

安信证券投资基金

一九九八年年度报告

华安基金管理有限公司

一九九九年三月二十九日

一. 基金简介

(一)基金名称:	安信证券投资基金 (简称: 基金安信)
交易代码:	500003
基金发起人:	上海国际信托投资公司 山东证券有限责任公司 华安基金管理有限公司
基金发行日期:	1998 年 6 月 16 日
基金成立日期:	1998 年 6 月 22 日
基金单位总份额:	20 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:	1998 年 6 月 26 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 (200120)
法定代表人:	徐建军
总经理:	韩方河

信息披露负责人： 孙昌海
电话： 021-58881111
传真： 021-58406138

(三) 基金托管人： 中国工商银行
注册地址： 北京市海淀区翠微路 15 号
办公地址： 北京市西城区复兴门内大街 55 号
(100031)
法定代表人： 刘廷焕
托管部负责人： 赵跃
信息披露负责人： 刘瑞霞
电话： 010-66106912
传真： 010-66106913

(四) 会计师事务所： 大华会计师事务所
注册及办公地址： 上海市昆山路 146 号
法定代表人： 石人瑾
经办注册会计师： 吕秋萍、朱鸣里

(五) 律师事务所： 方达律师事务所
注册及办公地址： 上海市浦东大道 138 号永华大厦 15 楼 E、F 座

法定代表人：黄伟民

经办律师：黄伟民、罗绍林

二. 基金管理人报告

在本报告期内，华安基金管理有限公司作为安信基金管理人，严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《安信证券投资基金契约》和其他有关法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无任何损害基金持有人利益的行为。

1998 年是我国国民经济发展遇到较大困难的一年。受亚洲金融危机影响，出口形势严峻，国内市场需求不振，加之我国长江流域遇到特大洪水灾害，对国民经济产生不利的影响。与之相对应，1998 年证券市场总体处于调整状态，沪深两市综合指数全年分别下跌 6.04%、11.76%。

安信基金 6 月 22 日正式成立时，恰逢股指处于全年最高区位，到年底两市同期分别下跌 18.05%、19.65%，本基金管理人面对市场不利局面，在具体操作中，采取了较为积极主动的对策：1. 通过合理控制持仓量，达到基金收益与风险的平衡；2. 根据产业发展前景确定重点投资行业，如：电子信息、通讯、医药、环保等；3. 根据行情衍变

特点，在注重长期投资的同时，充分利用行情的波动性，尝试长期投资品种短期化操作。经过半年多的运作，本基金资产取得了良好的增值。到 12 月 31 日为止，单位资产净值达到 1.1072 元。

1999 年我国的宏观经济形势将依然严峻，有效启动消费需要一段时间，而出口对经济的推动作用将维持在 98 年的水平上，拉动经济增长的主力军可能还是投资。如果东南亚地区 1999 年的经济有所恢复，由原来的负增长回升到零增长或以上水平，将有助于我国改善外部经济环境。

1999 年我国证券市场将继续承接 98 年的调整态势。但 99 年证券市场的主基调是发展，在发展中谋求规范。因此这种调整应该是上升途中的调整。99 年将是具有重要历史意义的一年，相信每一次重大事件都会给投资者带来机会。

1999 年国家投资的重点主要集中于农村电网改造、国家粮库建设、城市基础设施、公路建设和环保等六个方面，同时国家将加大对高新技术企业的投入及政策倾斜，因此，我们认为，电子信息、通信、环保、网络技术、基础设施等行业将会有较好的表现。

三、托管人报告

本托管人----中国工商银行，依据 1998 年 6 月 15 日签

署的《安信证券投资基金基金契约》与《安信证券投资基金托管协议》，自 1998 年 6 月 22 日起，托管安信证券投资基金的全部资产。从 1998 年 6 月 22 日至 1998 年 12 月 31 日的 1998 年度，在对安信证券投资基金的托管过程中，托管人严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、基金契约和其他有关法规的规定，没有发生任何损害基金持有人利益的行为，切实履行了托管人应尽的各项义务。

1998 年度，托管人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对安信证券投资基金的管理人----华安基金管理有限公司的基金运作，进行了全面的会计核算和必要的交易监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值及每份基金单位资产净值的计算等问题上有违反《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规规定的行为及任何损害基金持有人利益的行为。

本托管人依法对基金管理人在 1998 年度所编制和披露的安信证券投资基金招募说明书、基金上市公告书、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，认为基金管理人在 1998 年度内所编制的与托管人有关的各项基金披露信息是合法、真实和完整的。

四. 基金年度财务报告

(一) 审计报告

审 计 报 告

华业字(99)第 266 号

安信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 1998 年 12 月 31 日的资产负债表及 1998 年度收益及收益分配表。这些会计报表由华安基金管理有限公司负责，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，上述会计报表符合基金及其财务会计的相关制度、法规及公允会计原则；在所有重大方面公允地反映了贵基金 1998 年 12 月 31 日的财务状况以及 1998 年度经营成果；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·上海·昆山路 146 号 中国注册会计师：朱鸣里

1999 年 3 月 12 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	期初数	期末数
股票投资—成本：	—	1,374,642,017.99
股票投资—估值增值：	—	130,376,071.39
银行存款：	—	731,483,987.56
应收股利：	—	55,987.04
应收利息：	—	345,364.57
应收帐款：	—	320,518.52
其他应收款项：	—	243,076.92
<u>基金资产总额：</u>	—	<u>2,237,467,023.99</u>
应付基金管理费：	—	4,417,767.79
应付基金托管费：	—	441,776.81
应付帐款：	—	16,643,132.74
应付佣金：	—	1,363,410.60
其他应付款项：	—	177,744.00
<u>负债总额：</u>	—	<u>23,043,831.94</u>
基金单位总额：	—	2,000,000,000.00

未分配净收益：	—	84,047,120.66
未实现估值增值：	—	130,376,071.39
基金资产净值：	—	2,214,423,192.05
基金单位发行总份额：	—	2,000,000,000
每份基金单位资产净值：	—	1.1072

收益及分配报告书

收益及分配主要项目本期数、上期数如下：

项 目	本期数	上期数
在除息日确认的股息收入：	679,531.14	—
股票买卖价差收入：	47,011,214.16	—
债券买卖价差收入：	9,710,628.00	—
其他收入：	56,435,485.59	—
基金管理费：	26,843,990.19	—
基金托管费：	2,684,399.04	—
应由基金承担的其他费用：	261,349.00	—
基金净收益：	84,047,120.66	—
期末未分配净收益：	84,047,120.66	—

（三）会计报告书附注

报表帐项注释应列出以下事项：

1、主要会计政策

(1) 会计期间：公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。

(2) 记帐原则：权责发生制。

(3) 记帐本位币：人民币。

(4) 基金资产的估值方法：

①上市证券（包括上市未满两个月的配售新股）以计算日市场平均价为准；该日无交易的，以最近一日平均价计算。

②未上市的股票以发行价计算。

③未上市国债及银行存款以本金加计至估值日为止的应计利息额计算。

④如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定基金资产价值时，基金管理人依据主管机关的有关规定办理。

(5) 收入的确认政策

股息收入：在被投资股票股权除息日确认。

债券利息收入：按当期应计利息数确认。

其他收入：在实际收到时确认。

(6) 证券交易的成本计价方法

证券交易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

根据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》，对基金税收有如下规定：

- ①以发行基金方式募集资金不征收营业税。
- ②对基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税。
- ③对基金买卖股票按照 4‰的税率征收印花税。
- ④对基金从证券市场中取得的收入，暂免征所得税。
- ⑤基金向投资者分配的基金收益，暂免征所得税。

(8) 基金的收益分配政策：

- ①基金收益分配比例不低于基金净收益的 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
上海国际信托投资公司	管理公司发起人 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
山东证券有限责任公司	管理公司发起人 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
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

(2) 通过关联人席位交易情况：

关 联 人	年成交量	占年成交量比例	年佣金	占年佣金量比例	平均佣金比率
上海国际信托投资公司	1,495,291,862.98	93.35%	1,274,327.04	93.47%	0.85‰
申银万国证券股份有限公司	19,089,245.18	1.19%	16,225.38	1.19%	0.85‰
山东证券有限责任公司	32,456,342.16	2.03%	27,714.48	2.03%	0.85‰

(3) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额

①基金管理人的报酬

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 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 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

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。

98 年管理人收取的基金管理费金额为 26,843,990.19 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。

98 年托管人收取的基金托管费金额为 2,684,399.04 元。

3、主要报表项目说明

（1）本基金发行费使用情况如下

项 目	金 额
发行费收入	20,000,000.00
上网发行费	4,908,200.00
发行协调人费	1,000,000.00
上市推荐人费	700,000.00
律师费	50,000.00
会计师费	50,000.00
<u>上市初费</u>	<u>30,000.00</u>
基金发行费结余	13,261,800.00

发行时申购资金冻结利息额：24,237,556.45 元。

（2）应收帐款 1998 年 12 月 31 日余额为人民币 320,518.52 元，是应收股票清算款。由以下两项组成：上海应收交易资金，95,466.03 元；深圳应收交易资金，225,052.49 元。

（3）其他应收款项 1998 年 12 月 31 日余额为人民币 243,076.92 元，是深圳证券交易所调整交易保证金款项。

（4）应付帐款 1998 年 12 月 31 日余额为人民币

16,643,132.74 元，是应付交易资金和应付配股款。由以下三项组成：上海应付交易资金，7,653,301.41 元；深圳应付交易资金，6,584,324.53 元；应付配股款，2,405,506.80 元。

（四）本基金流通受限、不能自由转让的资产全部为认购的上市未满两个月的配售新股。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。1998 年 12 月 31 日估值时，上市未满两个月的新股估值增值额为 83,062,600.00 元。

序号	股票名称	上市日期	交易日期	数 量	成 本	市 价
1	国风塑业	98.11.19	99.1.19	1,200,000	5,820,000.00	14,292,000.00
2	顺鑫农业	98.11.4	99.1.4	1,400,000	8,260,000.00	18,550,000.00
3	江钻股份	98.11.26	99.1.29	1,000,000	4,750,000.00	10,930,000.00
4	双汇实业	98.12.10	99.3.1	1,000,000	6,240,000.00	11,140,000.00
5	黑化股份	98.11.4	99.1.4	3,000,000	11,730,000.00	17,010,000.00
6	黑龙股份	98.11.11	99.1.11	1,000,000	4,570,000.00	10,650,000.00
7	雅 戈 尔	98.11.19	99.1.19	1,100,000	12,012,000.00	24,629,000.00
8	广州冷机	98.12.24	99.3.1	1,140,000	5,141,400.00	9,747,000.00
9	天山股份	99.1.7	99.3.9	1,000,000	5,290,000.00	5,290,000.00
10	全柴动力	98.12.3	99.2.3	1,200,000	6,816,000.00	11,460,000.00
11	三爱海陵	99.1.15	99.3.15	1,000,000	5,000,000.00	5,000,000.00
12	华资实业	98.12.10	99.3.5	1,400,000	6,020,000.00	13,104,000.00
13	法 尔 胜	99.1.19	99.3.19	1,200,000	7,680,000.00	7,680,000.00
14	兰花股份	98.12.17	99.3.4	2,000,000	8,240,000.00	13,200,000.00
15	湖南高速	99.1.27	99.3.27	1,600,000	16,720,000.00	16,720,000.00
16	中牧股份	99.1.7	99.3.8	1,600,000	10,048,000.00	10,048,000.00
17	长城电工	98.12.24	99.3.5	1,875,000	10,181,250.00	18,131,250.00
18	吉林炭素	99.3.12	99.3.12	2,700,000	16,956,000.00	16,956,000.00
19	春都股份	99.3.19	99.5.20	1,200,000	8,496,000.00	8,496,000.00
20	津滨发展			1,400,000	6,510,000.00	6,510,000.00
21	北京城建	99.2.3	99.4.3	1,500,000	12,645,000.00	12,645,000.00
22	昌九股份	99.1.19	99.3.19	1,200,000	5,376,000.00	5,376,000.00
23	黎明股份	99.1.27	99.3.27	1,880,000	9,888,800.00	9,888,800.00
24	电广实业	99.3.25		1,315,000	12,071,700.00	12,071,700.00
合 计				34,910,000	206,462,150.00	289,524,750.00

（五）基金投资组合

1、按行业分类的投资组合

分 类	股 数	市 值	占净值比例
交通运输	12,143,189	122,490,766.74	5.53%
能源电力	3,211,536	34,076,290.20	1.54%
建材建筑	2,500,000	17,935,000.00	0.81%
冶金	8,465,786	54,912,430.28	2.48%
机械制造	10,545,039	175,841,398.64	7.94%
电子通讯	21,679,166	419,118,859.75	18.93%
化工	9,392,933	69,829,570.60	3.15%
医药	8,907,676	117,884,147.24	5.32%
汽车及配件制造	8,890,503	88,431,887.20	3.99%
纺织服装	5,159,571	49,764,952.34	2.25%
家电	79,852	1,364,670.68	0.06%
酿酒食品	6,911,200	88,858,982.30	4.01%
商贸旅游	8,078,258	77,355,904.29	3.49%
金融地产	302,000	3,195,860.00	0.14%
农林牧渔	5,187,782	51,045,338.12	2.31%
综合	12,920,514	132,912,031.00	6.00%
合 计	124,375,005	1,505,018,089.38	67.95%

2、国债、货币资金合计：731,483,987.56 元

3、基金投资前十名股票明细

序号	名 称	数 量	市 值	占净值比例
----	-----	-----	-----	-------

1	东方电子	8,904,330	198,922,732.20	8.98%
2	大唐电信	4,834,350	110,174,836.50	4.98%
3	环保股份	4,782,055	107,500,596.40	4.85%
4	巴士股份	8,125,879	88,409,563.52	3.99%
5	中青旅	4,544,667	45,628,456.68	2.06%
6	爱使股份	3,616,758	39,929,008.32	1.80%
7	太极集团	2,665,437	36,942,956.82	1.67%
8	江南重工	2,488,812	36,062,885.88	1.63%
9	深科技	1,598,636	35,905,364.56	1.62%
10	航天机电	2,409,418	28,792,545.10	1.30%

4、基金投资组合报告附注

①报告项目的计价方法。

上市证券采用公告内容截止日的当日平均价，非上市债券按面值加计至公告内容截止日应计利息。

②货币资金由银行存款和交易保证金构成，金额分别为 665,174,662.83 和 66,309,324.73。

③本基金不存在购入成本已超过基金资产净值 10%的股票。

（六）主要财务指标

1、基金可分配净收益为 84,047,120.66 元；单位基金净收益为 0.042 元。

- 2、期末基金资产总值为 2,237,467,023.99 元。
- 3、期末基金资产净值为 2,214,423,192.05 元；单位基金资产净值为 1.1072 元。
- 4、基金资产净值年收益率为 7.59%。

五. 基金持有人结构及前十名持有人

本基金发起人持有的基金份额为 0.6 亿基金单位，占基金发行总份额的 3%，其中：

发 起 人	持有份额(单位)	占总份额比例
上海国际信托投资公司	36,000,000	1.80%
华安基金管理有限公司	12,000,000	0.60%
山东证券有限责任公司	12,000,000	0.60%

社会公众持有的基金份额为 19.4 亿基金单位，占基金发行总份额的 97%。

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	上海国际信托投资公司	36,000,000	1.80%
2	赵振旭	17,982,000	0.90%
3	刘 文	13,469,700	0.67%

4	山东证券有限责任公司	12,000,000	0.60%
5	华安基金管理有限公司	12,000,000	0.60%
6	黄惠芳	11,707,900	0.59%
7	董 力	10,890,000	0.54%
8	肖顺利	10,023,900	0.50%
9	宋春玲	10,000,000	0.50%
10	王承敏	9,420,000	0.47%

六. 重要事项揭示

（一）根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》的有关要求，经我公司认真研究，我们向上海国际信托投资公司、申银万国证券股份有限公司、山东证券有限责任公司、国信证券有限公司、国通证券公司、光大证券有限公司这六家券商租用交易席位。我们选择证券经营机构的标准是：

①公司财务状况良好，经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。

②公司有较强的研究能力，能及时、定期、全面提供关于宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

我们从 98 年 12 月 7 日启用多席位交易系统。

各券商年成交量及年佣金情况如下：

券商名称	年成交量	占年成交量比例	年佣金	占年佣金量比例
上海国际信托投资公司	1,495,291,862.98	93.35%	1,274,327.04	93.47%
申银万国证券股份有限公司	19,089,245.18	1.19%	16,225.38	1.19%
山东证券有限责任公司	32,456,342.16	2.03%	27,714.48	2.03%
国通证券公司	23,073,923.64	1.44%	19,486.57	1.43%
光大证券有限公司	31,954,826.31	1.99%	25,656.77	1.88%

说明：

1998 年 12 月 7 日至 12 月 31 日，多席位交易系统开始试运行。在多席位交易系统启用之前，基金安信仅租用上海国际信托投资公司的交易席位。因此，上述各席位交易量分配与券商服务考评结果无直接关系。

（二）根据有关法规规定，基金管理公司董事长或其他高级管理人员不得在其他经营性机构兼任董事长或其他高级管理职务。华安基金管理有限公司将严格遵循上述有关法规规定，执行董事长或其他高级管理人员的任职事宜。

七. 备查文件目录

1. 证监会批准安信证券投资基金设立的文件。
2. 《安信证券投资基金基金契约》。
3. 《安信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. 安信证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注。
6. 安信证券投资基金 1998 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
一九九九年三月二十九日