608,072.62</u>

3. 收益分配报告书

项 目	附注	2002 年	2001 年 9 月 21 日 至 2001 年 12 月 31 日
本期基金净收益		83,628,608.46	34,446,822.35
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(11)	23,109,781.62	260,453.40
减：本期赎回基金单位的损益平准金	1(11)	<u>23,141,507.14</u>	<u>261,298.28</u>
可供分配基金净收益		<u>118,042,860.41</u>	<u>34,445,977.47</u>
减：本期已分配基金净收益	1(12)	103,365,000.94	--
期末基金净收益		<u>14,677,859.47</u>	<u>34,445,977.47</u>

4. 基金净值变动报告书

项 目	附注	2002 年	2001 年 9 月 21 日 至 2001 年 12 月 31 日
一、期初基金净值		5,064,713,018.51	5,000,001,124.00
二、本期经营活动：			
基金净收益		83,628,608.46	34,446,822.35
未实现估值增值变动数	1(10)	<u>-451,154,758.35</u>	<u>28,161,250.27</u>
经营活动产生的基金净值变动数		<u>-367,526,149.89</u>	<u>62,608,072.62</u>
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		1,146,484,966.88	40,922,669.77
基金赎回款		<u>-1,447,552,254.35</u>	<u>-38,818,847.88</u>
基金单位交易产生的基金净值变动数		<u>-301,067,287.47</u>	<u>2,103,821.89</u>
四、本期向持有人分配收益		<u>-103,365,000.94</u>	--
五、期末基金净值		<u>4,292,754,580.21</u>	<u>5,064,713,018.51</u>

（三）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。

（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于成交日结转。

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暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场收盘价估值。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于成交日结转。

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确认，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确认。债券差价收入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，在返售期限内采用直线法逐

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，在回购期限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) 未实现利得/(损失)

未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得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未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(11) 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。

(12) 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，不足以支付银行转帐或其他手费用时，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，收益分配比例不低于基金净收益的 90%，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。

(13) 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》，以及财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，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 基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，在 2003 年年底前暂免征收营业税和企业所得税。
- ③ 基金从证券市场中取得的其他收入包括股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款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 2002 年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	599,719,541.69	9.76%	467,751.18	9.94%	0.08%
东方证券有限责任公司	363,549,826.23	5.92%	286,555.55	6.09%	0.08%
合计	<u>963,269,367.92</u>	<u>15.68%</u>	<u>754,306.73</u>	<u>16.03%</u>	<u>0.08%</u>

2001 年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	139,489,467.44	16.45%	109,153.69	17.72%	0.08%
东方证券有限责任公司	226,198,183.37	26.68%	181,325.20	29.44%	0.08%
合计	<u>365,687,650.81</u>	<u>43.13%</u>	<u>290,478.89</u>	<u>47.16%</u>	<u>0.08%</u>

② 2002 年本基金通过关联人席位的国债和回购成交量

关联人	国债交易量	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	1.40%	500,000,000.00	7.43%
东方证券有限责任公司	696,731,599.30	3.96%	-	-
合 计	942,514,856.50	5.36%	500,000,000.00	7.43%

2001 年本基金通过关联人席位的国债和回购成交量

关联人	国债交易量	比例	回购交易量	比例
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-
东方证券有限责任公司	222,885,746.70	6.70%	-	-
合 计	222,885,746.70	6.70%	-	-

(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 72,818,768.43 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 12,136,461.44 元。

3. 主要报表项目说明

(1) 应收利息

项 目	2002 年	2001 年
应收债券利息	7,222,102.07	9,977,173.53
应收清算备付金利息	336,885.55	829,462.46
应收银行存款利息	64,058.14	65,588.45
合 计	7,623,045.76	10,872,224.44

(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，在一年内逐日摊销，于 2002 年 9 月 20 日摊销完毕。2002 年期末该项目余额为零。

(3) 实收基金

项 目	2002 年	2001 年 9 月 21 日 至 2001 年 12 月 31 日
-----	--------	---------------------------------------

期初数	5,002,284,701	5,000,001,124
加：本期申购	1,127,315,901	40,800,362
减：本期赎回	1,444,159,751	38,516,785
期末数	<u>4,685,440,851</u>	<u>5,002,284,701</u>

(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	2001 年 9 月 21 日 至 2001 年 12 月 31 日
国债认购手续费返还	924,000.00	6,270,000.00
赎回基金补偿收入	5,762,013.63	155,275.44
新股申购手续费返还	713,154.02	43,306.24
基金募集认购资金利息	--	446,415.84
合 计	<u>7,399,167.65</u>	<u>6,914,997.52</u>

(5) 其他费用

其他费用主要包括审计费、信息披露费、发行费用摊销以及其它费用。

项 目	2002 年	2001 年 9 月 21 日 至 2001 年 12 月 31 日
审计费	150,000.00	150,000.00
信息披露费	340,000.00	265,000.00
发行费用摊销	1,398,889.02	549,244.98
其他	134,110.68	2,545.00
合 计	<u>2,022,999.70</u>	<u>966,789.98</u>

(6) 未实现利得

项 目	2002 年	2001 年 9 月 21 日 至 2001 年 12 月 31 日
期初未实现利得	27,982,340.04	--
加：本期末未实现估值增值变动数	-451,154,758.35	28,161,250.27
加：本期申购基金单位的未实现利得平准金	-3,940,715.74	-138,145.63
减：本期赎回基金单位的未实现利得平准金	-19,749,003.79	40,764.60
期末未实现利得	<u>-407,364,130.26</u>	<u>27,982,340.04</u>

(四) 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的期间内，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。

根据中国证监会证监发行字[2002]54 号文《关于向二级市场投资者配售新股有

关问题的补充通知》，自 2002 年 5 月 20 日起，恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股股票市值参与配售，但累计申购总额不得超过基金按规定可申购的总额。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

本基金截止 2002 年 12 月 31 日流通受限股票情况如下：

股票名称	申购方式	申购确认日	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
草原兴发	配股	02-12-30	03-01-20	55,956	359,797.08	374,905.20	03-01-20 起流通
赣粤高速	配股	02-12-23	03-01-10	981,087	10,007,087.40	9,487,111.29	03-01-10 起流通
皖通高速	市值配售	02-12-26	03-01-07	738,000	1,623,600.00	1,623,600.00	03-01-07 起流通
中信证券	市值配售	02-12-24	03-01-06	641,000	2,884,500.00	2,884,500.00	03-01-06 起流通
中信证券	网上认购	02-12-20	03-01-06	515,000	2,317,500.00	2,317,500.00	03-01-06 起流通
中国联通	网下认购	02-09-26	02-10-09	4,343,311	9,989,615.30	11,683,506.59	02-10-09 起 6 个月
合 计					<u>27,182,099.78</u>	<u>28,371,123.08</u>	

(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	41,206,572.00	0.96%
B	采掘业	146,333,385.43	3.41%
C	制造业	1,560,335,732.83	36.35%
C0	其中：食品、饮料	94,624,010.23	2.20%
C1	纺织、服装、皮毛	71,531,974.16	1.67%
C2	木材、家具	773,722.00	0.02%
C3	造纸、印刷	41,957,258.43	0.98%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	260,417,415.56	6.07%
C5	电子	121,376,705.56	2.83%
C6	金属、非金属	201,095,957.72	4.68%
C7	机械、设备、仪表	546,876,095.69	12.74%
C8	医药、生物制品	221,682,593.48	5.16%
C99	其他	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	68,200,798.10	1.59%
E	建筑业	16,187,064.24	0.38%
F	交通运输、仓储业	291,680,661.73	6.79%
G	信息技术业	20,837,664.23	0.49%
H	批发和零售贸易	80,861,226.18	1.88%
I	金融、保险业	5,202,000.00	0.12%
J	房地产业	15,038,433.45	0.35%
K	社会服务业	132,470,723.25	3.09%
L	传播与文化产业	6,082,994.40	0.14%
M	综合类	28,266,318.51	0.66%
合 计		<u>2,412,703,574.35</u>	<u>56.20%</u>

2. 债券（不包括国债）合计

截止 2002 年 12 月 31 日，基金持有债券（不含应收利息）17,036,050.00 元，

占基金资产净值的 0.40%。

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 1,864,059,124.60 元，占基金资产净值的 43.42%。

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	上菱电器	15,213,022	165,365,549.14	3.85%
2	威孚高科	16,314,622	157,436,102.30	3.67%
3	大显股份	18,207,924	117,259,030.56	2.73%
4	通化东宝	12,000,933	99,967,771.89	2.33%
5	巴士股份	18,500,406	99,347,180.22	2.31%
6	宝钢股份	19,413,516	79,983,685.92	1.86%
7	盐田港A	5,100,900	75,340,293.00	1.76%
8	烟台万华	6,000,661	67,507,436.25	1.57%
9	上海机场	7,002,302	62,880,671.96	1.46%
10	扬子石化	11,820,979	55,558,601.30	1.29%
11	华能国际	4,500,000	51,750,000.00	1.21%
12	双汇发展	4,514,818	46,863,810.84	1.09%
13	辽河油田	6,300,967	45,682,010.75	1.06%
14	海油工程	3,193,936	44,108,256.16	1.03%
15	江淮汽车	3,616,613	42,567,535.01	0.99%
16	上海能源	4,100,692	42,360,148.36	0.99%
17	赣粤高速	4,373,818	42,294,820.06	0.99%
18	云天化	4,800,401	42,099,516.77	0.98%
19	华泰股份	3,358,578	41,679,952.98	0.97%
20	吉林森工	5,386,480	41,206,572.00	0.96%
21	上海汽车	6,000,000	41,100,000.00	0.96%
22	同仁堂	2,251,962	38,553,589.44	0.90%
23	盐湖钾肥	2,814,410	38,191,543.70	0.89%
24	宇通客车	2,751,433	34,035,226.21	0.79%
25	招商局A	3,690,665	32,810,011.85	0.76%
26	中远航运	3,650,810	32,601,733.30	0.76%
27	珠海中富	4,298,402	32,538,903.14	0.76%
28	华菱管线	6,650,000	31,122,000.00	0.72%
29	南京水运	2,877,380	28,773,800.00	0.67%
30	亚泰集团	5,074,743	28,266,318.51	0.66%
31	厦门建发	2,778,829	27,843,866.58	0.65%
32	海螺水泥	4,331,118	27,719,155.20	0.65%
33	云铝股份	3,373,850	27,260,708.00	0.64%
34	生益科技	4,197,282	26,988,523.26	0.63%
35	鲁泰A	3,154,887	26,343,306.45	0.61%
36	恒瑞医药	2,503,613	25,136,274.52	0.59%
37	申达股份	3,041,325	24,239,360.25	0.56%

38	丽珠集团	2,532,330	22,360,473.90	0.52%
39	新 钢 钒	3,855,300	21,358,362.00	0.50%
40	格力电器	2,500,588	20,854,903.92	0.49%
41	首创股份	1,850,281	19,464,956.12	0.45%
42	江苏舜天	1,702,336	18,180,948.48	0.42%
43	上海建工	2,005,832	16,187,064.24	0.38%
44	万 科A	1,546,533	14,924,043.45	0.35%
45	新 世 界	2,154,488	14,736,697.92	0.34%
46	五 粮 液	1,249,648	14,483,420.32	0.34%
47	国电电力	1,948,382	14,028,350.40	0.33%
48	许继电气	1,800,330	13,808,531.10	0.32%
49	兖州煤业	1,607,793	13,248,214.32	0.31%
50	佛山照明	1,131,644	13,013,906.00	0.30%
51	中集集团	908,095	12,967,596.60	0.30%
52	中化国际	1,399,098	12,032,242.80	0.28%
53	中国联通	4,343,311	11,683,506.59	0.27%
54	天 士 力	631,896	11,323,576.32	0.26%
55	东阿阿胶	1,104,238	11,064,464.76	0.26%
56	大众交通	1,133,010	10,480,342.50	0.24%
57	伊利股份	500,000	8,825,000.00	0.21%
58	振华港机	820,370	8,458,014.70	0.20%
59	模塑科技	705,000	8,001,750.00	0.19%
60	华北制药	1,650,000	7,936,500.00	0.18%
61	海欣股份	600,000	7,884,000.00	0.18%
62	南京中达	1,200,841	7,445,214.20	0.17%
63	红星发展	396,772	7,221,250.40	0.17%
64	中联重科	800,000	7,184,000.00	0.17%
65	中牧股份	910,447	7,128,800.01	0.17%
66	燕京啤酒	809,318	6,919,668.90	0.16%
67	外运发展	416,412	6,804,172.08	0.16%
68	新 希 望	800,354	6,354,810.76	0.15%
69	南山实业	700,603	6,354,469.21	0.15%
70	益民百货	617,400	6,241,914.00	0.15%
71	歌华有线	343,672	6,082,994.40	0.14%
72	中信证券	1,156,000	5,202,000.00	0.12%
73	华北高速	1,036,924	4,977,235.20	0.12%
74	波导股份	221,220	4,484,129.40	0.10%
75	天药股份	300,400	4,199,592.00	0.10%
76	天地科技	252,603	4,178,053.62	0.10%
77	TCL 通讯	292,224	4,094,058.24	0.10%
78	黑 牡 丹	200,050	3,636,909.00	0.08%
79	精伦电子	200,500	3,598,975.00	0.08%
80	一汽四环	292,751	3,533,504.57	0.08%
81	草原兴发	503,582	3,373,999.40	0.08%
82	强生控股	403,843	3,178,244.41	0.07%

83	雅 戈 尔	330,175	3,073,929.25	0.07%
84	迪马股份	149,960	2,703,778.80	0.06%
85	内蒙华电	320,854	2,422,447.70	0.06%
86	北京巴士	155,942	1,924,324.28	0.04%
87	福田汽车	200,209	1,869,952.06	0.04%
88	三佳模具	100,700	1,684,711.00	0.04%
89	深圳机场	200,000	1,650,000.00	0.04%
90	皖通高速	738,000	1,623,600.00	0.04%
91	佛塑股份	194,938	1,578,997.80	0.04%
92	大商股份	200,840	1,448,056.40	0.03%
93	海正药业	126,565	1,140,350.65	0.03%
94	万向钱潮	119,600	973,544.00	0.02%
95	中原油气	100,728	934,755.84	0.02%
96	美克股份	54,680	773,722.00	0.02%
97	湘电股份	70,000	688,100.00	0.02%
98	海龙科技	81,000	684,450.00	0.02%
99	青岛啤酒	80,000	618,400.00	0.01%
100	法拉电子	39,000	518,700.00	0.01%
101	宏智科技	27,000	435,510.00	0.01%
102	农 产 品	25,000	377,500.00	0.01%
103	菲达环保	23,000	315,330.00	0.01%
104	晨鸣纸业	16,635	277,305.45	0.01%
105	时代新材	20,000	271,200.00	0.01%
106	信 雅 达	6,000	140,460.00	0.00%
107	新华医疗	7,000	116,830.00	0.00%
108	栖霞建设	9,000	114,390.00	0.00%
109	光明乳业	5,000	56,100.00	0.00%
110	国风塑业	380	3,002.00	0.00%
	合 计		<u>2,412,703,574.35</u>	<u>56.20%</u>

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	-	1,746,533	-	200,000
2	招商局A	-	4,606,531	-	915,866
3	中集集团	-	990,081	-	81,986
4	深圳机场	-	1,135,884	120,000	1,055,884
5	中联重科	-	765,730	141,210	106,940
6	许继电气	-	2,026,239	-	225,909
7	晨鸣纸业	-	2,587,533	-	2,570,898
8	丽珠集团	-	2,532,330	-	-
9	佛山照明	-	1,131,644	-	-
10	TCL通讯	-	316,544	-	24,320
11	万向钱潮	-	119,600	-	-
12	威孚高科	-	19,629,011	-	3,314,389

13	格力电器	-	2,566,250	-	65,662
14	珠海中富	-	4,298,402	-	-
15	模塑科技	-	-	746,006	41,006
16	云铝股份	-	1,969,023	1,974,472	569,645
17	辽河油田	-	6,350,967	-	50,000
18	五粮液	-	2,452,126	75,000	1,277,478
19	国风塑业	-	150,380	-	150,000
20	扬子石化	-	12,020,979	-	200,000
21	新希望	-	716,769	83,585	-
22	华北高速	-	1,331,191	-	294,267
23	华菱管线	-	8,305,790	4,937,800	6,593,590
24	中原油气	-	1,815,300	-	1,714,572
25	佛塑股份	-	194,938	-	-
26	首创股份	-	2,360,761	-	510,480
27	皖通高速	738,000	-	-	-
28	宝钢股份	-	58,030,966	-	38,617,450
29	中信证券	1,156,000	-	-	-
30	歌华有线	-	313,672	30,000	-
31	中国联通	12,027,311	-	-	7,684,000
32	宇通客车	-	2,751,433	-	-
33	南京中达	-	956,085	244,756	-
34	南京水运	-	4,271,757	-	1,394,377
35	上海汽车	-	6,981,160	-	981,160
36	波导股份	-	405,058	-	183,838
37	厦门建发	-	3,490,442	-	711,613
38	福田汽车	-	200,209	-	-
39	上海建工	-	4,089,174	716,311	2,799,653
40	雅戈尔	-	557,337	-	227,162
41	生益科技	-	4,243,092	-	45,810
42	吉林森工	-	6,871,635	-	1,485,155
43	中牧股份	-	2,918,242	-	2,007,795
44	南山实业	-	700,603	-	-
45	海正药业	-	336,463	-	209,898
46	赣粤高速	-	5,564,642	981,087	2,171,911
47	外运发展	-	706,895	141,379	431,862
48	江苏舜天	-	1,702,336	-	-
49	华泰股份	-	3,747,540	521,149	910,111
50	振华港机	-	1,150,000	-	329,630
51	美克股份	-	52,680	2,000	-
52	精伦电子	27,000	200,500	-	27,000
53	红星发展	-	396,772	-	-
54	北京巴士	-	958,880	-	802,938
55	湘电股份	70,000	-	-	-
56	江淮汽车	-	4,536,613	-	920,000
57	中远航运	229,000	3,949,210	-	527,400

58	时代新材	20,000	-	-	-
59	天药股份	-	300,400	-	-
60	中化国际	-	968,932	474,466	44,300
61	宏智科技	27,000	-	-	-
62	黑牡丹	25,000	375,050	-	200,000
63	海龙科技	81,000	-	-	-
64	菲达环保	23,000	-	-	-
65	栖霞建设	9,000	-	-	-
66	天士力	35,000	596,896	-	-
67	法拉电子	39,000	-	-	-
68	迪马股份	7,000	149,960	-	7,000
69	信雅达	6,000	-	-	-
70	天地科技	85,000	167,603	-	-
71	海油工程	35,000	3,558,936	-	400,000
72	海螺水泥	204,000	7,202,768	-	3,075,650
73	新华医疗	7,000	-	-	-
74	光明乳业	259,000	-	-	254,000
75	青岛啤酒	-	462,100	-	382,100
76	大众交通	-	2,340,378	-	1,207,368
77	申达股份	-	3,172,925	-	131,600
78	新世界	-	1,895,140	259,348	-
79	强生控股	-	413,943	-	10,100
80	大商股份	-	200,840	-	-
81	巴士股份	-	21,810,608	4,908,014	8,218,216
82	一汽四环	-	2,397,997	-	2,105,246
83	大显股份	-	29,184,339	3,585,811	14,562,226
84	国电电力	-	2,035,069	113,313	200,000
85	华北制药	-	1,952,263	-	302,263
86	益民百货	-	664,256	-	46,856
87	海欣股份	-	500,000	100,000	-
88	内蒙华电	-	2,302,908	-	1,982,054
89	通化东宝	-	12,000,933	-	-

注：一级市场认购包括网上、网下新股认购和二级市场市值配售。
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	深能源 A	11,943,891	20,153,573	32,097,464
2	中兴通讯	1,727,641	5,593,295	7,320,936
3	深天健	-	501,842	501,842
4	华东科技	-	2,565,040	2,565,040
5	湘计算机	-	2,758,304	2,758,304
6	银河科技	-	310,860	310,860
7	中海发展	-	715,000	715,000
8	中国石化	7,985,800	4,000,000	11,985,800

9	招商银行	-	6,687,996	6,687,996
10	广州控股	1,100,867	270,766	1,371,633
11	营口港	-	120,000	120,000
12	大厦股份	-	22,000	22,000
13	山东基建	-	491,000	491,000
14	亚宝药业	-	22,000	22,000
15	旭光股份	-	13,000	13,000
16	承德钒钛	-	123,000	123,000
17	江西铜业	1,389,000	-	1,389,000
18	华冠科技	-	23,000	23,000
19	鑫新股份	-	2,000	2,000
20	宝光股份	600,000	-	600,000
21	安源股份	-	74,000	74,000
22	华鲁恒升	-	52,000	52,000
23	宝钛股份	-	139,000	139,000
24	扬农化工	-	19,000	19,000
25	长江股份	-	23,000	23,000
26	科达机电	-	6,000	6,000
27	西昌电力	-	68,000	68,000
28	香梨股份	300,000	-	300,000
29	天富热电	-	16,000	16,000
30	国药股份	-	37,000	37,000
31	腾达建设	-	54,000	54,000
32	第一投资	-	13,000	13,000
33	中天科技	-	63,000	63,000
34	长园新材	-	11,000	11,000
35	山东药玻	-	44,000	44,000
36	豫光金铅	-	27,000	27,000
37	华阳科技	-	23,000	23,000
38	中软股份	-	31,000	31,000
39	深高速	8,592,364	-	8,592,364
40	厦门钨业	-	13,000	13,000
41	科大创新	-	10,000	10,000
42	方兴科技	-	24,000	24,000
43	太行股份	-	35,000	35,000
44	茉织华	318,900	190,000	508,900
45	康缘药业	-	22,000	22,000
46	裕丰股份	-	24,000	24,000
47	金自天正	-	13,000	13,000
48	江西长运	-	15,000	15,000
49	精达股份	-	7,000	7,000
50	京能热电	-	120,000	120,000
51	黄海股份	-	48,000	48,000
52	卧龙科技	-	32,000	32,000
53	八一钢铁	-	202,000	202,000

54	金晶科技	-	19,000	19,000
55	泰豪科技	-	23,000	23,000
56	上海航空	-	449,000	449,000
57	龙溪股份	-	34,000	34,000
58	大连圣亚	-	17,000	17,000
59	中孚实业	-	32,000	32,000
60	北大荒	-	337,000	337,000
61	广电电子	-	689,896	689,896
62	金丰投资	-	3,200,000	3,200,000
63	广电信息	-	100,000	100,000
64	中远发展	-	778,000	778,000
65	申能股份	-	5,360,000	5,360,000
66	兆维科技	-	400,600	400,600
67	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（或最近交易日）的市场收盘价计算，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 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 1,044,168.74 元。与股票市值 2,412,703,574.35 元、债券市值（不含国债）17,036,050.00 元、国债及货币资金 1,864,059,124.60 元合计相减后等于基金净值。其他应收应付款项包括：深圳交易保证金、应收利息、应收基金申购款、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。

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、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、自 2002 年 10 月 1 日起，本基金托管人交通银行办公地址变更为上海市银城中路 188 号，请投资者注意本年报公布的有关基金托管人的信息变化。
- 4、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。
- 5、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%。

6、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》。

7、中国银行从 2002 年 2 月 4 日开始成为本基金的销售代理人。

8、交通银行从 2002 年 4 月开始新增 27 个城市分行代销本基金。

9、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。

10、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。

11、中国工商银行从 2003 年 3 月 18 日开始成为本基金的销售代理人。

12、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	949,673,563.55	15.46%	719,485.59	15.28%
海通证券股份有限公司	1,288,775,434.47	20.98%	974,276.63	20.69%
申银万国证券股份有限公司	599,719,541.69	9.76%	467,751.18	9.94%
广发证券有限责任公司	548,653,319.18	8.93%	422,981.25	8.98%
大鹏证券有限责任公司	487,832,218.89	7.94%	350,035.43	7.44%
东方证券有限责任公司	363,549,826.23	5.92%	286,555.55	6.09%
中国民族证券有限责任公司	305,065,996.04	4.97%	238,719.50	5.07%
平安证券有限责任公司	438,146,427.62	7.13%	342,857.19	7.28%
大通证券有限责任公司	768,554,302.31	12.51%	595,000.82	12.64%
招商证券股份有限公司	392,121,897.53	6.38%	310,156.04	6.59%
合计	6,142,092,527.51	100.00%	4,707,819.18	100.00%

② 国债及回购交易情况:

券商名称	国债成交量	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	3,282,651,409.10	18.65%	1,639,400,000.00	24.35%
海通证券股份有限公司	4,850,886,643.20	27.56%	2,229,000,000.00	33.10%
申银万国证券股份有限公司	245,783,257.20	1.40%	500,000,000.00	7.43%
广发证券有限责任公司	2,123,473,681.00	12.06%	554,100,000.00	8.23%
大鹏证券有限责任公司	2,037,329,033.40	11.57%	1,562,900,000.00	23.21%
东方证券有限责任公司	696,731,599.30	3.96%	-	-
中国民族证券有限责任公司	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-
大通证券有限责任公司	3,241,838,636.30	18.42%	248,000,000.00	3.68%
招商证券股份有限公司	1,124,139,373.60	6.39%	-	-
合计	17,602,833,633.10	100.00%	6,733,400,000.00	100.00%

七、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》。

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

2003 年 3 月 29 日