

# 安信证券投资基金

2003 年度中期报告

华安基金管理有限公司

2003 年 8 月 29 日

## 重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2003 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  
天同证券有限责任公司  
(原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)

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: 庄为

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	2003 年 1-6 月
基金本期净收益	26,032,996.73 元
单位基金本期净收益	0.0130 元
基金可分配净收益	-20,772,766.46 元
单位基金可分配净收益	-0.0104 元
期末基金资产总值	2,035,604,574.09 元
期末基金资产净值	1,979,227,233.54 元
期末单位基金资产净值	0.9896 元
基金资产净值收益率	1.42%
本期基金资产净值增长率	7.66%
累计资产净值增长率	109.77%

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]
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
3. 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
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

### 本基金业绩表现

截止 2003 年 6 月 30 日, 本基金单位资产净值为 0.9896 元, 比 2002 年底单位资产净值增长 7.66%。上半年基金安信实现净收益达 2603 万元。

### 基金经理简介

王国卫先生, 经济学硕士。10 年证券从业经历, 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。现任华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部总监, 基金安信和基金安久的基金经理。

李玲女士, 经济学学士。6 年证券从业经历, 曾在金华信托投资股份有限公司投资管理部、证大投资管理有限公司投资部工作。2000 年进入华安基金管理有限公司投资部任交易员。现任基金安信和基金安久的基金经理。

## （一）基金经理工作报告

### 市场回顾和投资总结

在 2002 年年报中，我们提出 2003 年将是证券市场“复苏临近、温和增长”的一年。从市场实际运行看，我们的判断是恰当的，甚至复苏的步伐比我们预期的快，增长的幅度比我们预期的大。我们认为，证券市场正逐步朝健康的方向发展。第一，证券市场作为宏观经济晴雨表的作用在增强。上半年，在遭受突如其来的非典影响下，宏观经济仍保持较高增速，显示出中国经济内生增长的因素越来越强。证券市场及时反映了这种变化，过去几年宏观经济和证券市场经常背离的局面有所改善。第二，政策的预期影响和效应在降低。随着证券市场规模的逐年扩大，单靠政策推动市场发展已不现实。单一政策对市场的作用是短暂的、有限的。第三，投资理念的变化初步体现了证券市场资产配置的作用。上半年少数行业、少数股票表现好而多数股票表现不佳，显示理智的投资者正逐步把有限的资金配置到效率较高的行业和公司，齐涨共跌的传统受到挑战。

在坚持“精选个股，集中投资”策略的基础上，顺应市场变化和行业变化，对原有投资组合进行了较大力度的调整。1、按照资产配置的一般要求，加强对跟踪基准结构的分析，根据各行业的发展现状、潜力和行业权重，确定行业配比，以此达到超越基准、控制风险的目标。2、注意把握个股的流动性，以降低冲击成本。我们认识到，对大资金而言，退出成本要大于小资金，因此保持基金资产真实价值的一个条件就是要提高资产的流动性。因此在注重上市公司基本面的同时，必须考虑其流动性和资金吞吐容量。3、坚持有所为有所不为，果断清除基本面变差的个股，同时增加蓝筹股投资。我们认为，即便是个别股票的绝对涨幅超出多数投资者的预期，但并不表明蓝筹股泡沫已经产生，很多蓝筹股因经营业绩发生了实质性提高而使得市场定价仍处于历史定价区域的低端。经过上半年的调整，我们认为现有投资组合保持了较好的稳健性和攻击性。

### 下半年市场展望

我们仍然维持年初所做的“复苏临近、温和增长”的判断。第一，虽然经历了突发的灾害，也还会出现各种摩擦和争端，但中国宏观经济持续向好的基本条件仍然具备。第二，在宏观经济持续向好的支持下，上市公司的质量稳步提高，因此市

市场的基础趋于扎实，宏观和微观背离的现象持续改善。第三，在仍以散户为主的市场中，市场信心的恢复是逐步的、渐进的。

我们判断，上半年表现较好的行业或个股由于阶段性涨幅较大，一定程度上会影响后续参与者的心态，可能会出现阶段性表现停滞，而部分行业中的龙头股将有不错的表现。同时，受人民币升值预期和公司基本面向好影响，部分可转债也将成为重要的投资对象。从整体上看，下半年仍有盈利的机会。

## （二） 内部监察报告

### 1、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。

### 2、内部监察工作报告

本报告期内，本基金管理人在内部监察工作方面本着合规运作、保障投资者利益的角度，遵照有关法律法规、基金契约和公司内部规章进行了持续的内部监察稽核工作，对于发现的问题及时向有关部门进行反馈，并对整改情况进行跟踪复查。上半年里着重开展了以下工作：

#### 1) 对安信基金日常投资运作合法性、合规性的检查

在合规的框架下获取投资收益，是公司秉承的一贯风格。为加强对投资交易行为的监控，我们坚持严格按照有关法律法规、基金契约及其他规定，通过系统设置，自动禁止违规交易。对于基金投资比例、新股申购、交易行为、席位交易量分配等我们进行了实时监控和检查，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，采取措施加以妥善解决。

#### 2) 落实内部控制指导意见，完善公司各项业务规范

年初中国证监会颁布实施了《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》，这

为我公司全面建设与完善内部控制体系指明了方向，监察稽核部与各部门一起对现有各类规章制度开展深入讨论、整理和修订，完善了内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章和业务流程、岗位职责相结合的系统的制度架构。

### 3) 全面开展风险自我评估，对公司业务风险点进行梳理与管控

根据上半年中国证监会在基金管理公司中开展内部控制执行情况检查的要求，本基金管理人除认真完成所要求的人力资源、投资交易和关联方交易的风险评估外，还完成了与开放式基金关系最为密切的基金注册业务的风险评估。目前，我们在公司内部全面开展其他业务环节的风险点确认、风险评估、风险自查和讨论改进措施的工作。通过风险自我评估，各业务部门深入检查内部控制中存在的隐患和存在的风险点，正在有重点地制定和执行各项风险管控及改进措施，努力使风险管理工作开展更为扎实有效。

### 4) 进行各系统恢复备份演习，提高灾难应变恢复能力

为防范系统风险，信息技术部对公司各大系统均进行了系统和数据库备份，为检验备份工作的真实有效，公司监察稽核部会同信息技术部和相关业务部门开展了对重要数据库的恢复备份演习，模拟灾难发生时的情景，在尽可能短的时间内恢复系统正常运行与业务开展。通过恢复备份演习，发现了在日常备份工作存在的不足，使公司能及时填补完善备份缺陷，提高面对灾难时的公司紧急应变与恢复正常运营的能力。

### 5) 加强对各业务的提前介入，将风险化解于萌芽之中

为做好监察工作，更好地了解新产品、新业务，公司监察人员积极参与业务部门的事前讨论，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，以有针对性地采取预防措施，化解风险或减少风险可能造成的损失。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制与风险管理理念，进一步完善内控制度，提高监察稽核工作水平，充分保障基金持有人的合法权益。

## 四. 基金年度中期财务报告

## (一) 基金会计报告书 (未经审计)

安信证券投资基金

资产负债表

2003 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注	2003 年 6 月 30 日	2002 年 12 月 31 日
银行存款		5,708,609.58	38,457,668.73
清算备付金		12,745,155.08	8,337,254.23
交易保证金	3(1)	750,000.00	750,000.00
应收证券清算款	3(2)	-	7,767,833.81
应收股利		-	-
应收利息	3(3)	5,133,511.21	4,356,039.90
其他应收款	3(4)	-	30,000.00
股票投资市值	1(4)	1,408,568,799.35	1,214,825,366.31
其中: 股票投资成本	1(6)	1,497,617,613.74	1,423,174,188.33
债券投资市值	1(4)	601,996,125.70	570,220,862.90
其中: 债券投资成本	1(6)	608,720,699.01	571,813,115.37
配股权证	1(4)	702,373.17	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,035,604,574.09</b>	<b>1,844,745,025.88</b>
应付证券清算款	3(5)	491,069.65	1,877,943.36
应付管理人报酬		2,507,089.37	2,365,715.18
应付托管费		417,848.21	394,285.87
应付佣金		1,398,912.27	282,904.62
应付利息		5,600.00	-
应付收益		-	-
其他应付款	3(6)	1,274,000.00	1,250,000.00
卖出回购证券款		50,000,000.00	-
预提费用	3(7)	282,821.05	250,000.00
其他负债		-	-
<b>负债合计</b>		<b>56,377,340.55</b>	<b>6,420,849.03</b>
实收基金		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得		-95,071,014.53	-209,941,074.49

未分配收益	74,298,248.07	48,265,251.34
持有人权益合计	<b>1,979,227,233.54</b>	<b>1,838,324,176.85</b>
负债及持有人权益总计	<b>2,035,604,574.09</b>	<b>1,844,745,025.88</b>

安信证券投资基金  
经营业绩表

2003 年 1 月 1 日至 2003 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2003 年 1-6 月	2002 年 1-6 月
<b>一、收入</b>		<b>46,141,562.91</b>	<b>93,383,285.24</b>
1、股票差价收入	1(5)	17,361,382.21	30,282,909.70
2、债券差价收入	1(5)	7,563,334.17	40,269,905.77
3、债券利息收入	1(5)	9,347,181.64	13,640,630.52
4、存款利息收入	1(5)	1,191,731.73	3,150,468.15
5、股利收入	1(5)	10,557,355.65	5,295,967.26
6、买入返售证券收入	1(5)	-	513,960.00
7、其他收入	3(8)	120,577.51	229,443.84
<b>二、费用</b>		<b>20,108,566.18</b>	<b>23,326,093.99</b>
1、基金管理人报酬	2(4)	14,677,826.93	17,014,550.21
2、基金托管费	2(4)	2,446,304.55	2,835,758.38
3、卖出回购证券支出		2,670,963.70	2,144,855.60
4、利息支出		-	-
5、其他费用	3(9)	313,471.00	1,330,929.80
其中：上市年费		29,752.78	29,753.31
信息披露费		168,603.31	408,603.31
审计费用		64,464.96	149,588.57
<b>三、基金净收益</b>		<b>26,032,996.73</b>	<b>70,057,191.25</b>
加：未实现利得		114,870,059.96	23,376,294.95
<b>四、基金经营业绩</b>		<b>140,903,056.69</b>	<b>93,433,486.20</b>

安信证券投资基金  
收益分配表

2003 年 1 月 1 日至 2003 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2003 年 1-6 月	2002 年 1-6 月
-----	----	--------------	--------------

本期基金净收益	<b>26,032,996.73</b>	<b>70,057,191.25</b>
加：期初基金净收益	48,265,251.34	483,123,150.63
加：以前年度损益调整	-	1,011,908.52
可供分配基金净收益	-	<b>554,192,250.40</b>
减：本期已分配基金净收益	1(8)	460,000,000.00
期末基金净收益	<b>74,298,248.07</b>	<b>94,192,250.40</b>

安信证券投资基金

净值变动表

2003 年 1 月 1 日至 2003 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2003 年 1-6 月
一、期初基金净值		<b>1,838,324,176.85</b>
二、本期经营活动：		-
基金净收益		26,032,996.73
未实现利得		114,870,059.96
经营活动产生的基金净值变动数		<u>140,903,056.69</u>
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		-
四、期末基金净值		<b><u>1,979,227,233.54</u></b>

(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 2003 年 1 月 1 日至 2003 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：

①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。

②未上市流通的证券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；

c. 已发行未上市的债券, 按成本估值。

③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, 则估值为零。

④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。

⑤如有新增事项, 按国家最新规定估值。

#### (5) 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算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。

#### (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税范围, 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:

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。

## 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
天同证券有限责任公司	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

\*注：同一股东为上海国际信托投资公司，系基金发起人和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 2003 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	263,292,282.66	11.16%	203,363.52	10.88%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	189,890,340.24	8.05%	148,593.21	7.94%	0.08%
天同证券有限责任公司	172,115,990.13	7.30%	134,586.93	7.20%	0.08%
合计	<u>625,298,613.03</u>	<u>26.51%</u>	<u>486,543.66</u>	<u>26.02%</u>	

②本基金通过关联人席位 2003 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	861,962,864.30	23.91%	357,900,000.00	15.25%
天同证券有限责任公司	337,632,931.20	9.36%	400,000,000.00	17.04%
申银万国证券股份有限公司	200,536,734.80	5.56%	-	-
合计	<u>1,400,132,530.30</u>	<u>38.83%</u>	<u>757,900,000.00</u>	<u>32.29%</u>

(3) 本基金与关联人 2003 年 1-6 月进行的银行间市场债券回购交易情况：

关联人	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行	-	-	220,000,000.00	161,767.12

(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, 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

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。

2003 年 1 月 1 日至 6 月 30 日, 管理人收取的基金管理费金额为 14,677,826.93 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。

2003 年 1 月 1 日至 6 月 30 日, 托管人收取的基金托管费金额为 2,446,304.55 元。

3、主要报表项目说明 (单位: 人民币元)

(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	750,000.00

(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	-	7,767,833.81
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	-	-
合计		<u>7,767,833.81</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	34,014.18	58,874.73
债券利息	<u>5,099,497.03</u>	<u>4,297,165.17</u>
合计	<u>5,133,511.21</u>	<u>4,356,039.90</u>

## (4) 其他应收款:

明细项目	期末数	期初数
应收券商费用	-	30,000.00

## (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	434,211.11	-
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	<u>56,858.54</u>	<u>1,877,943.36</u>
合计	<u>491,069.65</u>	<u>1,877,943.36</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	1,250,000.00	1,250,000.00
代收券商深圳席位通讯费	<u>24,000.00</u>	-
合计	<u>1,274,000.00</u>	<u>1,250,000.00</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, 应预提计入本期的费用, 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	188,603.31	120,000.00
审计费	64,464.96	<u>130,000.00</u>
上市年费	<u>29,752.78</u>	-
合计	<u>282,821.05</u>	<u>250,000.00</u>

## (8) 其他收入:

明细项目	本期数	上期数
新股手续费返还	52,949.51	114,826.70
配股手续费返还	9,044.00	-
债券手续费返还	6,084.00	110,000.00
印花税返还	-	<u>4,617.14</u>

债券退息	<u>52,500.00</u>	-
合计	<u>120,577.51</u>	<u>229,443.84</u>

(9) 其他费用:

明细项目	本期数	上期数
返售与回购交易费用	-	53,500.00
上市年费	29,752.78	29,753.31
审计费	64,464.96	149,588.57
信息披露费	168,603.31	408,603.31
红利发放手续费	-	673,227.40
其他费用	<u>50,649.95</u>	<u>16,257.21</u>
合计	<u>313,471.00</u>	<u>1,330,929.80</u>

(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。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。

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	三一重工	03-6-23	03-07-03	35,000	544,600.00	544,600.00	上市日起流通
2	北方天鸟	03-6-24	03-07-04	24,000	230,400.00	230,400.00	上市日起流通
3	瑞贝卡	03-6-30	03-07-10	10,000	104,000.00	104,000.00	上市日起流通
合 计					<u>879,000.00</u>	<u>879,000.00</u>	

(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	----	----
B	采掘业	32,392,030.46	1.64%
C	制造业	962,502,495.81	48.63%
C0	其中：食品、饮料	45,384,848.88	2.29%
C1	纺织、服装、皮毛	170,633,200.00	8.62%
C2	木材、家具	----	----
C3	造纸、印刷	20,585,762.48	1.04%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	148,770,268.48	7.52%
C5	电子	60,796,017.68	3.07%
C6	金属、非金属	149,950,181.61	7.58%

C7	机械、设备、仪表	223,638,088.75	11.30%
C8	医药、生物制品	142,744,127.93	7.21%
C99	其他	----	----
D	电力、煤气及水的生产和供应业	109,413,279.81	5.53%
E	建筑业	----	----
F	交通运输、仓储业	122,365,124.94	6.18%
G	信息技术业	17,922,242.88	0.91%
H	批发和零售贸易	58,733,890.20	2.97%
I	金融、保险业	92,858,795.25	4.69%
J	房地产业	----	----
K	社会服务业	12,380,940.00	0.63%
L	传播与文化产业	----	----
M	综合类	----	----
	合 计	<u>1,408,568,799.35</u>	71.17%

2. 债券（不包括国债）合计

截止 2003 年 6 月 30 日,基金持有的债券(不含应收利息)合计为 194,729,613.50 元, 占基金资产净值的 9.84%。

3. 国债、货币资金合计

截止 2003 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 425,229,207.21 元, 占基金资产净值的 21.48%。

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	海欣股份	12,795,000	155,587,200.00	7.86%
2	烟台万华	7,727,497	89,716,240.17	4.53%
3	同仁堂	2,991,902	59,508,930.78	3.01%
4	宝钢股份	11,004,282	56,121,838.20	2.84%
5	恒瑞医药	5,018,400	51,338,232.00	2.59%
6	上海汽车	4,149,478	49,295,798.64	2.49%
7	海螺水泥	6,281,493	48,870,015.54	2.47%
8	中化国际	5,667,210	48,681,333.90	2.46%
9	国电电力	4,718,283	46,003,259.25	2.32%
10	安彩高科	4,678,513	44,165,162.72	2.23%
11	招商银行	3,591,460	41,122,217.00	2.08%
12	外运发展	1,805,317	34,842,618.10	1.76%
13	曙光股份	3,488,815	33,108,854.35	1.67%
14	华能国际	2,192,736	32,649,839.04	1.65%
15	双汇发展	2,415,718	31,790,848.88	1.61%
16	申能股份	2,578,927	30,328,181.52	1.53%
17	上港集箱	2,470,000	29,343,600.00	1.48%
18	珠海中富	3,968,210	28,928,250.90	1.46%
19	威孚高科	2,465,733	27,912,097.56	1.41%
20	民生银行	2,732,825	27,355,578.25	1.38%
21	盐田港 A	1,351,004	27,168,690.44	1.37%
22	金杯汽车	3,400,000	25,602,000.00	1.29%

23	浦发银行	2,100,000	24,381,000.00	1.23%
24	华泰股份	1,878,263	20,585,762.48	1.04%
25	招商局 A	1,875,340	18,959,687.40	0.96%
26	振华港机	1,612,410	17,397,903.90	0.88%
27	生益科技	1,922,284	16,992,990.56	0.86%
28	铜都铜业	2,298,420	16,456,687.20	0.83%
29	华北制药	2,631,523	16,394,388.29	0.83%
30	三爱富	1,670,825	16,123,461.25	0.81%
31	丽珠集团	1,705,454	15,502,576.86	0.78%
32	常林股份	2,002,900	15,282,127.00	0.77%
33	茉织华	1,550,000	14,942,000.00	0.75%
34	海油工程	1,037,551	14,619,093.59	0.74%
35	上海电气	1,360,636	14,341,103.44	0.72%
36	中国联通	4,243,428	13,621,403.88	0.69%
37	五粮液	1,400,000	13,594,000.00	0.69%
38	强生控股	1,587,300	12,380,940.00	0.63%
39	许继电气	1,364,186	11,895,701.92	0.60%
40	彩虹股份	1,265,064	11,562,684.96	0.58%
41	山东铝业	1,000,638	11,507,337.00	0.58%
42	上海机场	1,020,300	10,845,789.00	0.55%
43	鞍钢新轧	2,594,211	10,506,554.55	0.53%
44	华联超市	908,090	10,052,556.30	0.51%
45	格力电器	960,000	7,891,200.00	0.40%
46	中国石化	2,000,000	7,520,000.00	0.38%
47	上海石化	1,600,000	6,944,000.00	0.35%
48	巢东股份	937,536	6,487,749.12	0.33%
49	红星发展	438,714	5,896,316.16	0.30%
50	兖州煤业	603,024	5,439,276.48	0.27%
51	兰花科创	553,931	4,813,660.39	0.24%
52	广电信息	376,200	4,589,640.00	0.23%
53	波导股份	236,700	4,300,839.00	0.22%
54	中联重科	288,642	3,143,311.38	0.16%
55	白云机场	138,000	1,204,740.00	0.06%
56	中国凤凰	200,000	1,162,000.00	0.06%
57	三一重工	35,000	544,600.00	0.03%
58	长电科技	39,000	478,530.00	0.02%
59	韶能股份	50,000	432,000.00	0.02%
60	北方天鸟	24,000	230,400.00	0.01%
61	瑞贝卡	10,000	104,000.00	0.01%
合计			1,408,568,799.35	71.17%

## 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 2003 年 6 月 30 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 49,300,386.52

元，与债券（不包括国债）市值 194,729,613.50 元、股票市值 1,408,568,799.35 元和国债及货币资金 425,229,207.21 元相减后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收利息、深交所交易保证金、配股权证、其他应收款、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	浦发银行	0	6,856,816	2,500,000	7,256,816
2	白云机场	663,000	999,999	0	1,524,999
3	民生银行	0	3,109,425	0	376,600
4	中国石化	0	5,000,000	0	3,000,000
5	三一重工	35,000	0	0	0
6	兰花科创	0	553,931	0	0
7	波导股份	0	236,700	0	0
8	生益科技	0	1,922,284	0	0
9	山东铝业	0	1,000,638	0	0
10	安彩高科	0	6,341,638	0	1,663,125
11	曙光股份	0	3,688,815	0	200,000
12	巢东股份	0	937,536	0	0
13	北方天鸟	24,000	0	0	0
14	瑞贝卡	10,000	0	0	0
15	长电科技	39,000	0	0	0
16	金杯汽车	0	8,255,483	0	4,855,483
17	上海石化	0	1,600,000	0	0
18	彩虹股份	0	2,050,562	0	785,498
19	常林股份	0	2,202,900	0	200,000
20	华北制药	0	2,731,523	0	100,000
21	韶能股份	0	50,000	0	0
22	铜都铜业	0	2,598,420	0	300,000
23	鞍钢新轧	0	5,134,211	0	2,540,000

新增股票附注：本表中“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	皖通高速	373,000	0	373,000
2	中信证券	586,000	0	586,000
3	四川路桥	0	119,000	119,000
4	宇通客车	216,879	0	216,879
5	云天化	366,432	78,051	444,483
6	中青旅	1,061,725	0	1,061,725
7	厦门建发	808,102	100,000	908,102
8	上海建工	150,000	0	150,000

9	雅戈尔	0	900,000	900,000
10	冠农股份	0	23,000	23,000
11	华芳纺织	0	99,000	99,000
12	江苏舜天	306,359	0	306,359
13	航天动力	0	64,000	64,000
14	长江通信	100,000	0	100,000
15	三房巷	0	39,000	39,000
16	星马汽车	0	14,000	14,000
17	北京巴士	252,804	0	252,804
18	太工天成	0	11,000	11,000
19	安泰集团	0	71,000	71,000
20	三友化工	0	122,000	122,000
21	湘电股份	70,000	0	70,000
22	江淮汽车	0	200,000	200,000
23	中远航运	953,083	273,000	1,226,083
24	冠豪高新	0	46,000	46,000
25	片仔癀	0	24,000	24,000
26	时代新材	19,000	0	19,000
27	贵研铂业	0	26,000	26,000
28	士兰微	0	10,000	10,000
29	双良股份	0	74,000	74,000
30	中科合臣	0	18,000	18,000
31	安徽水利	0	40,000	40,000
32	上海能源	981,427	263,929	1,245,356
33	腾达建设	58,000	0	58,000
34	联环药业	0	7,000	7,000
35	第一投资	6,000	0	6,000
36	华海药业	0	24,000	24,000
37	中天科技	65,000	0	65,000
38	山东药玻	0	223,820	223,820
39	华阳科技	28,000	0	28,000
40	天士力	42,100	0	42,100
41	海通集团	0	40,000	40,000
42	北海国发	0	36,000	36,000
43	厦门钨业	8,531	0	8,531
44	方兴科技	23,000	0	23,000
45	康缘药业	21,000	0	21,000
46	高淳陶瓷	0	15,000	15,000
47	法拉电子	36,000	0	36,000
48	迪马股份	7,000	0	7,000
49	惠泉啤酒	0	54,000	54,000
50	芜湖港	0	31,000	31,000
51	庆丰股份	0	50,000	50,000
52	上海航空	173,000	0	173,000
53	光明乳业	835,767	20,000	855,767

54	北大荒	168,000	0	168,000
55	青岛啤酒	869,851	0	869,851
56	广电电子	0	4,037,025	4,037,025
57	新世界	450,800	0	450,800
58	华联商厦	1,174,548	0	1,174,548
59	新黄浦	339,483	399,259	738,742
60	大商股份	0	547,749	547,749
61	巴士股份	1,161,772	200,000	1,361,772
62	鲁抗医药	0	90,310	90,310
63	益民百货	499,400	0	499,400
64	通化东宝	109,920	0	109,920
65	伊利股份	105,273	0	105,273
66	万科A	836,939	984,551	1,821,490
67	中兴通讯	655,202	560,600	1,215,802
68	海虹控股	0	17,674	17,674
69	模塑科技	74,600	89,917	164,517
70	韶钢松山	0	2,645,400	2,645,400
71	新兴铸管	0	1,100,415	1,100,415
72	盐湖钾肥	340,923	0	340,923
73	云铝股份	1,523,555	0	1,523,555
74	辽河油田	1,200,972	110,000	1,310,972
75	扬子石化	3,950,777	2,728,400	6,679,177
76	张裕A	101,798	0	101,798
77	华菱管线	2,300,000	200,000	2,500,000
78	神火股份	84,486	50,000	134,486
79	中原油气	1,114,534	1,016,189	2,130,723

### 五. 基金持有人结构及前十名持有人

截止 2003 年 6 月 30 日, 本基金发起人持有的基金份额为 0.36 亿基金单位, 占基金发行总份额的 1.8%, 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	18,000,000	0.90%
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%
天同证券有限责任公司	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 19.64 亿基金单位, 占基金发行总份额的 98.2%。

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	74,290,997	3.71%
2	中海信托	21,094,652	1.05%
3	中国人保	20,837,900	1.04%
4	上海国投	18,000,000	0.90%
5	长江证券	12,959,500	0.65%
6	华安基金	12,000,000	0.60%
7	沈玉芳	9,880,000	0.49%
8	再保险	7,075,400	0.35%
9	云天股份	6,342,400	0.32%
10	天同证券	6,000,000	0.30%

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 2003 年 6 月 30 日基金安信前 100 名持有人名册汇总统计而来。

#### 六. 重要事项揭示

1. 本基金管理人、托管人在本期内未发生任何诉讼事项；
2. 本基金中期不分配，纳入年末一次性分配；
3. 2003 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：

##### 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	263,292,282.66	11.16%	203,363.52	10.88%
天同证券有限责任公司	172,115,990.13	7.30%	134,586.93	7.20%
招商证券股份有限公司	485,741,429.67	20.59%	392,399.60	20.99%
申银万国证券股份有限公司	189,890,340.24	8.06%	148,593.21	7.95%
光大证券有限责任公司	141,145,466.97	5.98%	113,185.83	6.05%
南方证券股份有限公司	204,950,254.68	8.69%	162,233.45	8.68%
国信证券有限责任公司	162,168,903.65	6.88%	126,180.83	6.75%
海通证券股份有限公司	243,932,783.90	10.34%	195,379.75	10.45%
大鹏证券有限责任公司	495,383,593.25	21.00%	393,616.86	21.05%
合 计	<u>2,358,621,045.15</u>	<u>100.00%</u>	<u>1,869,539.98</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
上海证券有限责任公司	861,962,864.30	23.91%	357,900,000.00	15.25%
天同证券有限责任公司	337,632,931.20	9.36%	400,000,000.00	17.04%
招商证券股份有限公司	397,347,549.90	11.02%	300,000,000.00	12.78%
申银万国证券股份有限公司	200,536,734.80	5.57%	-	0.00%
光大证券有限责任公司	137,902,987.70	3.82%	130,000,000.00	5.53%
南方证券股份有限公司	186,476,060.60	5.17%	149,000,000.00	6.35%
国信证券有限责任公司	331,034,436.70	9.18%	300,000,000.00	12.78%
海通证券股份有限公司	329,766,579.30	9.15%	180,000,000.00	7.67%
大鹏证券有限责任公司	822,946,823.30	22.82%	530,500,000.00	22.60%
合 计	3,605,606,967.80	100.00%	2,347,400,000.00	100.00%

## 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

二零零三年八月二十九日