

安顺证券投资基金

2001 年度中期报告

华安基金管理有限公司

2001 年 8 月 29 日

重要提示

本基金的托管人交通银行已于 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: 安顺证券投资基金
(简称: 基金安顺)

交易代码: 500009

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
浙江证券有限责任公司
华安基金管理有限公司

基金发行日期: 1999 年 6 月 9 日

基金成立日期: 1999 年 6 月 15 日

基金单位总份额: 30 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: 1999 年 6 月 22 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
(邮政编码: 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

联系地址: 上海市浦东南路 360 号
新上海国际大厦 38 楼
(邮政编码: 200120)

(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
(邮政编码: 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: 021-62759266

联系地址: 上海市仙霞路 18 号
(邮政编码: 200336)

(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

	2001 年 1 月至 6 月
基金本期净收益：	263,621,506.07 元
单位基金本期净收益：	0.0879 元
基金可分配净收益：	296,873,675.87 元
单位基金可分配净收益：	0.0990 元
期末基金资产总值：	4,051,237,947.89 元
期末基金资产净值：	3,962,159,532.66 元
单位基金资产净值：	1.3207 元
基金资产净值收益率：	6.90%
本期基金净值增长率：	3.55%
基金累计净值增长率：	69.17%

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

基金累计净值增长率=(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

基金经理简介

尚志民先生，基金经理，经济学硕士。7 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，担任基金经理前为华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员。

李勿先生，基金经理，管理学博士。7 年证券从业经验，曾在海南华银国际信托投资公司上海证券业务部工作。进入华安基金管理有限公司后先后担任研究发展部高级研究员、安信基金基金经理助理等职。

(一) 基金经理工作报告

2001 年上半年，虽然世界经济进入了新的调整期，对中国经济增长产生了一定的负面影响，但在政府积极财政政策的有力支持和稳健的货币政策配合下，通过多方努力，我国经济依然保持了较平稳的增长速度，在世界经济减缓的不利环境中可以说是一枝独秀。而表现在证券市场上就是继续演绎 2000 年以来的大牛市行情。值得注意的是今年上半年的证券市场表现出与以往阶段的不同特征：

1、政策出台密集，证券市场的市场化改革进程加快，在发展中规范、在规范中发展的政策继续深化。

2、证券市场在国民经济中日益增强的重要地位和作用被普遍认识，市场参与者更加多样化，市场受到社会的关注度也前所未有。

3、热点板块转换相当频繁，伴随着指数的迭创新高，个股涨跌表现出非常大的差异。投资者在运作节奏上难以把握，虽然大盘指数表现出不断地温和攀升，但投资者“赚指数却不赚钱”的现象更加普遍。

在上述大背景下，我们总体上采取了较为谨慎的投资策略，表现在：

- 1、因认为市场处于相对高位，加上二季度的巨额现金分红，我们注意控制组合股票持仓的比例，掌握了市场变化过程中一定的操作主动权；
- 2、加大了组合结构调整的力度，将部分我们认为基本面有重大变化或业绩增长率将放缓的原长线重仓品种清仓或减持，在准备了大量分红现金的同时，我们又补充了一些在中药、外贸、机械等传统行业中挖掘的有增长潜力的新品种；
- 3、针对二级市场机会难以把握的状况，我们在充分利用国债市场融通资金便利的特点，提高国债资金使用效率的基础上，积极挖掘新发和增发新股中蕴含的投资机会，为基金赢得了较高的收益。
- 4、进一步强化了风险控制意识。我们根据上半年市场的特点，调整了原先在个股投资上相当集中的战术，适度调低了股票投资的集中度，既降低了因上市公司信息披露透明度欠佳造成的持股风险，也减低了因个股判断失误引致基金资产净值较大的波动性。坚持有所为、有所不为，对投资品种反复严格论证，虽然也错过了一些好的投资时机，但我们认为在某种程度上减少失误可能比捕捉机会更重要。

尽管我们认真努力，但上半年安顺基金的资产净值增长不够理想，仅取得3.55%的涨幅，落后于沪深两市大盘指数，也低于很多投资者的预期。这反映出我们对市场变化不够敏感，具前瞻性的市场把握能力有待提高，组合投资的手段不够灵活与娴熟，投资理念及策略需进一步改进及完善，应变能力有待提高。

展望下半年，我们认为市场继续维持资金推动型上涨行情的压力相当大。一方面市场经过2年的走牛之后，相当一部分上市公司的股价某种程度上已缺乏基本面的支持，更有一些上市公司违规事件的负面影响，使市场有调整的内在压力；另一方面管理层加大监管力度将迫使部分违规资金逐渐退出，国有股减持的实施及配合市场发展的扩容使证券市场中的资金进退及调整需要一个过程，不排除市场供求关系的短暂失衡现象。此外，下半年制约经济增长的不确定因素依然存在。我们相信管理层加强监管，改善上市公司质量，优化市场结构，规范投资行为的一系列举措，有利于夯实市场基础，改善投资环境，树立投资者的信心。虽然变革过程中可能免不了伴随着市场的阵痛，但从长远的眼光看，这些措施有助于挤压泡沫，有助于市场实现理性的回归，有利于证券市场持续健康发展。此外，在市场调整过程中，将促进理性投资理念的演变，并酝酿新的投资机会。

国有股减持的实施、我国加入WTO、开放式基金的推出、社保基金的运作等将对未来的证券市场产生积极影响，也孕育着相当大的投资机会。尤其是年内我国可望加入WTO，将对国内经济产生重大而深远的影响。借助加入WTO，我国的经济改革将步入一个新阶段，促使我国经济结构和产业结构进行调整。在此进程中，虽然一些长期受保护的产业可能将面临较大的冲击和竞争压力，但部分具国际比较优势的产业将更具竞争力，发展空间增大。证券市场必将出现顺应经济结构大变革的股价结构调整，为我们的投资带来难得的机遇。

在下半年复杂的市场环境中，我们将继续积极促进投资理念的成熟及完善，操作中“精耕细作”，注重提高投资组合的抗风险能力，以勤勉尽责的态度努力为

投资者赢得长期稳定的回报。

（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、《安顺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，因此风险管控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：

一、对安顺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，监察安顺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，安顺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。

二、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，使公司的风险管控有章可循、处罚有法可依。

三、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．基金年度中期财务报告

（一）基金会计报告书

资产负债表报告书

资产负债主要项目期初数、期末数如下：

项 目	2000年12月31日	2001年6月30日
股票投资--成本：	2,545,116,715.71	2,041,966,834.85
股票投资--估值增值：	783,597,223.37	664,723,646.27
债券投资--成本：	1,028,641,537.84	1,034,965,907.03
债券投资--估值增值：	1,612,439.36	562,210.52
买入返售证券：	0.00	0.00
银行存款：	700,872,252.87	283,106,662.80
应收股利：	0.00	927,607.80
应收利息：	7,980,601.44	8,607,931.97
应收账款：	208,818,594.11	15,891,441.36
其他应收款项：	712,381.27	485,705.29
基金资产总值：	5,277,351,745.97	4,051,237,947.89
应付基金管理费及业绩报酬：	9,170,439.19	4,831,213.02
应付基金托管费：	997,981.47	812,905.80
应付账款：	17,445,650.53	22,930,994.78
卖出回购证券款：	470,000,000.00	59,200,000.00
应付佣金：	809,513.51	989,673.01
其他应付款项	466,328.74	313,628.62
基金负债总额	498,889,913.44	89,078,415.23
基金单位总额	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配净收益	993,252,169.80	296,873,675.87
未实现估值增值	785,209,662.73	665,285,856.79
基金资产净值	4,778,461,832.53	3,962,159,532.66
基金单位发行总份额：	3,000,000,000	3,000,000,000

每份基金单位资产净值:	1.5928	1.3207
调整后每份基金单位资产净值:	1.2728	1.3207

收益及分配报告书

收益及分配主要项目本期数如下：

项 目	2001年1月1日-6月30日	2000年1月1日-6月30日
在除息日确认的股息收入	14,061,065.49	3,190,028.45
债券利息收入	12,190,492.76	2,743,799.82
股票买卖价差收入	274,540,423.43	605,389,857.27
债券买卖价差收入	2,371,885.52	3,213,252.22
其他收入	7,183,557.16	9,334,769.11
基金管理费	31,171,895.80	29,003,299.94
基金托管费	5,314,036.66	4,981,634.12
应由基金承担的其他费用	10,239,985.83	2,230,553.90
基金净收益	263,621,506.07	587,656,218.91
上年末未分配净收益	993,252,169.80	110,858,804.36
本期已分配收益:	960,000,000.00	105,000,000.00
期末未分配净收益:	296,873,675.87	593,515,023.27

(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) 记账原则：权责发生制。

(3) 记账本位币：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制的配售新股）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

证券买卖价差收入：在交易成交日，按实际成交价与账面成本的差额确认。

股息收入：在被投资股票股权除息日确认。

债券利息收入：

已上市国债在被投资国债除息日确认。

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票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结转成本。

(7) 税项

依据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金有关税收问题的通知》的有关规定，对基金管理人运用基金资产买卖股票按 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，暂不征收营业税和企业所得税。

(8) 基金的收益分配政策：

基金收益分配比例不低于可供分配基金净收益的 90%

基金收益分配采取现金方式，每年分配一次，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
交通银行	基金托管人	提取托管费	基金契约
上海国际信托投资公司	管理公司发起人 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
山东证券有限责任公司	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
浙江证券有限责任公司	管理公司股东 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
东方证券有限责任公司	管理公司股东	租用交易席位	席位使用协议

(2) 通过关联人席位交易情况：

股票交易情况：

关联人	1-6 月成交量	占总成交量 比例	1-6 月佣金	占总佣金量 比例	平均佣金比 率
申银万国证券股份有限公司	224,312,834.21	9.73%	178,912.34	9.64%	0.08%
上海国际信托投资公司	41,284,051.85	1.79%	32,305.64	1.74%	0.08%
山东证券有限责任公司	395,070,150.58	17.14%	318,708.52	17.17%	0.08%
浙江证券有限责任公司	242,624,372.06	10.52%	194,205.15	10.46%	0.08%
东方证券有限责任公司	545,698,197.31	23.67%	440,311.26	23.72%	0.08%
合计	1,448,989,606.01	62.85%	1,164,442.91	62.73%	0.08%

国债及回购交易情况:

关 联 人	1-6 月国债成交量	比例	1-6 月回购成交量	比例
申银万国证券股份有限公司	169,995,287.00	26.72%	113,000,000.00	31.61%
上海国际信托投资公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
山东证券有限责任公司	139,933,686.00	22.00%	182,200,000.00	50.97%
浙江证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东方证券有限责任公司	42,992,880.60	6.76%	32,300,000.00	9.03%
合计	352,921,853.60	55.48%	327,500,000.00	91.61%

(3) 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,本基金成立三个月后,若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%,超出部分不计提基金管理费。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(扣除本基金持有现金比例超过 20%部分的基金资产净值)

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 年上半年管理人收取的基金管理费金额为 31,171,895.80 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 年上半年托管人收取的基金托管费金额为 5,314,036.66 元。

3、主要报表项目说明

(1) 应收账款 2001 年 6 月 30 日余额为人民币 15,891,441.36 元。其中:应收上海交易资金 10,784,798.86 元;应收深圳交易资金 5,106,642.50 元。

(2) 其他应收款项 2001 年 6 月 30 日余额为人民币 485,705.29 元,是深圳证券交易所交易保证金款项。

(3) 应付账款 2001 年 6 月 30 日余额为人民币 22,930,994.78 元,是应付交易资金。其中:应付上海交易资金 22,930,840.94 元;应付深圳交易资金 153.84 元。

(4) 其他收入为人民币 7,183,557.16 元。其中:银行存款利息收入 6,149,735.98 元;买入返售证券收入 309,863.02 元;其他收入 723,958.16 元。

(5) 应由基金承担的其他费用为人民币 10,239,985.83 元。其中:卖出回购证券支出 6,959,422.33 元;2000 年度分红手续费 2,880,000.00 元;2000 年年报会计师审计费 100,000.00 元;2001 年度上市年费 60,000.00 元;2000 年信息披露

露费 220,000.00 元；返售和回购发生交易费 14,463.50 元；债券托管账户维护费 6,000.00 元；文件发送费 100.00 元。

(三) 本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的新股和配股。对于新股，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 日截止，已上市但流通受限的新股估值增值额为 145,540,200.00 元。流通受限的新股明细：

序号	股票名称	配售日期	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	12,220,000	146,395,600.00	291,935,800.00	00-7-11起1年
2	昌河股份	01-6-20	01-7-6	217,000	1,579,760.00	1,579,760.00	01-7-6起流通
3	交大昂立	01-6-18	01-7-2	89,000	1,225,530.00	1,225,530.00	01-7-2起流通
合 计					149,200,890.00	294,741,090.00	

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

序号	分 类	市值 (元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	3,492,918.00	0.09%
2	采掘业	161,434,000.00	4.07%
3	制造业	1,337,672,700.36	33.76%
	其中：食品、饮料	98,079,300.00	2.48%
	纺织、服装、皮毛	339,389,406.33	8.57%
	木材、家具	240,062.80	0.01%
	造纸、印刷	1,621,200.00	0.04%
	石油、化学、塑胶、塑料	131,284,367.40	3.31%
	电子	54,400,932.18	1.37%
	金属、非金属	130,935,356.90	3.30%
	机械、设备、仪表	340,347,707.08	8.59%
	医药、生物制品	223,787,167.67	5.65%
	其他制造业	17,587,200.00	0.44%
4	电力、燃气及水的生产和供应业	----	----
5	建筑业	4,405,830.00	0.11%
6	交通运输、仓储业	339,573,336.24	8.57%
7	信息技术业	634,392,400.01	16.01%
8	批发和零售贸易	166,875,727.91	4.21%
9	金融、保险业	12,271,688.00	0.31%

10	房地产业	13,306,750.00	0.34%
11	社会服务业	----	----
12	传播与文化产业	24,578,299.10	0.62%
13	综合类	8,686,831.50	0.22%
	合 计	2,706,690,481.12	68.31%

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 4,686,015.50 元，占基金资产净值的 0.12%。

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 1,315,193,347.23 元，占基金资产净值的 33.19%。

4、基金投资的股票明细

序号	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	东方电子	22,000,000	379,500,000.00	9.58%
2	上港集箱	12,220,000	291,935,800.00	7.37%
3	海欣股份	9,440,125	228,073,420.00	5.76%
4	广电信息	9,622,300	201,106,070.00	5.08%
5	中原油气	9,100,000	161,434,000.00	4.07%
6	同仁堂	7,321,321	151,038,852.23	3.81%
7	中化国际	7,101,025	133,712,300.75	3.37%
8	法尔胜	6,925,178	111,149,106.90	2.81%
9	五粮液	2,400,000	95,328,000.00	2.41%
10	中联重科	2,557,014	83,997,909.90	2.12%
11	许继电气	4,800,000	82,128,000.00	2.07%
12	青岛海尔	4,380,201	74,419,614.99	1.88%
13	亚星化学	2,855,000	63,066,950.00	1.59%
14	茉织华	2,299,524	56,660,271.36	1.43%
15	恒瑞医药	2,607,216	54,986,185.44	1.39%
16	超声电子	4,178,259	54,400,932.18	1.37%
17	上菱电器	2,830,541	49,562,772.91	1.25%
18	雅戈尔	3,137,154	42,853,523.64	1.08%
19	长江通信	1,059,000	42,084,660.00	1.06%
20	清华同方	1,250,369	33,559,903.96	0.85%
21	江苏舜天	1,239,291	33,163,427.16	0.84%

22	烟台万华	952,130	30,201,563.60	0.76%
23	中信海直	1,200,000	28,224,000.00	0.71%
24	歌华有线	628,601	24,578,299.10	0.62%
25	外运发展	683,816	19,413,536.24	0.49%
26	盐湖钾肥	1,087,060	19,404,021.00	0.49%
27	红星发展	423,948	18,484,132.80	0.47%
28	金瑞科技	458,000	17,587,200.00	0.44%
29	宝钢股份	3,005,000	16,257,050.00	0.41%
30	振华港机	808,062	13,623,925.32	0.34%
31	金地集团	505,000	13,306,750.00	0.33%
32	民生银行	820,300	12,271,688.00	0.31%
33	鲁泰A	774,789	11,598,591.33	0.29%
34	太太药业	300,000	11,472,000.00	0.29%
35	中兴通讯	333,161	11,464,070.01	0.29%
36	万杰高科	643,469	8,686,831.50	0.22%
37	天药股份	138,000	5,064,600.00	0.13%
38	中铁二局	237,000	4,405,830.00	0.11%
39	广东榕泰	102,000	3,529,200.00	0.09%
40	新太科技	176,410	3,492,918.00	0.09%
41	荣华实业	135,000	2,751,300.00	0.07%
42	新疆天宏	56,000	1,621,200.00	0.04%
43	昌河股份	217,000	1,579,760.00	0.04%
44	特精股份	54,000	1,475,820.00	0.04%
45	交大昂立	89,000	1,225,530.00	0.03%
46	美克股份	8,045	240,062.80	0.01%
47	中信国安	10,000	237,600.00	0.01%
48	华联控股	20,000	203,600.00	0.00%
49	中国化建	10,000	127,700.00	0.00%
	合计		2,706,690,481.12	68.31%

5、基金投资组合报告附注

(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 64,410,311.19 元, 抵减股票市值 2,706,690,481.12 元、债券(不包括国债)4,686,015.50 元、国债及货币资金 1,315,193,347.23 元后等于基金净值。其他应收应付款项包括: 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、其他应付款以及买入返售证券、应收买入返售证券利息、卖出回购证券款、应付卖出回购证券利息等。

(五) 本期新增股票

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	
歌华有线	237,000	891,601	-	500,000
同仁堂	-	5,983,713	1,337,608	-
中国化建	-	10,000	-	-
外运发展	-	621,660	62,156	-
江苏舜天	-	1,239,291	-	-
荣华实业	135,000	-	-	-
亚星化学	193,000	2,971,100	-	309,100
美克股份	-	8,045	-	-
红星发展	81,000	542,948	-	200,000
昌河股份	217,000	-	-	-
太太药业	-	300,000	-	-
金地集团	505,000	-	-	-
新疆天宏	56,000	-	-	-
特精股份	54,000	-	-	-
天药股份	138,000	-	-	-
中铁二局	237,000	-	-	-
交大昂立	89,000	-	-	-
茉织华	-	1,155,797	1,143,727	-
广东榕泰	102,000	-	-	-
广电信息	-	-	12,000,000	2,377,700
青岛海尔	-	-	5,215,034	834,833
华联控股	-	20,000	-	-
中兴通讯	-	-	384,261	51,100

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

股票名称	期初结存	本期增加	本期卖出
首创股份	1,780,000	-	1,780,000
南京水运	-	10,000	10,000
上海汽车	5,619,531	1,685,859	7,305,390
稀土高科	-	10,000	10,000

宏图高科	2,029,810	-	2,029,810
波导股份	363,500	-	363,500
乐凯胶片	-	12,000	12,000
青旅控股	2,150,000	-	2,150,000
莲花味精	-	6,040,803	6,040,803
大唐电信	5,333,605	-	5,333,605
安彩高科	1,123,957	-	1,123,957
南山实业	541,800	-	541,800
铜峰电子	-	10,000	10,000
仕奇实业	439,634	-	439,634
南纺股份	-	111,000	111,000
梧州中恒	259,000	-	259,000
海正药业	485,200	-	485,200
赣粤高速	715,000	-	715,000
开开实业	-	314,200	314,200
鄂尔多斯	-	130,960	130,960
星新材料	1,835,050	-	1,835,050
桂东电力	-	215,000	215,000
上海家化	-	150,000	150,000
国栋建设	-	189,000	189,000
西藏天路	189,000	-	189,000
中新药业	-	116,000	116,000
天通股份	53,000	-	53,000
广州药业	-	477,553	477,553
中发展	-	106,000	106,000
华微电子	-	138,000	138,000
联创光电	-	116,000	116,000
宁波韵升	252,000	-	252,000
宁沪高速	191,000	-	191,000
天科股份	87,000	-	87,000
白唇鹿	-	82,000	82,000
龙净环保	278,000	-	278,000
盘江股份	-	181,000	181,000
金山股份	-	117,000	117,000
昆明制药	209,000	-	209,000
康美药业	-	83,000	83,000
潜江制药	-	111,000	111,000
上实联合	1,482,000	-	1,482,000
南京医药	410,160	-	410,160
龙电股份	2,894,736	1,736,842	4,631,578
新亚股份	-	3,046,470	3,046,470
上海医药	2,803,340	133,451	2,936,791
纵横国际	100,000	-	100,000
星湖科技	2,445,000	285,321	2,730,321
招商局A	2,001,175	-	2,001,175

佛山照明	1,689,720	-	1,689,720
湖南投资	-	278,667	278,667
京东方A	482,550	-	482,550
环保股份	8,739,631	-	8,739,631
张裕A	390,000	-	390,000
神州股份	300,000	-	300,000
安泰科技	-	10,000	10,000
佛塑股份	565,000	-	565,000
兰光科技	279,900	-	279,900

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 0.2625 亿基金单位，占基金发行总份额的 0.875%，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	3,750,000	0.125%
山东证券有限责任公司	7,500,000	0.25%
浙江证券有限责任公司	7,500,000	0.25%
华安基金管理有限公司	7,500,000	0.25%

社会公众持有的基金份额为 29.7375 亿基金单位，占基金发行总份额的 99.125%。

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	259,000,000	8.63%
2	平安保险	223,569,600	7.45%
3	中国太保	169,874,500	5.66%
4	再保险	88,772,400	2.96%
5	久事公司	44,710,000	1.49%
6	泰康人寿	40,000,000	1.33%
7	新华人寿	28,537,800	0.95%
8	中国人保	24,000,000	0.80%
9	新华人保	22,652,800	0.76%
10	西北财务	20,000,000	0.67%

六．重要事项揭示

(一)、本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。

(二)、各券商 1-6 月成交量及佣金情况如下：

股票交易情况：

券商	成交量	占总成交量 比例	佣金	占总佣金量 比例	平均佣金 比率
申银万国证券股份有限公司	224,312,834.21	9.73%	178,912.34	9.64%	0.08%
上海国际信托投资公司	41,284,051.85	1.79%	32,305.64	1.74%	0.08%
山东证券有限责任公司	395,070,150.58	17.14%	318,708.52	17.17%	0.08%
浙江证券有限责任公司	242,624,372.06	10.52%	194,205.15	10.46%	0.08%

华夏证券有限责任公司	259,055,609.31	11.23%	210,264.09	11.32%	0.08%
国通证券有限责任公司	1,750,047.16	0.08%	1,369.45	0.07%	0.08%
南方证券有限责任公司	595,824,456.66	25.84%	480,488.96	25.88%	0.08%
东方证券有限责任公司	545,698,197.31	23.67%	440,311.26	23.72%	0.08%
合计	2,305,619,719.14	100.00%	1,856,565.41	100.00%	0.08%

国债及回购交易情况：

券商	国债成交量	比例	回购成交量	比例
申银万国证券股份有限公司	169,995,287.00	26.73%	113,000,000.00	31.61%
上海国际信托投资公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
山东证券有限责任公司	139,933,686.00	22.00%	182,200,000.00	50.97%
浙江证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华夏证券有限责任公司	160,198,373.40	25.18%	30,000,000.00	8.39%
国通证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
南方证券有限责任公司	123,000,022.00	19.33%	0.00	0.00%
东方证券有限责任公司	42,992,880.60	6.76%	32,300,000.00	9.03%
合计	636,120,249.00	100.00%	357,500,000.00	100.00%

七．备查文件目录

- 1．中国证监会批准安顺证券投资基金设立的文件。
- 2．《安顺证券投资基金基金契约》。
- 3．《安顺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．安顺证券投资基金 2001 年度中期财务报表及报表附注。
- 6．安顺证券投资基金 2000 年度收益分配报告。
- 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

2001 年 8 月 29 日