

安顺证券投资基金

2000 年年度报告

华安基金管理有限公司

2001 年 3 月 28 日

重要提示

本基金的托管人交通银行已于 2001 年 3 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: 安顺证券投资基金
(简称: 基金安顺)
- 交易代码: 500009
- 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
浙江证券有限责任公司
华安基金管理有限公司
- 基金发行日期: 1999 年 6 月 9 日
- 基金成立日期: 1999 年 6 月 15 日
- 基金单位总份额: 30 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: 1999 年 6 月 22 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
(邮政编码: 200120)
- 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: 交通银行
- 注册及办公地址: 上海市仙霞路 18 号
(邮政编码: 200336)
- 法定代表人: 方诚国
- 托管部负责人: 谢红兵
- 信息披露负责人: 江永珍
- 电话: 021-62082517
- 传真: 021-62759266
- (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

	2000 年	1999 年 6 月至 12 月
基金可分配净收益：	993,252,169.80 元	110,858,804.36 元
单位基金可分配净收益：	0.3311 元	0.0370 元
期末基金资产总值：	5,277,351,745.97 元	3,134,941,598.18 元
期末基金资产净值：	4,778,461,832.53 元	3,112,258,685.56 元
单位基金资产净值：	1.5928 元	1.0374 元
基金资产净值收益率：	32.83%	3.70%
本期基金可分配收益率：	33.03%	3.70%
本期基金净值增长率：	58.90%	3.74%
基金累计净值增长率：	62.78%	3.74%

基金配售新股政策停止前所获配售新股对单位基金的贡献为 0.1266 元，扣除此因素后的本期基金净值增长率为 46.27%。

三. 基金管理人报告

本基金业绩表现

截止 2000 年 12 月 31 日，基金单位资产净值达到 1.5928 元，年净值增长率为 58.90%，超过同期银行存款利率和同期沪深指数涨幅。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 46.27%，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、稳健操作”的原则，合理分配成长类股票和收益类股票的投资比例，通过基金仓位和品种结构的动态调整，严格控制市场风险和个股风险，力争为基金持有人谋求长期、稳定的投资收益。

基金经理简介

尚志民先生，基金经理，硕士。6 年证券从业经验，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，担任基金经理前为华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员。

李匆先生，基金经理，管理学博士。7 年证券从业经验，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、安信基金基金经理助理等职。

(一) 基金经理工作报告

2000 年中国证券市场继续演绎牛市行情，两市综合指数较去年末平均涨幅 54.91%，列全球前茅，为世界注目。宏观经济的转好，市场政策的变化和资金供给的空前充裕，成为推动股市上扬的主要因素。与往年相比，新千年的股票市场出现了一些新的变化，概括起来主要有以下几点：

一、 证券监管思路发生变化。年初证券管理层结合国内股市十年发展现状，提出促进市场化程度、超常规发展机构投资者、加快证券市场的国际化进程等新的监管思路，并陆续出台一系列具体措施，对增强市场信心、拓宽资金渠道起到积极作用，为全年股市的走强奠定了基础。

二、 一级市场空前繁荣。作为市场化的主要切入点，新股发行办法发生重大变化，从上网发行到二级市场市值配售，从战略投资到一般到法人配售，从定价发行到机构市场化定价等等，促使新股认购市场的空前活跃。一级市场的火爆场面以及新股上市以后的良好表现，成为 2000 年中国证券市场的一道奇观。

三、 市场结构出现调整。虽然以机构为主的长线资金比重增加，但在两市股指新高叠创的同时，投资者高位避险的心态较为普遍，短线操作氛围浓厚。市场缺乏持续热点，成交量不温不火，以前普涨或轮涨的局面不复存在，个股和板块的差异性显著提高，“赚指数、赔个股”的现象普遍存在。

四、 与国际市场的联系日趋紧密。新千年全球网络股和科技股出现持续调整，受油价和生资价格上涨影响，传统行业出现复苏或转机，反映到资本市场上，轻概念、重业绩的价值型投资理念又受青睐。国内市场也几乎同步出现变化，国内市场在对外开放之前理念上已与国际市场部分“接轨”。

面对市场形势的变化，结合基金的具体情况，本年度我们对安顺基金主要进行了以下三方面的调整：

一、 组合结构的调整。顺应市场趋势，降低了网络股和科技股的持仓比重，逐步增持了传统行业中以石油化工、交通运输、纺织服装等为代表的绩优类个股的比重。

二、 新股投资策略的调整。结合新的发行办法，调整了新股投资策略，改进了新股研究、投资的内部流程，在合理控制新股投资风险的前提下，加大了新股投资力度。

三、 债券投资策略的调整。基于利率走势、国债市场状况和国债回购政策的变化，调整债券投资策略，增加了银行间债券市场的国债投资比重，并通过回购提高资金使用效率。同时，尝试性地对可转换债券进行了少量投资。

通过上述调整，安顺基金 2000 年取得了较好的收益，全年净值增长率 58.90%，超过同期大盘的平均涨幅。但是，2000 年的投资中也存在许多遗憾之处，比如对科技股波段操作不太理想；投资策略比较单一，市场应变能力一般；投资新品种的开发工作也有待加强等，我们会在以后的运作中加以改进。

2000 年证券市场在快速发展的同时也暴露出许多问题，虽然股市中的问题不可能完全通过股市来解决，但市场制度和秩序方面的缺陷需要花力气来解决，否则将妨碍股市的长远发展。我们认为 2001 年中国股市主线将是整顿规范和解决历史遗留问题，市场的整体涨幅超过 2000 年的概率不大，“注重安全、崇尚业绩”将成为投资中需把握的两大重点。市场信息披露制度的日趋规范、上市公司的摘牌试点、新股的市场化发行、开放式基金的成立、世界贸易组织的加入、证券市场的对外开放试点以及国有股的减持、创业板的推出等，会给新一年的证券市场增添诸多变数，其中的机会和风险将相生相伴。日趋规范的市场环境，对新基金的运作将更加有利。

在新的一年里，我们将秉持“成长与价值并重”的投资理念，在继续看好行业前景广阔、具有较强竞争能力的科技类个股的同时，对传统产业中基本面良好、具有市场、品牌或资源等优势的行业领导性企业，以及加入 WTO 后将面临重大变革或发展机遇的企业也会给予充分关注。出于安全性的考虑，我们会适当提高对企业资产流动性和股票流动性的要求。在坚持“长期投资、稳健运作”原则基础上，增加对阶段性市场机会的把握，通过更耐心、深入、细致的工作，积跬步以至千里，以更好的业绩回报投资者的厚爱。

（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、《安顺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、对安顺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，监察安顺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，安顺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。在各业务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，使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

2000 年度，安顺证券投资基金（以下简称“安顺基金”）的托管人——交通银行，严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则的规定，依据《安顺证券投资基金契约》和《安顺证券投资基金托管协议》中的条款，认真履行基金托管人的各项职责，安全保管安顺基金的所有资产，做好安顺基金的投资监管和清算核算工作，切实维护广大基金持有人的合法权益，未发生任何损害基金持有人利益的事件和行为。

2000 年度，基金管理人严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约和其它有关法规的规定，基金托管人未发现基金管理人在投资运作中有损害基金持有人利益的行为。基金托管人确认，由基金管理人在 2000 年度编制和披露的安顺基金每日资产净值、每周资产净值公告、每季度投资组合公告、中期财务报告等有关基金信息是合法、真实和完整的。

五. 基金年度财务报告

（一） 审计报告

审 计 报 告

华业字(2001)第 626 号

安顺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《安顺证券投资基金契约》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

中国注册会计师：吴 蓉

中国·上海·昆山路 146 号

2001 年 2 月 24 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：	2,378,337,621.20	2,545,116,715.71
股票投资—估值增值：	4,060,906.33	783,597,223.37
债券投资—成本：	628,848,894.13	1,028,641,537.84
债券投资—估值增值：	-2,661,025.13	1,612,439.36
银行存款：	109,703,601.24	700,872,252.87
应收利息：	141,185.71	7,980,601.44
应收帐款：	16,081,388.18	208,818,594.11
其他应收款项：	429,026.52	712,381.27
基金资产总额：	<u>3,134,941,598.18</u>	<u>5,277,351,745.97</u>
应付基金管理费及业绩报酬：	3,935,621.35	9,170,439.19
应付基金托管费：	655,936.90	997,981.47
应付帐款：	17,419,751.75	17,445,650.53
卖出回购债券款：	—	470,000,000.00
应付佣金：	418,602.62	809,513.51
其他应付款项：	253,000.00	466,328.74
负债总额：	<u>22,682,912.62</u>	<u>498,889,913.44</u>
基金单位总额：	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配净收益：	110,858,804.36	993,252,169.80
未实现估值增值：	1,399,881.20	785,209,662.73
基金资产净值：	<u>3,112,258,685.56</u>	<u>4,778,461,832.53</u>
基金单位发行总份额：	3,000,000,000	3,000,000,000
每份基金单位资产净值：	1.0374	1.5928

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：	7,923,267.17	5,172,028.22
债券利息收入：	14,024,264.64	1,562,075.60
股票买卖价差收入：	1,032,031,458.99	109,518,211.89
债券买卖价差收入：	3,319,311.80	1,089,656.25

其他收入:	17,790,379.22	24,005,462.72
管理费及业绩报酬:	65,948,302.08	26,097,400.21
其中: 基金管理费:	62,760,607.87	26,097,400.21
业绩报酬:	3,187,694.21	—
基金托管费:	10,757,075.51	4,349,566.71
应由基金承担的其他费用:	10,989,938.79	41,663.40
基金净收益:	987,393,365.44	110,858,804.36
上年末未分配净收益:	110,858,804.36	—
本期已分配收益:	105,000,000.00	—
期末未分配净收益:	993,252,169.80	110,858,804.36

(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制的配售新股)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

证券买卖价差收入: 在交易成交日, 按实际成交价与帐面成本的差额确认。

股息收入: 在被投资股票股权除息日确认。

债券利息收入:

①已上市国债在被投资国债除息日确认。

②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票面利率确认利息收入

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结转成本。

(7) 税项

依据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金有关税收问题的通知》的有关规定, 对基金管理人运用基金资产买卖股票按 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, 暂不征收营业税和企业所得税。

(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，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
交通银行	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
申银万国证券股份公司	管理公司发起人	租用交易席位	席位使用协议
浙江证券有限责任公司	管理公司股东 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
东方证券有限责任公司	管理公司股东	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	475,199,808.14	9.56%	399,944.70	9.78%	0.08%
申银万国证券股份公司	766,860,923.91	15.44%	638,298.99	15.60%	0.08%
山东证券有限责任公司	221,736,560.77	4.46%	186,384.39	4.56%	0.08%
浙江证券有限责任公司	606,804,816.29	12.21%	500,375.24	12.23%	0.08%
东方证券有限责任公司	1,118,118,893.33	22.51%	893,848.98	21.85%	0.08%
合 计	3,188,721,002.44	64.18%	2,618,852.30	64.02%	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	14,141,881.34	0.31%	12,020.78	0.32%	0.09%
申银万国证券股份公司	3,103,822,604.73	68.31%	2,592,678.71	68.32%	0.08%
浙江证券有限责任公司	460,166,232.83	10.13%	386,981.45	10.20%	0.08%
合 计	3,578,130,718.90	78.75%	2,991,680.94	78.84%	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	比例	回购年成交量	比例
申银万国证券股份公司	142,870,487.30	4.27%	—	—
上海国际信托投资公司	162,705,602.30	4.86%	165,000,000.00	16.25%
山东证券有限责任公司	998,107,851.90	29.82%	514,600,000.00	50.66%

浙江证券有限责任公司	367,458,019.40	10.98%	133,100,000.00	13.10%
东方证券有限责任公司	16,885,100.00	0.50%	13,000,000.00	1.28%
合 计	1,688,027,060.90	50.43%	825,700,000.00	81.29%

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	比例	回购年成交量	比例
申银万国证券股份有限公司	534,333,618.10	34.76%	292,900,000.00	100%
浙江证券有限责任公司	157,191,743.70	10.23%	—	—
合 计	691,525,361.80	44.99%	292,900,000.00	100%

(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,本基金成立三个月后,若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%,超出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人报酬

E 为前一日的基金资产净值(扣除本基金持有现金比例超过 20%部分的基金资产净值)

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 62,760,607.87 元。1999 年管理人收取的基金管理费金额为 26,097,400.21 元。

②基金管理人业绩报酬

本基金在本会计年度按照《安顺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 3,187,694.21 元(1999 年: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。

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

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

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

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

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

$$\text{本年度已卖出配售新股实现收益}$$

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

$$\text{本年度配售新股对基金净值的影响}$$

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

$$2000 \text{ 年安顺基金计提的业绩报酬为 } 3,187,694.21 \text{ 元}$$

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：

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

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 10,757,075.51 元。1999 年托管人收取的基金托管费金额为 4,349,566.71 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 208,818,594.11 元，是应收股票清算款。由以下二项组成：上海应收交易资金 186,224,252.43 元；深圳应收交易资金 22,594,341.68 元。

(2) 其他应收款项 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 712,381.27 元，是深圳证券交易所交易保证金款项。

(3) 应收利息 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 7,980,601.44 元，由以下三项组成：应收银行存款利息 135,755.06 元；应收交易保证金利息 254,680.69 元；应收国债利息 7,590,165.69 元。

(4) 应付帐款 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 17,445,650.53 元，是上海应付交易资金和深圳应付交易资金。由以下二项组成：上海应付交易资金 9,047,265.07 元；深圳应付交易资金 8,398,385.46 元。

(5) 其他应付款 2000 年 12 月 31 日余额为人民币 466328.74 元，由以下二项组成：卖出回购证券款计提的应付利息 216,328.74 元；暂收款 250,000.00 元。

(四) 流通受限资产明细

本基金流通受限、不能自由转让的资产为认购的配售新股与配股。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 150,219,000.00 元，已上市但流通受限的配股估值增值额为 10,035,149.06 元。

1. 申购新股部分

序号	股票名称	申购日期	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
1	上港集箱	00-6-23	00-7-19	12,220,000	146,395,600.00	286,192,400.00	00-7-11起12个月
2	宝钢股份	00-11-15	00-12-12	8,405,000	35,132,900.00	45,555,100.00	01-3-1起流通
3	烟台万华	00-12-15	01-1-5	499,000	5,628,720.00	5,628,720.00	01-1-5起流通
4	西藏天路	00-12-25	01-1-16	189,000	1,300,320.00	1,300,320.00	01-1-16起流通
5	天通股份	00-12-26	01-1-18	53,000	476,470.00	476,470.00	01-1-18起流通
6	宁沪高速	00-12-28	01-1-16	191,000	802,200.00	802,200.00	01-1-16起流通
7	天科股份	00-12-25	01-1-11	87,000	572,460.00	572,460.00	01-1-11起流通
8	金瑞科技	00-12-20	01-1-15	158,000	2,368,420.00	2,368,420.00	01-1-15起流通
9	龙电股份	00-12-6	01-2-16	2,894,736	44,289,460.80	44,289,460.80	00-12-7起4个月
10	京东方A	00-12-15	01-1-12	482,550	8,106,840.00	8,106,840.00	01-1-12起流通
合计					245,073,390.80	395,292,390.80	----

2. 配股部分

名 称	除权日	上市日	数 量	成 本	市 值	流通受限期
新太科技	00-12-8	01-1-17	75,467	1,358,406.00	1,719,138.26	01-1-17 起流通
法尔胜	00-12-13	01-2-13	1,343,669	18,811,366.00	28,485,782.80	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	360,052,866.62	7.54%
能源电力类	47,463,460.80	0.99%
建材建筑类	5,856,130.00	0.12%
冶金类	212,098,927.60	4.44%
机械制造类	353,642,097.45	7.40%
电子通讯类	1,226,656,397.70	25.67%
化工类	269,042,511.81	5.63%
医药类	181,782,693.08	3.80%
汽车及配件制造类	68,164,911.03	1.43%
纺织服装类	304,822,921.29	6.38%
家电类	21,645,313.20	0.45%
酿酒食品类	131,807,500.00	2.76%
商贸旅游类	66,002,588.50	1.38%
金融地产类	10,840,580.00	0.23%
综合类	68,835,040.00	1.44%
合 计	3,328,713,939.08	69.66%

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 21,308,585.20 元，占基金资产净值的 0.45%。

3、国债、货币资金合计

截至 2000 年 12 月 31 日，基金持有的国债及货币资金合计为 1,901,190,588.45 元，占基金资产净值的 39.79%。

4、基金投资的股票明细

序 号	名 称	数 量	市 值	占净值比例(%)
1	东方电子	27463902	527,581,557.42	11.04%
2	上港集箱	12220000	286,192,400.00	5.99%
3	许继电气	9865198	200,658,127.32	4.20%
4	中原油气	12054619	185,038,401.65	3.87%
5	海欣股份	10407049	172,028,519.97	3.60%
6	大唐电信	5333605	164,915,066.60	3.45%

7	法尔胜	7744123	164,175,407.60	3.44%
8	环保股份	8739631	160,721,814.09	3.36%
9	五粮液	3100000	122,233,000.00	2.56%
10	雅戈尔	7301464	106,236,301.20	2.22%
11	清华同方	2384237	105,597,856.73	2.21%
12	上菱电器	5166256	102,808,494.40	2.15%
13	超声电子	5554717	77,710,490.83	1.63%
14	上海汽车	5619531	68,164,911.03	1.43%
15	中联重科	2557014	63,081,535.38	1.32%
16	上海医药	2803340	56,851,735.20	1.19%
17	长江通信	1059000	48,788,130.00	1.02%
18	恒瑞医药	1606872	48,174,022.56	1.01%
19	青旅控股	2150000	46,805,500.00	0.98%
20	宝钢股份	8405000	45,555,100.00	0.95%
21	龙电股份	2894736	44,289,460.80	0.93%
22	星湖科技	2445000	40,220,250.00	0.84%
23	首创股份	1780000	38,572,600.00	0.81%
24	盐湖钾肥	1884683	35,846,670.66	0.75%
25	宏图高科	2029810	35,379,588.30	0.74%
26	星新材料	1835050	33,379,559.50	0.70%
27	中信海直	1295276	31,565,876.12	0.66%
28	安彩高科	1123957	30,436,755.56	0.64%
29	上实联合	1482000	30,262,440.00	0.63%
30	招商局A	2001175	28,936,990.50	0.60%
31	佛山照明	1689720	21,645,313.20	0.45%
32	中化国际	1096350	19,197,088.50	0.40%
33	海正药业	485200	16,307,572.00	0.34%
34	赣粤高速	715000	12,555,400.00	0.26%
35	振华港机	808062	11,385,593.58	0.24%
36	波导股份	363500	11,257,595.00	0.23%
37	民生银行	631000	10,840,580.00	0.23%
38	鲁泰A	595992	10,334,501.28	0.22%
39	张裕A	390000	9,574,500.00	0.20%
40	南山实业	541800	9,075,150.00	0.19%

41	佛塑股份	565000	8,576,700.00	0.18%
42	万杰实业	643469	8,416,574.52	0.18%
43	京东方A	482550	8,106,840.00	0.17%
44	兰光科技	279900	8,016,336.00	0.17%
45	新太科技	327023	7,449,583.94	0.15%
46	宁波韵升	252000	7,408,800.00	0.15%
47	仕奇实业	439634	7,148,448.84	0.15%
48	龙净环保	278000	6,218,860.00	0.13%
49	南京医药	410160	6,021,148.80	0.13%
50	昆明制药	209000	5,791,390.00	0.12%
51	烟台万华	499000	5,628,720.00	0.12%
52	中恒集团	259000	4,555,810.00	0.09%
53	神州股份	300000	3,174,000.00	0.07%
54	金瑞科技	158000	2,368,420.00	0.05%
55	纵横国际	100000	2,017,000.00	0.04%
56	西藏天路	189000	1,300,320.00	0.03%
57	宁沪高速	191000	802,200.00	0.02%
58	天科股份	87000	572,460.00	0.01%
59	天通股份	53000	476,470.00	0.01%
60	中信国安	10000	282,000.00	0.01%
	合 计		3,328,713,939.08	69.66%

5、基金投资组合报告附注

(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 469,563,585.99 元，业绩报酬为贷方余额 3,187,694.21 元，抵减股票市值 3,328,713,939.08 元、债券（不包括国债）21,308,585.20 元、国债及货币资金 1,901,190,588.45 元后等于基金净值。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、应付托管费、应付券商佣金、其他应付款以及卖出回购债券款、应付卖出回购债券利息等。

(4) 本投资组合与 2001 年 1 月 19 日公布的第 4 号投资组合公告之差异系计提业绩报酬之影响。

(六) 本期新增股票

股票名称	本期买入					本期卖出
	政策性配售	一级市场认购	增发	二级市场买入	送股 配股	
招商局A			1800000	201175		
中信海直				1295276		
中联重科		284000		2273014		
佛山照明			1689720			
京东方A			482550			
鲁泰A			675992			80000
中信国安				10000		
张裕A			524721			134721
神州股份	1845000					1545000
佛塑股份	1130000					565000
兰光科技	559800					279900
首创股份	3560000					1780000
民生银行		631000				
上港集箱		12220000				
宝钢股份		8405000				
波导股份		500000				136500
安彩高科				1849957		726000
仕奇实业	879267					439633
中恒集团		259000				
海正药业		149000		336200		
赣粤高速	1430000					715000
恒瑞医药		174000		1432872		
星新材料	950000			885050		
烟台万华		499000				
振华港机			205212	602850		
西藏天路		189000				
天通股份		53000				
长江通信		339000		720000		
宁波韵升		252000				
宁沪高速		191000				
天科股份		87000				
龙净环保		278000				

金瑞科技	158000				
昆明制药	209000				
上实联合		1482000			
南京医药			410160		
龙电股份		2894736			
新太科技			336556	75467	85000
上菱电器			7298553		2132297
海欣股份		4961240	5445809		
纵横国际		882613			782613
星湖科技			2445000		

(七) 本期剔除股票

股票名称	本期买入					本期卖出
	债转股	一级市场 认购	增发	二级市场 买入	送股 配股	
深康佳A					324252	5544415
大亚股份						2330915
金陵药业						947453
小鸭电器						771400
广济药业						468750
河池化工						428600
欣龙无纺						472000
首钢股份						1024550
锡业股份						1671426
大连金牛						2460500
东方钨业				209200	350560	997960
华东医药						674200
浦发银行						6858000
秦岭水泥						600000
海南航空						3542000
赤天化						943800
海南椰岛						428600
真空电子				5591243	291429	18502566
电器股份						2882715
龙头股份						2259835

中大股份					9335361	
巴士股份			80000	1567658	338940	8878264
综艺股份			2485475			10734334
特发信息	831683					831683
广聚能源	255000					255000
麦科特	343000					343000
中成股份	276000					276000
川化股份	283000					283000
安塑股份	144000					144000
常山股份	288000					288000
国际实业	291000					291000
丝绸股份	1260000					1260000
晨鸣纸业		251813				251813
银基发展		1000000				1000000
经纬纺机		3000000				3000000
中色建设			10000			10000
鞍钢新轧	2244848					2244848
电广传媒		750000				750000
天水股份	831683					831683
长源电力	1069200					1069200
安泰科技	712900					712900
中科三环			388680			388680
湖北迈亚	653400					653400
乌江电力	960000					960000
春晖股份	831700			332680		1164380
浪潮信息	772300					772300
金马股份	680200					680200
圣雪绒	127000					127000
大庆华科	133000					133000
广州友谊	173000					173000
九芝堂	173000					173000
诚志股份	220000					220000
皇台酒业	113000					113000
捷利股份	255000					255000
新大陆	49000					49000

隆平高科	645000		645000
太极集团		103225	103225
东湖高新		717359	125762 843121
青岛碱业	1192000		1192000
沧州大化	950000		950000
凌钢股份	1256000		1256000
民丰特纸	615255		615255
桂冠电力	1220000		1220000
辽宁时代	189000		189000
华龙股份	472000		472000
青海华鼎	520000		520000
先锋股份	150000		150000
物华股份	129000		129000
鑫科新材	51000		51000
广汇股份	594059	297030	891089
首旅股份	950000		950000
兴业聚酯	832000		832000
凯乐科技	56000		56000
浙江阳光	85000		85000
北方股份	246000		246000
路桥建设	254000		254000
景谷林业	191000		191000
武昌鱼	280000		280000
亿利科技	360000		360000
东方创业	112000		112000
重庆港九	253000		253000
太化股份	381000		381000
南钢股份	207000		207000
钱江水利	133000		133000
羚锐股份	115000		115000
苏福马	146000		146000
西水股份	276000		276000
九龙电力	119000		119000
三峡新材	133000		133000
安琪酵母	128000		128000

维维股份	150000	150000
南化股份	115000	115000
曙光股份	213000	213000
商业城	215000	215000
华泰股份	151000	151000
巢东股份	123000	123000
兰太实业	215000	215000
长燃股份	119000	119000
美克股份	104000	104000
珠峰摩托	173000	173000
国旅联合	86000	86000
五洲交通	363000	363000
广电股份		679564
交运股份	570513	570513
国电电力		220000
悦达投资	2850000	2850000

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 0.3 亿基金单位, 占基金发行总份额的 1%, 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	7,500,000	0.25%
山东证券有限责任公司	7,500,000	0.25%
浙江证券有限责任公司	7,500,000	0.25%
华安基金管理有限公司	7,500,000	0.25%

社会公众持有的基金份额为 29.7 亿基金单位, 占基金发行总份额的 99%。

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	289,016,000	9.63%
2	中国太保	177,458,800	5.92%
3	广发质押	76,473,700	2.55%
4	再保险	73,172,400	2.44%
5	华泰保险	60,200,000	2.01%
6	平安保险	59,095,500	1.97%
7	广发质押	47,750,100	1.59%

8	平安保险	35,769,300	1.19%
9	平安保险	31,430,200	1.05%
10	平安保险	24,566,100	0.82%

七. 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. 本基金管理人于 2000 年 7 月 18 日发布安顺基金管理人《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 日发布安顺基金管理人《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. 各券商年成交量及年佣金情况如下：

①股票交易情况：

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	475,199,808.14	9.56%	399,944.70	9.78%
申银万国证券股份公司	766,860,923.91	15.44%	638,298.99	15.60%
浙江证券有限责任公司	606,804,816.29	12.21%	500,375.24	12.23%
华夏证券有限责任公司	1,339,809,686.41	26.97%	1,117,855.02	27.33%
山东证券有限责任公司	221,736,560.77	4.46%	186,384.39	4.56%
南方证券有限责任公司	439,743,867.11	8.85%	353,769.90	8.65%
东方证券有限责任公司	1,118,118,893.33	22.51%	893,848.98	21.85%
合 计	4,968,274,555.96	100.00%	4,090,477.22	100.00%

②国债及回购交易情况：

券商名称	国债年成交量	比例	回购年成交量	比例
申银万国证券股份公司	142,870,487.30	4.27%	—	—
上海国际信托投资公司	162,705,602.30	4.86%	165,000,000.00	16.25%
山东证券有限责任公司	998,107,851.90	29.82%	514,600,000.00	50.66%

浙江证券有限责任公司	367,458,019.40	10.98%	133,100,000.00	13.10%
华夏证券有限责任公司	1,496,794,860.40	44.71%	70,000,000.00	6.89%
南方证券有限责任公司	162,650,076.70	4.86%	120,000,000.00	11.82%
东方证券有限责任公司	16,885,100.00	0.50%	13,000,000.00	1.28%
合 计	3,347,471,998.00	100%	1,015,700,000.00	100%

八. 备查文件目录

1. 中国证监会批准安顺证券投资基金设立的文件。
2. 《安顺证券投资基金基金契约》。
3. 《安顺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. 安顺证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注。
6. 安顺证券投资基金 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

二〇〇一年三月二十八日