

安信证券投资基金

2000 年度中期报告

华安基金管理有限公司

2000 年 8 月 29 日

重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2000 年 8 月 29 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
(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、曹培青

二．主要财务指标

项 目	2000 年 6 月 30 日	1999 年 6 月 30 日
期末基金资产总值	4,364,730,720.45 元	3,322,201,716.12 元
期末基金资产净值	3,770,585,175.68 元	3,294,951,795.47 元
单位基金资产净值	1.8853 元	1.6475 元
基金累计净值增长率	124.73%	68.95%
项 目	2000 年 1 - 6 月	1999 年 1 - 6 月
基金可分配净收益	767,907,890.93 元	364,628,122.77 元
单位基金净收益	0.3840 元	0.1823 元
基金资产净值收益率	30.78%	17.11%
本期基金可分配收益率	30.87%	17.12%
本期基金净值增长率	51.60%	54.66%

三．基金管理人报告

基金经理简介

本基金经理小组主要成员：

王国卫先生，基金经理，总经理助理兼基金投资部经理，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 年是中国证券史上革命性的一年。虽然在年初时我们曾判断 2000 年将延续 1999 年的恢复性上涨行情，但对今年行情运行的高度和时间跨度仍估计不足。

我们认为，导致今年行情迭创新高的主要原因有三：首先是基本面。连续 3 年实施积极的财政和货币政策已对国民经济产生了实质性影响，宏观经济开始出现重要转机。宏观经济转强是促成指数创历史新高的真正动力。可以看出，随着证券市场的规模不断扩大，证券市场作为国民经济晴雨表的功能越来越强化。根据经济周期各阶段的特征，在经济启动阶段，首先受益的是资源和原材料类行业，因此，石油、钢材等行业的上市公司业绩可能比去年有较大提高，反映在证券市场上，这类股票的走势较好。其次是资金面的支持。资金面的空前宽松是本轮行情的直接动力。根据价值规律的论述，价格是由价值决定的，同时受供求关系影响。就证券市场而言，供求关系体现在两个方面，股票的供给量和资金的供给量。相比而言，今年股票供给量远远小于资金的供给量。由于政策逐步放宽，各类新增基金源源不断进入一、二级市场，今年的资金面空前宽裕。而且，与以往不同的是，今年机构投资者的比例有较大提高，机构投资者的长线投资理念使得行情衍变方式与以往迥然不同。最后是政策面。政策面的巨大变化改变了过去市场长期扭曲的状态，“让市场说话”恢复了市场的真面目，一系列的政策已经或正在推动着中国证券市场进行一场前所未有的大变革。

针对今年行情的特点，我们在操作策略上选择了两个重点：

第一，利用不同阶段个股表现的差异，适当减持个股的持仓量，以有效获取价差。这符合我们积极操作的投资策略。我们认为，投资组合中的一批个股质地优良，有较大的发展潜力，适合中长期投资，但从短期看，

根据我们对企业的理解，其价格已高估，暂时减持是符合基金长期利益的。在适当时机，我们仍然会买入这些股票。

第二，利用不同市场之间的隔离和差异，积极参与银行间同业拆借市场和新股认购。

基金参与配售新股的方法改变后，要求基金管理人要进一步提高资金的使用效率，提高单位资金的收益率。针对银行间债券市场和交易所债券市场、一级市场和二级市场隔离的实际情况，我们尽可能打好资金的时间差，在符合法规和基金契约的前提下，增大可使用资金量，通过有效控制风险，提高基金总体获利水平。

2000 年 1 - 6 月基金安信实现可分配收益 7.65 亿元，超过去年全年的总和。截止到 2000 年 6 月 30 日，基金单位资产净值达到 1.8853 元，净值增长率为 51.60%，高于同期银行存款利率和同期沪深指数涨幅，在同类基金中仍处于领先地位。扣除 20% 的国债投资后，2000 年 1 - 6 月基金安信股票投资的增值约 68%。扣除当年配售新股对基金净值增长的贡献因素，本基金净值增长率为 39.50%。

我们意识到，在这轮行情中我们做的并不理想。第一，政策敏感性不够，缺少相应的灵活性。今年的行情对我们的投资理念提出了严峻的考验。第二，缺乏经济循环各阶段投资策略的分析和运用，阶段机会的把握能力不够。第三，新品种开发力度不够。第四，国债投资方法仍有待提高。

我们认为，通信、应用软件、环保、港口、垄断资源类、房地产和建筑类行业将在经济循环周期中获益，纺织行业将因中国入世步伐的加快而面临难得的历史发展机遇，这些行业的上市公司将有望有快速增长的机会，投资潜力较大。我们仍将坚持“精选个股、集中投资、长期持有、积极操作”的投资策略，同时根据宏观经济和市场的变化情况，适时调整投资组合，为投资者谋取长期稳定的收益。

（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。在严格控制风险的基础上，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。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

鉴于保障基金持有人利益是本基金管理人内部监察工作不变的目标，本报告期内，我们监察工作重点仍然围绕防范投资运作风险，确保基金投资符合基金契约和有关法律法规的规定。

一．对安信基金日常运作合法、合规性的监察

监察稽核人员通过现场观察、人员询问、重点抽查等方法检查基金投资既定程序执行情况；通过基金交易监控系统对安信基金投资组合各项比例控制情况及日常交易操作行为的合规性进行实时监控，保证安信基金投资组合符合基金契约的约定；定期制作监察报告，发现违规隐患及时向管理层和监管部门报告并督促整改。

二．完善投资流程，提高基金投资运作效率

本报告期内，证券市场政策变化较大，其中一些涉及基金运作，例如新股发行方式的改变。本管理人及时对原有投资程序中不适应新情况的部分进行调整，以期提高基金投资运作效率。

三．完善监察稽核部门与各业务部门的沟通

在监察稽核人员与各业务人员间培养经常性沟通习惯，监察人员发现问题及时与有关人员沟通，及时了解情况，分析问题，解决问题。

四、加强对属下公司员工职业操守的教育和监察意识的培养。

通过上述工作，本报告期内，安信基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，员工行为合法合规，安信基金持有人利益得到充分保障。我们将继续高度重视风险控制，不断引入先进的内控技术，提高内部监察工作的科学性和效率性，切实保障基金安全运作，以优异的业绩回报投资者。

四．基金财务报告

（一）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	附注	期初数	期末数
股票投资—成本：		1,866,947,896.93	1,813,907,292.02
股票投资—估值增值：		488,249,499.35	1,002,677,284.75
债券投资—成本：		631,244,458.00	764,880,000.00
债券投资—估值增值：		-3,425,946.30	-
买入返售证券：		8,000,000.00	-
银行存款：		201,082,775.51	516,575,613.66
应收股利：		-	42,768.00
应收利息：		168,064.12	193,640.62
应收帐款：	1	14,150,389.19	2,436,065.54
其他应收款项：	2	423,358.83	264,018,055.86
基金资产总额：		3,206,840,495.63	4,364,730,720.45
应付基金管理费：		6,548,929.84	4,606,750.29
应付基金托管费：		654,892.95	767,791.69
应付帐款：	3	28,927,508.75	11,956,022.88
卖出回购证券款：		38,462,500.00	575,600,000.00
应付佣金：		637,994.48	584,990.94
其他应付款项：	4	4,361,734.21	629,988.97
负债总额：		79,593,560.23	594,145,544.77
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	767,907,890.93
未实现估值增值：		484,823,553.05	1,002,677,284.75
基金资产净值：		3,127,246,935.40	3,770,585,175.68
基金单位发行总份额：		2,000,000,000	2,000,000,000.00
每份基金单位资产净值：		1.5636	1.8853
调整后每份基金单位资产净值：		1.2436	1.8853

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	附注	2000 年 1-6 月	1999 年 1-6 月
在除息日确认的股息收入:		3,599,298.52	7,586,089.35
债券利息收入:		2,741,998.11	21,318,597.20
股票买卖价差收入:		786,278,501.20	351,855,033.46
债券买卖价差收入:		1,287,814.06	6,754,714.43
其他收入:	5	7,942,921.79	8,131,941.10
基金管理费:		27,576,997.98	28,004,041.44
基金托管费:		4,596,166.43	2,800,404.24
应由基金承担的其他费用:		4,192,860.69	260,927.75
基金净收益:		765,484,508.58	364,581,002.11
上年未分配净收益:		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:		767,907,890.93	364,628,122.77

(二) 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：

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。

未上市的股票以发行价计算。

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。

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：

以发行基金方式募集资金不征收营业税。

对基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税。

对基金买卖股票按照 4‰ 的税率征收印花税。

对基金从证券市场中取得的收入，暂免征所得税。

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：

基金收益分配比例不低于基金净收益的 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	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	1-6 月成交量	占成交总量 比例	1-6 月佣金	占佣金总 量比例
上海国际信托投资公司	336,685,464.69	13.54%	281,242.29	13.51%
申银万国证券股份有限公司	535,149,297.77	21.52%	445,687.37	21.41%
山东证券有限责任公司	308,163,404.33	12.39%	259,466.99	12.47%

(3) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额

基金管理人的报酬

本基金给付基金管理人的管理费，按前一日基金资产净值的 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 为前一日基金资产净值

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。

2000 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，管理人收取的基金管理费金额为 27,576,997.98 元。

基金托管费

本基金给付基金托管人的托管费，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。

2000 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，托管人收取的基金托管费金额为 4,596,166.43 元。

3. 主要报表项目说明

(1) 应收帐款 2000 年 6 月 30 日余额为人民币 2,436,065.54 元，是应收股票清算款。由以下两项组成：上海应收交易资金，2,428,298.21 元；深圳应收交易资金，7,767.33 元。

(2) 其他应收款项 2000 年 6 月 30 日余额为人民币 264,018,055.86 元，其中：深圳证券交易所调整交易保证金为 853,793.14 元；上海国投深圳证券交易所 1999 年席位费为 17,500.00 元；光大证券上海证券交易所电话费为 1,901.13 元；新股申购款 260,700,000.00 元；预提未上市国债利息 2,444,861.59 元。

(3) 应付帐款 2000 年 6 月 30 日余额为人民币 11,956,022.88 元，其中：上海应付交易资金 3,600,695.80 元；深圳应付交易资金 8,355,327.08 元。

(4) 其他应付款项 2000 年 6 月 30 日余额为人民币 629,988.97 元，为卖出返售债券款计提的利息支出。

(5) 其他收入包括银行存款利息收入 6,027,579.74 元、回购利息收入 1,521,444.00 元、配股及认购新股手续费返还 321,274.74 元、国债兑付手续

费 33,080.00 元、证券交易所印花税返还 39,543.31 元。

(三) 本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的新股以及参与上市公司增资配股所认购的股份。认购的新股, 在估值时如果该新股还未上市, 则按成本计价; 如已上市, 则按当日市场平均价计价。配股所认购股份, 按当日市场平均价计价。

截至 2000 年 6 月 30 日, 已上市但流通受限的新股估值增值额为 109,808,536.14 元。

序号	股票名称	上市日期	数 量	成 本	市 价
1	大连金牛	2000-3-1	833,550	3,400,884.00	8,310,493.50
2	青岛碱业	2000-3-9	398,000	1,504,440.00	4,318,300.00
3	长源电力	2000-3-16	356,400	2,174,040.00	5,057,316.00
4	桂冠电力	2000-3-23	610,000	3,910,100.00	10,839,700.00
5	沧州大化	2000-4-6	317,000	1,401,140.00	3,759,620.00
6	天水股份	2000-4-6	277,228	1,275,248.80	3,859,013.76
7	星新材料	2000-4-20	317,000	2,031,970.00	5,376,320.00
8	首创股份	2000-4-27	1,190,000	10,686,200.00	26,096,700.00
9	湖北迈亚	2000-4-27	217,800	962,676.00	2,824,866.00
10	凌钢股份	2000-5-11	419,000	2,338,020.00	3,645,300.00
11	特发信息	2000-5-11	277,228	2,190,101.20	8,086,740.76
12	赣粤高速	2000-5-18	480,000	5,280,000.00	8,140,800.00
13	兴业聚酯	2000-5-25	277,000	1,218,800.00	3,889,080.00
14	佛塑股份	2000-5-25	375,000	2,355,000.00	5,550,000.00
15	广汇股份	2000-5-26	198,020	1,306,932.00	5,172,282.40
16	丝绸股份	2000-5-29	425,000	1,776,500.00	5,244,500.00
17	安泰科技	2000-5-29	237,600	3,559,248.00	10,024,344.00
18	首旅股份	2000-6-1	300,000	1,761,000.00	6,060,000.00
19	春晖股份	2000-6-1	277,200	2,406,096.00	7,861,392.00
20	乌江电力	2000-6-8	325,000	2,145,000.00	4,845,750.00
21	浪潮信息	2000-6-8	257,450	1,984,939.50	6,920,256.00
22	民丰特纸	2000-6-15	205,085	1,316,645.70	2,727,630.50
23	黄山金马	2000-6-16	226,750	1,244,857.50	2,947,750.00
24	神州股份	2000-6-22	629,000	2,893,400.00	6,415,800.00
25	兰光科技	2000-6-22	186,600	1,619,688.00	4,944,900.00
26	仕奇实业	2000-6-28	293,089	2,344,712.00	4,478,399.92
27	上实联合	2000-6-29	1,482,000	25,727,520.00	33,226,440.00

28	波导股份	2000-7-6	900,000	14,400,000.00	14,400,000.00
29	上港集箱	2000-7-19	9,170,000	109,856,600.00	109,856,600.00
30	凯乐股份	2000-7-6	17,000	161,160.00	161,160.00
31	东方创业	2000-7-12	104,000	650,000.00	650,000.00
32	南化股份	2000-7-12	94,000	437,100.00	437,100.00
33	圣雪绒	2000-7-6	121,000	1,040,600.00	1,040,600.00
34	诚志股份	2000-7-6	88,000	871,200.00	871,200.00
35	隆平高科		430,000	5,581,400.00	5,581,400.00
合 计			22,312,000	223,813,218.70	333,621,754.84

截至 2000 年 6 月 30 日 ,尚未流通的配股的估值增值额为 41,169,333.39 元。

序号	股票名称	配股日期	数 量	成 本	市 价
1	青旅控股	2000-6-7	2,618,119	31,417,428.00	56,891,725.87
2	大唐电信	2000-6-15	978,617	25,444,042.00	33,302,336.51
3	雅戈尔	2000-6-16	1,678,103	25,943,472.38	33,780,213.39
合 计			5,274,839	82,804,942.38	123,974,275.77

(四) 基金投资组合

1. 按行业分类的股票投资组合

分 类	市 值 (元)	占净值比例
交通运输类	179,513,785.18	4.76%
能源电力类	59,099,352.76	1.57%
建材建筑类	9,031,296.16	0.24%
冶金类	143,631,598.05	3.81%
机械制造类	516,912,714.74	13.71%
电子通讯类	958,119,765.75	25.41%
化工类	156,428,638.54	4.15%
医药类	118,990,829.68	3.15%
汽车及配件制造类	47,505,081.00	1.26%
纺织服装类	170,453,717.37	4.52%
家电类	41,577,581.43	1.10%
酿酒食品类	1,830,900.00	0.05%
商贸旅游类	278,916,483.11	7.40%
农林牧渔类	5,581,400.00	0.15%

综合类	128,991,433.00	3.42%
合 计	2,816,584,576.77	74.70%

2. 国债、货币资金合计

截至 2000 年 6 月 30 日，基金持有的国债及货币资金合计为 1,271,935,656.32 元，占基金资产净值的 33.73%。

3. 基金投资股票明细

序号	名 称	数 量	市 值 (元)	占净值比例
1	东方电子	26,918,655	514,146,310.50	13.64%
2	环保股份	17,877,377	484,834,464.24	12.86%
3	青旅控股	10,676,607	232,002,670.11	6.15%
4	许继电气	7,413,322	167,170,411.10	4.43%
5	大唐电信	4,821,363	164,070,982.89	4.35%
6	雅戈尔	6,857,381	138,039,079.53	3.66%
7	上海医药	4,552,062	109,932,297.30	2.92%
8	上港集箱	9,170,000	109,856,600.00	2.91%
9	法尔胜	3,174,409	80,979,173.59	2.15%
10	盐湖钾肥	3,740,230	72,298,645.90	1.92%
11	首创股份	2,360,000	51,754,800.00	1.37%
12	真空电子	3,300,000	50,721,000.00	1.35%
13	巴士股份	4,621,537	46,862,385.18	1.24%
14	上海汽车	3,298,100	44,557,331.00	1.18%
15	广电股份	1,725,927	41,577,581.43	1.10%
16	上实联合	1,482,000	33,226,440.00	0.88%
17	星新材料	1,923,484	32,622,288.64	0.87%
18	申能股份	1,807,628	31,940,786.76	0.85%
19	中大股份	1,998,300	29,714,721.00	0.79%
20	长城电工	2,164,500	29,350,620.00	0.78%
21	综艺股份	859,150	29,004,904.00	0.77%
22	中原油气	1,930,000	28,544,700.00	0.76%
23	新太科技	957,475	20,738,908.50	0.55%
24	东方钨业	292,100	15,268,067.00	0.40%
25	波导股份	900,000	14,400,000.00	0.38%
26	万杰实业	1,225,900	14,355,289.00	0.38%
27	浪潮信息	514,900	13,840,512.00	0.37%
28	中科三环	288,000	13,057,920.00	0.35%

29	锡业股份	1,114,287	12,346,299.96	0.33%
30	中化国际	737,200	11,139,092.00	0.30%
31	桂冠电力	610,000	10,839,700.00	0.29%
32	安泰科技	237,600	10,024,344.00	0.27%
33	深招港A	720,000	9,864,000.00	0.26%
34	仕奇实业	586,178	8,956,799.84	0.24%
35	大连金牛	833,550	8,310,493.50	0.22%
36	赣粤高速	480,000	8,140,800.00	0.22%
37	特发信息	277,228	8,086,740.76	0.21%
38	春晖股份	277,200	7,861,392.00	0.21%
39	南山实业	429,000	6,486,480.00	0.17%
40	神州股份	629,000	6,415,800.00	0.17%
41	首旅股份	300,000	6,060,000.00	0.16%
42	隆平高科	430,000	5,581,400.00	0.15%
43	佛塑股份	375,000	5,550,000.00	0.15%
44	桐君阁	325,863	5,298,532.38	0.14%
45	丝绸股份	425,000	5,244,500.00	0.14%
46	广汇股份	198,020	5,172,282.40	0.14%
47	长源电力	356,400	5,057,316.00	0.13%
48	兰光科技	186,600	4,944,900.00	0.13%
49	乌江电力	325,000	4,845,750.00	0.13%
50	海南航空	500,000	4,790,000.00	0.13%
51	青岛碱业	398,000	4,318,300.00	0.11%
52	赤天化	314,600	3,976,544.00	0.11%
53	兴业聚酯	277,000	3,889,080.00	0.10%
54	天水股份	277,228	3,859,013.76	0.10%
55	九芝堂	160,000	3,760,000.00	0.10%
56	沧州大化	317,000	3,759,620.00	0.10%
57	凌钢股份	419,000	3,645,300.00	0.10%
58	黄山金马	226,750	2,947,750.00	0.08%
59	湖北迈亚	217,800	2,824,866.00	0.07%
60	民丰特纸	205,085	2,727,630.50	0.07%
61	维维股份	102,000	1,830,900.00	0.05%
62	圣雪绒	121,000	1,040,600.00	0.03%
63	诚志股份	88,000	871,200.00	0.02%

64	东方创业	104,000	650,000.00	0.02%
65	南化股份	94,000	437,100.00	0.01%
66	凯乐股份	17,000	161,160.00	0.00%
合 计			2,816,584,576.77	74.70%

4.本期新增股票

序号	名称	一级市场 认购	增发	配股	买入	送股	卖出
1	首创股份	2,380,000					20,000
2	上港集箱	9,170,000					
3	波导股份	900,000					
4	长城电工				2,164,500		
5	青岛碱业	796,000					398,000
6	沧州大化	634,000					317,000
7	凌钢股份	838,000					419,000
8	民丰特纸	410,170					205,085
9	桂冠电力	1,220,000					610,000
10	仕奇实业	586,178					
11	广汇股份	396,040					198,020
12	首旅股份	600,000					300,000
13	兴业聚酯	554,000					277,000
14	凯乐股份	17,000					
15	赣粤高速	960,000					480,000
16	东方创业	104,000					
17	星新材料	634,000			1,289,484		
18	维维股份	102,000					
19	南化股份	94,000					
20	上实联合		1,482,000				
21	广电股份				1,735,927		10,000
22	新太科技				957,475		
23	深招港A		720,000				
24	特发信息	554,455					277,227
25	丝绸股份	850,000					425,000
26	许继电气				5,120,132	2,640,112	346,922
27	天水股份	554,455					277,227
28	长源电力	712,800					356,400

29	神州股份	1,258,000					629,000
30	安泰科技	475,200					237,600
31	中科三环				288,000		
32	湖北迈亚	435,600					217,800
33	佛塑股份	750,000					375,000
34	乌江电力	650,000					325,000
35	春晖股份	554,400					277,200
36	浪潮信息	514,900					
37	黄山金马	453,500					226,750
38	兰光科技	373,200					186,600
39	圣雪绒	121,000					
40	九芝堂	160,000					
41	诚志股份	88,000					
42	隆平高科	430,000					

5.本期剔除股票

序号	股票名称	买入	送股	配股	卖出
1	浦发银行				4,571,000
2	万东医疗				950,000
3	同仁堂				74,763
4	清华同方				268,937
5	太极集团	700,000		297,558	1,487,788
6	紫江企业				555,500
7	长春经开				536,000
8	浙江医药				362,000
9	秦岭水泥				400,000
10	海南椰岛				285,700
11	大江股份				873,795
12	上菱电器				1,595,000
13	深康佳A				2,862,228
14	桂林集琦				169,815
15	湖南高速				1,000,000
16	大亚股份				500,000
17	金陵药业				457,100
18	小鸭电器				514,300

19	广济药业				312,500
20	河池化工				285,700
21	欣龙无纺				314,000
22	首钢股份				1,024,550
23	华东医药				449,400
	北方股份	164,000			164,000
	江苏悦达	1,420,000			1,420,000

6.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 6 月 30 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 317,935,057.41 元，股票市值 2,816,584,576.77 元、国债及货币资金 1,271,935,656.32 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：应收股利、应收利息、应收新股申购款、应收国债利息、其他应收款、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金以及卖出回购债券款、应付卖出回购债券款利息等。

五．基金持有人结构及前十名持有人

截止 2000 年 6 月 30 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	196,074,600	9.80%
2	中国太保	121,761,200	6.09%
3	平安保险	56,738,200	2.84%
4	中煤信托	53,217,500	2.66%
5	投资信托	36,000,000	1.80%
6	新华人寿	30,862,800	1.54%
7	久事浦东	25,527,300	1.28%
8	华泰保险	22,917,600	1.15%
9	中国电财	21,000,000	1.05%
10	丽晶新	15,520,400	0.78%

六．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《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。目前正在办理有关工商注册变更手续。

4. 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》（证监基字（1998）29 号）中有关规定及本基金管理人 1998 年 10 月 30 日公告的选择券商标准，本基金管理人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、国通证券有限责任公司、光大证券有限公司、南方证券有限公司等七家券商租用交易席位。

2000 年 1 - 6 月，各券商股票成交量及佣金情况如下：

券商名称	股票交易量	占股票总成交量比例	国债交易量	佣金	占总佣金比例
上海国际信托投资公司	336,685,464.69	13.54%	1,085,821,089.00	281,242.29	13.51%
申银万国证券股份有限公司	535,149,297.77	21.52%	212,140,260.70	445,687.37	21.41%
山东证券有限责任公司	308,163,404.33	12.39%	282,091,149.90	259,466.99	12.47%
国通证券有限责任公司	743,993,984.59	29.91%	877,039,462.60	622,672.44	29.91%
光大证券有限公司	41,342,918.44	1.66%	37,591,713.00	34,758.75	1.67%
南方证券有限公司	291,136,810.56	11.70%	431,870,612.80	244,487.76	11.75%
国信证券有限公司	230,812,466.02	9.28%	105,786,792.00	193,204.38	9.28%

七．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 1998 年度报告。
6. 安信证券投资基金 1998 年审计报告。
7. 安信证券投资基金 1999 年度报告。
8. 安信证券投资基金 1999 年审计报告。
9. 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

2000 年 8 月 29 日