

安久证券投资基金

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:	3,144,859.94 元
单位基金本期净收益:	0.0063 元
基金可分配净收益:	-58,072,780.99 元
单位基金可分配净收益:	-0.1161 元
期末基金资产总值:	460,902,396.70 元
期末基金资产净值:	441,927,219.01 元
单位基金资产净值:	0.8839 元
基金资产净值收益率:	1.27%
本期基金资产净值增长率:	2.65%
累计资产净值增长率:	-17.81%

上述部分指标计算公式:

1. 基金资产净值收益率=基金本期净收益/〔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. 本期基金资产净值增长率=(扩募前单位净值/期初单位净值)*〔期末单位净值/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

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。

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 0.8839 元，比 2001 年末增长了 2.65%。本期基金安久实现净收益 314 万元。

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。

（一）基金经理工作报告

上半年两市指数基本符合我们年初预计的箱体整理走势，但期间股指运行却一波三折，振幅超过预期。围绕国有股减持问题，市场展开政策博弈。6 月 23 日，国务院决定停止通过国内证券市场减持国有股，极大地提升了投资者信心，引发 6.24 井喷行情。同时，上半年管理层陆续出台了一系列符合中国国情的呵护证券市场的举措，使得市场环境得以改变，个股投资机会凸现，股票差异性拉大。

基金安久在上半年完成了扩募工作，由原来的 2 亿份基金单位增加到 5 亿份基金单位。基金经理小组根据本基金的特点和投向，提出了“相对集中、均衡投资、大进大出、灵活调整”的操作策略，希望以扩募为新的起点，早日使基金单位净值回到面值之上。应该说，扩募前基金的选股和仓位调控比较成功。考虑到政策面已经趋暖以及基金自身扩募因素，基金安久在 4 月底前的操作基本以精选个股的单向增仓为主，较好地抓住了年初的反弹行情。然而扩募之后，本基金的仓位直线下降。面对盘整近两个月的行情，基金经理做出的加仓决策显得相对谨慎，虽规避了此后市场短期波动的风险，但在 6.24 井喷行情后失去了此前保持的优势。根据市场出现的新特征，6.24 行情后，基金经理小组采取了相对积极的投资策略，有选择地增加了中低价低市盈率股的投资，按照均衡投资的原则进行

行业和个股配置。

我们判断，下半年将在整体环境趋暖的情况下进入新的平衡状态。并且我们注意到，随着入世效应的逐步显现，国内行业和区域性整合的力度在加大，竞争的压力迫使越来越多的上市公司注重开发和运用新技术以提高竞争力，部分公司开始积极寻求对外资的股权转让以引进新技术，这些都增加了本基金投资的可选择范围。下半年我们将加倍努力，争取给基金持有人满意的回报。

（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、对基金安久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：基金安久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，基金安久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久存在重大违规情况。

四. 基金年度中期财务报告

(一) 基金会计报告书 (未经审计)

安久证券投资基金

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		619,622.12	569,178.48
清算备付金		37,476,399.62	24,819,387.52
交易保证金	3(1)	500,000.00	250,000.00
应收证券清算款		-	-
应收股利		-	-
应收利息	3(2)	1,433,261.36	68,814.29
其他应收款		-	-
股票投资市值	1(5)	277,813,005.80	58,863,965.86
其中：股票投资成本		279,108,920.17	64,718,805.61
债券投资市值	1(6)	143,060,107.80	51,012,100.00
其中：债券投资成本		143,840,922.89	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		460,902,396.70	135,583,446.15
负债与基金持有人权益			
负债：			
应付证券清算款	3(3)	17,475,202.03	-
应付管理人报酬		536,119.53	-
应付托管费		89,353.26	28,596.38
应付佣金		211,436.41	49,286.02
应付利息		-	-

应付收益		-	-
其他应付款	3(4)	500,000.00	500,000.00
卖出回购证券款		-	-
预提费用	3(5)	163,066.46	-
其他负债		-	-
负债合计		18,975,177.69	577,882.40
持有人权益:			
实收基金	1(11)	500,000,000.00	200,000,020.00
未实现利得		-2,076,729.46	-5,852,040.67
未分配收益		-55,996,051.53	-59,142,415.58
持有人权益合计		441,927,219.01	135,005,563.75
负债及持有人权益总计		460,902,396.70	135,583,446.15

安久证券投资基金
经营业绩表
2002 年1 月1 日至2002 年6 月30 日

单位: 人民币元

	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:		5,888,943.55	-45,888,412.46
股票差价收入	1(5)	4,036,548.09	-46,558,957.92
债券差价收入	1(6)	-321,170.38	-
债券利息收入	1(7)	1,346,221.23	-
存款利息收入	1(7)	435,483.65	327,471.14
股利收入	1(7)	309,150.90	343,074.32
买入返售证券收入	1(7)	29,500.00	-
其他收入	3(6)	53,210.06	-
二. 本期基金费用:		2,744,083.61	164,808.07
基金管理人报酬	1(8)	1,822,604.83	-
基金托管费	1(9)	305,643.34	164,708.07
卖出回购证券支出	1(10)	322,425.00	-
利息支出		-	-
其他费用	3(7)	293,410.44	100.00
其中: 上市年费		29,752.78	-
信息披露费		178,520.30	-
审计费用		74,793.38	-
三. 已实现基金净收益		3,144,859.94	-46,053,220.53
加: 未实现利得	3(8)	3,776,815.32	49,220,578.72
四. 基金经营业绩		6,921,675.26	3,167,358.19

安久证券投资基金
收益分配表
2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日

单位：人民币元

	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		3,144,859.94	-46,053,220.53
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	3(8)	1,504.11	-
可供分配基金净收益		-55,996,051.53	-66,156,837.66
减：本期已分配基金净收益		-	-
期末基金净收益		-55,996,051.53	-66,156,837.66

安久证券投资基金
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

	附注	2002 年 1 月 1 日- 2002 年 6 月 30 日
一. 期初基金净值		135,005,563.75
二. 本期经营活动：		
基金净收益		3,144,859.94
未实现利得	3(8)	3,776,815.32
经营活动产生的基金净值变动数		6,921,675.26
三. 本期扩募基金单位		299,999,980.00
四. 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		-
五. 期末基金净值		441,927,219.01

(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《安久证券投资基金上市公告书》及《安久证券投资基金招募说明书》的规定，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。基金扩募三个月后，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《安久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 年底以前暂免征收营业税”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。

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
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	租用交易席位	席位使用协议
	同属一股东*		

*该股东为上海国际信托投资公司，系管理公司发起人

(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
东方证券有限责任公司	95,660,385.88	28.63%	75,393.15	29.36%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	78,310,241.01	23.44%	57,696.22	22.47%	0.07%
上海证券有限责任公司	74,893,746.75	22.41%	58,606.18	22.83%	0.08%
合 计	248,864,373.64	74.48%	191,695.55	74.66%	0.08%

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
东方证券有限责任公司	138,295,275.40	14.70%	50,000,000.00	12.83%
申银万国证券股份有限公司	499,636,315.20	53.13%	160,000,000.00	41.07%
上海证券有限责任公司	-	-	-	-
合 计	637,931,590.60	67.83%	210,000,000.00	53.90%

(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, 本基金扩募三个月后, 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 年上半年管理人收取的基金管理费金额为 1,822,604.83 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 年上半年托管人收取的基金托管费金额为 305,643.34 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	500,000.00	250,000.00

(2) 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	22,695.05	11,280.03
债券利息	1,410,566.31	57,534.26
合计	1,433,261.36	68,814.29
(3) 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	10,572,313.99	-
应付深圳证券清算款	6,902,888.04	-
合计	17,475,202.03	-
(4) 其他应付款		
	2002 年 6 月 30 日	2001 年 12 月 31 日
券商垫付交易保证金	500,000.00	500,000.00
(5) 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	74,793.38	-
信息披露费	58,520.30	-
上市年费	29,752.78	-
合计	163,066.46	-
(6) 其他收入		
	2002 年 1-6 月	2001 年 1-6 月
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	-
新股申购手续费返还	31,047.01	-
印花税返还	1,311.60	-
合计	53,210.06	-
(7) 其他费用		
	2002 年 1-6 月	2001 年 1-6 月
审计费	74,793.38	-
信息披露费	178,520.30	-
上市年费	29,752.78	-
返售与回购交易费	8,143.75	-
其他	2,200.23	100.00
合计	293,410.44	100.00
(8) 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，债券估值增值和未实现利得分别调减人民币1,504.11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	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	19,999.80 元

（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	64,600	471,580.00	739,024.00	2002-7-10起流通
2	安源股份	2002-6-20	2002-7-2	8,000	47,920.00	47,920.00	2002-7-2起流通
3	宏智科技	2002-6-27	2002-7-9	4,000	34,720.00	34,720.00	2002-7-9起流通
4	泰豪科技	2002-6-24	2002-7-3	7,000	33,320.00	33,320.00	2002-7-3起流通
	合计				587,540.00	854,984.00	

注：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。

2. 截至 2002 年 6 月 30 日止，本基金认购的发行中企业债券，自债券认购日至债券发行结束日期间，暂时无法流通。

债券名称	认购日期	流通日期	数量	成本	市值	流通受限期
02电网债（15）	2002-6-25	2002-7-17	50,000	5,000,000.00	5,000,000.00	2002-7-17起流通

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	-	-
B	采掘业	10,703,130.76	2.42%
C	制造业	191,129,002.79	43.25%
C0	其中: 食品、饮料	29,796,738.52	6.74%
C1	纺织、服装、皮毛	12,812,166.36	2.90%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	19,118,608.71	4.33%
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	43,409,630.00	9.82%
C7	机械、设备、仪表	54,831,761.10	12.41%
C8	医药、生物制品	31,160,098.10	7.05%
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	30,598,095.95	6.92%
E	建筑业	2,466,000.00	0.56%
F	交通运输、仓储业	4,644,000.00	1.05%
G	信息技术业	7,312,987.20	1.65%
H	批发和零售贸易	12,368,123.38	2.80%
I	金融、保险业	739,024.00	0.17%
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	17,852,641.72	4.04%
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	总计	277,813,005.80	62.86%

2. 债券（不包括国债）合计

截止 2002 年 6 月 30 日, 基金持有债券(不含应收利息) 合计为 15,318,000.00 元, 占基金资产净值的 3.47%。

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 148,362,927.51 元, 占基金资产净值的 33.57%。

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	振华港机	1,496,482	20,022,929.16	4.53%
2	海螺水泥	1,803,000	14,802,630.00	3.35%
3	宝钢股份	3,100,000	14,415,000.00	3.26%
4	威孚高科	1,200,000	14,112,000.00	3.19%
5	双汇发展	1,037,241	13,152,215.88	2.98%
6	丽珠集团	1,200,000	12,852,000.00	2.91%

7	中化国际	816,917	12,368,123.38	2.80%
8	华菱管线	2,000,000	12,120,000.00	2.74%
9	华能国际	800,000	11,504,000.00	2.60%
10	国电电力	700,219	11,238,514.95	2.54%
11	伊利股份	551,966	11,033,800.34	2.50%
12	巴士股份	1,540,586	10,814,913.72	2.45%
13	海油工程	626,647	10,703,130.76	2.42%
14	珠海中富	1,126,331	10,058,135.83	2.28%
15	同仁堂	487,257	9,296,863.56	2.10%
16	恒瑞医药	688,406	9,011,234.54	2.04%
17	宇通客车	600,000	8,922,000.00	2.02%
18	上菱电器	633,682	8,345,591.94	1.89%
19	内蒙华电	868,020	7,855,581.00	1.78%
20	海欣股份	385,000	7,241,850.00	1.64%
21	强生控股	608,800	7,037,728.00	1.59%
22	红星发展	251,171	6,208,947.12	1.40%
23	张裕A	290,711	5,610,722.30	1.27%
24	茉织华	324,044	5,570,316.36	1.26%
25	波导股份	250,000	5,105,000.00	1.15%
26	上海机场	450,000	4,644,000.00	1.05%
27	许继电气	300,000	3,348,000.00	0.76%
28	烟台万华	195,168	2,794,805.76	0.63%
29	上海建工	200,000	2,466,000.00	0.56%
30	兆维科技	174,140	2,173,267.20	0.49%
31	云铝股份	200,000	2,072,000.00	0.47%
32	招商银行	64,600	739,024.00	0.17%
33	华鲁恒升	4,000	56,720.00	0.01%
34	安源股份	8,000	47,920.00	0.01%
35	宏智科技	4,000	34,720.00	0.01%
36	泰豪科技	7,000	33,320.00	0.01%
	合计		277,813,005.80	62.86%

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 433,285.70 元，与股票市值 277,813,005.80 元、债券（不包括国债）15,318,000.00 元、国债及货币资金 148,362,927.51 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、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	丽珠集团	-	1,600,000	-	400,000
2	威孚高科	-	1,200,000	-	-
3	珠海中富	-	1,126,331	-	-
4	云铝股份	-	612,685	119,665	532,350
5	张裕A	-	300,111	-	9,400
6	华菱管线	-	2,000,000	518,469	518,469
7	上海机场	-	450,000	-	-
8	宝钢股份	-	3,100,000	-	-
9	招商银行	64,600	200,000	-	200,000
10	宇通客车	-	600,000	-	-
11	波导股份	-	250,000	-	-
12	上海建工	-	200,000	-	-
13	振华港机	-	1,496,482	-	-
14	安源股份	8,000	-	-	-
15	华鲁恒升	4,000	-	-	-
16	中化国际	-	816,917	-	-
17	宏智科技	4,000	-	-	-
18	海油工程	-	924,047	-	297,400
19	海螺水泥	4,000	1,799,000	-	-
20	泰豪科技	7,000	-	-	-
21	兆维科技	-	220,000	-	45,860
22	巴士股份	-	1,379,708	160,878	-
23	国电电力	-	700,219	-	-
24	内蒙华电	-	868,020	-	-
25	伊利股份	-	801,966	-	250,000

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	中联重科	-	50,000	50,000
2	湘计算机	-	113,780	113,780
3	北新建材	-	131,000	131,000
4	银河科技	-	62,172	62,172
5	神火股份	-	19,700	19,700
6	中海发展	-	31,000	31,000
7	中国石化	144,000	-	144,000
8	云天化	-	86,900	86,900
9	兖州煤业	220,000	50,000	270,000
10	营口港	-	5,000	5,000

11	大厦股份	-	6,000	6,000
12	山东基建	-	14,000	14,000
13	精伦电子	-	6,000	6,000
14	江西铜业	25,000	-	25,000
15	中远航运	-	8,000	8,000
16	扬农化工	-	2,000	2,000
17	长江股份	-	8,000	8,000
18	西昌电力	-	72,000	72,000
19	香梨股份	19,000	-	19,000
20	天富热电	-	1,000	1,000
21	黑牡丹	-	6,000	6,000
22	山东药玻	-	8,000	8,000
23	栖霞建设	-	1,000	1,000
24	中软股份	-	4,000	4,000
25	深高速	203,382	-	203,382
26	卧龙科技	-	37,000	37,000
27	中孚实业	-	7,000	7,000
28	北大荒	-	12,000	12,000
29	申能股份	-	160,800	160,800
30	友谊股份	-	126,000	126,000

五. 基金持有人结构及前十名持有人

截止 2002 年 6 月 30 日, 本基金发起人华安基金管理有限公司持有的基金份额为 500 万份基金单位, 占基金发行总份额的 1%。

社会公众持有的基金份额为 49500 万份基金单位, 占基金发行总份额的 99%。

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	239,000,000	47.80%
2	金信证券有限责任公司	10,000,000	2.00%
3	华安基金管理有限公司	5,000,000	1.00%
4	广州证券有限责任公司	4,864,719	0.97%
5	刘培轩	1,800,000	0.36%
6	林少雄	1,800,000	0.36%
7	陈莹	1,788,490	0.36%
8	梅县坝头水电站	1,693,800	0.34%
9	刘书党	1,658,000	0.33%
10	李文华	1,312,400	0.26%

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 6 月 30 日基金安久前 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. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 根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。
6. 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。
7. 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。
8. 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
东方证券有限责任公司	95,660,385.88	28.63%	75,393.15	29.36%
申银万国证券股份有限公司	78,310,241.01	23.44%	57,696.22	22.47%
上海证券有限责任公司	74,893,746.75	22.41%	58,606.18	22.83%
平安证券有限责任公司	85,268,625.10	25.52%	65,076.53	25.34%
合 计	334,132,998.74	100%	256,772.08	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
东方证券有限责任公司	138,295,275.40	14.70%	50,000,000.00	12.83%
申银万国证券股份有限公司	499,636,315.20	53.13%	160,000,000.00	41.07%
上海证券有限责任公司	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	302,566,070.50	32.17%	179,600,000.00	46.10%
合 计	940,497,661.10	100%	389,600,000.00	100%

七. 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、中期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

2002 年8 月29 日