

安瑞证券投资基金

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

本基金的托管人中国工商银行已于 2003 年 3 月 26 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(1992 年 4 月 29 日至 2007 年 4 月 28 日)

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: 010-66107333

传 真: 010-66106904

(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

项 目	2002年度	2001年度	2000年度7-12月
基金本期净收益	11,029,415.05	33,791,539.08	3,513,072.23
单位基金本期净收益	0.0221	0.0676	0.0169
基金可分配净收益	-33,592,231.57	37,381,773.19	3,590,234.11
单位基金可分配净收益	-0.0672	0.0748	0.0173
期末基金资产总值	467,651,279.58	556,282,731.98	222,094,707.27
期末基金资产净值	466,407,768.43	547,023,283.34	219,486,676.40
期末单位基金资产净值	0.9328	1.0940	1.0567
基金资产净值收益率	2.15%	12.65%	1.69%
本期基金资产净值增长率	-9.10%	14.39%	5.63%
累计资产净值增长率	9.83%	20.83%	5.63%

上述部分指标计算公式:

- 1、基金可分配净收益=期末基金净收益+MIN(0, 期末未实现利得余额)
- 2、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*本期天数 + 扩募日资金流入额*扩募日至本期末天数) / 本期天数)
- 3、本期基金资产净值增长率= (扩募或分红前单位净值 / 期初单位净值) * (期末单位净值 / 扩募或分红后单位净值) -1
- 4、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。

基金经理简介

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研究员、基金安信和基金安久的基金经理。现任基金安顺和基金安瑞的基金经理。

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。

（一）基金经理工作报告

截止 2002 年 12 月 31 日，基金单位资产净值达到 0.9328 元，年净值增长率为 -9.10%，超过同期上证综指和深证综指-17.52%和-18.32%的市场表现。实现净收益 1103 万元。由于基金单位净值低于面值，没有能够进行分红。

本基金 2000 年 7 月 18 日成立，2001 年 10 月扩募，成立以来历年的业绩表现总结如下，基金业绩在本年度及过去两年中均处于同类基金的前列：

期间	净值增长率	单位分红	上证综指涨幅	深证综指涨幅
2000.7.18—12.31	5.63%	-	3.98%	3.48%
2001	14.39%	0.07 元	-20.62%	-25.13%
2002	-9.10%	-	-17.52%	-18.32%
累计	9.83%	0.07 元	-31.92%	-36.72%
年复合增长率	3.18%	-	-12.03%	-14.15%

在世界经济复苏乏力的情况下，2002 年中国宏观经济仍然保持快速增长，全年 GDP 增长率达到 8%，超过年初大多数机构的预测，主要原因在于外贸出口的强劲增长以及投资增速的迅猛提升，受益于此，上市公司的业绩也普遍得到提升，尤其是行业整体复苏的石化以及受需求拉动的钢铁、汽车等行业。

然而，股市作为宏观经济“晴雨表”的作用在 2002 年仍然没有显现，与经济高速增长相反，2002 年的中国股市却是震荡下行，尤其是下半年，以上证综指为例，除了 8 月份略微上涨 0.9%以外，其余 5 个月几乎以每个月 5%的幅度下跌，不仅将上半年 6.24 行情的反弹成果全部吞没，而且使得全年的跌幅达到 17.5%，包括个人投资者、券商、基金等在内的所有市场参与者又经历了一个“寒冬”。我们认为，2002 年中国证券市场的弱市格局，既和管理层接连不断出台利好政策期望稳定市场的预期不符，也和宏观、微观经济的增长态势不符。当前证券市场已不是简单的政策面、宏观面的问题，而是股市本身的结构性问题，如部分上市公司市盈率依然偏高，上市公司股权结构不合理和不平等，上市公司管理和财务不透明等，这些都已成为制约中国证券市场发展的巨大障碍。

国有股减持政策的变化给证券市场留下了一个“6.24”，能否判断并把握“6.24”，决定了 2002 年投资的成败。遗憾的是，我们不是幸运儿。“6.24”的出现某种程度上影响了市场的博弈格局，也打乱了我们的步调。虽然在“6.24”初期没有仓促增仓，避免了陷入更大的被动。但心态的改变影响了我们的市场判断，下半年在股市回调过程中，安瑞的仓位在缓慢增加，但 2002 年的机会只有一次，最终没有能有效扭转落后局面。

作为小盘股基金，品种选择的重点还是以自下而上的思路为主。2001 年以来市场结构出现明显分化，流动性受到普遍关注。低价大盘股较多的传统行业出现景气复苏，增加了大盘股的活跃程度。而小盘股由于前几年对其成长性的推崇，定位普遍较高，且流动性欠佳，客观上也限制了我们的选股范围。

展望 2003 年，我们预计全年 GDP 可望继续保持 7.5%左右的高速增长，宏观经济仍将继续为证券市场营造良好的外部环境；随着入世条款的逐步实施，中国证券市场将逐步向外资开放，这势必促进证券市场进一步规范化、市场化和国际化，QFII 的正式实施将会对市场的选股标准、投资理念、盈利模式产生影响，我

们必须重视其可能对市场造成的影响。此外国有股、法人股的流通问题仍然是中国股市无法回避的重大课题，这个问题不解决，中国证券市场的长期发展仍将受其困扰。

我们认为 2003 年将是市场自身存在问题及股价结构调整的一年，或者说是“熊牛”交织的一年，股指仍将维持箱体震荡格局，但市场环境基础将好于 2002 年，由此而产生的局部行情、个股机会将会多于 2002 年。我们会在关注流动性的前提下，兼顾小企业的成长性分析，通过对阶段性机会的把握，增加波段操作力度，提高资产利用效率，以期为持有人带来良好的回报。

（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。

二、 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、 对基金安瑞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》、《安瑞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，未发现基金安瑞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。为做好监察工作，更好地了解新产品、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

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。

2002 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 2002 年度内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、基金中期报告等公告信息进行了复核，认为安瑞证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2002 年度内所编制和披露的基金信息是准确、真实、完整的。

中国工商银行基金托管部

2003 年 3 月 17 日

五. 基金年度财务报告

(一) 审计报告

安永大华业字（2003）第 394 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 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状况，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 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 上海 昆山路 146 号

中国注册会计师：吕秋萍

中国注册会计师：曹 勤

2003 年 2 月 15 日

(二) 基金会计报告书

安瑞证券投资基金

资产负债表

2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注	2002年12月31日	2001年12月31日
资产：			
银行存款		10,191,600.00	98,777,819.03
清算备付金		10,027,056.86	2,098,952.44
交易保证金	3(1)	750,000.00	250,000.00
应收证券清算款	3(2)	6,716,495.44	-
应收股利		-	-
应收利息	3(3)	835,627.79	301,168.80
其他应收款		-	-
股票投资市值	1(4)	292,453,552.39	143,506,751.71
其中：股票投资成本	1(7)	339,671,693.96	135,213,281.56
债券投资市值	1(4)	146,676,947.10	311,331,000.00
其中：债券投资成本	1(7)	147,041,307.54	310,000,000.00
配股权证		-	17,040.00
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产总计		467,651,279.58	556,282,731.98
负债：			
应付证券清算款		-	4,159,760.61
应付管理人报酬		600,161.27	4,408,095.77
应付托管费		100,026.86	115,765.30
应付佣金		90,123.02	86,176.96
应付利息		-	-
其他应付款	3(4)	263,200.00	489,650.00
卖出回购证券款		-	-
预提费用	3(5)	190,000.00	-
负债合计		1,243,511.15	9,259,448.64
持有人权益：			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		-47,582,502.01	9,641,510.15
未分配收益		13,990,270.44	37,381,773.19
持有人权益合计		466,407,768.43	547,023,283.34
负债及持有人权益总计		467,651,279.58	556,282,731.98

安瑞证券投资基金

经营业绩表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002年度	2001年度
一、收入		22,660,659.83	42,864,207.87
1、股票差价收入	1(6)	9,073,213.04	31,924,604.51
2、债券差价收入	1(6)	1,870,217.54	3,855,943.06
3、债券利息收入	1(6)	7,090,483.45	250,815.29
4、存款利息收入	1(6)	1,737,858.87	3,145,660.67
5、股利收入	1(6)	2,378,593.81	655,471.51
6、买入返售证券收入	1(6)	63,000.00	-
7、其他收入	3(6)	447,293.12	3,031,712.83
二、费用		11,631,244.78	9,072,668.79
1、基金管理人报酬	2(4)	7,854,624.06	8,225,259.93
2、基金托管费	2(4)	1,310,920.65	751,959.36
3、卖出回购证券支出		1,771,149.81	69,087.00
4、利息支出		-	-
5、其他费用	3(7)	694,550.26	26,362.50
其中：上市年费		60,000.00	25,000.00
信息披露费		340,000.00	-
审计费用		140,000.00	-
三、基金净收益		11,029,415.05	33,791,539.08
加：未实现利得	3(8)	-56,644,929.96	1,445,067.86
四、基金经营业绩		-45,615,514.91	35,236,606.94

安瑞证券投资基金
收益分配表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002年度	2001年度
本期基金净收益		11,029,415.05	33,791,539.08
加：期初基金净收益		37,381,773.19	3,590,234.11
加：以前年度损益调整	3(8)	579,082.20	-
可供分配基金净收益		48,990,270.44	37,381,773.19
减：本期已分配基金净收益	1(9)	35,000,000.00	-
期末基金净收益		13,990,270.44	37,381,773.19

安瑞证券投资基金
净值变动表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002年度	2001年度
一、期初基金净值		547,023,283.34	219,486,676.40
二、本期经营活动：			
基金净收益		11,029,415.05	33,791,539.08
未实现利得	3(8)	-56,644,929.96	1,445,067.86
经营活动产生的基金净值变动数		-45,615,514.91	35,236,606.94
三、本期基金单位交易：			

基金申购款	-	292,300,000.00
基金赎回款	-	-
基金单位交易产生的基金净值变动数	-	292,300,000.00
四、本期向持有人分配收益：		
向持有人分配收益产生的基金净值变动数	-35,000,000.00	-
五、期末基金净值	<u>466,407,768.43</u>	<u>547,023,283.34</u>

(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。本会计期间为 2002 年 1 月 1 日至 2002 年 12 月 31 日。

(2) 记账原则：权责发生制。

(3) 记账本位币：人民币；记账单位：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，以最近交易日的价格估值。

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，估值为零。

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) 待摊费用和预付费用的核算方法

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、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。

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：在债券持有期间内逐日计提，按票面价值与票面利率计提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。

(7) 证券的成本计价方法：

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：

依据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》的有关规定，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征收范围，不征收营业税；对基金管理人运用基金买卖股票按 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 日起证券交易印花税下调为 2%。

(9) 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。

(10) 会计政策变更及其影响：

基金自 2002 年 1 月 1 日起执行财政部于 2001 年 11 月 11 日颁发的《证券投资基金会计核算办法》，其影响主要为证交所交易债券的成本计价方法和利息收入确认方法的变更，即成本计价方法由含息成本变更为不含息成本，利息收入确认

方法由在收到时确认变更为在债券持有期内逐日计提确认。按照新的会计政策，基金于 2002 年 1 月 1 日对相关科目进行调整，具体为“应收利息”调增 579,082.20 元，记入“以前年度损益调整”579,082.20 元，同时“未实现利得”和“债券估值增值”调减 579,082.20 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
中国工商银行	基金托管人	提取托管费 银行间回购交易	基金契约 成交确认书
上海证券有限责任公司	与基金管理公司 属同一股东*	租用交易席位	席位使用协议

*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 2002 年 1-12 月的股票交易情况：

关联人	1-12 月股票成交量	占成交总量比例	1-12 月佣金	占佣金总量比例	平均佣金比率
上海证券有限责任公司	118,789,635.04	20.35%	90,821.06	21.39%	0.076%

本基金通过关联人席位 2001 年 1-12 月的股票交易情况：

关联人	1-12 月股票成交量	占成交总量比例	1-12 月佣金	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%

② 本基金通过关联人席位 2002 年 1-12 月的债券及回购交易情况：

关联人	1-12 月债券成交量	占成交总量比例	1-12 月回购成交量	占成交总量比例
上海证券有限责任公司	245,620,828.80	8.40%	232,100,000.00	15.10%

本基金通过关联人席位 2001 年 1-12 月的债券及回购交易情况：

关联人	1-12 月债券成交量	占成交总量比例	1-12 月回购成交量	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%

(3) 本基金与关联人 2002 年 1-12 月银行间市场债券买卖交易和银行间市场债券回购交易情况：

关联人	1-12 月银行间债	占成交总量比	1-12 月回购成交量	占成交总量	融资利息金额	所占比例
-----	------------	--------	-------------	-------	--------	------

	券成交量	例	比例		
中国工商银行	-	-	100,000,000.00	100%	118,917.81 100%

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 年基金管理人收取的基金管理费金额为 7,854,624.06 元。2001 年基金管理人收取的管理费金额为 4,511,755.98 元,业绩报酬为 3,713,503.95 元。

②基金托管费

本基金应支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 年基金托管人收取的基金托管费金额为 1,310,920.65 元。2001 年基金托管人收取的基金托管费金额为 751,959.36 元。

3、主要报表项目说明

(1) 交易保证金:

明细项目	期末数	期初数
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 交易保证金	750,000.00	250,000.00

(2) 应收证券清算款:

明细项目	期末数	期初数
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	2,982,945.56	-
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	3,733,549.88	-
合计	<u>6,716,495.44</u>	-

(3) 应收利息:

明细项目	期末数	期初数
银行存款和清算备付金利息	15,237.20	71,031.76
债券利息	<u>820,390.59</u>	<u>230,137.04</u>
合计	<u>835,627.79</u>	<u>301,168.80</u>

(4) 其他应付款:

明细项目	期末数	期初数
券商代垫交易保证金	250,000.00	250,000.00
其他	<u>13,200.00</u>	<u>239,650.00</u>
合计	<u>263,200.00</u>	<u>489,650.00</u>

(5) 预提费用: 预计将发生的, 影响基金单位净值小数点后第五位, 应预提记入本期的费用。如: 上市年费、信息披露费、审计费用和律师费等。

明细项目	期末数	期初数
信息披露费	120,000.00	-
审计费	<u>70,000.00</u>	-
合计	<u>190,000.00</u>	-

(6) 其他收入:

明细项目	本期数	上期数
新股手续费返还	90,458.78	4,766.07
配股手续费返还	1,991.31	
债券手续费返还	352,000.00	415,800.00
印花税返还	2,843.03	932.73
老基金清理和扩募费节余		<u>2,610,214.03</u>
合计	<u>447,293.12</u>	<u>3,031,712.83</u>

(7) 其他费用:

明细项目	本期数	上期数
交易所费用	40,510.74	1,262.50
上市年费	60,000.00	25,000.00
审计费	140,000.00	-
信息披露费	340,000.00	-
红利发放手续费	105,000.00	-
其他费用	9,039.52	<u>100.00</u>
合计	<u>694,550.26</u>	<u>26,362.50</u>

(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579,082.20元，同时将人民币579,082.20元记入以

前年度损益调整科目；未实现利得和债券估值增值分别调减人民币579,082.20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。

明细项目	本期数	上期数
交易所债券价息分离调整	579,082.20	-

(四) 流通转让受限的基金资产

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。2002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186,169.93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	中国联通	2002-9-26	2002-10-9	454,073	1,044,367.90	1,230,537.83	上市日起6个月
2	皖通高速	2002-12-26	2003-1-7	97,000	213,400.00	213,400.00	上市日起流通
3	中信证券	2002-12-24	2003-1-6	165,000	742,500.00	742,500.00	上市日起流通
合 计					<u>2,000,267.90</u>	<u>2,186,437.83</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。

(五) 基金投资组合

1、按行业分类的投资组合

序号	分 类	市 值 (元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	3,840,000.00	0.82%
B	采掘业	4,350,060.00	0.93%
C	制造业	203,267,429.16	43.58%
C0	其中：食品、饮料	28,566,360.83	6.13%
C1	纺织、服装、皮毛	31,595,280.53	6.77%
C2	木材、家具		
C3	造纸、印刷	18,367,903.90	3.94%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	64,351,971.21	13.80%
C5	电子	1,699,520.00	0.36%
C6	金属、非金属	5,419,126.50	1.16%
C7	机械、设备、仪表	29,731,173.71	6.37%
C8	医药、生物制品	23,536,092.48	5.05%
C99	其他	---	---
D	电力、煤气及水的生产和供应业	---	---
E	建筑业	210,540.00	0.04%
F	交通运输、仓储业	12,632,077.50	2.71%
G	信息技术业	10,435,095.95	2.24%
H	批发和零售贸易	54,089,119.78	11.60%

I	金融、保险业	3,629,230.00	0.78%
J	房地产业	---	---
K	社会服务业	---	---
L	传播与文化产业	---	---
M	综合类	---	---
	合 计	292,453,552.39	62.70%

2、债券（不包括国债）合计

截止 2002 年 12 月 31 日，基金持有的债券（不含应收利息）合计为 49,935,000.00 元，占基金资产净值的 10.71%

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 123,677,099.40 元，占基金资产净值的 26.52%。

4、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	1,088,447	20,212,460.79	4.33%
2	张裕A	1,341,812	19,590,455.20	4.20%
3	盐湖钾肥	1,381,651	18,597,022.46	3.99%
4	华泰股份	1,463,578	18,367,903.90	3.94%
5	华联超市	1,462,693	18,283,662.50	3.92%
6	海欣股份	1,067,154	14,054,418.18	3.01%
7	振华港机	1,245,364	13,163,497.48	2.82%
8	中化国际	1,474,039	13,030,504.76	2.79%
9	厦门建发	1,150,000	11,569,000.00	2.48%
10	珠海中富	1,495,320	11,528,917.20	2.47%
11	黑牡丹	617,941	11,462,805.55	2.46%
12	招商局A	1,225,800	10,995,426.00	2.36%
13	丽珠集团	1,000,002	8,750,017.50	1.88%
14	天士力	458,005	8,216,609.70	1.76%
15	江苏舜天	705,711	7,565,221.92	1.62%
16	新希望	953,867	7,526,010.63	1.61%
17	恒瑞医药	638,432	6,569,465.28	1.41%
18	云天化	720,872	6,329,256.16	1.36%
19	鲁泰A	732,296	6,078,056.80	1.30%
20	模塑科技	525,630	6,002,694.60	1.29%
21	福田汽车	613,579	5,730,827.86	1.23%
22	华菱管线	1,034,450	4,934,326.50	1.06%
23	深桑达A	395,872	4,912,771.52	1.05%
24	湘电股份	465,511	4,650,454.89	1.00%
25	神火股份	400,000	4,308,000.00	0.92%
26	吉林森工	500,000	3,840,000.00	0.82%
27	益民百货	368,495	3,640,730.60	0.78%

28	天地科技	212,300	3,541,164.00	0.76%
29	招商银行	354,200	2,886,730.00	0.62%
30	中国联通	1,048,073	2,840,277.83	0.61%
31	兆维科技	242,926	2,210,626.60	0.47%
32	三佳模具	98,036	1,659,749.48	0.36%
33	法拉电子	126,000	1,648,080.00	0.35%
34	三爱富	120,000	1,291,200.00	0.28%
35	中信证券	165,000	742,500.00	0.16%
36	伊利股份	41,250	730,125.00	0.16%
37	北京巴士	53,550	660,271.50	0.14%
38	光明乳业	53,000	600,490.00	0.13%
39	云铝股份	60,000	484,800.00	0.10%
40	中远航运	47,000	423,940.00	0.09%
41	中天科技	34,000	354,620.00	0.08%
42	上海航空	52,000	339,040.00	0.07%
43	卧龙科技	22,000	284,900.00	0.06%
44	时代新材	18,000	247,860.00	0.05%
45	皖通高速	97,000	213,400.00	0.05%
46	腾达建设	22,000	210,540.00	0.05%
47	龙溪股份	20,000	194,000.00	0.04%
48	新华医疗	9,000	151,020.00	0.03%
49	华阳科技	12,000	142,560.00	0.03%
50	菲达环保	10,000	138,900.00	0.03%
51	科达机电	6,000	131,460.00	0.03%
52	裕丰股份	12,000	119,280.00	0.03%
53	信雅达	5,000	116,800.00	0.02%
54	精达股份	5,000	85,200.00	0.02%
55	旭光股份	4,000	51,440.00	0.01%
56	海油工程	3,000	42,060.00	0.01%
	合计		292,453,552.39	62.70%

5、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 342,116.64 元，与债券市值（不包括国债）49,935,000.00 元、股票市值 292,453,552.39 元、国债及货币资金 123,677,099.40 元合计后等于基金资产净值。其他应收应付款项包括：应收利息、深交所交易保证金、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、预提费用以及其他应付款等。

(六) 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场申 购	二级市场买入	其他	
1	招商局A		1,942,315		716,515
2	深桑达A		189,041	275,654	68,823
3	珠海中富		1,554,320		59,000
4	模塑科技		516,300	149,201	139,871
5	云铝股份			358,995	298,995
6	新希望		793,064	160,803	
7	华菱管线			1,234,450	200,000
8	皖通高速	97,000			
9	中信证券	165,000			
10	招商银行	354,200			
11	中国联通	1,329,073			281,000
12	云天化		1,064,406		343,534
13	厦门建发		1,380,418		230,418
14	福田汽车		813,579		200,000
15	吉林森工		694,900		194,900
16	江苏舜天		925,824	200,063	420,176
17	华泰股份		1,348,315	249,663	134,400
18	振华港机		1,713,224		467,860
19	旭光股份	9,000			5,000
20	北京巴士		53,550		
21	湘电股份	21,000	551,511		107,000
22	中远航运	47,000			
23	时代新材	18,000			
24	科达机电	6,000			
25	黑牡丹	13,000	746,630		141,689
26	腾达建设	22,000			
27	中天科技	34,000			
28	菲达环保	10,000			
29	华阳科技	18,000			6,000
30	天士力	19,000	439,005		
31	裕丰股份	12,000			
32	法拉电子	26,000	100,000		
33	信雅达	5,000			
34	精达股份	5,000			
35	卧龙科技	22,000			
36	天地科技	19,000	378,003		184,703
37	海油工程	3,000			
38	新华医疗	9,000			
39	上海航空	76,000			24,000
40	龙溪股份	20,000			
41	光明乳业	53,000			
42	三爱富		100,000	20,000	

43	兆维科技	1,224,627	981,701
44	益民百货	568,495	200,000
45	华联超市	1,547,693	85,000
46	伊利股份		41,250

新增股票附注：本表“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	深能源 ^A	-	100,000	100,000
2	东阿阿胶	531,722	300,000	831,722
3	湘计算机	-	344,788	344,788
4	武汉中百	355,000	652,180	1,007,180
5	北新建材	-	917,014	917,014
6	银河科技	-	186,516	186,516
7	辽河油田	-	240,000	240,000
8	中信国安	-	247,011	247,011
9	双汇发展	768,870	803,246	1,572,116
10	华能国际	25,324	-	25,324
11	中海发展	-	148,000	148,000
12	烟台万华	36,537	1,600	38,137
13	营口港	-	13,000	13,000
14	大厦股份	-	13,000	13,000
15	山东基建	-	59,000	59,000
16	亚宝药业	-	20,000	20,000
17	精伦电子	-	12,000	12,000
18	承德钒钛	-	39,000	39,000
19	华联综超	39,000	-	39,000
20	华冠科技	-	15,000	15,000
21	宝光股份	28,000	-	28,000
22	安源股份	-	17,000.00	17,000
23	华鲁恒升	-	14,000	14,000
24	扬农化工	-	9,000	9,000
25	长江股份	-	23,000	23,000
26	宏智科技	-	12,000.00	12,000
27	西昌电力	-	34,000	34,000
28	香梨股份	77,000	-	77,000
29	天富热电	-	1,000	1,000
30	国药股份	-	27,000	27,000
31	第一投资	-	11,000	11,000
32	海龙科技	-	23,000	23,000
33	长园新材	-	15,000	15,000
34	山东药玻	-	14,000	14,000
35	豫光金铅	-	20,000	20,000
36	栖霞建设	-	1,000	1,000

37	中软股份	-	4,000	4,000
38	深 高 速	838,689	-	838,689
39	厦门钨业	-	12,000	12,000
40	科大创新	-	10,000	10,000
41	方兴科技	-	20,000	20,000
42	太行股份	-	26,000	26,000
43	茉 织 华	392,160	-	392,160
44	康缘药业	-	19,000	19,000
45	金自天正	-	17,000	17,000
46	江西长运	-	12,000	12,000
47	迪马股份	-	8,000	8,000
48	山鹰纸业	56,000	-	56,000
49	黄海股份	-	23,000	23,000
50	八一钢铁	-	51,000	51,000
51	海螺水泥	-	20,000	20,000
52	金晶科技	-	12,000	12,000
53	泰豪科技	-	13,000	13,000
54	大连圣亚	-	9,000	9,000
55	中孚实业	-	13,000	13,000
56	北 大 荒	-	36,000	36,000
57	申能股份	-	536,000	536,000
58	友谊股份	723,885	333,000	1,056,885

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 3,250,083 份基金单位, 占基金发行总份额的 0.65%, 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	1,250,000	0.25%
其中: 未上市流通份额	1,250,000	0.25%
华安基金管理有限公司	2,000,083	0.40%
其中: 未上市流通份额	1,250,000	0.25%

社会公众持有的基金份额为 496,749,917 份基金单位, 占基金发行总份额的 99.35%。

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	中国人保	44,188,188	8.84%
2	中国人寿	30,739,025	6.15%
3	平安保险	11,293,575	2.26%
4	再保险	6,769,293	1.35%
5	光大证券	6,190,000	1.24%
6	苗昌英	5,486,258	1.10%
7	中海信托	4,995,000	1.00%

8	永安保险	4,442,751	0.89%
9	杨玉国	4,208,965	0.84%
10	天安保险	4,000,000	0.80%

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 2002 年 12 月 31 日基金安瑞前 100 名持有人名册汇总统计而来。

七. 重要事项揭示

- 1、基金管理人、托管人在本期内未发生任何重大诉讼事项；
- 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、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 1-12 月各券商股票、债券和回购交易及佣金情况情况如下：

(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	118,789,635.04	20.35%	90,821.06	21.39%
招商证券股份有限公司	108,304,712.72	18.56%	84,750.44	19.96%
长城证券有限责任公司	94,983,843.36	16.27%	66,641.53	15.69%
国泰君安证券股份有限公司	92,116,323.19	15.78%	72,083.32	16.97%
兴业证券股份有限公司	89,693,124.05	15.37%	61,217.66	14.41%
中国民族证券有限责任公司	79,783,195.06	13.67%	49,173.61	11.58%
合 计	<u>583,670,833.42</u>	<u>100.00%</u>	<u>424,687.62</u>	<u>100.00%</u>

(2) 债券及回购交易情况：

券 商	债券成交量	占成交总量 比例	回购成交量	占成交总量 比例
中国民族证券有限责任公司	1,220,922,878.60	41.75%	399,700,000.00	26.01%
长城证券有限责任公司	793,187,492.40	27.13%	325,000,000.00	21.15%
兴业证券股份有限公司	656,261,083.20	22.44%	580,000,000.00	37.74%
上海证券有限责任公司	245,620,828.80	8.40%	232,100,000.00	15.10%
国泰君安证券股份有限公司	8,157,793.20	0.28%	-	-
合 计	<u>2,924,150,076.20</u>	<u>100.00%</u>	<u>1,536,800,000.00</u>	<u>100.00%</u>

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、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原件。

华安基金管理有限公司
二零零三年三月二十九日