

# 安顺证券投资基金

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: 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  
天同证券有限责任公司  
(原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
- 客户服务热线: 021-68604666
- 国际互联网地址: <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 (邮政编码: 200336)
- 办公地址: 上海市银城中路 188 号 (邮政编码: 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: 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

	2002 年	2001 年	2000 年
基金本期净收益:	42,034,297.09 元	327,782,066.43 元	987,393,365.44 元
单位基金本期净收益:	0.0140 元	0.1093 元	0.3291 元
基金可分配净收益:	-108,516,998.87 元	361,034,236.23 元	993,252,169.80 元
单位基金可分配净收益:	-0.0362 元	0.1203 元	0.3311 元
期末基金资产总值:	2,897,109,909.87 元	3,754,205,454.75 元	5,277,351,745.97 元
期末基金资产净值:	2,891,483,001.13 元	3,507,482,880.05 元	4,778,461,832.53 元
单位基金资产净值:	0.9638 元	1.1692 元	1.5928 元
基金资产净值收益率:	1.32%	8.58%	32.83%
本期基金净值增长率:	-9.12%	-8.33%	57.48%
累计资产净值增长率:	36.10%	49.76%	63.37%

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
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, 基金单位资产净值达到 0.9638 元, 年净值增长率为 -9.12%, 超过同期上证综指和深证综指-17.52%和-18.32%的市场表现。实现净收益 4203 万元。遗憾的是, 由于基金单位净值低于面值, 没有能够进行分红。

本基金自 1999 年 6 月 15 日成立以来, 历年的业绩表现总结如下, 可以看出, 基金业绩在本年度及过去三年中均处于同类基金的前列:

年度	净值增长率	单位分红	上证综指涨幅	深证综指涨幅
1999.6.15--	3.74%	0.035 元	-1.52%	-1.02%
2000	57.48%	0.320 元	51.73%	58.07%
2001	-8.33%	0.110 元	-20.62%	-25.13%
2002	-9.12%	-	-17.52%	-18.32%

累计	36.10%	0.465 元	-2.17%	-4.32%
年复合增长率	8.01%	-	-0.55%	-1.10%

### 基金经理简介

李匆先生，基金经理，管理学博士。10 年证券从业经历，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、基金安信基金经理助理等职，现任基金安顺和基金安瑞的基金经理。

林彤彤先生，基金经理，工商管理硕士（MBA）。11 年银行、证券从业经历。曾就职于中国银行漳州分行信贷管理处，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，基金安信和基金安久的基金经理等职，现任基金安顺和基金安瑞的基金经理。

## （一）基金经理工作报告

### 2002 年投资总结

2002 年仍是股市的冬季，股市的表现与宏观经济形势背道而驰。全年两市股指平均下跌 17.92%，虽跌幅并非历史之最，却将证券业推入几乎全面亏损的境地，封闭式基金净值全面低于面值，分红陷入尴尬境地。市场熊气弥漫，投资人损失惨重。长期处于牛市氛围的境内投资者，在逐步规范的市场环境中，深切领略了系统性风险的承受之痛。

始自 2001 年中的股市回调，除了市场自身规律的作用外，也源于并伴随于有关中国股市的理论争鸣和政策变革。作为“新兴”加“转轨”的市场，不规范与不成熟是其最基本的现实之一，而政策的频繁出台或变更，更是无法回避。2002 年与证券市场有关的政策出台密度之高、力度之强、影响之大是历史上少有的。从实施交易佣金浮动制到恢复向二级市场投资者配售新股，从允许向外商转让上市公司国有股、法人股到 QFII 制度实施等等；其中，最引人注目的是国有股减持政策在几经周折后，最终由国务院决定停止执行，由此引发“6.24”井喷行情。但行情并没有能够延续下去，7 月以后股指一路下跌，屡创新低。

诸多明显具有“利多”性质的“政策”并没有改变市场的疲弱走势，说明“政策”对市场的影响力在逐步减弱，市场自身的力量正日益壮大。虽然政策不会改变市场的长期趋势，但政策的频繁变更或“试错”效应，给市场增加了更多的不确定性，投资者一方面形成严重的“政策依赖”心理，另一方面也提高了对“政策风险”的防范意识。现阶段有关股市重大问题的政策缺位，必然影响市场长期投资的信心。

综观全年，“6.24”是投资业绩的分水岭，能否正确分析并把握“6.24”行情，决定了全年投资的成败。回顾安顺基金的操作，成绩小于不足，教训多于经验，总结几点如下：

第一，市场判断与仓位控制。上半年出于谨慎考虑，仓位控制较严，一季度表现尚可，但却错过“6.24”的普涨行情。“6.24”的“踏空”，对我们的触动很大，心态也由此发生变化。虽然在“6.24”行情初期没有盲目增仓，但下半年仓位还是随股指的回落逐步增加，而市场并没有再给一次机会。尽管全年的净值增长率仍保持同类基金的前列，但这主要是得益于组合品种质地较好，抗跌性强的缘故。全年在仓位控制方面不佳，市场判断能力有待进一步提高。

第二，行业配置。行业把握最大的不足是对汽车、金融行业的重视不够。“6.24”

后少量参与了银行股，可惜时机已晚。四季度适当增加汽车行业的配置，取得一定效果。电力和房产行业的比例控制较好，没有受到电力股危机的重大冲击；在通讯板块和酿酒行业的投资效果也不理想。比较而言，效果较好的行业主要有交通运输、造纸等。

第三，操作策略。由于我们没有经历熊市的经验和切身感受，对市场走弱的时间、幅度认识不深、准备不足，影响到对组合品种的调整力度；同时，也没有根据市场的变化，尽快摸索出熊市或弱市中的操作策略，在流动性管理和波段运做上存在一定差距。尽管时机选择并不是共同基金的主流策略，但严酷的竞争，已使当期收益成为基金生存的重要基础。面对市场的变化，适者生存仍是最高法则。

## 2003 年市场展望

在新的一年里，我们仍将继续面临诸多重大不确定性因素，全球范围内投资人对金融系统的信心和信任感仍有待恢复，但国内的市场环境已经出现明显转暖迹象，“十六大”后改革的深化和开放的扩大，将为国民经济的发展提供强大动力，中国经济仍将保持高速发展态势。天时、地利都已具备，只要市场参与各方从尊重现实、尊重市场的角度出发共同努力，中级以上的反弹行情仍可预期。

作为境内机构投资者，我们正视股权分割的现实，坚信“用发展的办法解决前进中的问题”的可行性。但这不会降低我们对外资并购、MBO 和新国资管理体制改革的关注，因为在股票价格多轨制格局中，非流通股权的变更不只影响到上市公司的经营，更会通过利益格局的变动直接或间接影响到流通股东的根本利益。股份上市，贵在流通。流通的价值，不仅在于降低风险，更在于增加约束。流通股东是股份制改革的最积极参与者和贡献者，但在所有的出资人中，他们的地位和影响力是最弱的，最需要得到保护。而最大的保护，就是规则的公平性。

我们积极迎接资本市场的对外开放，相信股市的国际化是一个长期、必然的趋势，并期待 QFII 能给国内市场带来新的理念和活力；同时，相信中国股市的发展不可能套用现成的模式，因为“在社会主义条件下发展市场经济，是前无古人的伟大创举”，实体经济的不同，决定了股市的不同。我们只能借鉴，而无法复制。

我们相信中国股市会对资源配置起“基础性作用”。相信股市会在全体参与者的努力下逐步“恢复本色”，不再只是融资者的天堂，也会逐步成为投资者的乐园。虽然本色恢复的过程可能很漫长，理性投资仍会面临迷茫、困惑或无奈，但我们笃信理性投资的价值，相信价值永远是相对的，投资风险不会因市场的成熟、规范而消失。我们不能选择市场，但我们会努力去适应市场，并通过学习和探索，采取灵活变通的投资策略，化解不规范市场中的风险，以期抓住更多的机会，回报长期关注、支持我们的基金持有人。

## (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”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:

#### 1、对基金安顺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》、《安顺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,未发现基金安顺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。为更好了解新产品、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, 交通银行作为安顺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》及其实施准则的规定, 依据《安顺证券投资基金基金契约》和《安顺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, 安全保管基金安顺的所有资产;
2. 本托管人认真完成了安顺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, 交通银行作为安顺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 年度安顺证券投资基金每周资产净值公告、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. 基金年度财务报告

##### (一) 审计报告

#### 审 计 报 告

安永大华业字 (2003) 第 396 号

安顺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》和证券投资基金相关法规以及《安顺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 14 日

(二) 基金会计报告书

安顺证券投资基金

资产负债表

2002 年 12 月 31 日

金额单位：人民币元

资产	附注	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		101,468,478.05	307,208,069.92
清算备付金		177,142,112.23	576,422,898.28
交易保证金	3(1)	441,869.76	916,881.96
应收证券清算款	3(2)	53,002,585.71	13,285,313.78
应收股利		-	-
应收利息	3(3)	8,281,669.76	2,049,497.58
其他应收款	3(4)	60,000.00	-
股票投资市值	1(4)	1,780,104,463.66	1,642,225,550.93
其中：股票投资成本		1,960,341,603.36	1,499,077,364.09
债券投资市值	1(4)	776,608,730.70	1,212,095,322.30
其中：债券投资成本		780,953,810.88	1,208,796,785.32
配股权证		-	1,920.00
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,897,109,909.87</b>	<b>3,754,205,454.75</b>
<b>负债与基金持有人权益</b>			
<b>负债：</b>			
应付证券清算款	3(5)	-	40,180,328.18
应付管理人报酬		3,713,094.25	4,443,988.50
应付托管费		618,849.03	744,193.34
应付佣金		538,965.46	524,968.90
应付利息		-	329,095.78
应付收益		-	-
其他应付款	3(6)	500,000.00	500,000.00
卖出回购证券款		-	200,000,000.00
预提费用	3(7)	256,000.00	-
其他负债		-	-
<b>负债合计</b>		<b>5,626,908.74</b>	<b>246,722,574.70</b>
<b>持有人权益：</b>			
实收基金		3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得		-184,582,219.88	146,448,643.82

未分配收益	76,065,221.01	361,034,236.23
持有人权益合计	2,891,483,001.13	3,507,482,880.05
负债及持有人权益总计	2,897,109,909.87	3,754,205,454.75

安顺证券投资基金  
经营业绩表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

	附注	2002 年	2001 年
一. 已实现基金收入：		106,639,308.97	412,784,429.29
股票差价收入	1(6)	12,816,199.51	304,568,977.20
债券差价收入	1(6)	28,689,659.90	46,777,857.08
债券利息收入	1(6)	39,212,616.47	25,823,388.69
存款利息收入	1(6)	7,621,196.14	15,232,994.37
股利收入	1(6)	17,471,175.44	18,163,088.81
买入返售证券收入	1(6)	184,000.00	379,795.02
其他收入	3(8)	644,461.51	1,838,328.12
二. 本期基金费用：		64,605,011.88	85,002,362.86
基金管理人报酬	2(4)	48,362,233.28	57,905,051.71
基金托管费	2(4)	8,062,720.17	9,789,950.14
卖出回购证券支出		6,009,711.60	13,860,504.51
利息支出		-	-
其他费用	3(9)	2,170,346.83	3,446,856.50
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		700,000.00	340,000.00
审计费用		260,000.00	100,000.00
三. 已实现基金净收益		42,034,297.09	327,782,066.43
加：未实现利得		-328,034,176.01	-638,761,018.91
四. 基金经营业绩		-285,999,878.92	-310,978,952.48

安顺证券投资基金  
收益分配表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

	附注	2002 年	2001 年
本期基金净收益		42,034,297.09	327,782,066.43
加：期初基金净收益		361,034,236.23	993,252,169.80
加：以前年度损益调整	1(10)	2,996,687.69	-
可供分配基金净收益		406,065,221.01	1,321,034,236.23

减：本期已分配基金净收益	330,000,000.00	960,000,000.00
期末基金净收益	76,065,221.01	361,034,236.23

### 安顺证券投资基金

#### 基金净值变动表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

	附注	2002 年	单位：人民币元 2001 年
一、期初基金净值		3,507,482,880.05	4,778,461,832.53
二、本期经营活动：			
基金净收益		42,034,297.09	327,782,066.43
未实现利得		-328,034,176.01	-638,761,018.91
经营活动产生的基金净值变动数		-285,999,878.92	-310,978,952.48
三、本期向持有人分配收益：			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-330,000,000.00	-960,000,000.00
四、期末基金净值		2,891,483,001.13	3,507,482,880.05

### (三) 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。

(2) 记帐原则：权责发生制。

(3) 记帐本位币：人民币。

(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；估值日无交易的，以最近交易日的市价估值。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。

②未上市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

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。

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 证券买卖价差收入：

a. 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。

b. 债券差价收入：卖出上市债券，应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。

② 股利收入：

在被投资股票股权除息日确认，并按上市公司宣告分红派息比例计算的金额入帐。

③ 债券利息收入：

债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额入账。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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

根据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55 号文和[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的征税范围，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 年年底以前暂免征收营业税和企业所得税。
- ③ 对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 基金管理人运用基金买卖股票按照 2% 的税率征收印花税。

(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，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) 会计政策的变更及其影响

根据中华人民共和国财政部 2001 年 11 月 11 日颁布的《证券投资基金会计核算办法》，本基金从 2002 年 1 月 1 日起，证券交易所债券交易的成本计价及利息收入确认方法作如下会计政策变更：成本计价方法由含息成本变更为不含息成本，利息收入由债券除息日确认变更为在债券持有期内按日计提确认。

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 12,272,037.21 元，债券投资成本调减人民币 9,275,349.52 元，两者差额人民币 2,996,687.69 元计入以前年度损益调整科目；同时，债券投资市值和未实现利得分别调减人民币 2,996,687.69 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
交通银行	基金托管人	提取托管费	基金契约
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
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
上海证券有限责任公司	与基金管理人 同属一股东*	租用交易席位	席位使用协议

\*该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  
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	年成交量	占总成交量比例	年佣金	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	394,414,788.66	12.93%	294,606.54	12.82%	0.07%
天同证券有限责任公司	61,051,266.97	2.00%	47,773.40	2.08%	0.08%

浙江证券有限责任公司	70,024,604.14	2.30%	51,147.71	2.23%	0.07%
东方证券有限责任公司	365,641,991.23	11.99%	276,792.39	12.04%	0.08%
合计	891,132,651.00	29.22%	670,320.04	29.17%	0.08%

本基金通过关联人席位 2001 年的股票交易情况:

关联人	年成交量	占总成交量比例	年佣金	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	483,068,374.00	11.54%	381,858.46	11.59%	0.08%
上海证券有限责任公司	55,620,872.80	1.33%	43,524.33	1.32%	0.08%
天同证券有限责任公司	451,974,528.14	10.80%	364,246.06	11.05%	0.08%
浙江证券有限责任公司	242,624,372.06	5.80%	194,205.15	5.89%	0.08%
东方证券有限责任公司	545,698,197.31	13.04%	440,311.26	13.36%	0.08%
合计	1,778,986,344.31	42.51%	1,424,145.26	43.21%	0.08%

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	比例	回购年成交量	比例
申银万国证券股份有限公司	1,626,079,420.50	14.38%	725,000,000.00	14.90%
天同证券有限责任公司	-	-	-	-
浙江证券有限责任公司	627,215,121.30	5.55%	-	-
东方证券有限责任公司	973,504,182.50	8.61%	470,000,000.00	9.66%
合计	3,226,798,724.30	28.54%	1,195,000,000.00	24.56%

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	比例	回购年成交量	比例
申银万国证券股份有限公司	725,127,541.30	11.76%	263,000,000.00	13.87%
上海证券有限责任公司	-	-	-	-
天同证券有限责任公司	207,337,093.70	3.36%	227,200,000.00	11.98%
浙江证券有限责任公司	-	-	-	-
东方证券有限责任公司	42,992,880.60	0.70%	32,300,000.00	1.70%
合计	975,457,515.60	15.82%	522,500,000.00	27.55%

(3) 本基金在本会计期间与关联人未发生银行间市场债券买卖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,本基金成立六个月后,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 为每日应支付的基金管理费

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。

	2002 年	2001 年
基金管理费	48,362,233.28 元	57,905,051.71 元

②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。

	2002 年	2001 年
基金托管费	8,062,720.17 元	9,789,950.14 元

3. 主要报表项目说明（单位：人民币元）

(1) 交易保证金

	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
深交所交易保证金	441,869.76	916,881.96

(2) 应收证券清算款

	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
应收上海证券清算款	37,646,925.30	9,829,520.11
应收深圳证券清算款	15,355,660.41	3,455,793.67
合计	53,002,585.71	13,285,313.78

(3) 应收利息

	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
银行存款和清算备付金利息	162,232.29	342,648.24
债券利息	8,119,437.47	1,706,849.34
合计	8,281,669.76	2,049,497.58

(4) 其他应收款

	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
应收券商费用	60,000.00	-

(5) 应付证券清算款

	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
应付上海证券清算款	-	35,824,804.62
应付深圳证券清算款	-	4,355,523.56
合计	-	40,180,328.18

(6) 其他应付款

	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
券商代垫交易保证金	500,000.00	500,000.00

(7) 预提费用

	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
审计费	130,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
债券帐户维护费	6,000.00	-
合计	256,000.00	-

(8) 其他收入

	2002 年	2001 年
国债认购手续费返还	220,000.00	1,520,340.00
配股新股手续费返还	418,410.93	284,291.26
印花税返还	6,050.58	33,696.86
合计	644,461.51	1,838,328.12

(9) 其他费用

	2002 年	2001 年
审计费	260,000.00	100,000.00
信息披露费	700,000.00	340,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
分红手续费	990,000.00	2,880,000.00
返售与回购交易费	122,520.30	44,067.00
其他	37,826.53	22,789.50
合计	2,170,346.83	3,446,856.50

(10) 以前年度损益调整

以前年度损益调整反映本年度发生的调整以前年度损益的事项。具体调整情况，参见主要会计政策部分的“会计政策的变更及其影响”。

	2002 年	2001 年
交易所债券价息分离调整	2,996,687.69	-

(四) 本基金流通受限、不能自由转让的资产

1. 基金获配新股，自新股获配日至新股上市日或以下规定期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。

截至 2002 年 12 月 31 日止，本基金持有流通受限的股票明细如下：

序号	股票名称	配售或申购 确认日期	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
1	中国联通	2002-9-26	2002-10-9	4,343,311	9,989,615.30	11,770,372.81	上市日起 6 个月
2	中信证券	2002-12-24	2003-1-6	978,000	4,401,000.00	4,401,000.00	上市日起流通
3	皖通高速	2002-12-26	2003-1-7	584,000	1,284,800.00	1,284,800.00	上市日起流通
	合计				15,675,415.30	17,456,172.81	

2. 截至 2002 年 12 月 31 日止，本基金无流通受限的债券。

3. 截至 2002 年 12 月 31 日止，本基金无流通受限的配股。

## (五) 基金投资组合

### 1. 按行业分类的股票投资组合

代码	分类	市值 (元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	43,136,751.71	1.49%
C	制造业	1,236,726,686.25	42.77%
C0	其中：食品、饮料	116,719,588.06	4.04%
C1	纺织、服装、皮毛	284,673,466.48	9.84%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	64,654,588.00	2.24%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	241,807,775.94	8.36%
C5	电子	47,044,691.18	1.63%
C6	金属、非金属	72,341,669.64	2.50%
C7	机械、设备、仪表	211,736,206.21	7.32%
C8	医药、生物制品	197,580,900.74	6.83%
C99	其他制造业	167,800.00	0.01%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	29,607,285.30	1.02%
E	建筑业	7,521,239.04	0.26%
F	交通运输、仓储业	140,371,499.86	4.86%
G	信息技术业	39,502,782.11	1.37%
H	批发和零售贸易	206,465,014.09	7.14%
I	金融、保险业	46,821,872.25	1.62%
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	22,329,162.90	0.77%
L	传播与文化产业	7,622,170.15	0.26%
M	综合类	-	-
	总计	1,780,104,463.66	61.56%

### 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 167,842,485.10 元，占基金资产净值的 5.80%。

### 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 940,379,421.59 元，占基金资产净值的 32.52%。

### 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	海欣股份	20,091,618	264,606,609.06	9.15%
2	同仁堂	7,973,527	138,420,428.72	4.79%
3	中化国际	12,391,785	109,543,379.40	3.79%
4	上菱电器	9,121,466	100,153,696.68	3.46%
5	烟台万华	6,863,690	76,598,780.40	2.65%
6	华泰股份	5,151,760	64,654,588.00	2.24%
7	盐湖钾肥	4,400,702	59,233,448.92	2.05%

8	威孚高科	5,785,130	55,421,545.40	1.92%
9	盐田港 <sup>A</sup>	3,725,000	55,167,250.00	1.91%
10	五粮液	4,604,481	53,504,069.22	1.85%
11	招商银行	5,205,015	42,420,872.25	1.47%
12	珠海中富	5,481,229	42,260,275.59	1.46%
13	红星发展	2,135,651	39,659,039.07	1.37%
14	上海机场	4,300,000	38,829,000.00	1.34%
15	厦门建发	3,800,000	38,228,000.00	1.32%
16	广电信息	3,311,714	35,998,331.18	1.24%
17	招商局 <sup>A</sup>	3,911,784	35,088,702.48	1.21%
18	光明乳业	2,648,674	30,009,476.42	1.04%
19	华能国际	2,645,870	29,607,285.30	1.02%
20	江苏舜天	2,377,866	25,490,723.52	0.88%
21	振华港机	2,345,548	24,792,442.36	0.86%
22	恒瑞医药	2,360,888	24,293,537.52	0.84%
23	海螺水泥	3,700,000	23,680,000.00	0.82%
24	张裕 <sup>A</sup>	1,547,900	22,599,340.00	0.78%
25	首创股份	2,136,762	22,329,162.90	0.77%
26	辽河油田	2,994,698	21,771,454.46	0.75%
27	华菱管线	4,511,690	21,520,761.30	0.74%
28	中国联通	7,888,311	21,377,322.81	0.74%
29	宝钢股份	5,134,318	21,102,046.98	0.73%
30	上海汽车	2,917,654	19,927,576.82	0.69%
31	通化东宝	2,164,530	17,922,308.40	0.62%
32	扬子石化	3,804,447	17,804,811.96	0.62%
33	鲁泰 <sup>A</sup>	1,837,472	15,251,017.60	0.53%
34	丽珠集团	1,700,100	14,875,875.00	0.51%
35	上海能源	1,269,493	13,164,642.41	0.46%
36	华联超市	857,902	10,723,775.00	0.37%
37	中兴通讯	815,450	10,568,232.00	0.37%
38	大显股份	1,630,000	10,562,400.00	0.37%
39	华联商厦	1,310,165	9,891,745.75	0.34%
40	歌华有线	431,851	7,622,170.15	0.26%
41	新世界	1,013,223	7,031,767.62	0.24%
42	北京城建	732,684	7,004,459.04	0.24%
43	兆维科技	750,603	6,830,487.30	0.24%
44	生益科技	1,013,585	6,557,894.95	0.23%
45	云铝股份	746,817	6,034,281.36	0.21%
46	模塑科技	524,500	5,989,790.00	0.21%
47	双汇发展	579,216	5,977,509.12	0.21%
48	外运发展	366,378	5,938,987.38	0.21%
49	神火股份	532,400	5,733,948.00	0.20%

50	益民百货	562,310	5,555,622.80	0.19%
51	中信证券	978,000	4,401,000.00	0.15%
52	伊利股份	233,384	4,130,896.80	0.14%
53	黑牡丹	216,018	4,007,133.90	0.14%
54	海油工程	175,942	2,466,706.84	0.09%
55	天士力	115,315	2,068,751.10	0.07%
56	上海航空	316,000	2,060,320.00	0.07%
57	中远航运	222,000	2,002,440.00	0.07%
58	三佳模具	92,000	1,557,560.00	0.05%
59	皖通高速	584,000	1,284,800.00	0.04%
60	天地科技	66,000	1,100,880.00	0.04%
61	中联重科	100,000	906,000.00	0.03%
62	茉织华	76,582	808,705.92	0.03%
63	中天科技	54,000	563,220.00	0.02%
64	腾达建设	54,000	516,780.00	0.02%
65	法拉电子	37,000	483,960.00	0.02%
66	卧龙科技	33,000	427,350.00	0.01%
67	龙溪股份	36,000	349,200.00	0.01%
68	菲达环保	22,000	305,580.00	0.01%
69	时代新材	19,000	261,630.00	0.01%
70	裕丰股份	24,000	238,560.00	0.01%
71	青岛啤酒	23,500	184,240.00	0.01%
72	长园新材	10,000	167,800.00	0.01%
73	信雅达	7,000	163,520.00	0.01%
74	新华医疗	8,000	134,240.00	0%
75	精达股份	6,000	102,240.00	0%
76	燕京啤酒	8,830	75,496.50	0%
77	中孚实业	400	4,580.00	0%
	合计		1,780,104,463.66	61.56%

## 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(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 3,156,630.78 元,与股票市值 1,780,104,463.66 元、债券(不包括国债) 167,842,485.10 元、国债及货币资金 940,379,421.59 元之和相加后等于基金净值。其他应收应付款项包括:深圳交易保证金、应收利息、其他应收款、应付管理费、应付托管费、应付券商佣金、其他应付款、预提费用等。

(六) 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场认购	二级市场买入	其他	
1	上海机场	-	7,527,533	-	3,227,533
2	皖通高速	584,000	-	-	-
3	宝钢股份	-	7,834,318	-	2,700,000
4	中信证券	978,000	-	-	-
5	招商银行	4,849,775	2,149,200	-	1,793,960
6	中国联通	9,897,311	-	-	2,009,000
7	上海汽车	-	4,917,654	-	2,000,000
8	厦门建发	-	5,445,842	-	1,645,842
9	生益科技	-	1,013,585	-	-
10	北京城建	-	2,032,352	-	1,299,668
11	外运发展	-	366,378	-	-
12	华泰股份	-	4,972,612	455,810	276,662
13	中远航运	222,000	-	-	-
14	时代新材	19,000	-	-	-
15	黑牡丹	24,000	192,018	-	-
16	腾达建设	54,000	-	-	-
17	中天科技	54,000	-	-	-
18	长园新材	10,000	-	-	-
19	菲达环保	22,000	-	-	-
20	天士力	28,000	368,615	-	281,300
21	裕丰股份	24,000	-	-	-
22	法拉电子	37,000	-	-	-
23	信雅达	7,000	-	-	-
24	精达股份	6,000	-	-	-
25	卧龙科技	33,000	-	-	-
26	天地科技	66,000	-	-	-
27	海油工程	23,000	152,942	-	-
28	海螺水泥	123,000	8,319,448	-	4,742,448
29	新华医疗	8,000	-	-	-
30	上海航空	436,000	-	-	120,000
31	龙溪股份	36,000	-	-	-
32	中孚实业	41,000	-	-	40,600
33	光明乳业	252,000	3,661,674	-	1,265,000
34	青岛啤酒	-	1,358,845	-	1,335,345
35	新世界	-	1,078,019	195,604	260,400
36	华联商厦	-	1,399,595	-	89,430
37	兆维科技	-	1,048,500	-	297,897
38	大显股份	-	6,873,502	2,046,780	7,290,282

39	益民百货	-	962,310	-	400,000
40	华联超市	-	893,967	-	36,065
41	通化东宝	-	2,164,530	-	-
42	伊利股份	-	1,005,144	202,500	974,260
43	丽珠集团	-	1,700,100	-	-
44	威孚高科	-	7,148,051	-	1,362,921
45	珠海中富	-	5,481,229	-	-
46	模塑科技	-	449,900	74,600	-
47	燕京啤酒	-	708,830	-	700,000
48	云铝股份	-	30,000	1,136,817	420,000
49	辽河油田	-	2,994,698	-	-
50	扬子石化	-	3,920,147	-	115,700
51	张裕 <sup>A</sup>	-	1,547,900	-	-
52	华菱管线	-	1,400,000	7,406,700	4,295,010

#### 新增股票附注

本表中“其他”项目包括：配股、转增、送股、增发、债转股。

#### (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	上港集箱	6,729,500	-	6,729,500
2	中海发展	-	618,000	618,000
3	兖州煤业	2,108,760	199,990	2,308,750
4	吉林森工	-	746,870	746,870
5	营口港	-	79,000	79,000
6	大厦股份	-	32,000	32,000
7	长江通信	999,368	795,318	1,794,686
8	山东基建	-	340,000	340,000
9	亚宝药业	-	23,000	23,000
10	旭光股份	-	14,000	14,000
11	精伦电子	-	16,000	16,000
12	承德钒钛	-	120,000	120,000
13	华联综超	21,892	-	21,892
14	华冠科技	-	22,000	22,000
15	鑫新股份	-	2,000	2,000
16	宝光股份	208,000	-	208,000
17	安源股份	-	81,000	81,000
18	湘电股份	-	80,000	80,000
19	华鲁恒升	-	66,000	66,000
20	宝钛股份	-	59,000	59,000
21	扬农化工	-	21,000	21,000

22	长江股份	-	29,000	29,000
23	烽火通信	291,000	-	291,000
24	科达机电	-	7,000	7,000
25	宏智科技	-	28,000	28,000
26	西昌电力	-	75,000	75,000
27	香梨股份	103,000	-	103,000
28	天富热电	-	10,000	10,000
29	国药股份	-	38,000	38,000
30	第一投资	-	12,000	12,000
31	海龙科技	-	70,000	70,000
32	贵州茅台	169,000	-	169,000
33	贵航股份	148,000	-	148,000
34	山东药玻	-	33,000	33,000
35	豫光金铅	-	27,000	27,000
36	华阳科技	-	24,000	24,000
37	栖霞建设	-	8,000	8,000
38	中软股份	-	30,000	30,000
39	深 高 速	2,935,410	-	2,935,410
40	厦门钨业	-	14,000	14,000
41	科大创新	-	10,000	10,000
42	方兴科技	-	24,000	24,000
43	太行股份	-	34,000	34,000
44	康缘药业	-	22,000	22,000
45	金自天正	-	14,000	14,000
46	江西长运	-	14,000	14,000
47	迪马股份	-	7,000	7,000
48	山鹰纸业	238,000	-	238,000
49	京能热电	-	115,000	115,000
50	黄海股份	-	49,000	49,000
51	八一钢铁	-	191,000	191,000
52	金晶科技	-	19,000	19,000
53	泰豪科技	-	16,000	16,000
54	大连圣亚	-	17,000	17,000
55	北 大 荒	-	250,000	250,000
56	金丰投资	-	1,920,000	1,920,000
57	中远发展	-	389,000	389,000
58	申能股份	-	2,680,000	2,680,000
59	青岛海尔	1,373,195	-	1,373,195
60	龙电股份	-	1,505,569	1,505,569
61	巴士股份	-	230,000	230,000
62	国电电力	-	584,158	584,158
63	友谊股份	10,000	304,000	314,000

64	内蒙华电	-	2,409,966	2,409,966
65	深能源A	1,921,265	310,000	2,231,265
66	东阿阿胶	-	20,000	20,000
67	华东科技	-	961,890	961,890
68	湘计算机	-	1,034,364	1,034,364
69	武汉中百	40,000	12,000	52,000
70	银河科技	-	373,032	373,032
71	超声电子	2,527,360	-	2,527,360
72	法尔胜	236,200	-	236,200

## 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 0.2364 亿基金单位, 占基金发行总份额的 0.788%, 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	8,644,900	0.288%
天同证券有限责任公司	3,750,000	0.125%
浙江证券有限责任公司	3,750,000	0.125%
华安基金管理有限公司	7,500,000	0.25%

其中: 每个发起人持有未上市流通份额都为 3,750,000 份基金单位, 各占总份额比例的 0.125%。

社会公众持有的基金份额为 29.7636 亿基金单位, 占基金发行总份额的 99.212%。

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	中国太保	212,140,310	7.07%
2	中国人寿	159,507,539	5.32%
3	中国人保	115,235,300	3.84%
4	久事公司	83,458,680	2.78%
5	平安保险	74,046,481	2.47%
6	再保险	62,492,100	2.08%
7	联通国脉	40,912,900	1.36%
8	海通证券	20,218,600	0.67%
9	高新咨询	20,000,000	0.67%
10	贵财投资	18,036,000	0.60%

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 日基金安顺前 100 名持有人名册汇总统计而来。

## 七. 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. 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. 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信息变化。
6. 券商 2002 年各券商股票、债券及回购成交量和佣金情况如下：

### ①股票交易情况：

券商	股票年成交量	占总成交量 比例	年佣金	占总佣金量 比例
国泰君安证券股份有限公司	648,302,188.36	21.26%	480,621.22	20.91%
招商证券有限责任公司	481,532,068.53	15.79%	369,536.62	16.08%
华夏证券有限公司	435,079,673.11	14.26%	324,849.13	14.14%
海通证券股份有限公司	416,392,829.49	13.65%	325,239.47	14.15%
申银万国证券股份有限公司	394,414,788.66	12.93%	294,606.54	12.82%
东方证券有限责任公司	365,641,991.23	11.99%	276,792.39	12.04%
南方证券有限责任公司	177,420,886.10	5.82%	127,488.02	5.55%
浙江证券有限责任公司	70,024,604.14	2.30%	51,147.71	2.23%
天同证券有限责任公司	61,051,266.97	2.00%	47,773.40	2.08%
合计	3,049,860,296.59	100%	2,298,054.50	100%

### ②债券及回购交易情况：

券商	债券年成交量	比例	回购年成交量	比例
国泰君安证券股份有限公司	3,836,818,416.60	33.93%	1,230,000,000.00	25.27%
华夏证券有限公司	1,710,050,736.30	15.12%	791,600,000.00	16.27%
申银万国证券股份有限公司	1,626,079,420.50	14.38%	725,000,000.00	14.90%
海通证券股份有限公司	1,092,897,126.90	9.66%	520,000,000.00	10.68%
东方证券有限责任公司	973,504,182.50	8.61%	470,000,000.00	9.66%
招商证券有限责任公司	827,600,728.90	7.32%	370,000,000.00	7.60%
浙江证券有限责任公司	627,215,121.30	5.55%	-	-
南方证券有限责任公司	614,174,925.50	5.43%	760,000,000.00	15.62%

天同证券有限责任公司	-	-	-	-
合 计	11,308,340,658.50	100%	4,866,600,000.00	100%

#### 八. 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。

华安基金管理有限公司

2003 年 3 月 29 日