

安顺证券投资基金

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

本基金的托管人交通银行已于 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： 021-62750005

(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1月-6月
基金本期净收益：	140,594,077.13 元
单位基金本期净收益：	0.0469 元
基金可分配净收益：	174,625,001.05 元
单位基金可分配净收益：	0.0582 元
期末基金资产总值：	3,370,142,522.93 元
期末基金资产净值：	3,318,410,599.08 元
单位基金资产净值：	1.1061 元
基金资产净值收益率：	4.42%
本期基金资产净值增长率：	4.30%
累计资产净值增长率：	56.20%

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
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

截至 2002 年 6 月 30 日止, 本基金单位资产净值为 1.1061 元, 比 2001 年末增长了 4.30%。本期基金安顺实现净收益 14,059 万元。

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

上半年 GDP 同比增长 7.8%，好于年初市场的预期，并且二季度的增幅高于一季度，小幅回升的增长态势有助于投资者信心的恢复。但经济增长的微观基础并不坚实，消费物价指数的低位运行、财政收入增长的放缓、下岗失业以及“三农”问题等，又在某种程度上制约了增量资金入市的热情。

与宏观经济运行态势相一致，上半年股市探底回稳，二季度涨幅好于一季度，但总体仍保持箱体运行的格局，明显的趋势性变化尚未形成。除了经济因素的支撑以外，上半年政策上也出现重大变化，从第八次降息到降低交易佣金，从新股市值配售到终止国有股通过 A 股市场减持等，这一系列政策的组合效应，对市场走势产生巨大影响，最集中的表现是 6 月 24 日沪深两市的井喷走势，短短几天的行情，某种程度上却改变了大多数投资者半年多的投资命运。

安顺基金小组根据年初制定的策略，在一季度相对平衡的市场中，通过仓位控制和波段运作，取得较好成绩。二季度开始，尤其是二季度末，市场出现戏剧性变化，在最后一周净值表现急剧落后，上半年净值增长 4.30%，落后于沪市的 5.27%和深市的 6.52%，基金投资效果并不理想。归纳其原因主要表现在以下两个方面：

第一，投资偏于谨慎：去年中期以来大盘持续下跌形成惯性的熊市思维，加上本年初将要进行现金分红，基金的股票仓位一直控制在 50%左右。在基本面不确定性因素不明朗的情况下，我们采取了相对保守的投资策略，但同时却忽视了特定历史时期可能出现的政策性变化对市场的影响，从而错失了大盘突变所带来的巨大赢利机会，这再一次暴露出我们在政策分析、理解和判断上的差距。

第二，结构性矛盾突出：作为运作时间超过三年、并且经历牛熊市洗礼的基金，虽然一直致力于品种结构的优化，但还是始终面临品种老化的问题。面对市场结构和理念出现的重大变化，我们长期坚持的“精选个股、集中投资、长期持有”的理念正面临挑战。组合中部分重仓品种表现平平，形成所谓的“无效仓位”；在某种程度上也影响了基金总仓位的效力。求稳的心态使我们对风险小、市赢率低的品种更加关注，但忽视了基本面一般、但流动性较好的低价大盘股的短期配置，组合结构并不均衡，妨碍了对市场热点的参与力度。

值得欣慰的是，我们在控制股票仓位的同时，提高了国债投资的比重，从而较充分地分享了上半年国债市场的投资收益。另外，在“6.24”井喷行情中，我们没有盲目大幅增仓，而是积极进行了组合结构的调整，较好地控制了股票仓位和成本，避免了再次陷入被动的境地。

虽然影响股市最大的系统性因素国有股减持问题基本有了一个明确的结论，但市场的系统性风险并没有充分释放。“入世”为我们带来机会的同时，也会让我们承受经济调整的阵痛。上市公司、会计师、证券分析师行业在全球范围内面临的危机正使股市为过去的辉煌付出代价。我们在看好宏观经济增长潜力的同时，更关注微观经济增长的质量和持续性。国有股减持政策的变化，某种意义上将刺激企业进行其他形式的股权转让、变动行为。作为身处多重市场、多重股权

环境中的国内机构投资者，在新的形势下必须充分关注在不同市场、不同类别股东之间进行的股权变动活动，洞察蕴藏其中的利益关系和长远影响，规避风险，把握机会。

上半年基金安顺的净值表现并不理想，给我们下半年的运作增添了更多的压力。我们将充分利用市场活跃的时机，大力进行品种结构的优化，通过资产的配置、个股的挖掘和机会的捕捉来提高投资效益，力争扭转净值落后的局面。

（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”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”，在上半年来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、对基金安顺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：基金安顺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，基金安顺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顺存在重大违规情况。

四. 基金年度中期财务报告

(一) 基金会计报告书 (未经审计)

安顺证券投资基金
资产负债表
2002 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注	2002年6月30日	2001年12月31日
资产：			
银行存款		205,873,200.28	307,208,069.92
清算备付金		114,241,208.31	576,422,898.28
交易保证金	3(1)	538,099.94	916,881.96
应收证券清算款	3(2)	-	13,285,313.78
应收股利		-	-
应收利息	3(3)	14,137,317.66	2,049,497.58
其他应收款		-	-
股票投资市值	1(5)	1,870,278,780.48	1,642,225,550.93
其中：股票投资成本		1,727,565,979.30	1,499,077,364.09
债券投资市值	1(6)	1,164,544,601.30	1,212,095,322.30
其中：债券投资成本		1,163,471,804.45	1,208,796,785.32
配股权证		-	1,920.00
买入返售证券		-	-
待摊费用	3(4)	529,314.96	-
其他资产		-	-
资产总计		3,370,142,522.93	3,754,205,454.75

负债与基金持有人权益

负债：			
应付证券清算款	3(5)	45,815,491.35	40,180,328.18
应付管理人报酬		3,903,509.04	4,443,988.50
应付托管费		650,584.83	744,193.34
应付佣金		654,229.76	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)	208,108.87	-
其他负债		-	-
负债合计		51,731,923.85	246,722,574.70
持有人权益:			
实收基金	1(11)	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得		143,785,598.03	146,448,643.82
未分配收益		174,625,001.05	361,034,236.23
持有人权益合计		3,318,410,599.08	3,507,482,880.05
负债及持有人权益总计		3,370,142,522.93	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6 月30 日

单位: 人民币元

项目	附注	2002年1月1日- 2002年6月30日	2001年1月1日- 2001年6月30日
一、已实现基金收入:		173,688,630.50	310,347,424.36
股票差价收入	1(5)	87,854,245.64	274,540,423.43
债券差价收入	1(6)	51,477,728.69	2,371,885.52
债券利息收入	1(7)	23,099,928.19	12,190,492.76
存款利息收入	1(7)	5,008,827.21	6,149,735.98
股利收入	1(7)	5,564,276.33	14,061,065.49
买入返售证券收入	1(7)	184,000.00	309,863.02
其他收入	3(8)	499,624.44	723,958.16
二、本期基金费用:		33,094,553.37	46,725,918.29
基金管理人报酬	1(8)	24,910,274.84	31,171,895.80
基金托管费	1(9)	4,154,060.45	5,314,036.66
卖出回购证券支出	1(10)	2,746,066.14	6,959,422.33
利息支出		-	-
其他费用	3(9)	1,284,151.94	3,280,563.50
其中: 上市年费		29,753.31	60,000.00
信息披露费		538,520.30	220,000.00
审计费用		149,588.57	100,000.00
三、已实现基金净收益		140,594,077.13	263,621,506.07
加: 未实现利得	3(10)	333,641.90	-119,923,805.94
四、基金经营业绩		140,927,719.03	143,697,700.13

安顺证券投资基金
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 月 1 日- 2002 年 6 月 30 日	2001 年 1 月 1 日- 2001 年 6 月 30 日
本期基金净收益		140,594,077.13	263,621,506.07
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	3(10)	2,996,687.69	-
可供分配基金净收益		504,625,001.05	1,256,873,675.87
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		174,625,001.05	296,873,675.87

安顺证券投资基金
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 月 1 日- 2002 年 6 月 30 日
一、期初基金净值		3,507,482,880.05
二、本期经营活动：		
基金净收益		140,594,077.13
未实现利得	3(10)	333,641.90
经营活动产生的基金净值变动数		140,927,719.03
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		330,000,000.00
四、期末基金净值		3,318,410,599.08

(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) 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

(3) 会计制度

本基金执行国家有关的会计制度和《证券投资基金会计核算办法》。

(4) 记账原则和计价基础

本基金的会计核算以权责发生制为记账原则，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。

(5) 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账。

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平均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场平均价估值。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场平均价估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

(6) 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账，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平均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场平均价估值。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。

(7) 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。

⑦其他收入在实际收到时确认。

(8) 基金管理费

基金管理费为支付给基金管理人的报酬，根据中国证券监督管理委员会证监基金字[1999]15号《关于同意设立安顺证券投资基金的批复》的规定，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提，按月支付。基金成立三个月后，如果基金持有的现金比例超过基金资产净值的20%，超出部分不计提管理费。

(9) 基金托管费

基金托管费为根据《安顺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，按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提，按月支付。

(10) 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。

(11) 实收基金

实收基金以基金单位面值乘以实际发行基金单位数入账。

(12) 税项

根据财政部、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》，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 2000 年底以前暂免征收营业税。
- ③ 基金管理人运用基金买卖股票按照 4 %的税率征收印花税。
- ④ 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。

根据财政部、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》中有关规定：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(股票)交易印花税下调为 2 %。

(13) 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。

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	提取管理费	基金契约
	基金发起人		
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	租用交易席位	席位使用协议
	基金发起人		
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	租用交易席位	席位使用协议
	基金发起人		
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：

①股票交易情况:

关 联 人	1-6月股票成交量	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	345,784,484.16	21.86%	256,552.59	21.60%	0.07%
天同证券有限责任公司	61,051,266.97	3.86%	47,773.40	4.02%	0.08%
浙江证券有限责任公司	70,024,604.14	4.43%	51,147.71	4.31%	0.07%
东方证券有限责任公司	198,077,100.98	12.52%	145,671.72	12.27%	0.07%
合 计	674,937,456.25	42.67%	501,145.42	42.20%	0.07%

②债券及回购交易情况:

关 联 人	1-6月债券成交量	占总成交 量比例	1-6月回购成交量	占总成交 量比例
申银万国证券股份有限公司	1,624,925,340.20	26.57%	725,000,000.00	29.41%
天同证券有限责任公司	-	-	-	-
浙江证券有限责任公司	627,215,121.30	10.25%	-	-
东方证券有限责任公司	949,130,368.50	15.52%	470,000,000.00	19.07%
合 计	3,201,270,830.00	52.34%	1,195,000,000.00	48.48%

(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,按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提,本基金成立三个月后,如果基金持有的现金比例超过本基金资产净值的 20%,超出部分不计提管理费。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 年上半年本基金需支付基金管理费 24,910,274.84 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 年上半年本基金需支付基金托管费 4,154,060.45 元。

3. 主要报表项目说明

(1) 交易保证金

	2002 年 6 月 30 日	2001 年 12 月 31 日
深交所交易保证金	538,099.94	916,881.96

(2) 应收证券清算款

	2002 年6 月30 日	2001 年12 月31 日
应收上海证券清算款	-	9,829,520.11
应收深圳证券清算款	-	3,455,793.67
合计	-	13,285,313.78

(3) 应收利息

	2002 年6 月30 日	2001 年12 月31 日
银行存款和清算备付金利息	113,804.27	342,648.24
债券利息	14,023,513.39	1,706,849.34
合计	14,137,317.66	2,049,497.58

(4) 待摊费用

待摊费用包括已经发生的、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、审计费用和律师费用等。

	2002 年6 月30 日	2001 年12 月31 日
上市年费	30,246.69	-
分红手续费	499,068.27	-
合计	529,314.96	-

(5) 应付证券清算款

	2002 年6 月30 日	2001 年12 月31 日
应付上海证券清算款	28,850,701.09	35,824,804.62
应付深圳证券清算款	16,964,790.26	4,355,523.56
合计	45,815,491.35	40,180,328.18

(6) 其他应付款

	2002 年6 月30 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

预提费用包括预计将发生的、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、审计费用和律师费用等。

	2002 年6 月30 日	2001 年12 月31 日
审计费	149,588.57	-
信息披露费	58,520.30	-
合计	208,108.87	-

(8) 其他收入

	2002 年1-6 月	2001 年1-6 月
国债认购手续费返还	220,000.00	522,675.00
配股新股手续费返还	273,573.86	188,692.75
印花税返还	6,050.58	12,590.41
合计	499,624.44	723,958.16

(9) 其他费用

	2002 年1-6 月	2001 年1-6 月
审计费	149,588.57	100,000.00
信息披露费	538,520.30	220,000.00
上市年费	29,753.31	60,000.00
分红手续费	490,931.73	2,880,000.00
返售与回购交易费	58,750.00	14,463.50
其他	16,608.03	6,100.00
合计	1,284,151.94	3,280,563.50

(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，债券估值增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。

	2002 年1-6 月	2001 年1-6 月
交易所债券价息分离调整	2,996,687.69	-

(三) 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 6 月 30 日止，本基金持有流通受限的股票明细如下：

序号	股票名称	配售确认日期	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
1	招商银行	2002-4-1	2002-4-9	4,849,775	35,403,357.50	55,481,426.00	2002-4-9起8个月
2	安源股份	2002-6-20	2002-7-2	81,000	485,190.00	485,190.00	2002-7-2起流通
3	宏智科技	2002-6-27	2002-7-9	28,000	243,040.00	243,040.00	2002-7-9起流通
4	泰豪科技	2002-6-24	2002-7-3	16,000	76,160.00	76,160.00	2002-7-3起流通
	合计				36,207,747.50	56,285,816.00	

2. 截至 2002 年 6 月 30 日止，本基金无流通受限的债券。
3. 截至 2002 年 6 月 30 日止，本基金无流通受限的配股。

(四) 基金投资组合**1. 按行业分类的投资组合**

代码	分 类	市值 (元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	5,914,392.00	0.18%
B	采掘业	42,916,167.33	1.29%
C	制造业	1,304,037,331.18	39.30%
C0	其中: 食品、饮料	110,092,822.10	3.32%
C1	纺织、服装、皮毛	386,881,898.30	11.66%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	26,549,584.30	0.80%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	190,714,010.06	5.75%
C5	电子	122,590,646.68	3.69%
C6	金属、非金属	84,462,917.82	2.55%
C7	机械、设备、仪表	209,038,202.96	6.30%
C8	医药、生物制品	173,707,248.96	5.23%
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	66,987,301.22	2.02%
E	建筑业	18,362,507.00	0.55%
F	交通运输、仓储业	143,696,651.48	4.33%
G	信息技术业	10,582,592.72	0.32%
H	批发和零售贸易	185,886,673.18	5.60%
I	金融、保险业	55,481,426.00	1.67%
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	16,362,638.85	0.49%
L	传播与文化产业	20,051,099.52	0.61%
M	综合类	-	-
	总计	1,870,278,780.48	56.36%

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 86,572,141.80 元, 占基金资产净值的 2.61%。

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 1,352,271,376.74 元, 占基金资产净值的 40.75%。

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	16,743,015	314,936,112.15	9.49%
2	同 仁 堂	7,475,881	142,639,809.48	4.30%
3	中化国际	7,873,775	119,208,953.50	3.59%
4	上菱电器	8,195,302	107,932,127.34	3.25%
5	烟台万华	6,570,000	94,082,400.00	2.84%
6	五 粮 液	5,001,200	75,268,060.00	2.27%
7	广电信息	5,096,514	74,714,895.24	2.25%

8	威孚高科	6,193,454	72,835,019.04	2.20%
9	盐田港A	3,814,396	63,738,557.16	1.92%
10	上海机场	5,696,951	58,792,534.32	1.77%
11	招商银行	4,849,775	55,481,426.00	1.67%
12	盐湖钾肥	3,546,101	55,248,253.58	1.66%
13	华能国际	3,236,164	46,536,038.32	1.40%
14	茉 织 华	2,703,625	46,475,313.75	1.40%
15	红星发展	1,674,084	41,383,356.48	1.25%
16	海螺水泥	4,542,880	37,297,044.80	1.12%
17	江苏舜天	2,398,288	35,638,559.68	1.07%
18	华菱管线	5,728,315	34,713,588.90	1.05%
19	恒瑞医药	2,373,372	31,067,439.48	0.94%
20	华泰股份	1,665,595	26,549,584.30	0.80%
21	厦门建发	2,000,000	26,180,000.00	0.79%
22	鲁 泰A	1,728,232	24,972,952.40	0.75%
23	超声电子	2,527,360	23,984,646.40	0.72%
24	大显股份	3,193,998	23,891,105.04	0.72%
25	振华港机	1,699,791	22,743,203.58	0.69%
26	张 裕A	1,147,397	22,144,762.10	0.67%
27	神火股份	1,552,700	21,411,733.00	0.65%
28	歌华有线	728,601	20,051,099.52	0.60%
29	北京城建	1,419,050	18,362,507.00	0.55%
30	招商局A	1,400,000	18,284,000.00	0.55%
31	首创股份	1,141,845	16,362,638.85	0.49%
32	内蒙华电	1,742,018	15,765,262.90	0.48%
33	双汇发展	1,000,000	12,680,000.00	0.38%
34	云铝股份	1,136,817	11,777,424.12	0.35%
35	兖州煤业	1,008,750	10,995,375.00	0.33%
36	上海能源	744,387	10,116,219.33	0.30%
37	长江通信	321,360	6,501,112.80	0.20%
38	吉林森工	573,100	5,914,392.00	0.18%
39	龙电股份	600,000	4,686,000.00	0.14%
40	友谊股份	254,000	4,312,920.00	0.13%
41	中兴通讯	160,202	3,838,439.92	0.12%
42	中远航运	222,000	2,881,560.00	0.09%
43	三佳模具	92,000	2,376,360.00	0.07%
44	天地科技	66,000	1,706,100.00	0.05%
45	中孚实业	41,000	674,860.00	0.02%
46	卧龙科技	33,000	617,430.00	0.02%
47	大厦股份	32,000	546,240.00	0.02%
48	黑 牡 丹	24,000	497,520.00	0.02%
49	安源股份	81,000	485,190.00	0.01%
50	海油工程	23,000	392,840.00	0.01%
51	中联重科	18,100	266,613.00	0.01%
52	宏智科技	28,000	243,040.00	0.01%

53	泰豪科技	16,000	76,160.00	0.00%
	合计		1,870,278,780.48	56.36%

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 9,288,300.06 元，与股票市值 1,870,278,780.48 元、债券（不包括国债）86,572,141.80 元、国债及货币资金 1,352,271,376.74 元之和相加后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收利息、深圳交易保证金、待摊费用、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。

(五) 本期新增股票

序号	股票名称	本 期 新 增			本期卖出
		一级市场认购	二级市场买入	其他	
1	威孚高科	-	6,630,818	-	437,364
2	云铝股份	-	-	1,136,817	-
3	张裕A	-	1,147,397	-	-
4	华菱管线	-	-	7,406,700	1,678,385
5	上海机场	-	5,696,951	-	-
6	招商银行	4,849,775	-	-	-
7	厦门建发	-	2,478,156	-	478,156
8	吉林森工	-	573,100	-	-
9	北京城建	-	1,419,050	-	-
10	华泰股份	-	1,665,595	-	-
11	大厦股份	32,000	-	-	-
12	安源股份	81,000	-	-	-
13	中远航运	222,000	-	-	-
14	宏智科技	28,000	-	-	-
15	黑牡丹	24,000	-	-	-
16	卧龙科技	33,000	-	-	-
17	天地科技	66,000	-	-	-
18	海油工程	23,000	-	-	-
19	海螺水泥	123,000	4,979,880	-	560,000
20	泰豪科技	16,000	-	-	-
21	中孚实业	41,000	-	-	-
22	龙电股份	-	1,108,792	-	508,792
23	大显股份	-	5,160,277	2,046,780	4,013,059

24	内蒙华电	-	1,742,018	-	-
----	------	---	-----------	---	---

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。

(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	深能源A	1,921,265	310,000	2,231,265
2	东阿阿胶	-	20,000	20,000
3	湘计算机	-	1,034,364	1,034,364
4	武汉中百	40,000	12,000	52,000
5	银河科技	-	373,032	373,032
6	法 尔 胜	236,200	-	236,200
7	上港集箱	6,729,500	-	6,729,500
8	中海发展	-	618,000	618,000
9	营 口 港	-	79,000	79,000
10	山东基建	-	340,000	340,000
11	精伦电子	-	16,000	16,000
12	北京华联	21,892	-	21,892
13	鑫新股份	-	2,000	2,000
14	宝光股份	208,000	-	208,000
15	华鲁恒升	-	66,000	66,000
16	宝钛股份	-	59,000	59,000
17	扬农化工	-	21,000	21,000
18	长江股份	-	29,000	29,000
19	烽火通信	291,000	-	291,000
20	西昌电力	-	75,000	75,000
21	香梨股份	103,000	-	103,000
22	天富热电	-	10,000	10,000
23	贵州茅台	169,000	-	169,000
24	贵航股份	148,000	-	148,000
25	山东药玻	-	33,000	33,000
26	栖霞建设	-	8,000	8,000
27	中软股份	-	30,000	30,000
28	深 高 速	2,935,410	-	2,935,410
29	山鹰纸业	238,000	-	238,000
30	京能热电	-	115,000	115,000
31	北 大 荒	-	250,000	250,000
32	金丰投资	-	1,920,000	1,920,000
33	中远发展	-	389,000	389,000
34	申能股份	-	2,680,000	2,680,000
35	青岛海尔	1,373,195	-	1,373,195
36	巴士股份	-	230,000	230,000
37	国电电力	-	483,108	483,108

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 0.2265 亿份基金单位, 占基金发行总份额的 0.755%, 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	7,650,000	0.255%
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%

社会公众持有的基金份额为 29.7735 亿份基金单位, 占基金发行总份额的 99.245%。

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	214,257,410	7.14%
2	中国人寿	159,136,139	5.30%
3	中国人保	115,235,300	3.84%
4	平安保险	111,285,800	3.71%
5	久事公司	77,790,130	2.59%
6	再保险	62,492,100	2.08%
7	联通国脉	40,912,900	1.36%
8	泰康人寿	31,000,000	1.03%
9	金华信托	25,000,000	0.83%
10	东方证券	24,828,000	0.83%

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 6 月 30 日基金安顺前 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、托管人目前无重大诉讼事项。
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、债券及回购成交量和佣金情况如下:

①股票交易情况:

券商	股票成交量	占总成交量 比例	佣金	占总佣金量 比例
申银万国证券股份有限公司	345,784,484.16	21.86%	256,552.59	21.60%
天同证券有限责任公司	61,051,266.97	3.86%	47,773.40	4.02%
浙江证券有限责任公司	70,024,604.14	4.43%	51,147.71	4.31%
华夏证券有限公司	160,322,818.05	10.14%	126,805.45	10.68%
招商证券股份有限公司	308,342,898.95	19.49%	234,013.56	19.71%
南方证券股份有限公司	138,331,981.81	8.74%	101,494.26	8.55%
东方证券有限责任公司	198,077,100.98	12.52%	145,671.72	12.27%
国泰君安证券股份有限公司	299,906,298.48	18.96%	223,963.01	18.86%
合 计	1,581,841,453.54	100%	1,187,421.70	100%

②债券及回购交易情况:

券商	债券成交量	占总成交量 比例	回购成交量	占总成交量 比例
申银万国证券股份有限公司	1,624,925,340.20	26.57%	725,000,000.00	29.41%
天同证券有限责任公司	-	-	-	-
浙江证券有限责任公司	627,215,121.30	10.25%	-	-
华夏证券有限公司	30,540,000.00	0.50%	-	-
招商证券股份有限公司	817,094,644.80	13.36%	370,000,000.00	15.01%
南方证券股份有限公司	272,700,036.60	4.46%	500,000,000.00	20.28%
东方证券有限责任公司	949,130,368.50	15.52%	470,000,000.00	19.07%
国泰君安证券股份有限公司	1,794,274,144.40	29.34%	400,000,000.00	16.23%
合 计	6,115,879,655.80	100%	2,465,000,000.00	100%

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. 安顺证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注。
6. 安顺证券投资基金 2001 年度收益分配公告。
7. 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

2002 年 8 月 29 日