

安瑞证券投资基金

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

本基金的托管人中国工商银行已于 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：010-66106878

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 1-6 月
基金本期净收益	20,225,662.10元
单位基金本期净收益	0.0405元
基金可分配净收益	23,186,517.49元
单位基金可分配净收益	0.0464元
期末基金资产总值	536,690,522.27元
期末基金资产净值	535,108,822.65元
期末单位基金资产净值	1.0702元
基金资产净值收益率	3.95%
本期基金资产净值增长率	4.29%
累计资产净值增长率	26.01%

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 / 调整后期初基金资产净值
2. 本期基金资产净值增长率 = (分红前单位净值 / 期初单位净值) * (期末单位净值 / 分红后单位净值) - 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高级研究员、基金安信和基金安久的基金经理等职。现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。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

上半年回顾

在经历了 2001 年下半年的暴跌之后，2002 年上半年的市场总体走势呈先抑后扬，并依靠最后一周的飚升行情使得股指的半年线勉强收阳，也使得所有的投资者再次领略了政策的强大威力。2002 年上半年管理层相继出台了包括降低利率、证券交易佣金浮动、新股发行按市值配售、停止通过国内证券市场减持国有股等一系列重大政策，从而增强了投资者的信心。

基于我们基金经理小组对市场面的判断，基金安瑞上半年主要做了以下三方面的工作：

首先，由于基金安瑞在 4 月份进行分红，分红后股票仓位自然提高，因此在总体上采取的是轻仓操作的策略，尽管仓位水平相比 2001 年底有了很大的提高，但仍维持在 40%左右的低水平，这一操作策略基本上还比较成功，但在最后一个交易周由于行情的突变使得基金净值增长率排名迅速下降，这也暴露了我们在对政策的理解和把握方面仍然有所欠缺，值得吸取经验教训并争取下半年有所提高；

其次，在控制仓位的同时我们对部分重点品种进行了波段操作，取得了较好的效果，在一定程度上弥补了仓位低的不利因素；

第三，国债方面虽然我们也较好地把握了前五个月的上涨行情，但在高位没有及时减仓，因此半年的收益率低于市场平均水平，同样也留有遗憾。

下半年展望

正如我们在 2001 年的年报中所提及的，在加入 WTO 的大背景下，2002 年的中国证券市场主基调是规范与发展，强调在发展的基础上进行规范，从这点考虑，我们没有理由对下半年的行情持悲观态度。另一方面，市场盈利方式也在发生改变，在尚未找到新的盈利模式之前，获利难度将比以前更大，以往受到市场冷落的大盘股正逐步成为资金关注的重点，这对于以小市值个股为主要投资对象的基金安瑞而

言无疑又增大了投资的难度。

就下半年操作而言，基金安瑞经理小组将重点做好以下两方面的工作：第一，在坚持精选个股的基础上加强对大盘趋势的分析力度，从今年的市场情况来看，对仓位控制在某种程度上可能更胜于对个股的把握，以往只重个股轻大盘的思路需要修正；第二，加大波段操作力度，积小胜为大胜，尤其是要有逆向操作的思维，在市场悲观的时候加大建仓力度，而在市场过于狂热的时候应保持一份清醒。

基金安瑞下半年所面临的形势较为严峻，但市场的机会一直存在，关键在于如何把握，因此有一个良好的心态将至关重要。基金安瑞经理小组将在加大对政策研究的基础上，把握机会争取扭转上半年的落后态势，以良好的业绩回报基金持有人的信任。

（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”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”。在上半年里，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、对基金安瑞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：基金安瑞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，基金安瑞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瑞存在重大违规情况。

四．基金年度中期财务报告

(一) 基金会计报告书 (未经审计)

安瑞证券投资基金

资产负债表

2002 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注	2002年6月30日	2001年12月31日
资产：			
银行存款		4,054,629.38	98,777,819.03
清算备付金	3(1)	61,275,837.95	2,098,952.44
交易保证金	3(2)	750,000.00	250,000.00
应收证券清算款		-	-
应收股利		-	-
应收利息	3(3)	2,458,365.45	301,168.80
其他应收款		-	-
股票投资市值	1(4)	265,945,815.37	143,506,751.71
其中：股票投资成本	1(6)	253,736,267.72	135,213,281.56
债券投资市值	1(4)	202,122,695.70	311,331,000.00
其中：债券投资成本	1(6)	202,409,938.19	310,000,000.00
配股权证	1(4)	-	17,040.00
买入返售证券		-	-
待摊费用	3(4)	83,178.42	-
其他资产		-	-
资产总计		536,690,522.27	556,282,731.98
负债：			
应付证券清算款	3(5)	303,555.74	4,159,760.61
应付管理人报酬		643,015.70	4,408,095.77
应付托管费		107,571.94	115,765.30
应付佣金		140,957.74	86,176.96
应付利息		-	-
其他应付款	3(6)	263,200.00	489,650.00

卖出回购证券款		-	-
预提费用	3(7)	123,398.50	-
负债合计		1,581,699.62	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		11,922,305.16	9,641,510.15
未分配收益		23,186,517.49	37,381,773.19
持有人权益合计		535,108,822.65	547,023,283.34
负债及持有人权益总计		536,690,522.27	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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002年1-6月	2001年1-6月
一、收入		26,180,636.51	31,419,503.80
1、股票差价收入	1(5)	14,364,278.17	29,748,104.58
2、债券差价收入	1(5)	5,089,249.34	-
3、债券利息收入	1(5)	4,209,710.18	-
4、存款利息收入	1(5)	1,104,856.91	1,391,379.42
5、股利收入	1(5)	935,515.33	280,019.80
6、买入返售证券收入	1(5)	63,000.00	-
7、其他收入	3(8)	414,026.58	-
二、费用		5,954,974.41	2,043,917.94
1、基金管理人报酬	2(4)	4,008,543.09	1,751,843.91
2、基金托管费	2(4)	669,907.22	291,974.03
3、卖出回购证券支出		926,500.00	-
4、利息支出		-	-
5、其他费用	3(9)	350,024.10	100.00
其中：上市年费		29,753.31	-
信息披露费		168,603.31	-
审计费用		74,795.19	-
三、基金净收益		20,225,662.10	29,375,585.86
加：未实现利得	3(10)	2,859,877.21	4,822,459.53
四、基金经营业绩		23,085,539.31	34,198,045.39

安瑞证券投资基金 收益分配表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002年1-6月	2001年1-6月
-----	----	-----------	-----------

本期基金净收益		20,225,662.10	29,375,585.86
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(10)	579,082.20	-
可供分配基金净收益		58,186,517.49	32,965,819.97
减：本期已分配基金净收益	1(8)	35,000,000.00	-
期末基金净收益		23,186,517.49	32,965,819.97

安瑞证券投资基金

净值变动表

2002 年 1 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002年1-6月
一、期初基金净值		547,023,283.34
二、本期经营活动：		
基金净收益		20,225,662.10
未实现利得	3(10)	2,859,877.21
经营活动产生的基金净值变动数		23,085,539.31
三、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
四、期末基金净值		535,108,822.65

(二) 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 6 月 30 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：

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。

未上市的证券应区分以下情况处理：

- 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；
- 首次公开发行的股票，按成本估值；
- 已发行未上市的债券，按成本估值。

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，则不估值。

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。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

(5) 收入的确认政策：

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。

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。

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。

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算的金额确认利息收入。

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。

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。

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‰。

(8) 基金的收益分配政策：

基金收益分配比例不低于可供分配基金净收益的90%。

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。

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。

基金投资当年亏损，则不进行收益分配。

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 上海证券有限责任公司	基金托管人 与基金管理公 司属同一股东*	提取托管费 租用交易席位	基金契约 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：

本基金通过关联人席位 2002 年 1-6 月的股票交易情况：

关联人	1-6 月股票成交量	占成交总量 比例	1-6 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	60,459,696.02	17.93%	45,362.18	18.82%	0.075%

本基金通过关联人席位 2002 年 1-6 月的债券及回购交易情况：

关联人	1-6 月债券成交量	占成交总量 比例	1-6 月回购成交量	占成交总量 比例
上海证券有限责任公司	115,706,160.90	5.78%	150,000,000.00	15.79%

(3) 本基金与关联人 2002 年 1-6 月未进行银行间市场债券买卖交易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：

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 1 月 1 日至 6 月 30 日，管理人收取的基金管理费金额为 4,008,543.09 元。

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：

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

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 1 月 1 日至 6 月 30 日，托管人收取的基金托管费金额为 669,907.22 元。

3、主要报表项目说明

(1) 清算备付金：

明细项目	期末数	期初数
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	40,116,722.24	652,407.31
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司最低备付金	3,300,000.00	520,000.00
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	17,859,115.71	926,545.13
合 计	<u>61,275,837.95</u>	<u>2,098,952.44</u>

(2) 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

(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	25,520.22	71,031.76
债券利息	2,432,845.23	230,137.04
合 计	<u>2,458,365.45</u>	<u>301,168.80</u>

(4) 待摊费用：已经发生的、影响基金单位净值小数点后第五位，应分摊记入本期和以后各期的费用，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
上市年费	30,246.69	-
分红手续费	59,931.73	-
合 计	<u>83,178.42</u>	

(5) 应付证券清算款：

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	303,555.74	861,474.61
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	-	3,298,286.00
合 计	<u>303,555.74</u>	<u>4,159,760.61</u>

(6) 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	13,200.00	239,650.00
合 计	<u>263,200.00</u>	<u>489,650.00</u>

(7) 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	48,603.31	-
审计费	74,795.19	-
合计	<u>123,398.50</u>	

(8) 其他收入：

明细项目	本期数	上期数
新股手续费返还	57,905.55	-
配股手续费返还	1,278.00	-
债券手续费返还	352,000.00	-
印花税返还	2,843.03	-
合计	<u>414,026.58</u>	

(9) 其他费用：

明细项目	本期数	上期数
交易所费用	22,625.00	-
上市年费	29,753.31	-
审计费	74,795.19	-
信息披露费	168,603.31	-
红利发放手续费	52,068.27	-
其他费用	<u>2,179.02</u>	100.00
合计	<u>350,024.10</u>	<u>100.00</u>

(10) 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	-

(三) 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6月30日估值时，已上市但流通受限的新股估值增值额为1,466,388.00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	招商银行	02-4-01	02-4-9	354,200	2,585,660.00	4,052,048.00	上市日起 4 个月
2	安源股份	02-6-20	02-7-2	17,000	101,830.00	101,830.00	上市日起流通
3	泰豪科技	02-6-24	02-7-3	13,000	61,880.00	61,880.00	上市日起流通
4	宏智科技	02-6-27	02-7-9	12,000	104,160.00	104,160.00	上市日起流通
	合 计				<u>2,853,530.00</u>	<u>4,319,918.00</u>	

2、流通受限的债券

序号	债券名称	承购日期	流通日期	数量	成本	市值	流通受限期
1	02 电网债	02-06-25	02-07-17	50,000	5,000,000.00	5,000,000.00	02-07-17 起流通

(四) 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	7,171,368.00	1.34%
B	采掘业	10,808,129.50	2.02%
C	制造业	176,765,362.22	33.03%
C0	其中：食品、饮料	27,038,171.60	5.05%
C1	纺织、服装、皮毛	27,910,099.20	5.21%
C2	木材、家具	---	---
C3	造纸、印刷	19,898,141.10	3.72%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	47,244,868.70	8.83%
C5	电子	---	---
C6	金属、非金属	10,542,135.20	1.97%
C7	机械、设备、仪表	32,787,230.00	6.13%
C8	医药、生物制品	11,344,716.42	2.12%
C99	其他	---	---
D	电力、煤气及水的生产和供应业	364,159.12	0.07%
E	建筑业	---	---
F	交通运输、仓储业	9,242,348.50	1.73%
G	信息技术业	1,232,227.20	0.23%
H	批发和零售贸易	56,310,172.83	10.52%
I	金融、保险业	4,052,048.00	0.76%
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	<u>265,945,815.37</u>	<u>49.70%</u>

2、债券（不包括国债）合计

截止 2002 年 6 月 30 日，基金持有的债券（不含应收利息）合计为 15,318,000.00 元，占基金资产净值的 2.86%。

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 251,831,607.29 元，占基金资产净值的 47.06%。

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	1,150,617	28,443,252.24	5.32%
2	张 裕 A	1,341,812	25,896,971.60	4.84%
3	振华港机	1,550,000	20,739,000.00	3.88%
4	华泰股份	1,248,315	19,898,141.10	3.72%
5	盐湖钾肥	1,194,037	18,603,096.46	3.48%
6	海欣股份	889,295	16,727,638.95	3.13%
7	江苏舜天	1,016,938	15,111,698.68	2.82%
8	厦门建发	1,000,327	13,094,280.43	2.45%
9	华联超市	900,340	12,910,875.60	2.41%
10	中化国际	742,693	11,244,372.02	2.10%
11	神火股份	780,050	10,756,889.50	2.01%
12	恒瑞医药	720,000	9,424,800.00	1.76%
13	招商局 A	600,000	7,836,000.00	1.46%
14	华菱管线	1,234,450	7,480,767.00	1.40%
15	吉林森工	694,900	7,171,368.00	1.34%
16	鲁 泰 A	440,973	6,372,059.85	1.19%
17	三佳模具	225,000	5,811,750.00	1.09%
18	天地科技	219,000	5,661,150.00	1.06%
19	茉 织 华	264,160	4,540,910.40	0.85%
20	招商银行	354,200	4,052,048.00	0.76%
21	云铝股份	258,995	2,683,188.20	0.50%
22	友谊股份	111,285	1,889,619.30	0.35%
23	武汉中百	218,480	1,837,416.80	0.34%
24	双汇发展	90,000	1,141,200.00	0.21%
25	兆维科技	90,390	1,128,067.20	0.21%
26	丽珠集团	100,082	1,071,878.22	0.20%

27	东阿阿胶	72,420	848,038.20	0.16%
28	北京巴士	53,550	796,288.50	0.15%
29	中远航运	47,000	610,060.00	0.11%
30	卧龙科技	22,000	411,620.00	0.08%
31	华能国际	25,324	364,159.12	0.07%
32	黑牡丹	13,000	269,490.00	0.05%
33	大厦股份	13,000	221,910.00	0.04%
34	中孚实业	13,000	213,980.00	0.04%
35	华鲁恒升	14,000	198,520.00	0.04%
36	海螺水泥	20,000	164,200.00	0.03%
37	宏智科技	12,000	104,160.00	0.02%
38	安源股份	17,000	101,830.00	0.02%
39	泰豪科技	13,000	61,880.00	0.01%
40	海油工程	3,000	51,240.00	0.01%
	合计		265,945,815.37	49.70%

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 6 月 30 日 本基金其他应收应付款项为借方余额 2,013,399.99 元，与债券市值 15,318,000.00 元、股票市值 265,945,815.37 元、国债及货币资金 251,831,607.29 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、待摊费用、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。

(五) 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场申购	二级市场买入	其他	
1	招商局 A	-	1,230,715	-	630,715
2	云铝股份	-	-	358,995	100,000
3	华菱管线	-	-	1,234,450	-
4	招商银行	354,200	-	-	-
5	厦门建发	-	1,000,327	-	-
6	吉林森工	-	694,900	-	-
7	江苏舜天	-	816,875	200,063	-
8	华泰股份	-	1,248,315	-	-
9	振华港机	-	1,550,000	-	-
10	大厦股份	13,000	-	-	-
11	北京巴士	-	53,550	-	-

12	安源股份	17,000	-	-	-
13	华鲁恒升	14,000	-	-	-
14	中远航运	47,000	-	-	-
15	宏智科技	12,000	-	-	-
16	黑牡丹	13,000	-	-	-
17	卧龙科技	22,000	-	-	-
18	天地科技	19,000	200,000	-	-
19	海油工程	3,000	-	-	-
20	海螺水泥	20,000	-	-	-
21	泰豪科技	13,000	-	-	-
22	中孚实业	13,000	-	-	-
23	兆维科技	-	390,390	-	300,000
24	华联超市	-	900,340	-	-

新增股票附注：本表“其他”项目包括“配转送增”。

(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	深能源 A	-	100,000	100,000
2	湘计算机	-	344,788	344,788
3	北新建材	-	917,014	917,014
4	银河科技	-	186,516	186,516
5	中信国安	-	247,011	247,011
6	中海发展	-	148,000	148,000
7	云天化	-	343,534	343,534
8	烟台万华	36,537	1,600	38,137
9	营口港	-	13,000	13,000
10	山东基建	-	59,000	59,000
11	精伦电子	-	12,000	12,000
12	北京华联	39,000	-	39,000
13	宝光股份	28,000	-	28,000
14	扬农化工	-	9,000	9,000
15	长江股份	-	23,000	23,000
16	西昌电力	-	34,000	34,000
17	香梨股份	77,000	-	77,000
18	天富热电	-	1,000	1,000
19	山东药玻	-	14,000	14,000
20	栖霞建设	-	1,000	1,000
21	中软股份	-	4,000	4,000
22	深高速	838,689	-	838,689
23	山鹰纸业	56,000	-	56,000
24	北大荒	-	36,000	36,000
25	申能股份	-	536,000	536,000

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	14,921,338	2.98%
3	平安保险	11,293,575	2.26%
4	再保险	6,769,293	1.35%
5	中国太保	6,290,651	1.26%
6	中煤信托	6,224,162	1.24%
7	海通证券	5,987,660	1.20%
8	永安保险	4,442,751	0.89%
9	黄乐英	3,990,000	0.80%
10	杨玉国	3,436,991	0.69%

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 6 月 30 日基金安瑞前 100 名持有人名册汇总统计而来。

六．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、本基金中期不分配，纳入年末一次性分配；

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1-6月各券商股票、债券及回购交易情况和佣金情况如下：

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
长城证券有限责任公司	63,841,375.99	18.94%	43,114.71	17.89%
招商证券股份有限公司	62,065,599.79	18.41%	48,567.53	20.15%
上海证券有限责任公司	60,459,696.02	17.93%	45,362.18	18.82%
兴业证券股份有限公司	52,869,309.33	15.68%	37,906.84	15.72%
国泰君安证券股份有限公司	52,558,132.59	15.59%	41,128.12	17.06%
中国民族国际信托投资公司	45,328,541.66	13.45%	24,985.03	10.36%
合 计	<u>337,122,655.38</u>	<u>100.00%</u>	<u>241,064.41</u>	<u>100.00%</u>

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
中国民族国际信托投资公司	928,298,936.80	46.34%	290,000,000.00	30.53%
长城证券有限责任公司	676,552,918.10	33.77%	240,000,000.00	25.26%
兴业证券股份有限公司	282,783,487.80	14.11%	270,000,000.00	28.42%
上海证券有限责任公司	115,706,160.90	5.78%	150,000,000.00	15.79%
合 计	<u>2,003,341,503.60</u>	<u>100.00%</u>	<u>950,000,000.00</u>	<u>100.00%</u>

七．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
二零零二年八月二十九日