

安久证券投资基金

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 25 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: 5 亿份基金单位
- 基金类型: 契约型封闭式
- 基金存续期: 15 年 (自 1992 年 8 月 31 日至 2007 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
- 注册地址: 上海市仙霞路 18 号
- 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 7 月-12 月
基金本期净收益：	1,131,478.56 元	-39,038,798.45 元	-12,564,384.90 元
单位基金本期净收益：	0.0023 元	-0.1952 元	-0.0628 元
基金可分配净收益：	-111,828,644.06 元	-59,142,415.58 元	-20,103,617.13 元
单位基金可分配净收益：	-0.2237 元	-0.2957 元	-0.1005 元
期末基金资产总值：	408,574,195.89 元	135,583,446.15 元	138,524,394.11 元
期末基金资产净值：	388,171,355.94 元	135,005,563.75 元	136,303,648.50 元
单位基金资产净值：	0.7763 元	0.6750 元	0.6815 元
基金资产净值收益率：	0.33%	-28.64%	-7.45%
本期基金净值增长率：	-9.85%	-0.95%	-19.16%
累计资产净值增长率：	-27.82%	-19.93%	-19.16%

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 / (期初基金资产净值 * 本期天数 + 扩募日资金流入额 * 扩募日至本期末天数) / 本期天数
2. 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
3. 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

基金简介

安久证券投资基金是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。根据中国证监会证监基金字[2000]28 号文《关于四川国信投资基金清理规范方案的批复》，经 2000 年 6 月 15 日原四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议通过，四川国信投资基金更名为安久证券投资基金，基金管理人变更为华安基金管理有限公司，基金托管人变更为交通银行。截至 2000 年 7 月 3 日止，基金资产过户移交时基金资产净值为人民币 168,608,719.99 元，基金总份额为 200,000,020 份基金单位，每基金单位净值为 0.8430 元。2000 年 7 月 4 日起华安基金管理有限公司正式开始管理本基金。

根据中国证监会证监基金字[2000]56 号文《关于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》和深圳证券交易所深证上[2001]77 号《上市通知书》审核同意，基金安久于 2001 年 8 月 31 日在深圳证券交易所挂牌交易。

根据 2000 年 6 月 15 日原四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议，中国证监会证监基金字[2000]56 号文《关于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》，以及 2002 年 3 月 7 日基金安久第一次持有人大会审议通过的关于部分变更本次扩募方式的决议，基金安久于 2002 年 5 月 21 日完成扩募，基金总份额由 200,000,020 份基金单位扩募至 5 亿份基金单位，扩募后基金存续期延长 5 年，至 2007 年 8 月 30 日止。

基金经理简介

王国卫先生，基金经理，经济学硕士。9 年证券从业经历。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。5 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

本基金自 2000 年 7 月 4 日成立以来，历年的业绩表现总结如下：

	净值增长率	上证综指涨幅	深证综指涨幅	单位分红
2000*	-19.16%	9.38%	7.56%	-
2001	-0.95%	-20.62%	-25.13%	-
2002	-9.85%	-17.52%	-18.32%	-
累计	-27.82%	-28.38%	-34.23%	-

*自成立之日起计算

基金经理工作报告

我们首先要感谢本基金的全体持有人，在你们的支持下，本基金于年初完成了扩募，从而延长了经营期。基金安久 2002 年净值增长-9.85%，分别超越上证指数 7.67%和深综指 8.47%。

2002 年基金运作回顾：

在经历了 2001 年下半年急风暴雨式下跌的大洗礼之后，2002 年中国证券市场继续大幅下跌，整个基金业首次面临全行业亏损的严峻考验。与此同时，由于市场走势与宏观经济和政策面完全背离，市场参与各方因而陷入了前所未有的矛盾之中。

年初两会行情的预热以及政策利好频频出台，市场出现温和的反弹行情。基金安久对一季度市场走势把握较好，一季度本基金净值增长排名位居前列，取得了较好的成绩。

基金扩募后使得资产规模扩大了一倍以上，导致股票仓位迅速大幅下降，虽然我们相应制定了逐步提升仓位的策略，但“6.24”井喷行情突然降临，本基金的命运也因此而转瞬改变。虽然国有股正式停止在国内证券市场减持，使原先冲击市场的根本性因素暂时得以解除，市场运行环境因此而明朗，但是指数却在一天井喷之后一路盘跌，“踏空”后再无机会弥补。我们认识到，扩募时间距井喷行情较近是一个客观存在提升仓位的制约因素，但是我们对政策估计不足、理解能力的欠缺是基金安久失去此前优势的直接原因。踏空并不是致命的，重要的

是 6.24 后我们整个心态发生变化。相对于规模较大的基金而言，小基金操作的难度相对要小一些，因为流动性因素的制约要小得多，而我们错失了调整的机会。虽然最终通过努力，本基金净值表现于四季度开始逐步回升，重新回到同类基金前列，这主要有赖于我们根据市场变化有选择的增加了低市盈率大盘蓝筹股的投资，但回顾 2002 年投资全过程，我们认为是有失误的。

2003 年市场展望：

我们认为 2003 年证券市场将是理性回归的一年。首先，全球制造业加速向中国转移，入世积极效应会得到进一步释放，支持中国经济独立高速增长。随着中国经济逐步向“内生性自主增长机制”的转换，宏观经济将继续为股市创造良好的发展环境。其次，辩证看待国有股流通以及股权分割现状。指数的剧烈波动已使管理层意识到必须把握好“新兴+转轨”市场中发展与规范的尺度，同时也使参与各方深刻地认识到自我保护的重要性，而不是盲目博弈。第三，资本市场进入实质性对外开放，QFII 的进入将极大的推动整个市场理性投资理念的升级，给市场注入新的活力，即使是封闭式基金也必须充分重视流动性管理、行业配置、风险管理等投资手段。

我们预期 2003 年证券市场的表现将好于 2002 年，市场演变的特征将更多的体现出与国际化投资理念的接轨，局部热点频繁。上市公司的整体业绩受宏观经济向好的影响将得到进一步提升；部分周期性行业如钢铁有色等出现景气回升；而外资、民营资本也会在十六大后进入一个新的活跃阶段；汽车、住房、旅游等新兴消费热点将在消费结构升级的驱动下，对扩大内需、拉动经济增长将产生前所未有的贡献。

2003 年我们将采取更加积极进取的投资策略，高度重视行业配置的策略性投资，注重对政策导向型行业、周期性行业等投资机会的捕捉，加强流动性管理，争取为基金持有人提供稳定增长的投资回报。

（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、《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、对基金安久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》、《安久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，未发现基金安久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，交通银行作为安久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，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，安全保管基金安久的所有资产；
- 2、本托管人认真完成了安久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，交通银行作为安久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 年度安久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 397 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 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 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 15 日

(二) 基金会计报告书

安久证券投资基金
资产负债表
2002 年 12 月 31 日

		单位：人民币元	
资产	附注	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		168,491.93	569,178.48

清算备付金		11,924,428.59	24,819,387.52
交易保证金	3(1)	750,000.00	250,000.00
应收证券清算款	3(2)	4,394,154.43	-
应收股利		-	-
应收利息	3(3)	875,709.82	68,814.29
其他应收款		-	-
股票投资市值	1(4)	253,812,941.82	58,863,965.86
其中：股票投资成本		307,104,429.77	64,718,805.61
债券投资市值	1(4)	136,648,469.30	51,012,100.00
其中：债券投资成本		137,176,192.50	51,009,300.92
配股权证		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产总计		<u>408,574,195.89</u>	<u>135,583,446.15</u>

负债与基金持有人权益

负债：

应付证券清算款	3(4)	19,004,697.60	-
应付管理人报酬		500,552.71	-
应付托管费		83,425.47	28,596.38
应付佣金		58,164.17	49,286.02
应付利息		-	-
应付收益		-	-
其他应付款	3(5)	500,000.00	500,000.00
卖出回购证券款		-	-
预提费用	3(6)	256,000.00	-
其他负债		-	-
负债合计		<u>20,402,839.95</u>	<u>577,882.40</u>

持有人权益：

实收基金		500,000,000.00	200,000,020.00
未实现利得		-53,819,211.15	-5,852,040.67
未分配收益		-58,009,432.91	-59,142,415.58
持有人权益合计		<u>388,171,355.94</u>	<u>135,005,563.75</u>
负债及持有人权益总计		<u>408,574,195.89</u>	<u>135,583,446.15</u>

安久证券投资基金

经营业绩表

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.已实现基金收入：		8,791,799.66	-38,689,329.70
股票差价收入	1(6)	5,436,023.45	-43,091,474.84

债券差价收入	1(6)	-3,103,553.91	2,287,134.94
债券利息收入	1(6)	3,731,465.59	57,534.26
存款利息收入	1(6)	954,495.76	623,761.74
股利收入	1(6)	1,666,192.78	642,322.32
买入返售证券收入	1(6)	29,500.00	-
其他收入	3(7)	77,675.99	791,391.88
二.本期基金费用:		7,660,321.10	349,468.75
基金管理人报酬	2(3)	4,991,369.43	-
基金托管费	2(3)	833,770.79	328,200.69
卖出回购证券支出		1,252,483.81	580.00
利息支出		-	-
其他费用	3(8)	582,697.07	20,688.06
其中: 上市年费		60,000.00	20,000.00
信息披露费		340,000.00	-
审计费用		140,000.00	-
三.已实现基金净收益		1,131,478.56	-39,038,798.45
加: 未实现利得		-47,965,666.37	37,740,713.70
四.基金经营业绩		<u>-46,834,187.81</u>	<u>-1,298,084.75</u>

安久证券投资基金
收益分配表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

		2002 年	单位: 人民币元 2001 年
	附注		
本期基金净收益		1,131,478.56	-39,038,798.45
加: 期初基金净收益		-59,142,415.58	-20,103,617.13
加: 以前年度损益调整	1(10)	1,504.11	-
可供分配基金净收益		-58,009,432.91	-59,142,415.58
减: 本期已分配基金净收益		-	-
期末基金净收益		<u>-58,009,432.91</u>	<u>-59,142,415.58</u>

安久证券投资基金
基金净值变动表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

		2002 年	单位: 人民币元 2001 年
	附注		
一. 期初基金净值		135,005,563.75	136,303,648.50
二. 本期经营活动:			
基金净收益		1,131,478.56	-39,038,798.45
未实现利得		-47,965,666.37	37,740,713.70
经营活动产生的基金净值变动数		-46,834,187.81	-1,298,084.75
三. 本期扩募基金单位		299,999,980.00	-

四. 本期向持有人分配收益:	-	-
五. 期末基金净值	388,171,355.94	135,005,563.75

(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: 人民币元。

(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; 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。估值日无交易的, 以最近交易日的市价(平均价)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(平均价)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》，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。

(9) 基金的收益分配政策：

①基金收益分配采用现金方式或法规允许的其他方式，每年分配一次，管理人应在基金每一会计年度结束后 90 个工作日内公布上一会计年度的收益分配方案并于 120 个工作日内完成分配方案的实施；

②基金收益分配比例不得低于基金当年可分配收益的 90%，其具体分配数额及比例由基金管理人拟定；

③基金当年收益应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，利息收入由收到时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 5,264.38 元，债券投资成本调减人民币 3,760.27 元，两者差额人民币 1,504.11 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 1,504.11 元。上述调整不影响 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
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
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	股票年成交量	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	160,466,331.84	29.10%	120,862.69	28.80%	0.08%
东方证券有限责任公司	138,403,112.00	25.10%	104,804.34	24.97%	0.08%
上海证券有限责任公司	99,835,592.89	18.10%	78,123.48	18.61%	0.08%
合 计	398,705,036.73	72.30%	303,790.51	72.38%	0.08%

本基金通过关联人席位 2001 年的股票交易情况：

关 联 人	股票年成交量	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	2,056,421.80	0.46%	1,666.23	0.46%	0.08%
东方证券有限责任公司	449,071,616.79	99.54%	362,261.38	99.54%	0.08%
合 计	451,128,038.59	100.00%	363,927.61	100.00%	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	725,266,034.40	42.14%	360,000,000.00	35.31%
东方证券有限责任公司	470,958,505.20	27.36%	280,000,000.00	27.46%
上海证券有限责任公司	8,772,889.70	0.51%	-	-
合 计	1,204,997,429.30	70.01%	640,000,000.00	62.77%

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	1,009,200.00	1.18%	1,000,000.00	100.00%
东方证券有限责任公司	84,375,572.30	98.82%	-	-
合 计	85,384,772.30	100.00%	1,000,000.00	100.00%

(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	4,991,369.43 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 年基金管理费。自 2002 年起恢复计提。

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
托管费	833,770.79 元	328,200.69 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	750,000.00	250,000.00

(2) 应收证券清算款

	2002 年 12 月 31 日	2001 年 12 月 31 日
应收深圳证券清算款	4,394,154.43	-

(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	11,683.64	11,280.03

债券利息	864,026.18	57,534.26
合计	875,709.82	68,814.29
(4) 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	19,004,697.60	-
(5) 其他应付款		
	2002 年12 月31 日	2001 年12 月31 日
券商垫付交易保证金	500,000.00	500,000.00
(6) 预提费用		
	2002 年12 月31 日	2001 年12 月31 日
审计费	70,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
上市年费	60,000.00	-
债券帐户维护费	6,000.00	-
合计	256,000.00	-
(7) 其他收入		
	2002 年	2001 年
新股申购手续费返还	55,512.94	1,268.40
国债手续费返还	-	99,000.00
印花税返还	1,311.60	1,488.22
上市清理费结余	-	689,635.26
基金额定扩募费用结余	19,999.80	-
基金扩募期间冻结利息	851.65	-
合计	77,675.99	791,391.88
(8) 其他费用		
	2002 年	2001 年
审计费	140,000.00	-
信息披露费	340,000.00	-
上市年费	60,000.00	20,000.00
交易所返售和回购交易费用	27,268.84	12.50
其他	15,428.23	675.56
合计	582,697.07	20,688.06
(9) 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	1,504.11	-

4. 额定扩募费用及额定扩募费用余额

本基金的基金规模在本会计期间自 200,000,020 份基金单位扩募至 5 亿份基金单位。额定扩募费用是按照扩募配售的基金单位份额及每基金单位人民币 0.01 元计算的扩募配售价格中超出面值发行的部分。额定扩募费用余额即额定扩募费用扣除实际发生的扩募费用后的差额，该差额计入扩募当期基金的收益与收益分配表。

额定扩募费用	2,999,999.80 元
减：券商承销费	2,980,000.00 元
额定扩募费用余额	<u>19,999.80 元</u>

(四) 流通受限资产明细

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	2002-09-26	2002-10-09	947,632	2,179,553.60	2,568,082.72	2002-10-09 起 6 个月
2	中信证券	2002-12-24	2003-01-06	143,000	643,500.00	643,500.00	2003-01-06 起流通
3	皖通高速	2002-12-26	2003-01-07	84,000	184,800.00	184,800.00	2003-01-07 起流通
	合计				3,007,853.60	3,396,382.72	

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	10,327,790.94	2.66%
C	制造业	164,008,584.19	42.25%
C0	其中：食品、饮料	16,159,670.54	4.16%
C1	纺织、服装、皮毛	9,506,444.64	2.45%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	11,882,168.42	3.06%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	26,232,847.65	6.76%
C5	电子	235,440.00	0.06%
C6	金属、非金属	35,761,500.00	9.21%
C7	机械、设备、仪表	33,275,906.64	8.57%
C8	医药、生物制品	30,954,606.30	7.98%
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,943,082.12	2.30%
E	建筑业	3,554,905.92	0.92%
F	交通运输、仓储业	14,220,878.71	3.66%
G	信息技术业	6,477,053.95	1.67%
H	批发和零售贸易	27,281,206.50	7.03%

I	金融、保险业	2,316,695.00	0.60%
J	房地产业	3,791,597.21	0.98%
K	社会服务业	12,891,147.28	3.32%
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	总计	253,812,941.82	65.39%

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）合计为 49,940,000.00 元，占基金资产净值的 12.87%。

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 84,190,846.65 元，占基金资产净值的 21.69%。

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	宝钢股份	3,300,000	13,563,000.00	3.49%
2	振华港机	1,260,700	13,325,599.00	3.43%
3	中化国际	1,375,375	12,158,315.00	3.13%
4	丽珠集团	1,300,000	11,375,000.00	2.93%
5	华联超市	833,120	10,414,000.00	2.68%
6	海油工程	736,647	10,327,790.94	2.66%
7	上海机场	1,133,300	10,233,699.00	2.64%
8	华菱管线	2,100,000	10,017,000.00	2.58%
9	珠海中富	1,203,661	9,280,226.31	2.39%
10	海螺水泥	1,430,000	9,152,000.00	2.36%
11	同仁堂	525,046	9,114,798.56	2.35%
12	国电电力	1,240,372	8,943,082.12	2.30%
13	恒瑞医药	838,406	8,627,197.74	2.22%
14	威孚高科	880,000	8,430,400.00	2.17%
15	巴士股份	1,503,223	8,057,275.28	2.08%
16	华泰股份	621,870	7,804,468.50	2.01%
17	三爱富	695,796	7,486,764.96	1.93%
18	双汇发展	687,241	7,092,327.12	1.83%
19	海欣股份	462,000	6,084,540.00	1.57%
20	烟台万华	482,827	5,388,349.32	1.39%
21	宇通客车	400,000	4,940,000.00	1.27%
22	强生控股	608,800	4,833,872.00	1.25%
23	张裕 ^A	320,711	4,682,380.60	1.21%
24	上菱电器	379,518	4,167,107.64	1.07%
25	海螺型材	451,073	4,077,699.92	1.05%
26	新黄浦	420,821	3,791,597.21	0.98%
27	茉织华	324,044	3,421,904.64	0.88%
28	华联商厦	450,000	3,397,500.00	0.88%
29	上海建工	410,184	3,334,795.92	0.86%

30	北京巴士	264,728	3,264,096.24	0.84%
31	光明乳业	279,766	3,169,748.78	0.82%
32	云铝股份	350,000	2,828,000.00	0.73%
33	中国联通	947,632	2,568,082.72	0.66%
34	红星发展	127,258	2,363,181.06	0.61%
35	许继电气	300,000	2,340,000.00	0.60%
36	兆维科技	215,976	1,965,381.60	0.51%
37	招商银行	205,300	1,673,195.00	0.43%
38	通化东宝	200,000	1,656,000.00	0.43%
39	波导股份	80,211	1,630,689.63	0.42%
40	第一食品	126,450	1,273,351.50	0.33%
41	中信证券	143,000	643,500.00	0.17%
42	青岛啤酒	78,806	617,839.04	0.16%
43	云天化	69,500	610,210.00	0.16%
44	伊利股份	33,750	597,375.00	0.15%
45	模塑科技	37,300	425,966.00	0.11%
46	上海航空	58,000	378,160.00	0.10%
47	中天科技	30,000	312,900.00	0.08%
48	华阳科技	20,000	237,600.00	0.06%
49	法拉电子	18,000	235,440.00	0.06%
50	扬子石化	50,000	234,000.00	0.06%
51	腾达建设	23,000	220,110.00	0.06%
52	时代新材	15,000	206,550.00	0.05%
53	皖通高速	84,000	184,800.00	0.05%
54	康缘药业	13,000	181,610.00	0.05%
55	厦门钨业	11,000	168,740.00	0.04%
56	招商局A	17,851	160,123.47	0.04%
57	迪马股份	4,000	72,800.00	0.02%
58	第一投资	4,000	38,040.00	0.01%
59	方兴科技	2,800	32,760.00	0.01%
	合 计		253,812,941.82	65.39%

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 227,567.47 元，与股票市值 253,812,941.82 元、债券（不包括国债）49,940,000.00 元、国债及货币资金 84,190,846.65 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、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	招商局 ^A	-	50,000	-	32,149
2	丽珠集团	-	1,700,000	-	400,000
3	威孚高科	-	1,230,000	-	350,000
4	海螺型材	-	672,503	-	221,430
5	珠海中富	-	1,206,331	-	2,670
6	模塑科技	-	-	37,300	-
7	云铝股份	-	812,685	119,665	582,350
8	扬子石化	-	250,000	-	200,000
9	张裕 ^A	-	330,111	-	9,400
10	华菱管线	-	2,100,000	518,469	518,469
11	上海机场	-	1,183,300	-	50,000
12	皖通高速	84,000	-	-	-
13	宝钢股份	-	3,300,000	-	-
14	中信证券	143,000	-	-	-
15	招商银行	64,600	340,700	-	200,000
16	中国联通	1,702,632	-	-	755,000
17	宇通客车	-	600,000	-	200,000
18	云天化	-	156,400	-	86,900
19	波导股份	-	250,000	-	169,789
20	上海建工	-	570,184	40,000	200,000
21	华泰股份	-	637,870	34,000	50,000
22	振华港机	-	1,496,482	-	235,782
23	北京巴士	-	264,728	-	-
24	时代新材	15,000	-	-	-
25	中化国际	-	916,917	458,458	-
26	腾达建设	23,000	-	-	-
27	第一投资	7,000	-	-	3,000
28	中天科技	30,000	-	-	-
29	华阳科技	20,000	-	-	-
30	厦门钨业	11,000	-	-	-
31	方兴科技	17,000	-	-	14,200
32	康缘药业	13,000	-	-	-
33	法拉电子	18,000	-	-	-
34	迪马股份	6,000	-	-	2,000
35	海油工程	-	1,034,047	-	297,400
36	海螺水泥	4,000	2,359,000	-	933,000
37	上海航空	58,000	-	-	-
38	光明乳业	57,000	319,500	-	96,734
39	青岛啤酒	-	214,726	-	135,920
40	第一食品	-	100,000	42,150	15,700
41	华联商厦	-	520,000	-	70,000

42	三 爱 富	-	579,830	115,966	-
43	新 黄 浦	-	424,568	-	3,747
44	兆维科技	-	560,000	-	344,024
45	巴士股份	-	1,599,708	160,878	257,363
46	国电电力	-	750,219	490,153	-
47	华联超市	-	848,120	-	15,000
48	通化东宝	-	200,000	-	-
49	伊利股份	-	801,966	33,750	801,966

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	中联重科	-	50,000	50,000
2	格力电器	-	80,000	80,000
3	湘计算机	-	113,780	113,780
4	北新建材	-	131,000	131,000
5	盐湖钾肥	-	183,482	183,482
6	银河科技	-	62,172	62,172
7	神火股份	-	19,700	19,700
8	华能国际	6,048	1,216,957	1,223,005
9	中海发展	-	31,000	31,000
10	中国石化	144,000	-	144,000
11	兖州煤业	220,000	50,000	270,000
12	营 口 港	-	5,000	5,000
13	大厦股份	-	6,000	6,000
14	山东基建	-	14,000	14,000
15	亚宝药业	-	15,000	15,000
16	旭光股份	-	14,000	14,000
17	精伦电子	-	6,000	6,000
18	承德钒钛	-	39,000	39,000
19	江西铜业	25,000	-	25,000
20	华冠科技	-	21,000	21,000
21	安源股份	-	8,000	8,000
22	湘电股份	-	21,000	21,000
23	华鲁恒升	-	4,000	4,000
24	中远航运	-	8,000	8,000
25	扬农化工	-	2,000	2,000
26	长江股份	-	8,000	8,000
27	科达机电	-	8,000	8,000
28	宏智科技	-	4,000	4,000
29	西昌电力	-	72,000	72,000
30	香梨股份	19,000	-	19,000
31	天富热电	-	1,000	1,000
32	黑 牡 丹	-	6,000	6,000

33	国药股份	-	19,000	19,000
34	海龙科技	-	33,000	33,000
35	长园新材	-	14,000	14,000
36	菲达环保	-	18,000	18,000
37	山东药玻	-	8,000	8,000
38	豫光金铅	-	17,000	17,000
39	栖霞建设	-	1,000	1,000
40	天士力	-	17,000	17,000
41	中软股份	-	4,000	4,000
42	深高速	203,382	-	203,382
43	科大创新	-	13,000	13,000
44	太行股份	-	19,000	19,000
45	裕丰股份	-	20,000	20,000
46	金自天正	-	14,000	14,000
47	江西长运	-	11,000	11,000
48	信雅达	-	3,000	3,000
49	精达股份	-	7,000	7,000
50	黄海股份	-	21,000	21,000
51	卧龙科技	-	37,000	37,000
52	八一钢铁	-	32,000	32,000
53	金晶科技	-	20,000	20,000
54	新华医疗	-	8,000	8,000
55	泰豪科技	-	7,000	7,000
56	龙溪股份	-	15,000	15,000
57	大连圣亚	-	1,000	1,000
58	中孚实业	-	7,000	7,000
59	北大荒	-	12,000	12,000
60	申能股份	-	160,800	160,800
61	友谊股份	-	126,000	126,000
62	内蒙华电	-	868,020	868,020

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 0.05 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	5,000,000	1.00%
其中: 未上市流通份额	2,500,000	0.50%

社会公众持有的基金份额为 495,000,000 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	海通证券股份有限公司	230,500,000	46.10%
2	广州证券有限责任公司	6,377,382	1.28%
3	华安基金管理有限公司	5,000,000	1.00%
4	陈莹	4,786,490	0.96%
5	唐朝	2,579,551	0.52%
6	徐艳洪	2,231,062	0.45%
7	梅县坝头水电站	1,693,800	0.34%
8	李小芽	1,252,000	0.25%
9	鲁瑶	1,183,573	0.24%
10	刘佳颖	1,179,700	0.24%

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深圳分公司传送的截止 2002 年 12 月 31 日基金安久前 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. 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。
5. 根据 2000 年 6 月 15 日原四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议，中国证监会证监基金字[2000]56 号文《关于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》，以及 2002 年 3 月 7 日基金安久第一次持有人大会（通讯方式）审议通过的关于部分变更本次扩募方式的决议，基金安久于 2002 年 5 月 21 日完成扩募，基金总份额由 200,000,020 份基金单位扩募至 5 亿份基金单位。经大华会计师事务所有限公司（现安永大华会计师事务所有限责任公司）出具验资报告予以验证。扩募后基金存续期延长 5 年，至 2007 年 8 月 30 日止。
6. 2002 年 3 月 7 日，基金安久第一次持有人大会以通讯表决方式审议通过关于部分变更本次扩募方式并对基金安久之基金契约中的“基金投资目标”等部分条款进行修改等九项议案。
7. 据中国证监会证监基金字[2000]56 号文的规定，华安基金管理有限公司作为本基金的发起人，应于本基金扩募时持有不低于基金总规模 1% 的基金份额，且在基金存续期内持有不低于基金总规模 0.5% 的基金份额，其余部分可在基金扩募部分上市二个月后流通。
8. 经基金管理人华安基金管理有限公司董事会批准，本基金不予提取 2001 年管理人报酬，自 2002 年起恢复计提基金管理费。
9. 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。

10. 券商 2002 年成交量及年佣金情况如下：

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	平均佣金 比率
申银万国证券股份有限公司	160,466,331.84	29.10%	120,862.69	28.80%	0.08%
平安证券有限责任公司	141,276,774.19	25.62%	106,990.42	25.49%	0.08%
东方证券有限责任公司	138,403,112.00	25.10%	104,804.34	24.97%	0.08%
上海证券有限责任公司	99,835,592.89	18.10%	78,123.48	18.61%	0.08%
光大证券有限责任公司	11,443,284.07	2.08%	8,954.64	2.13%	0.08%
合 计	551,425,094.99	100.00%	419,735.57	100.00%	0.08%

②债券和回购交易情况：

券 商	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	725,266,034.40	42.14%	360,000,000.00	35.31%
平安证券有限责任公司	501,178,454.10	29.12%	379,600,000.00	37.23%
东方证券有限责任公司	470,958,505.20	27.36%	280,000,000.00	27.46%
上海证券有限责任公司	8,772,889.70	0.51%	-	-
光大证券有限责任公司	15,048,392.70	0.87%	-	-
合 计	1,721,224,276.10	100.00%	1,019,600,000.00	100.00%

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