

安久证券投资基金

2001 年年度报告

华安基金管理有限公司

2002 年 3 月 29 日

重要提示

本基金的托管人交通银行已于 2002 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: 安久证券投资基金
(简称: 基金安久)
- 交易代码: 184709
- 基金发起人: 华安基金管理有限公司
- 基金成立日期: 1992 年 8 月 31 日 (原四川国信投资基金成立日期)
2000 年 7 月 4 日华安基金管理有限公司开始管理基金安久
- 基金单位总份额: 200,000,020 份基金单位
- 基金类型: 契约型封闭式
- 基金存续期: 10 年(自 1992 年 8 月 31 日至 2002 年 8 月 30 日)
- 基金上市地点: 深圳证券交易所
- 基金上市日期: 2001 年 8 月 31 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: 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、曹培青

二. 主要财务指标

	2001 年	2000 年 7 月-12 月
基金本期净收益:	-39,038,798.45 元	-12,564,384.90 元
单位基金本期净收益:	-0.1952 元	-0.0628 元
基金可分配净收益:	-59,142,415.58 元	-20,103,617.13 元
单位基金可分配净收益:	-0.2957 元	-0.1005 元
期末基金资产总值:	135,583,446.15 元	138,524,394.11 元
期末基金资产净值:	135,005,563.75 元	136,303,648.50 元
单位基金资产净值:	0.6750 元	0.6815 元
基金资产净值收益率:	-28.64%	-7.45%
本期基金净值增长率:	-0.95%	-19.16%
基金累计净值增长率:	-19.93%	-19.16%

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

(一)基金管理人报告

基金经理简介

王国卫先生, 基金经理, 硕士学位。9 年证券从业经验。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作。现任华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部总监, 基金安信和基金安久的基金经理。

李玲女士, 基金经理, 经济学学士, 在读研究生。4 年证券从业经历, 曾在金华信托投资股份有限公司投资管理部、证大投资管理有限公司投资部工作。2000 年进入华安基金管理有限公司投资部任交易员。现任基金安信和基金安久的基金经理。

基金业绩表现

截止 2001 年 12 月 31 日, 本基金单位资产净值为 0.6750 元, 基金净值增长率为 -0.95%, 表现优于两市指数 (上证综指下跌 20.62%, 深综指下跌 25.13%)。由于基金单位净值仍在面值以下, 本年度基金无法分红。

基金管理人工作报告

2001 年已经过去，关于证券市场的回顾我们不想做过多的描述。这是基金安久第一份年报，我们希望多介绍一下基金的历史和具体的操作。作为华安基金管理公司管理的 5 个基金中的一个，基金安久不幸成为单位净值最低的基金，而且是唯一低于面值的基金，与华安其他基金形成了鲜明的对比。需要说明的是，华安并没有歧视规模小的基金，没有因为管理费少而不投入足够的人力。相反地，为使基金安久能早日成功扩募并返回面值之上，基金经理小组尽了最大的努力。

基金安久是由原四川国信基金转制而来，2000 年 7 月接手时该基金只满仓投资了环保股份一只股票。2000-2001 年，受经营性和其他非经营性因素影响，环保股份基本面急剧变化，反映在二级市场上，股票价格阴跌不止，其跌幅远高于深综指的下跌幅度。非常明显单一的持仓结构完全不符合基金组合投资的一般要求，注定了操作上将时时处于被动状态。管理这样的基金对基金经理是一个极大的挑战。特别是在 2001 年市场整体机会不多的情况下，基金业绩大幅增长的难度更大。而个股的严重亏损对基金经理的心理影响是非常大的，在操作时难免患得患失。根据基金安久原资产质量不高和规模相对较小的特点，2001 年基金经理小组制定了针对性的操作策略：

1. 清除环保股份，将个股对组合的负面影响降到最低程度。事实证明，清除环保股份对扭转该基金运作的不利局面起到至关重要的作用。基金获得宝贵的现金，一方面可以选择其他有潜力的品种投资，另一方面有效规避了下半年大市转弱可能带来的更大的风险。
2. 按照组合投资的要求和均衡投资的策略，遵照华安精选个股的程序，重新构造基金投资组合。均衡投资就是投资组合中股票个股控制在 20 个左右，除个别品种外，多数品种的投资金额相对均匀，以此增强个股操作的灵活性。从新品种全年的表现看，多数品种跑赢了指数，组合的风险程度也大为降低。
3. 制定有针对性的操作策略，最大限度获取个股资本利得。基金安久总资产不足 2 亿，相比本公司管理的其他基金，规模小，因而更容易应对市场短期的变化，有“船小调头快”的优势。针对这个特点，在操作上为基金安久制定了“勿以利小而不为”和“大进大出”的操作策略，快速切换股票和国债的投资比例，在符合法规要求的前提下，使资金发挥最大的效益。因此，从周转率指标看，基金安久的此项指标可能会高于本公司管理的其他基金。

由于原基金买入环保股份的成本过高，在清仓时实现了巨额亏损，虽然其他股票获得了一定的收益，但仍难以弥补亏损。截至 2001 年底，基金安久实现的亏损已经收缩到了 3900 多万元，在沪深两市大盘跌幅高达 22.88% 的背景下，基金净值仅下跌 0.95%。基金经理认为，从基金长远发展考虑，目前实现亏损是合理和无奈的，是基金组合结构调整的最小代价。为尽早使基金安久走出困境，我们主动放弃提取基金 2001 年的管理费。

2002 年证券市场的不确定性较多，但全国金融工作会议提出稳定是发展的基础，证券市场要处理好稳定、规范和发展三者之间的关系，制约证券市场的一些不利因素可能会得到缓解。加之宏观经济仍总体向好，GDP 有望保持 7% 左右的速度增长，指数大幅下跌的概率极小，稳定的环境为小基金的操作提供了有利条件，基金契约的成功修改使基金安久可投资的股票范围比原来有所扩展，因此基金经理有信心通过努力尽快使基金单位净值恢复到面值之上。2002 年，基金安久计划

扩募到 5 亿份，我们真诚的希望新老投资者能一如既往地信任和支持我们。

（二）内部监察报告

一、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、《安久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。

二、内部监察工作报告

2001 年度中，伴随公司基金管理规模逐步扩大、公司组织结构逐步完善、新业务开发速度加快，公司对全方位的合法合规性运作提出了更高的要求。这不仅要求严格遵循现有法律法规制度，更需要根据现代企业制度的要求规范完善公司业务流程规则与内部风险控制体系，树立全员风险防范、控制意识。

在过去的一年里，监察稽核部与各业务部门紧密配合，共同建立公司风险防范体系；监察稽核部自身也积极吸取境外合作伙伴风险控制先进经验，不断对现有监察工作方式和工作内容进行调整和完善，主要表现在完善监察规则与程序、调整监察手段、提高监察效率等诸多方面。

在报告期内，我们对以下方面着重实施了监察：

1、对基金安久日常投资运作合法性、合规性的监察。

为加强公司风险监控，防范投资违规风险，维护公司良好的市场形象，根据《暂行办法》、《试点办法》及其他规定对投资行为进行每日检查，重点对基金投资比例、席位分配比例、投资决策和交易制度执行情况进行检查，发现异常情况时及时报管理层并反馈给相关投资部人员，要求解释和纠正。除因基金安久规模较小，申请新的交易席位有一定的困难，造成通过单一证券经营机构买卖证券的年成交量超过基金安久买卖证券年成交总量的 30%外，未发现基金安久的投资运作存在重大违规行为。鉴于基金安久于 2001 年 8 月 31 日上市后 6 个月调整期，我们已督促相关部门和人员加快办理新的交易席位，在规定的时间内将席位分配比例调整到位。

2、建立电脑应用系统权限管理

随着业务发展，特别是开放式基金的推出，公司新增了基金注册、客户服务等应用系统。为加强对信息的控管，在华安创新开放式基金发行前，我们确定了员工权限开通、变更和取消的程序，并在信息技术部及相关业务部门的配合下，我们对基金交易、基金核算、基金注册、客户服务等各应用系统的明细权限进行了集中整理，确定了每位员工在系统中的明细权限。

3、加强法律工作力量

随着开放式基金的推出，基金公司将每天与基金投资者发生业务交往，使基金管理公司可能面临的民事法律纠纷的可能性也相应增加。为此，我们聘请了知名律师事务所担任公司的常年法律顾问，有效地防范了法律风险。此外，我们还充实了内部的法律专业人员，相信今后能更好地理解有关法律法规及监管政策，进一步加强公司管理与基金合规性运作。

4、加强风险的事前防范工作

通过参与开放式基金的筹备过程，我们意识到及早介入公司业务，有利于了解业务全貌，发现掌握风险点，尽早制订风险防范方法。制定公司应急计划，开

展应急计划演习是风险事前防范的另一表现形式。2001 年，以监察稽核部牵头，公司各业务部门分别制订了本部门应急计划，我们还分部门进行了应急演习。2002 年，我们将进一步加强对应急计划的修订和演习。

四、托管人报告

2001 年度，安久证券投资基金（以下简称“基金安久”）的托管人——交通银行，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《安久证券投资基金基金契约》和《安久证券投资基金托管协议》中的条款，认真履行基金托管人的各项职责，安全保管基金安久的所有资产，做好基金安久的投资监管和清算核算工作，切实维护广大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。

2001 年度，基金管理人遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约和其它有关法规的规定，基金托管人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。基金托管人确认，由基金管理人在 2001 年度编制和披露的基金安久每日资产净值、每周资产净值公告、每季度投资组合公告、年度财务报告等有关基金信息是合法、真实和完整的。

五. 基金年度财务报告

（一） 审计报告

审 计 报 告

华业字(2002)第 579 号

安久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 2001 年 12 月 31 日的资产负债表及 2001 年度收益及收益分配表。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及其财务会计的相关法规、制度和《安久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 2001 年 12 月 31 日的财务状况以及 2001 年度经营成果；会计处理方法的选用遵循了一贯性原则。

大华会计师事务所有限公司

中国注册会计师：吕秋萍
中国注册会计师：曹培青

中国·上海·昆山路 146 号

2002 年 2 月 6 日

（二）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	说明	期末数	期初数
股票投资—成本		64,718,805.61	162,984,627.51
股票投资—估值增值		-5,854,839.75	-43,592,754.37
债券投资—成本		51,009,300.92	-
债券投资—估值增值		2,799.08	-
配股权证		-	-
银行存款和清算备付金	(1)	25,388,566.00	19,122,001.73
应收利息	(2)	68,814.29	10,519.24
应收账款		-	-
其他应收款项	(3)	250,000.00	-
基金资产总值		<u>135,583,446.15</u>	<u>138,524,394.11</u>
应付基金管理费及业绩报酬		-	170,792.82
应付基金托管费		28,596.38	28,465.45
应付账款		-	-
卖出回购债券款		-	-
应付佣金		49,286.02	64,302.08
其他应付款项	(4)	500,000.00	1,957,185.26
负债总额		<u>577,882.40</u>	<u>2,220,745.61</u>
基金单位总额		200,000,020.00	200,000,020.00
未分配净收益		-59,142,415.58	-20,103,617.13
未实现估值增值		-5,852,040.67	-43,592,754.37
基金资产净值		<u>135,005,563.75</u>	<u>136,303,648.50</u>
基金单位发行总份额		200,000,020	200,000,020
每份基金单位资产净值		0.6750	0.6815

收益及分配报告书

收益及分配主要项目本期数、上期数如下:

项 目	说明	本期数	上期数 (2000 年 7 月-12 月)
在除息日确认的股息收入		642,322.32	-
债券利息收入		57,534.26	-
股票买卖价差收入		-43,091,474.84	-11,568,938.90
债券买卖价差收入		2,287,134.94	-
其他收入	(5)	1,415,153.62	239,752.22
管理费及业绩报酬		-	1,058,085.64
其中: 基金管理费		-	1,058,085.64
业绩报酬		-	-
基金托管费		328,200.69	176,347.58
应由基金承担的其他费用	(6)	21,268.06	765.00
基金净收益		<u>-39,038,798.45</u>	<u>-12,564,384.90</u>
上年末未分配净收益		-20,103,617.13	-7,539,232.23

本期已分配收益	-	-
期末未分配净收益	-59,142,415.58	-20,103,617.13

(三) 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：

①任何上市流通的有价证券，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。

②未上市的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。

④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，基金管理人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。

⑤如有新增事项，按国家最新规定估值。

(5) 收入的确认政策：

①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。

②债券差价收入：卖出上市债券，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。

③股息收入：在被投资股票股权除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

④债券利息收入：已上市债券在被投资债券除息日确认，按实际持有期间以票面价值与票面利率计算的金额确认利息收入；未上市债券、在银行间债券市场交易的债券在持有期间内逐日计提，按票面价值与票面利率计算的金额确认利息收入。

⑤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。

⑥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。

⑦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，暂不征收企业所得税，在 2000 年底前暂免征收营业税。

依据财政部、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》的有关规定，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 日起证券交易印花税下调为 2‰。

(8) 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 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
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
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	占年成交量比例	年佣金	占年佣金量比例	平均佣金比率
东方证券有限责任公司	449,071,616.79	99.54%	362,261.38	99.54%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	2,056,421.80	0.46%	1,666.23	0.46%	0.08%
合 计	<u>451,128,038.59</u>	100.00%	<u>363,927.61</u>	100.00%	0.08%

本基金通过关联人席位 2000 年的股票交易情况：

关 联 人	年成交量	占年成交量比例	年佣金	占年佣金量比例	平均佣金比率
东方证券有限责任公司	81,961,245.35	100.00%	64,302.08	100.00%	0.08%
合 计	<u>81,961,245.35</u>	100.00%	<u>64,302.08</u>	100.00%	0.08%

②本基金通过关联人席位 2001 年的国债及回购交易情况：

关 联 人	国债年成交量	比例	回购年成交量	比例
东方证券有限责任公司	84,375,572.30	98.82%	-	-
申银万国证券股份有限公司	1,009,200.00	1.18%	1,000,000.00	100.00%
合 计	<u>85,384,772.30</u>	100.00%	<u>1,000,000.00</u>	100.00%

本基金通过关联人席位 2000 年的国债及回购交易情况：

无

(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

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	2000 年
管理人报酬	-	1,058,085.64 元

说明：经基金管理人华安基金管理有限公司董事会批准，不予计提基金安久 2001 年管理人报酬。自 2002 年起恢复计提。

②基金管理人业绩报酬

本基金在 2001 年和 2000 年均不能提取业绩报酬。

③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：

$$H = E \times 2.5\text{‰} \div \text{当年天数}$$

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	2000 年
托管费	328,200.69 元	176,347.58 元

3、主要报表项目说明

(1) 银行存款和清算备付金 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 25,388,566.00 元，其中：

存放地	年末余额	年初余额
交通银行上海分行	372,123.60	13,712,185.39
交通银行深圳分行	197,054.88	37,099.92
中国证券登记结算公司上海分公司	22,650,267.38	4,429,091.02
中国证券登记结算公司深圳分公司	1,969,120.14	933,625.40
* 中国证券登记结算公司上海分公司	200,000.00	10,000.00
合 计	<u>25,388,566.00</u>	<u>19,122,001.73</u>

* 系上海证券交易所根据交易量规定基金存放的交易保证金。

(2) 应收利息 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 68,814.29 元，其中：

明细项目	年末余额	年初余额
银行存款和交易备付金利息	11,280.03	10,519.24

国债利息	57,534.26	-
合 计	<u>68,814.29</u>	<u>10,519.24</u>

(3) 其他应收款项 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 250,000.00 元, 其中:

明细项目	年末余额	年初余额
* 中国证券登记结算公司深圳分公司	250,000.00	-

* 系深圳证券交易所根据交易量规定基金存放的交易保证金。

(4) 其他应付款 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 500,000.00 元, 其中:

明细项目	年末余额	年初余额
尚未结清的清理费	-	1,707,185.26
券商垫付交易保证金	500,000.00	250,000.00
合 计	<u>500,000.00</u>	<u>1,957,185.26</u>

(5) 其他收入 2001 年实现 1,415,153.62 元, 其中:

明细项目	2001 年	2000 年 7 月-12 月
存款利息收入	623,761.74	236,431.49
清理费结余	689,635.26	-
其他	101,756.62	3,320.73
合 计	<u>1,415,153.62</u>	<u>239,752.22</u>

(6) 应由基金承担的其他费用 2001 年为 21,268.06 元, 其中:

明细项目	2001 年	2000 年 7 月-12 月
卖出回购证券利息支出	580.00	-
上市年费	20,000.00	-
返售和回购交易费	12.50	-
其他	675.56	765.00
合 计	<u>21,268.06</u>	<u>765.00</u>

(四) 流通受限资产明细

本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的配售新股、债券与配股。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 12 月 31 日估值时, 已上市但流通受限的新股估值增值额为 727,878.24 元。

1. 申购新股部分

序号	股票名称	申购确认日期	上市日期	数量	成本	估值	流通受限期
1	华能国际	01-11-20	01-12-6	6,048	48,081.60	76,325.76	01-12-6起3个月
2	江西铜业	01-12-26	02-1-11	25,000	56,750.00	56,750.00	02-1-11起流通
3	深高速	01-12-11	01-12-25	203,382	744,378.12	1,444,012.20	01-12-25起3个月
	合计				<u>849,209.72</u>	<u>1,577,087.96</u>	

2. 申购债券部分

序号	债券名称	发行日期	上市日期	数量	成本	估值	流通受限期
----	------	------	------	----	----	----	-------

1 21国债15 01-12-18 02-1-4 500,000 50,000,000.00 50,000,000.00 02-1-4起流通

3. 配股部分

无

(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	257,830.00	0.19%
B	采掘业	2,818,480.00	2.09%
C	制造业	46,800,385.90	34.67%
C0	其中: 食品、饮料	2,581,200.00	1.91%
C1	纺织、服装、皮毛	15,252,331.08	11.30%
C2	木材、家具	----	----
C3	造纸、印刷	----	----
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,543,444.14	5.59%
C5	电子	----	----
C6	金属、非金属	56,750.00	0.04%
C7	机械、设备、仪表	5,180,152.00	3.84%
C8	医药、生物制品	16,186,508.68	11.99%
C99	其他制造业	----	----
D	电力、煤气及水的生产和供应业	76,325.76	0.05%
E	建筑业	----	----
F	交通运输、仓储业	1,444,012.20	1.07%
G	信息技术业	----	----
H	批发和零售贸易	----	----
I	金融、保险业	----	----
J	房地产业	----	----
K	社会服务业	7,466,932.00	5.53%
L	传播与文化产业	----	----
M	综合类	----	----
	总计	<u>58,863,965.86</u>	<u>43.60%</u>

2、国债、货币资金合计

截止 2001 年 12 月 31 日, 基金持有的国债及货币资金合计为 76,458,200.26 元, 占基金资产净值的 56.63%。

3、基金投资的股票明细

序 号	名 称	数 量	市 值	占净值比例(%)
1	恒瑞医药	584,117	9,965,036.02	7.38%
2	海欣股份	583,100	9,801,911.00	7.26%

3	强生控股	669,680	7,466,932.00	5.53%
4	同仁堂	312,794	6,221,472.66	4.61%
5	茉织华	324,044	5,450,420.08	4.04%
6	烟台万华	170,002	4,100,448.24	3.04%
7	红星发展	107,762	3,442,995.90	2.55%
8	上菱电器	236,520	2,980,152.00	2.21%
9	双汇发展	191,200	2,581,200.00	1.91%
10	兖州煤业	220,000	2,318,800.00	1.72%
11	许继电气	200,000	2,200,000.00	1.63%
12	深高速	203,382	1,444,012.20	1.07%
13	中国石化	144,000	499,680.00	0.37%
14	香梨股份	19,000	257,830.00	0.19%
15	华能国际	6,048	76,325.76	0.06%
16	江西铜业	25,000	56,750.00	0.04%
	合 计		<u>58,863,965.86</u>	<u>43.60%</u>

4、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 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 316,602.37 元，与股票市值 58,863,965.86 元、国债及货币资金 76,458,200.26 元之和相抵后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收利息、深圳交易保证金、应付托管费、应付券商佣金、其他应付款等。

(六) 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	
双汇发展		191,200		
华能国际	6,048			
中国石化	144,000			
同仁堂		1,806,941	414,082	1,908,229
兖州煤业		300,000		80,000
恒瑞医药		454,898	212,939	83,720
烟台万华		180,002	10,000	20,000
江西铜业	25,000			

红星发展		107,762		
香梨股份	19,000			
深高速	203,382			
茉织华		158,250	209,858	44,064
强生控股		698,800	60,880	90,000
上菱电器		306,520		70,000

新增股票附注

本表中“其他”项目包括“配转送增”

(七) 本期剔除股票

股票名称	期初结存	本期增加	本期卖出
中联重科		405,200	405,200
湖南投资		64,903	64,903
泰山石油	674,320		674,320
东方电子		170,500	170,500
京东方A	96,510		96,510
环保股份	3,619,000		3,619,000
法尔胜	896,070	491,384	1,387,454
广州控股		500,000	500,000
福建南纸		400,782	400,782
开开实业		314,200	314,200
鄂尔多斯		52,383	52,383
振华港机	205,212		205,212
北京华联		5,000	5,000
成发科技		8,000	8,000
烽火通信		1,000	1,000
中化国际		489,008	489,008
山鹰纸业		9,000	9,000
安阳钢铁		14,000	14,000
广电信息		122,600	122,600
青岛海尔		179,400	179,400
新亚股份		507,745	507,745

六. 基金持有人结构及前十名持有人

截止 2001 年 12 月 31 日, 本基金发起人持有的基金份额为 0.02 亿基金单位, 占基金发行总份额的 1.00%, 其中:

发 起 人	持有份额(单位)	占总份额比例
华安基金管理有限公司	2,000,000	1.00%

社会公众持有的基金份额为 198,000,020 基金单位，占基金发行总份额的 99.00%。

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	四川省国际信托投资公司	7,272,728	3.64%
2	安联大众人寿保险有限公司	3,500,000	1.75%
3	徐良奇	3,328,780	1.66%
4	陈莹	3,219,000	1.61%
5	肖汉信	2,795,027	1.40%
6	黄根芝	2,705,851	1.35%
7	杭州联大投资有限公司	2,668,635	1.33%
8	冯巧玲	2,474,520	1.24%
9	王木达	2,152,450	1.08%
10	华安基金管理有限公司	2,000,000	1.00%

七. 重要事项揭示

1. 本基金管理人、托管人在本期内未发生任何诉讼事项。
2. 本基金 2001 年度不分配。
3. 基金安久是按照《证券投资基金管理暂行办法》、原有投资基金清理规范的有关要求和《关于四川国信投资基金清理规范方案的批复》（证监基金字[2000]28 号）由原四川国信投资基金清理规范而成的契约型封闭式证券投资基金。基金安久的存续期为 10 年（自 1992 年 8 月 31 日至 2002 年 8 月 30 日）。
4. 本基金于 2001 年 8 月 31 日在深圳证券交易所上市。
5. 本基金于 2001 年 8 月 29 日发布《安久证券投资基金扩募提示性公告》，根据中国证监会证监基金字[2001]56 号文《关于同意四川国信投资基金规范为安久证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》批准，基金安久将于上市后进行扩募，扩募至 5 亿份基金单位。
6. 本基金管理人于 2001 年 9 月 20 日发布基金安久管理人《关于调整基金经理的公告》：因工作需要，经董事会同意，决定从即日起对管理的基金安久基金经理作如下调整：聘任李玲女士担任基金安信、基金安久基金经理，林彤彤先生不再担任基金安信、基金安久基金经理；王国卫先生继续担任基金安信、基金安久基金经理。
7. 经基金管理人华安基金管理有限公司董事会批准，不予计提基金安久 2001 年管理人报酬，自 2002 年起恢复计提。
8. 各券商 2001 年成交量及年佣金情况如下：

①股票交易情况：

券 商	年成交量	占年成交量比例	年佣金	占年佣金量比例	平均佣金比率
东方证券有限责任公司	449,071,616.79	99.54%	362,261.38	99.54%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	2,056,421.80	0.46%	1,666.23	0.46%	0.08%

合 计	<u>451,128,038.59</u>	100.00%	<u>363,927.61</u>	100.00%	0.08%
-----	-----------------------	---------	-------------------	---------	-------

②国债和回购交易情况:

券 商	国债年成交量	比例	回购年成交量	比例
东方证券有限责任公司	84,375,572.30	98.82%	-	-
申银万国证券股份有限公司	1,009,200.00	1.18%	1,000,000.00	100.00%
合 计	<u>85,384,772.30</u>	100.00%	<u>1,000,000.00</u>	100.00%

说明: 基金安久 2001 年 8 月 31 日上市, 尚处于 6 个月的调整期, 因此上述交易量分配未符合每一券商交易量不得超过 30%的比例限制的规定。

八. 备查文件目录

1. 中国证监会批准安久证券投资基金设立的文件。
2. 《安久证券投资基金基金契约》。
3. 《安久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. 安久证券投资基金 2001 年审计报告正本、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 3 月 29 日