

安瑞证券投资基金

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

本基金的托管人中国工商银行已于 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: 安瑞证券投资基金
(简称: 基金安瑞)

交易代码: 500013
基金发起人: 北方证券有限责任公司
华安基金管理有限公司

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
基金上市地点: 上海证券交易所
基金上市日期: 2001 年 8 月 30 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
(邮编: 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
国际互联网网址: <http://www.huaan.com.cn>

(三) 基金托管人: 中国工商银行
注册及办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号
(邮编: 100032)

法定代表人: 姜建清
托管部负责人: 周月秋
信息披露负责人: 刘长江
电 话: 010-66106878
传 真: 010-66106904

(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

(单位: 人民币元)

项目	2001 年度	2000 年度 7-12 月
基金本期净收益	33,791,539.08	3,513,072.23
单位基金本期净收益	0.0676	0.0169
基金可分配净收益	37,381,773.19	3,590,234.11
单位基金可分配净收益	0.0748	0.0173
期末基金资产总值	556,282,731.98	222,094,707.27
期末基金资产净值	547,023,283.34	219,486,676.40
期末单位基金资产净值	1.0940	1.0567
基金资产净值收益率	12.65%	1.69%
本期基金资产净值增长率	14.39%	5.63%
累计资产净值增长率	20.83%	5.63%

上述部分指标计算公式:

1. 基金资产净值收益率:

2000 年 = 本期净收益 / 期初基金资产净值

2001 年 = 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:

2000 年 = 期末单位净值 / 期初单位净值 - 1

2001 年 = (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

扩募后单位净值 = (扩募后基金净值 + 扩募费节余 + 扩募期间冻结利息) / 扩募后基金份额

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

注: 上述各项指标与《安瑞证券投资基金投资组合公告》(2001 年第 1 号)的差异是由于提取 2001 年管理人业绩报酬所引起的。

三. 基金管理人报告

基金简介

安瑞证券投资基金是由原沈阳富民基金、沈阳万利基金、金龙基金清理规范合并而成的契约型封闭式证券投资基金, 发起人为华安基金管理有限公司和北方证券有限责任公司。截止 2000 年 7 月 17 日基金资产移交时每基金单位净值 1.0004

元，基金总份额为 207,700,000 份基金单位。2000 年 7 月 18 日，基金安瑞管理人更换为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行。

根据中国证监会证监基金字[2001]19 号文《关于同意安瑞证券投资基金上市、扩募和续期的批复》和上海证券交易所上证上字[2001]129 号《上市通知书》审核同意，基金安瑞于 2001 年 8 月 30 日在上海证券交易所挂牌交易。

经原基金持有人临时持有人大会决议通过，并经中国证监会证监基金字[2001]19 号文批准，基金安瑞于 2001 年 11 月 2 日完成扩募，基金总份额由 207,700,000 份基金单位扩募至 500,000,000 份基金单位，扩募后基金存续期延长 5 年，至 2007 年 4 月 28 日止。

本基金业绩表现

截止 2001 年 12 月 31 日，基金单位资产净值达到 1.0940 元。由于本基金 2001 年 11 月 2 日成功扩募至 5 亿份基金单位，单位净值有所摊薄。全面摊薄净值增长率为 3.53%，年度综合净值增长率 14.39%，远超过同期上证综指和深证综指-20.62%和-25.13%的市场表现。基金本年度实现净收益 3379 万元，每基金单位派发现金红利 0.07 元，取得了基金净值实现正增长、涨幅超过同期银行存款利率并进行现金分红的佳绩。

基金经理简介

林彤彤先生，基金经理，工商管理硕士（MBA）。10 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，担任基金经理前为华安基金管理有限公司研究发展部研究员、基金安信和基金安久基金经理。现担任基金安顺和基金安瑞的基金经理。

李勿先生，基金经理，管理学博士。9 年证券从业经验，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。现担任基金安顺和基金安瑞的基金经理。

（一）基金经理工作报告

首先，感谢各位基金持有人对我们的支持和信任，感谢你们在动荡的市场环境中积极参与基金安瑞的扩募，并与我们一起度过市场最困难的时期。

历史不会忘记 2001 年的中国股市，它以深刻的变革在中国证券史上写下了浓浓的一笔，也给未来留下了深深的思考。这一年，股市经历大喜大悲，股指创出了历史新高，随后又以惨烈的回调让人们饱尝了风险的滋味；这一年，市场监管力度之强史无前例，坐庄、造假行为遭到严惩，违规事件得到集中、充分的曝光；这一年，市场的力量显著增强、影响日益扩大，股市几乎吸引了全社会的目光，关于股市大是大非的讨论空前激烈；这一年，理念的冲突和结构的变革增加了投资的风险，市场参与各方也随股指的跌宕起伏经受了考验和磨练。某种意义上，2001 年成为中国股市的分水岭：股指的深幅调整并不只是简单的量的变化，更是一种质的飞跃，它带来视野的转变，观念的转变，结构的改变和规则的改变。

表面上看，引发 96 年以来大牛市行情出现大幅调整的导火索是国有股减持问题，但更深层的原因还是与中国加入 WTO 这一重大历史事件有关。从入世后防范

金融风险的大局考虑，管理层加强了银行资金入市的控制，并对操纵、造假等违规、违法行为进行了严厉整治和查处。资金链的断裂使许多长线“牛股”走熊，增加了市场的恐慌气氛。许多上市公司的业绩遭到质疑，理念失去方向，信心受到打击，股市的系统风险和个股风险同时提高，增加了机构理性投资的难度。但市场秩序的整顿，无疑有利于股市的长远发展。

基金安瑞自 2000 年 7 月 18 日正式交由本管理人运作以来，大盘一直处于历史相对高位，面临的系统风险较大，并且基金还将要上市和扩募，所以在运做上也非常谨慎，股票仓位一直控制在较低水平。针对小盘股流动性较差的问题，适当控制组合的集中度，保持了较好的组合流动性。股票投资重点参与了风险度较低的品种如新股认购和增发申购等，结合市场热点，适度参与了次新股等板块的投资。通过合理的资产配置和波段运做，既有效回避了系统风险，又抓住了一些市场机会，取得了较好的投资收益。

截止 2000 年末，单位净值从运作初的 1.0004 元增长为 1.0567 元，2000 年净值增长率达到 5.63%，超过同期沪深两市 3.98% 和 3.48% 的涨幅。2001 年末单位净值全面摊薄后仍达到 1.0940 元，全年全面摊薄净值增长率 3.53%，年度综合净值增长率 14.39%，远超过同期沪深综指平均-22.88% 的市场表现；本年度实现净收益 3379 万元，单位派发现金红利 0.07 元。基金安瑞是 2001 年度沪深两市为数甚少的净值实现正增长、涨幅超过同期银行存款利息、并且进行现金分红的基金。

2002 年证券市场的主基调是规范与发展，政策面和市场面的变数非常多，市场将维持“变中求稳，稳中有变”的运行格局，存在阶段性和局部的投资机会。作为入世的第一年，经济结构调整和政策规则的变革将逐步展开，扩大内需的政策也将稳步推行，其中蕴藏的投资机会值得深入挖掘。随着市场结构的改变，机构时代逐步取代庄股时代，机构之间的相对优势减弱，大部分时间趋同运作，超额利润产生的机会大大减少。而有关新股发行方式的改变以及统一指数、CDR 等创新品种的推出也将对市场走势和投资理念产生影响。做为以小盘股投资为主的基金，我们不能充分参与大市值品种的投资，加上没有公认的小盘指数作为参照，客观上也增加了我们投资制胜的难度。

在新的一年里，我们将继续保持稳健、进取的操作心态，秉承本管理人“精选个股、重点投资、长期持有、波段操作”的投资理念，加大政策与市场关系的研究，在注重基本面研究的同时，提高市场应变能力。通过投资具有产业和资本增长潜力的中小公司，与广大基金持有人一起分享企业成长的烦恼与喜悦。

（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、《安瑞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，伴随着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、对基金安瑞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《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》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。除因基金安瑞规模较小，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瑞证券买卖年成交总量的 30%外，未发现基金安瑞的投资运作中存在重大违规行为。鉴于基金安瑞于 2001 年 8 月 30 日上市后有 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与过户登记应用系统。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、基金注册与过户登记、客户关系管理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，由监察稽核部牵头，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

本托管人——中国工商银行，依据《安瑞证券投资基金基金契约》与《安瑞证券投资基金托管协议》，托管安瑞证券投资基金。

2001 年度，在对安瑞证券投资基金的托管过程中，本托管人严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对安瑞证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，没有发生任何损害基金持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为托管人所应尽的义务。

本托管人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对安瑞证券投资基金的投资组合进行了监督，认为华安基金管理有限公司在安瑞证券投资基金的投资运作、基金资产净值及单位基金资产净值的计算上，遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，没有发现任何损害基金持有人利益的行为。

本托管人依法对安瑞证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2001 年度所编制和披露的安瑞证券投资基金资产净值公告、基金投资组合公告、基金年度报告等公告信息进行了核查，认为安瑞证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2001 年度内所编制和披露的基金信息是合法、真实和完整的。

中国工商银行基金托管部
2002 年 3 月 25 日

五. 基金年度财务报告

（一）审计报告

审 计 报 告

华业字（2002）第 578 号

安瑞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《安瑞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 年度的经营成果，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：		135,213,281.56	89,548,310.48
股票投资—估值增值：		8,293,470.15	8,196,442.29
债券投资—成本：		310,000,000.00	-
债券投资—估值增值：		1,331,000.00	-
配股权证：		17,040.00	-
买入返售证券：		-	-
银行存款和清算备付金：		100,876,771.47	124,031,002.18
应收股利：		-	-
应收利息：	1	301,168.80	68,952.32
应收账款：		-	-
其他应收款项：	2	250,000.00	250,000.00
基金资产总值：		556,282,731.98	222,094,707.27
应付管理费及业绩报酬：		4,408,095.77	275,582.79
应付基金托管费：		115,765.30	45,930.47
应付账款：	3	4,159,760.61	-
卖出回购证券：		-	-
应付佣金：		86,176.96	67,758.40
其他应付款项：	4	489,650.00	2,218,759.21
负债总额：		9,259,448.64	2,608,030.87
基金单位总额：		500,000,000.00	207,700,000.00
未分配净收益：		37,381,773.19	3,590,234.11
未实现估值增值：		9,641,510.15	8,196,442.29
基金资产净值：		547,023,283.34	219,486,676.40
基金单位发行总份额：		500,000,000	207,700,000
每份基金单位资产净值：		1.0940	1.0567

收益及收益分配报告书

收益及收益分配主要项目本期数、上期数如下：

项 目	说明	本期数	上期数
在除息日确认的股息收入：		655,471.51	-
债券利息收入：		250,815.29	-
股票买卖价差收入：		31,924,604.51	3,546,883.87
债券买卖价差收入：		3,855,943.06	-
其他收入：	5	6,177,373.50	1,643,447.35
管理费及业绩报酬：		8,225,259.93	1,436,707.74
其中：基金管理费：		4,511,755.98	1,436,707.74
业绩报酬：		3,713,503.95	-
基金托管费：		751,959.36	239,451.25
应由基金承担的其他费用：	6	95,449.50	1,100.00
基金净收益：		33,791,539.08	3,513,072.23
上年末未分配净收益：		3,590,234.11	77,161.88
本期已分配收益：		-	-
期末未分配净收益：		37,381,773.19	3,590,234.11

（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帐。

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）证券的成本计价方法：

证券在取得时按实际成本计价，出售时按移动加权平均法计价。

（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，分配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
中国工商银行	基金托管人	提取托管费	基金契约

上海证券有限责任公司 与管理公司属同 租用交易席位 席位使用协议
一股东*

*注：同一股东为上海国际信托投资公司，系基金管理公司发起人。

(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	占成交总量 比例	年佣金	占佣金总 量比例	平均佣 金比率
上海证券有限责任公司	423,972,001.05	97.00%	339,294.01	97.21%	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	占成交总量 比例	年佣金	占佣金总 量比例	平均佣 金比率
上海证券有限责任公司	84,872,893.50	100.00%	67,758.40	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	年国债成交量	占成交总量 比例	年回购成交量	占成交总量 比例
上海证券有限责任公司	455,498,868.00	100.00%	0.00	0.00%

本基金 2000 年末通过关联人席位进行国债及回购交易。

(3) 本基金与关联人 2001 年末进行银行间市场债券买卖和银行间市场回购交易。

(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

本基金应支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，若持有现金比例超过本基金资产净值的 20%，超过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费

E 为前一日的基金资产净值（扣除超过规定比例现金后的资产净值）

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 年基金管理人收取的管理费金额为 4,511,755.98 元。2000 年基金管理人收取的管理费金额为 1,436,707.74 元。

②基金管理人业绩报酬

本基金在本会计年度按照《安瑞证券投资基金基金契约》规定的计提方法和比例（本基金由于在本年度进行了扩募，计算方法相应调整），并经托管人核对和

会计师审计确认计算过程和结果，在年末一次性计提管理人业绩报酬人民币 3,713,503.95 元。

业绩报酬 = 加权平均期初资产净值 * $\text{Min}\{M, N\}$ * 5%

其中：

加权平均期初资产净值 = 期末基金资产净值 / (1+ 基金综合资产净值增长率)；

M = 基金综合可分配净收益率 - 1.2*同期银行一年定期储蓄存款利率（如果年内
银行利率发生变动，则按时间段进行加权平均调整）；

N = 基金综合资产净值增长率 - 同期证券市场平均收益率；

$\text{Min}\{M, N\}$ 为 M、N 中较小者；

基金综合可分配净收益率 = (1+扩募前可分配净收益率) * (1+扩募后可分配净收
益率) - 1

基金综合资产净值增长率 = (1+扩募前资产净值增长率) * (1+扩募后资产净值增
长率) - 1

基金扩募前可分配净收益率 = 扩募前可分配净收益 / 期初资产净值

基金扩募后可分配净收益率 = 扩募后可分配净收益 / (扩募后期初资产净值+扩
募费节余+扩募期间冻结利息)

基金扩募前资产净值增长率 = (扩募前基金资产净值 - 期初资产净值) / 期初资
产净值

基金扩募后资产净值增长率 = [期末基金资产净值 - (扩募后期初资产净值+扩
募费节余+扩募期间冻结利息)] / (扩募后期初
资产净值+扩募费节余+扩募期间冻结利息)

证券市场平均收益率 = [(当年深综指涨跌幅 * 深市平均总市值+当年沪综指涨跌
幅 * 沪市平均总市值) / (深市平均总市值+沪市平均总
市值)] * 80%+同期国债平均收益率 * 20%；

深市平均总市值 = (年末深市总市值+年初深市总市值) / 2

沪市平均总市值 = (年末沪市总市值+年初沪市总市值) / 2

2001 年度基金支付的用于奖励基金管理人员的业绩报酬金额为 3,713,503.95 元。

2000 年度未发生管理人业绩报酬支出。

③基金托管费

本基金应支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 年托管人收取的基金托管费金额为 751,959.36 元。2000 年托管人收取的
基金托管费金额为 239,451.25 元。

3、主要报表项目说明

(1) 应收利息 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 301,168.80 元。由以下两项组成：银行存款和交易备付金利息为 71,031.76 元；国债利息为 230,137.04 元。

(2) 其他应收款项 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 250,000.00 元,是应收深圳证券交易所交易保证金 250,000.00 元。

(3) 应付帐款 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 4,159,760.61 元，是应付上海交易清算资金 861,474.61 元和应付深圳交易清算资金 3,298,286.00 元。

(4) 其他应付款项 2001 年 12 月 31 日余额为人民币 489,650.00 元，由以下两项组成：应付券商席位保证金 250,000.00 元；其他应付款 239,650.00 元。

(5) 其他收入 2001 年发生额为人民币 6,177,373.50 元，由以下二项组成：银行存款和交易备付金利息收入 3,145,660.67 元；其他收入 3,031,712.83 元。

(6) 应由基金承担的其他费用 2001 年发生额为人民币 95,449.50 元，由以下四项组成：交易费用 1,262.50 元；回购利息支出 69,087.00 元；上市年费 25,000.00 元；其他费用 100.00 元。

4、额定扩募费用及额定扩募费用余额

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与实际发生的扩募费用的差额，于扩募结算工作完成后计入当期收益。

额定扩募费用	2,923,000.00 元
减：上网扩募手续费	608,035.80 元
上市协调费	200,000.00 元
扩募验资费	30,000.00 元
扩募律师费	20,000.00 元
信息披露费	325,090.00 元
信息查询费	100.00 元
扩募费用小计：	<u>1,183,225.80 元</u>
额定扩募费用余额：	1,739,774.20 元

(四) 本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的新股和承购的债券。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 3,003,353.24 元。

1、流通受限的新股

序号	股票名称	申购 确定日期	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
1	华能国际	01-11-20	01-12-06	25,324	201,325.80	319,588.88	上市日起 3 个月
2	深 高 速	01-12-11	01-12-25	838,689	3,069,601.74	5,954,691.90	上市日起 3 个月
3	三佳模具	01-12-24	02-01-08	25,000	170,000.00	170,000.00	上市日起流通

4	宝光股份	01-12-27	02-01-16	28,000	77,280.00	77,280.00	上市日起流通
	合 计				<u>3,518,207.54</u>	<u>6,521,560.78</u>	

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、流通受限的债券

序号	债券名称	发行日期	上市日期	数量	成本	市价	流通受限期
1	21 国债 15	01-12-18	02-01-04	2,000,000	200,000,000.00	200,000,000.00	上市日起流通

（五）基金投资组合

1、按行业分类的投资组合

分 类	市值（元）	占净值比例
农、林、牧、渔业	1,044,890.00	0.19%
采掘业	10,274,292.84	1.87%
制造业	105,785,779.44	19.34%
其中：食品、饮料	18,070,898.84	3.30%
纺织、服装、皮毛	32,842,034.04	6.00%
木材、家具	----	----
造纸、印刷	596,400.00	0.11%
石油、化学、塑胶、塑料	29,527,491.26	5.40%
电子	----	----
金属、非金属	----	----
机械、设备、仪表	247,280.00	0.05%
医药、生物制品	24,501,675.30	4.48%
其他	----	----
电力、煤气及水的生产和供应业	319,588.88	0.06%
建筑业	----	----
交通运输、仓储业	5,954,691.90	1.09%
信息技术业	----	----
批发和零售贸易	20,127,508.65	3.68%
金融、保险业	----	----
房地产业	----	----
社会服务业	----	----
传播与文化产业	----	----
综合类	----	----
合 计	<u>143,506,751.71</u>	<u>26.23%</u>

2. 国债、货币资金合计

截至 2001 年 12 月 31 日，基金持有的国债及货币资金合计为 408,278,147.90 元，占基金资产净值的 74.64%。

3. 基金投资股票明细

序号	名 称	数量 (股)	市值 (元)	占净值比例
1	红星发展	663,690	21,204,895.50	3.88%
2	海欣股份	889,295	14,949,048.95	2.73%
3	鲁 泰 A	810,973	11,296,853.89	2.06%
4	恒瑞医药	629,662	10,742,033.72	1.96%
5	友谊股份	723,885	10,489,093.65	1.92%
6	双汇发展	768,870	10,379,745.00	1.90%
7	神火股份	697,508	10,274,292.84	1.88%
8	丽珠集团	830,100	7,703,328.00	1.41%
9	张 裕 A	413,948	7,691,153.84	1.41%
10	盐湖钾肥	500,762	7,441,323.32	1.36%
11	茉 织 华	392,160	6,596,131.20	1.20%
12	中化国际	443,500	6,133,605.00	1.12%
13	东阿阿胶	531,722	6,056,313.58	1.11%
14	深 高 速	838,689	5,954,691.90	1.09%
15	武汉中百	355,000	2,896,800.00	0.53%
16	香梨股份	77,000	1,044,890.00	0.19%
17	烟台万华	36,537	881,272.44	0.16%
18	北京华联	39,000	608,010.00	0.11%
19	山鹰纸业	56,000	596,400.00	0.11%
20	华能国际	25,324	319,588.88	0.06%
21	三佳模具	25,000	170,000.00	0.03%
22	宝光股份	28,000	77,280.00	0.01%
合计			<u>143,506,751.71</u>	<u>26.23%</u>

4. 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 4,761,616.27 元, 股票市值 143,506,751.71 元、国债及货币资金 408,278,147.90 元合计与其相抵减后等于基金净值。其他应收应付款项包括: 应收利息、其他应收款、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金以及其他应付款等。

(4) 本报告与《安瑞证券投资基金投资组合公告》(2001年第1号) 差异是由于提取2001年管理人业绩报酬所引起的。

(六) 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场申购	二级市场买入	其他	
1	东阿阿胶	-	531,722	-	-
2	丽珠集团	-	830,100	-	-
3	盐湖钾肥	-	500,762	-	-

4	双汇发展	-	768,870	-	-
5	神火股份	-	727,508	-	30,000
6	华能国际	25,324	-	-	-
7	恒瑞医药	-	799,662	-	170,000
8	烟台万华	-	751,369	307,477	1,022,309
9	北京华联	39,000	-	-	-
10	红星发展	-	863,690	-	200,000
11	宝光股份	28,000	-	-	-
12	中化国际	-	650,000	-	206,500
13	香梨股份	77,000	-	-	-
14	三佳模具	25,000	-	-	-
15	深 高 速	838,689	-	-	-
16	茉 织 华	-	-	503,660	111,500
17	山鹰纸业	56,000	-	-	-
18	友谊股份	-	723,885	-	-

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

序号	股票名称	期初结存	本期增加	本期卖出
1	佛山照明	1,126,480	-	1,126,480
2	湖南投资	-	125,400	125,400
3	京东方 A	193,020	-	193,020
4	振华科技	289,855	-	289,855
5	中国石化	-	261,000	261,000
6	同 仁 堂	-	1,032,088	1,032,088
7	广州控股	-	430,305	430,305
8	莲花味精	-	3,624,481	3,624,481
9	开开实业	-	314,200	314,200
10	鄂尔多斯	-	62,860	62,860
11	振华港机	205,212	-	205,212
12	广州药业	-	349,429	349,429
13	长江通信	-	118,392	118,392
14	冰山橡塑	-	1,000	1,000
15	成发科技	-	38,000	38,000
16	华纺股份	-	1,000	1,000
17	安阳钢铁	-	14,000	14,000
18	青岛海尔	-	717,600	717,600
19	龙电股份	1,157,895	694,737	1,852,632
20	新亚股份	-	1,015,490	1,015,490
21	星湖科技	199,970	-	199,970

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 5,000,083 份基金

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
北方证券有限责任公司	3,000,000	0.60%
其中：未上市流通份额	3,000,000	0.60%
华安基金管理有限公司	2,000,083	0.40%
其中：未上市流通份额	2,000,000	0.40%

社会公众持有的基金份额为 494,999,917 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	中国人寿	34,002,752	6.80%
2	再保险	10,153,450	2.03%
3	刘昌达	3,741,800	0.75%
4	杨玉国	3,646,991	0.73%
5	永安保险	3,619,551	0.72%
6	坝头水电	3,200,000	0.64%
7	致远创业	3,089,833	0.62%
8	北方证券	3,000,000	0.60%
9	陈香启	2,978,161	0.60%
10	云南石化	2,938,714	0.59%

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. 2001 年 9 月 20 日本基金管理人发布《关于调整基金经理的公告》：因工作需要，经董事会同意，从 2001 年 9 月 20 日起对本基金基金经理做如下调整：聘任林彤彤先生担任本基金基金经理，尚志民先生不再担任本基金基金经理，李匆先生继续担任本基金基金经理。

3. 2001 年各券商股票、国债及回购交易情况和佣金情况如下：

①股票交易情况与佣金情况：

券 商	成交量	占成交总量 比例	佣金	占佣金总量比例
上海证券有限责任公司	423,972,001.05	97.00%	339,294.01	97.21%
中国民族国际信托投资公司	13,121,958.02	3.00%	9,749.85	2.79%
合 计	<u>437,093,959.07</u>	<u>100.00%</u>	<u>349,043.86</u>	<u>100.00%</u>

②国债及回购交易情况:

券 商	国债成交量	占成交总 量比例	回购成交量	占成交总量比例
上海证券有限责任公司	455,498,868.00	100.00%	0.00	0.00%
中国民族国际信托投资公司	0.00	0.00%	101,000,000.00	100.00%
合 计	<u>455,498,868.00</u>	<u>100.00%</u>	<u>101,000,000.00</u>	<u>100.00%</u>

注：基金安瑞 2001 年 8 月 30 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成交总量 30%的比例限制的规定。

八. 备查文件目录

1. 中国证监会批准安瑞证券投资基金设立和扩募的文件。
2. 《安瑞证券投资基金基金契约》。
3. 《安瑞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. 安瑞证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注。
6. 安瑞证券投资基金 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