

安信证券投资基金

二零零零年年度报告

华安基金管理有限公司

二零零一年三月二十六日

重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2001 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
(邮编: 200120)

国际互联网网址: <http://www.huaan.com.cn>

法定代表人: 杜建国
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: 北京市西城区复兴门内大街 55 号
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: 赵 跃
 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、吴蓉

二. 主要财务指标

项目	2000 年度	1999 年度
基金本期净收益	1,156,451,241.41 元	642,376,261.69 元
基金可分配净收益	1,158,874,623.76 元	642,423,382.35 元
单位基金可分配净收益	0.5794 元	0.3212 元
期末基金资产总值	4,559,416,572.04 元	3,206,840,495.63 元
期末基金资产净值	3,931,847,083.78 元	3,127,246,935.40 元
单位基金资产净值	1.9659 元	1.5636 元
基金资产净值收益率	46.50%	30.15%
本期基金可分配收益率	46.59%	30.15%
本期基金净值增长率	58.08%	46.79%
基金累计净值增长率	132.79%	60.56%

扣除当年配售新股对基金净值增长的贡献因素, 2000 年本基金净值增长率为 47.69%。

上述部分指标计算公式:

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

本期基金可分配收益率=(期末未分配净收益-未实现资本利得损失)/调整后期初基金资产净值

本期基金净值增长率=(期末单位基金资产净值-调整后期初单位基金资产净值)/调整后期初单位基金资产净值

三.基金管理人报告

本基金业绩表现

截止到 2000 年 12 月 31 日, 本基金单位资产净值为 1.9659 元, 净值年增长率达 58.08%, 高于同期上证综指 51.73%及深综指 58.07%的涨幅, 扣除当年配售新股对基金资产净值的贡献因素, 本基金的净值年增长率为 47.69%。同期证券市场平均收益率为 44.25%,基金表现好于同期大盘表现。

本基金投资风格

坚持“精选个股、重点投资、长期持有、积极操作”的原则, 在注意控制市场风险和个股风险的前提下, 适当加大对高新技术类成长股的投资, 争取为基金持

有人谋取超过平均水平的投资收益。

基金经理简介

王国卫先生，基金经理，总经理助理，基金投资部总监，硕士学历。7 年证券从业经验，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；

林彤彤先生，基金经理，工商管理硕士（MBA），9 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。

（一） 基金经理工作报告

2000 年宏观经济及证券市场回顾

与其他国家证券市场形成鲜明对比的是，2000 年我国证券市场走出了近几年少见的大牛市，两市指数迭创历史新高。我们仍然维持在 2000 年基金中报中分析的形成牛市的原因，就是持续转好的宏观经济、充足的资金供给和鼓励性的政策。2000 年中国证券市场的变化是明显的。这种变化表现在：政策多、创新多、融资多。在新股发行、促进机构投资者发展及历史遗留问题的解决方面先后出台了一系列政策；以市场化为特征的创新融资手段大大多于往年，全年筹集的资金总额，比 1999 年有显著增加。

由于市场特征的变化，我们在操作策略上也采取了一定的应对措施。

1、由高度集中调整为适度集中，以应对市场的轮动。在组合构造上，将投资重点扩大到前 20 名股票。在重点投资主业突出且具有高成长性的科技股的同时，也兼顾其它行业的投资，并相应的对个股进行了调整，减持成长性明显下降或价格被明显高估的品种，同时补充具有较好成长性及扩张潜力的个股。

2、重视新股的认购。2000 年有关新股发行政策出现了变化，在风险加大的同时也蕴藏着较大的投资机会，在新股发行没有完全市场化之前，投资新股的风险仍然小于二级市场投资，这也是中国证券市场的一大特征。

3、利用银行间债券市场及交易所债券市场进行资金的融通，提高基金总体收益水平。

4、尝试投资可转债。由于可转债的市场规模较小，基金总体投入不大，但有利于积累相关经验。

虽然 2000 年我们在网络股投资上获得了较大的收益，但仍然反映出理念不够成熟。另外对部分基础性行业转好的信息反应不敏感，组合调整的灵活性欠缺。

2001 年宏观经济形势及证券市场展望

2001 年证券市场将以规范为主线进行蓄势调整。我们判断，市场可能会出现一些新的变化：

1、市场震荡趋于频繁。规范整顿和继续解决历史遗留问题仍将是 2001 年政策的主基调。加强监管可能会使证券市场在短期内有一定的震荡，但从长期看，有利于市场的发展。

2、如果新股发行完全采用核准制及市场化，投资新股的风险将显现。上市公司退出机制的执行，使得重组绩差公司的成本提高，壳资源的利用价值下降，劣股驱

逐良股的现象逐步扭转。

3、开放式基金的推出将标志着蓝筹股时代的来临，促使市场结构进一步调整。

在坚持业已形成的投资理念的同时，我们将重点做好以下工作：

继续强化对上市公司基本面的研究，改进对上市公司的判断方法，引入新的判断指标，希望籍此能挖掘出值得投资的品种；

相应增加波段操作，将长期投资和短期操作结合起来，根据行情衍变适时适度的调整股票、国债及现金比例，以提高基金的总体回报率；

把握宏观经济变化对不同行业的影响度，积极调整组合中行业的配比。随着我国加入 WTO，大部分行业将面临不同程度的冲击，但同时也为部分具有国际竞争力的行业提供了大发展的机会。我们将重点关注专用软件、电子通信、港口运输、医药化工、新材料等行业。

2001 的投资难度会更大。作为基金经理，在任何情况下都要调整 and 平衡好心态。我们将继续努力给投资者持续的回报。

（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《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。基金投资组合符合有关法规及基金契约的约定。

内部监察工作报告

防范基金运作风险、保障基金持有人正当权益是 2000 年度本基金管理人开展内部监察工作所坚持的一贯准则。

鉴于管理基金资产规模的不断增长，防范基金运作风险依然是我们进行监察的工作重点。结合市场新政策、新情况，监察部门对各业务部门调整完善业务流程及其流程遵循情况实施监察；通过基金交易监控系统对基金投资运作合规状况进行实时检查；对查处的违规隐患向当事方及时提出整改措施、敦促实施，并报公司管理层和上级监管部门。

我们根据对各业务部门日常运作和业务流程的监察情况，定期或不定期制作监察反馈表、监察通知给相关部门，定期制作监察报告报中国证监会和公司管理层。

在报告期内，我们对以下方面着重实施了监察：

一．对安信基金日常投资运作合法性、合规性的监察。

监察稽核员以现行的法律法规、基金契约和公司内部管理制度为准绳，以查看现场、跟踪系统、调阅材料、人员询问、个股抽查为手段，监察安信基金投资遵循既定投资程序情况、基金投资组合各项比例控制情况以及在日常投资交易中具体操作行为的合规性情况。

在本报告期内，安信基金日常投资运作符合法律和法规的要求，没有发现重大违规行为。2000 年 9 月，结合准备推出开放式基金，公司完善了监察、投资、交易等相关规章制度，明确研究、投资、交易等业务操作流程。监察稽核部据此

进行定期检查和不定期抽查，一旦发现有违规行为将严肃查处。迄今为止，该项工作执行情况良好，在投资交易中尚未发生违规交叉交易情况。

二、增强业务部门之间的交流与沟通，进一步完善业务流程。

本报告期内，证券市场新法规、新政策出台频频，为适应新政策环境，各业务部门及时调整了包括部门内、部门间的业务流程，从而进一步理顺研究部与投资部等业务部门之间的业务关系，提高基金投资运作效率。在各部门制定业务流程的基础上，监察稽核部将其汇编成公司运作手册，使业务流程的监察有章可循。

三、加强监察稽核部与业务部门沟通，深入开展各项监察工作。

监察稽核部开展工作需要各业务部门的协助与配合，因而需建立和保持同各部门良好沟通与反馈的机制。即业务人员一旦发现问题能及时反映，监察人员能有效协助业务部门解决问题，从而有效控制运作风险。

在本报告期内，监察稽核部逐步完善现行监察条款、修订完成公司内部监察手册，使公司在内部监察制度建设方面又迈进一步。

四.托管人报告

本托管人——中国工商银行，依据《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》，托管安信证券投资基金。

2000 年度，在对安信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，对安信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，对安信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信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。

本托管人依法对安信证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2000 年度所编制和披露的安信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，认为安信证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2000 年度内所编制和披露的基金信息是合法、真实和完整的。

中国工商银行证券投资基金托管部

2001 年 3 月 23 日

五.基金年度财务报告

（一）审计报告

审计报告

——华业字（2001）第 625 号

安信基金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 2000 年 12 月 31 日的资产负债表及 2000 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。我们的审计意见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<<安信证券投资基金契约>>的有关规定，在所有重大方面公允地反映了贵基金 2000 年 12 月 31 日的财务状况以及 2000 年的经营成果；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：吴蓉

中国上海昆山路 146 号

2001 年 2 月 23 日

（二）基金会计报告书

资产负债表报告书

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：	1,866,947,896.93	2,058,603,497.54
股票投资—估值增值：	488,249,499.35	771,046,179.24
债券投资—成本：	631,244,458.00	860,058,564.52
债券投资—估值增值：	-3,425,946.30	1,926,280.78
买入返售证券：	8,000,000.00	-
银行存款：	201,082,775.51	344,861,410.91
应收股利：	-	-
应收利息：	168,064.12	5,222,053.93
应收帐款：	14,150,389.19	517,386,784.24
其他应收款项：	423,358.83	311,800.88
基金资产总值：	3,206,840,495.63	4,559,416,572.04

应付管理费及业绩报酬:	6,548,929.84	9,196,266.39
应付基金托管费:	654,892.95	819,099.17
应付帐款:	28,927,508.75	56,431,370.82
卖出回购证券款:	38,462,500.00	560,000,000.00
应付佣金:	637,994.48	822,039.51
其他应付款项:	4,361,734.21	300,712.37
负债总额:	79,593,560.23	627,569,488.26
基金单位总额:	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配净收益:	642,423,382.35	1,158,874,623.76
未实现估值增值:	484,823,553.05	772,972,460.02
基金资产净值:	3,127,246,935.40	3,931,847,083.78
基金单位发行总份额:	2,000,000,000	2,000,000,000
每份基金单位资产净值:	1.5636	1.9659

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	本期数	上期数
在除息日确认的股息收入:	6,515,906.32	8,374,748.97
债券利息收入:	12,076,964.58	20,268,812.20
股票买卖价差收入:	1,204,044,276.52	686,263,692.58
债券买卖价差收入:	885,961.13	-8,662,145.62
其他收入:	14,487,974.02	13,040,037.56
管理费及业绩报酬:	60,621,590.82	69,459,039.00
其中: 基金管理费:	56,339,919.58	69,459,039.00
业绩报酬:	4,281,671.24	-
基金托管费:	9,389,986.70	6,945,903.97
应由基金承担的其他费用:	11,548,263.64	503,941.03
基金净收益:	1,156,451,241.41	642,376,261.69
上年末未分配净收益:	642,423,382.35	84,047,120.66
本期已分配收益:	640,000,000.00	84,000,000.00
期末未分配净收益:	1,158,874,623.7	642,423,382.35

(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（包括已上市但根据有关规定流通受限的配售新股）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和交易备付金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估值对象为基金所拥有的股票、国债和银行存款。

⑥每日均对基金资产进行估值。

(5) 收入的确认政策

①证券买卖差价收入：在交易日成交，按实际成交价与帐面成本的差额确认。

②股息收入：在被投资股票股权除息日确认。

③债券利息收入：a.已上市国债在被投资国债除息日确认。b.未上市，在银行间债券市场交易的国债在持有期间内以本金按帐面利率确认利息收入。

④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。

(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	租用交易席位	席位使用协议
	基金发起人		
山东证券有限责任公司	管理公司发起人	租用交易席位	席位使用协议
	基金发起人		
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:

①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
上海国际信托投资公司	583,746,012.74	13.11%	476,919.41	13.01%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	635,493,871.55	14.27%	527,278.40	14.39%	0.08%
山东证券有限责任公司	378,889,241.13	8.51%	316,234.84	8.63%	0.08%

本基金通过关联人席位 1999 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
上海国际信托投资公司	831,895,718.99	19.37%	684,191.62	19.14%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	560,665,201.15	13.06%	470,539.94	13.17%	0.08%
山东证券有限责任公司	908,914,269.33	21.17%	758,956.50	21.24%	0.08%

②本基金通过关联人席位 2000 年的国债及回购交易情况:

关 联 人	国债年成交量	占成交总量 比例	回购年成交量	占成交总量比 例
上海国际信托投资公司	1,150,500,146.40	35.61%	645,000,000.00	55.65%
申银万国证券股份有限公司	220,381,415.40	6.82%	180,000,000.00	15.53%
山东证券有限责任公司	282,091,149.90	8.73%	5,000,000.00	0.43%

本基金通过关联人席位 1999 年的国债及回购交易情况:

关 联 人	国债年成交量	占成交总 量比例	回购年成交量	占成交总量比 例
-------	--------	-------------	--------	-------------

上海国际信托投资公司	290,418,631.90	9.67%	60,000,000.00	2.90%
申银万国证券股份有限公司	536,326,651.40	17.85%	237,400,000.00	11.49%
山东证券有限责任公司	595,900,153.08	19.84%	222,000,000.00	10.74%

(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 1.5%的年费率计提，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。

2000 年管理人收取的基金管理费金额为 56,339,919.58 元。1999 年管理人收取的基金管理费金额为 69,459,039.00 元。

②基金管理人业绩报酬

本基金在本会计年度按照《安信证券投资基金基金契约》规定的计提方法和比例，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 4,281,671.24 元（1999：无）。华安基金管理有限公司在计算过程中，考虑到政策性配售新股对基金净值和收益的贡献，已主动将此部分所产生的影响扣除。

$$\text{业绩报酬} = \text{调整后期初资产净值} \times \text{Min}\{M, N\} \times 5\%$$

$$M = \text{基金可分配净收益率} - 1.2 \times \text{同期银行一年定期储蓄存款利率}$$

$$N = \text{基金资产净值增长率} - \text{证券市场平均收益率}$$

$$\text{基金可分配净收益率} = (\text{当期可分配净收益} - 2000 \text{ 年度已卖出配售新股实现收益} - \text{未实现资本利得损失}) / \text{调整后期初资产净值}$$

$$\text{基金资产净值增长率} = (\text{期末基金资产净值} - \text{调整后期初基金资产净值} - 2000 \text{ 年度配售新股对基金净值的影响}) / \text{调整后期初基金资产净值}$$

$$\text{本年度已卖出配售新股实现收益}$$

$$= (\text{基金可流通日上市均价} - \text{配售成本}) \times \text{已卖出配售新股数量}$$

$$\text{本年度配售新股对基金净值的影响}$$

$$= (\text{基金可流通日上市均价} - \text{配售成本或年初估价}) \times \text{配售新股数量}$$

$$2000 \text{ 年度基金支付的用于奖励基金管理人的业绩报酬金额为 } 4,281,671.24 \text{ 元}$$

③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。

2000 年托管人收取的基金托管费金额为 9,389,986.70 元。1999 年托管人收取的基金托管费金额为 6,945,903.97 元。

3、主要报表项目说明

(1) 应收帐款 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 517,386,784.24 元，是应收交易清算资金。由以下两项组成：上海应收交易清算资金 496,026,288.79 元；深圳应收交易清算资金 21,360,495.45 元。

(2) 应收利息 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 5,222,053.93 元。由以下两项组成：银行存款和交易备付金利息为 289,957.75 元；国债利息为 4,932,096.18 元。

(3) 其他应收款项 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 311,800.88 元，是深圳证券交易所交易保证金 311,800.88 元。

(4) 应付帐款 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 56,431,370.82 元，是应付交易清算资金。由以下两项组成：上海应付交易清算资金 41,931,508.65 元；深圳应付交易清算资金 14,499,862.17 元。

(5) 其他应付款 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 300,712.37 元，是卖出回购证券款所计提的应付利息 300,712.37 元。

(四) 本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的增发及配售的新股。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。2000 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 115,327,000.00 元。

1. 认购的增发及配售的新股：

序号	股票名称	发行日期	上市日期	数量	成本	市价	流通受限期
1	上港集箱	00-6-28	00-7-19	9,170,000	109,856,600.00	214,761,400.00	00-7-11 起 1 年
2	宝钢股份	00-11-20	00-12-12	8,405,000	35,132,900.00	45,555,100.00	01-3-1 起流通
3	龙电股份	00-12-6	01-2-16	2,315,789	35,431,571.70	35,431,571.70	00-12-7 起 4 个月
4	烟台万华	00-12-15	01-1-5	128,000	1,443,840.00	1,443,840.00	01-1-5 起流通
5	京东方A	00-12-15	01-1-12	361,912	6,080,121.60	6,080,121.60	01-1-12 起流通
6	金瑞科技	00-12-20	01-1-15	131,000	1,963,690.00	1,963,690.00	01-1-15 起流通
7	宁沪高速	00-12-23	01-1-16	183,000	768,600.00	768,600.00	01-1-16 起流通
8	天科股份	00-12-25	01-1-11	95,000	625,100.00	625,100.00	01-1-11 起流通
9	天通股份	00-12-26	01-1-18	201,000	1,806,990.00	1,806,990.00	01-1-18 起流通
10	通海高科	00-7-6	待定	60,000	1,012,800.00	1,012,800.00	待定

2. 配股部分冻结的股票

序号	股票名称	除权日	上市日期	数量	成本	市价	流通受限期
11	新太科技	00-12-8	01-1-17	257,123	4,628,214.00	5,857,261.94	01-1-17 起流通
12	法尔胜	00-12-13	01-2-13	952,217	13,331,038.00	20,187,000.40	01-2-13 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
交通运输类	223,830,038.00	5.69%
能源电力类	112,204,309.05	2.85%
冶金类	186,122,396.72	4.73%
机械制造类	304,651,892.28	7.75%
电子通讯类	998,774,928.11	25.40%
化工类	249,049,178.70	6.33%
医药类	202,847,041.00	5.16%
汽车及配件制造类	29,512,277.87	0.75%
纺织服装类	276,363,407.19	7.03%
家电类	58,315,813.42	1.48%
商贸旅游类	99,497,132.00	2.53%
金融地产类	15,530,720.00	0.39%
综合类	72,950,542.44	1.86%
合 计	2,829,649,676.78	71.97%

2. 债券（不包括国债）合计

截至 2000 年 12 月 31 日，基金持有的债券合计为 22,103,330.20 元，占基金资产净值的 0.56%。

3. 国债、货币资金合计

截止 2000 年 12 月 31 日，基金持有的国债及货币资金合计为 1,645,698,339.43 元，占基金资产净值的 41.86%。

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	东方电子	26,690,760	512,729,499.60	13.04%

2	环保股份	12,509,700	230,053,383.00	5.85%
3	上港集箱	9,170,000	214,761,400.00	5.46%
4	大唐电信	6,674,208	206,366,511.36	5.25%
5	许继电气	8,367,306	170,191,004.04	4.33%
6	海欣股份	8,547,513	141,290,389.89	3.59%
7	雅戈尔	8,800,000	128,040,000.00	3.26%
8	法尔胜	5,595,897	118,633,016.40	3.02%
9	泰山石油	5,460,939	92,180,650.32	2.34%
10	恒瑞医药	3,065,546	91,905,069.08	2.34%
11	青旅控股	4,000,000	87,080,000.00	2.21%
12	申能股份	3,871,545	76,772,737.35	1.95%
13	盐湖钾肥	3,852,974	73,283,565.48	1.86%
14	上海医药	3,449,114	69,948,031.92	1.78%
15	中原油气	3,611,344	55,434,130.40	1.41%
16	上菱电器	2,485,725	49,465,927.50	1.26%
17	宝钢股份	8,405,000	45,555,100.00	1.16%
18	长江通信	916,622	42,228,775.54	1.07%
19	星湖科技	2,300,000	37,835,000.00	0.96%
20	龙电股份	2,315,789	35,431,571.70	0.90%
21	长城电工	2,409,130	31,174,142.20	0.79%
22	上海汽车	2,432,999	29,512,277.87	0.75%
23	广电股份	1,428,508	28,727,295.88	0.73%
24	中联重科	1,089,000	26,865,630.00	0.68%
25	星新材料	1,425,750	25,934,392.50	0.66%
26	首创股份	1,190,000	25,787,300.00	0.66%
27	新太科技	1,109,198	25,267,530.44	0.64%
28	锌业股份	2,071,638	19,970,590.32	0.51%
29	波导股份	558,347	17,292,006.59	0.44%
30	振华港机	1,175,212	16,558,737.08	0.42%
31	万杰高科	1,225,900	16,034,772.00	0.41%
32	民生银行	904,000	15,530,720.00	0.39%
33	佛山照明	675,632	8,654,845.92	0.22%
34	首旅股份	300,000	6,933,000.00	0.18%
35	鲁泰A	405,595	7,033,017.30	0.18%
36	超声电子	500,050	6,995,699.50	0.18%
37	京东方A	361,912	6,080,121.60	0.15%
38	龙净环保	262,000	5,860,940.00	0.15%
39	中化国际	313,200	5,484,132.00	0.14%
40	兰光科技	186,600	5,344,224.00	0.14%
41	中信海直	175,000	4,264,750.00	0.11%
42	赣粤高速	229,800	4,035,288.00	0.10%
43	昆明制药	114,000	3,158,940.00	0.08%
44	天通股份	201,000	1,806,990.00	0.05%

45	金瑞科技	131,000	1,963,690.00	0.05%
46	烟台万华	128,000	1,443,840.00	0.04%
47	通海高科	60,000	1,012,800.00	0.03%
48	宁沪高速	183,000	768,600.00	0.02%
49	天科股份	95,000	625,100.00	0.02%
50	春兰股份	8,000	195,040.00	0.01%
51	沧州大化	10,000	147,500.00	0.00%
合计			2,829,649,676.78	71.97%

5.本期新增股票

序号	名称	政策性配售	一级市场认购	增发	配股	买入	送股	卖出
1	首创股份	2,380,000						1,190,000
2	民生银行		904,000					
3	上港集箱		9,170,000					
4	宝钢股份		8,405,000					
5	波导股份		900,000					341,653
6	长城电工				649,350	2,164,500		404,720
7	沧州大化	634,000				10,000		634,000
8	首旅股份	600,000						300,000
9	赣粤高速	960,000						730,200
10	恒瑞医药		170,000			2,895,546		
11	星新材料	634,000				1,289,484		497,734
12	烟台万华		128,000					
13	振华港机			205,212		970,000		
14	天通股份		201,000					
15	长江通信		226,000			690,622		
16	宁沪高速		183,000					
17	天科股份		95,000					
18	龙净环保		262,000					
19	金瑞科技		131,000					
20	昆明制药		114,000					
21	广电股份					1,735,927		307,419
22	龙电股份			2,315,789				
23	新太科技				257,123	957,475		105,400
24	海欣股份			3,720,930		4,948,283		121,700
25	春兰股份					8,000		
26	星湖科技					2,400,000		100,000
27	中信海直		164,000			11,000		
28	中联重科		219,000			870,000		
29	许继电气					7,035,533	2,640,112	1,308,339
30	佛山照明			1,126,480				450,848
31	泰山石油					5,478,439		17,500
32	京东方A			361,912				
33	鲁泰A			405,595				

34	锌业股份					1,593,568	478,070	
35	超声电子					500,050		
36	兰光科技	373,200						186,600
37	通海高科		60,000					

6. 本期剔除股票

序号	股票名称	一级市场 认购	增发	二级市场买 入	送股	配股	债转股	本期卖出
1	深康佳A							2,862,228
2	桐君阁							1,048,590
3	桂林集琦							169,815
4	现代投资							1,000,000
5	大亚股份							500,000
6	金陵药业							457,100
7	小鸭电器							514,300
8	广济药业							312,500
9	河池化工							285,700
10	欣龙无纺							314,000
11	首钢股份							1,024,550
12	锡业股份							1,114,287
13	大连金牛							1,667,100
14	东方钨业			510,000	73,680			875,780
15	华东医药							449,400
16	浦发银行							4,571,000
17	万东医疗							950,000
18	同仁堂							74,763
19	清华同方							268,937
20	太极集团			997,558				1,487,788
21	紫江企业							555,500
22	长春经开							536,000
23	浙江医药							362,000
24	秦岭水泥							400,000
25	南山实业							429,000
26	海南航空							2,360,000
27	赤天化							629,200
28	海南椰岛							285,700
29	真空电子			1,246,240	300,000			18,006,561
30	大江股份							873,795
31	中大股份							3,800,000
32	巴士股份				2,384,952	658,489		9,481,897
33	综艺股份			189,150				9,117,127
34	招商局A		720,000					720,000
35	特发信息	554,455						554,455
36	广聚能源	325,000						325,000
37	麦科特	151,000						151,000
38	中成股份	255,000						255,000
39	川化股份	266,000						266,000

40	安塑股份	144,000						144,000
41	国际实业	231,000						231,000
42	丝绸股份	850,000						850,000
43	晨鸣纸业		251,813					251,813
44	银基发展		1,000,000					1,000,000
45	风华高科			93,400	46,700			140,100
46	张裕A		524,721					524,721
47	鞍钢新轧						2,466,060	2,466,060
48	电广传媒		500,000					500,000
49	天水股份	554,455						554,455
50	长源电力	712,800						712,800
51	神州股份	1,258,000						1,258,000
52	安泰科技	475,200						475,200
53	中科三环			288,000				288,000
54	湖北迈亚	435,600						435,600
55	佛塑股份	750,000						750,000
56	乌江电力	650,000						650,000
57	春晖股份	554,400				221,760		776,160
58	浪潮信息	514,900						514,900
59	金马股份	453,500						453,500
60	圣雪绒	121,000						121,000
61	大庆华科	96,000						96,000
62	广州友谊	161,000						161,000
63	九芝堂	160,000						160,000
64	诚志股份	88,000						88,000
65	新大陆	66,000						66,000
66	隆平高科	430,000						430,000
67	罗顿发展			277,300				277,300
68	青岛碱业	796,000						796,000
69	凌钢股份	838,000						838,000
70	民丰特纸	410,170						410,170
71	桂冠电力	1,220,000						1,220,000
72	仕奇实业	586,178						586,178
73	辽宁时代	214,000						214,000
74	华龙集团	379,000						379,000
75	先锋股份	77,000						77,000
76	物华股份	157,000						157,000
77	中恒集团	132,000						132,000
78	鑫科材料	57,000						57,000
79	广汇股份	396,040						396,040
80	兴业聚酯	554,000						554,000
81	凯乐科技	17,000						17,000
82	浙江阳光	121,000						121,000
83	北方股份	164,000						164,000
84	景谷林业	183,000						183,000
85	海正药业	148,000		858,068				1,006,068
86	武昌鱼	234,000						234,000
87	亿利科技	144,000						144,000
88	东方创业	104,000						104,000
89	重庆港九	298,000						298,000

90	太化股份	295,000					295,000
91	南钢股份	175,000					175,000
92	钱江水利	106,000					106,000
93	羚锐股份	73,000					73,000
94	大恒科技	87,000					87,000
95	西水股份	242,000					242,000
96	九龙电力	79,000					79,000
97	三峡新材	145,000					145,000
98	美罗药业	105,000					105,000
99	安琪酵母	113,000					113,000
100	维维股份	102,000					102,000
101	南化股份	94,000					94,000
102	商业城	247,000					247,000
103	华泰股份	284,000					284,000
104	巢东股份	110,000					110,000
105	兰太实业	161,000					161,000
106	美克股份	86,000					86,000
107	珠峰摩托	226,000					226,000
108	国旅联合	102,000					102,000
109	宁波韵升	138,000					138,000
110	五洲交通	231,000					231,000
111	上实联合		1,482,000				1,482,000
112	交运股份		570,513				570,513
113	青岛海尔			10,000			10,000
114	东大阿派			46,000			46,000
115	悦达投资		1,420,000				1,420,000

7、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 2000 年 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 565,604,262.63 元，债券市值 22,103,330.20 元，股票市值 2,829,649,676.78 元、国债及货币资金 1,645,698,339.43 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、应收国债利息、其他应收款、应付管理人报酬及业绩报酬、应付托管费、应付券商佣金以及卖出回购债券款、应付卖出回购债券款利息等。

(4) 本报告与《安信证券投资基金投资组合公告》(2000 年第 4 号)差异是由于提取 2000 年管理人业绩报酬所引起的。

六.基金持有人结构及前十名持有人

截止 2000 年 12 月 31 日，本基金发起人持有的基金份额为 0.54 亿基金单位，占基金发行总份额的 2.7%，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%
其中：未上市流通份额	18,000,000	0.90%
华安基金管理有限公司	12,000,000	0.60%
其中：未上市流通份额	6,000,000	0.30%
山东证券有限责任公司	6,000,000	0.30%
其中：未上市流通份额	6,000,000	0.30%

社会公众持有的基金份额为 19.46 亿基金单位，占基金发行总份额的 97.3%。

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	191,673,200	9.58%
2	中国太保	124,002,200	6.20%
3	中煤信托	40,617,500	2.03%
4	投资信托	36,000,000	1.80%
5	平安保险	32,668,200	1.63%
6	浙江信托	24,745,600	1.24%
7	中国太保	22,325,300	1.12%
8	华泰保险	20,975,400	1.05%
9	中电天证	17,100,000	0.86%
10	丽晶新	15,520,400	0.78%

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. 本基金中期不分配，纳入年末一次性分配；
3. 本基金管理人于 2000 年 7 月 18 日发布安信基金管理人《华安基金管理有限公司关于增资及股权结构调整的公告》：根据华安基金管理有限公司第五次股东会决议，并经中国证监会证监基金字（2000）29 号文批准，华安基金管理有限公司注册资本由人民币 5000 万元增加到 15000 万元，东方证券有限责任公司和浙江证券有限责任公司成为公司新股东。

增资后，各股东出资比例调整为：

- 上海国际信托投资公司出资 4500 万元，占注册资本的 30%；
- 申银万国证券股份有限公司出资 3000 万元，占注册资本的 20%；
- 山东证券有限责任公司出资 3000 万元，占注册资本的 20%；
- 东方证券有限责任公司出资 3000 万元，占注册资本的 20%；
- 浙江证券有限责任公司出资 1500 万元，占注册资本的 10%。

上述各股东出资已经大华会计师事务所验资到位，并已办理完毕有关工商注册变更手续。

4.本基金管理人于 2000 年 2 月 26 日发布安信基金管理人《华安基金管理有限公司第一届董事会第三次会议决议公告》：徐建军辞去董事长职务,选举杜建国担任董事长。

5.2000 年各券商股票成交量及佣金情况如下：

①股票交易情况：

关 联 人	年成交量	占年成交总量比例	年佣金	占年佣金总量比例
上海国际信托投资公司	583,746,012.74	13.11%	476,919.41	13.01%
申银万国证券股份有限公司	635,493,871.55	14.27%	527,278.40	14.39%
山东证券有限责任公司	378,889,241.13	8.51%	316,234.84	8.63%
国通证券有限责任公司	1,336,130,463.15	30.00%	1,097,517.21	29.94%
光大证券有限公司	226,919,566.74	5.09%	186,879.77	5.10%
南方证券有限公司	736,157,429.25	16.53%	604,965.84	16.51%
国信证券有限公司	556,417,962.62	12.49%	455,219.48	12.42%

②国债及回购交易情况：

关 联 人	国债年成交量	占成交总量比例	回购年成交量	占成交总量比例
上海国际信托投资公司	1,150,500,146.40	35.61%	645,000,000.00	55.65%
申银万国证券股份有限公司	220,381,415.40	6.82%	180,000,000.00	15.53%
山东证券有限责任公司	282,091,149.90	8.73%	5,000,000.00	0.43%
国通证券有限责任公司	975,756,237.70	30.21%	197,500,000.00	17.04%
光大证券有限公司	37,591,713.00	1.16%	-	-
南方证券有限公司	446,354,361.60	13.82%	116,500,000.00	10.05%
国信证券有限公司	117,779,936.70	3.65%	15,000,000.00	1.30%

八．备查文件目录

- 1.中国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 2000 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

二 零 零 一 年 三 月 二 十 六 日