

华安创新证券投资基金

2003 年中期报告

华安基金管理有限公司

2003 年 8 月 29 日

重要提示

本基金的托管人交通银行已于 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: 华安创新证券投资基金
(简称: 华安创新)

交易代码: 040001
深交所行情代码: 160401
基金发起人: 华安基金管理有限公司
基金发行日期: 2001 年 9 月 11 日
基金成立日期: 2001 年 9 月 21 日
首次募集规模: 5,000,001,124 份
基金类型: 契约型开放式
基金存续期: 无限期

(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: 交通银行
注册地址: 上海市仙霞路 18 号
办公地址: 上海市银城中路 188 号 (邮编: 200120)
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： 021-58408846
传 真： 021-58408836

(四) 会计师事务所： 普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址： 上海市浦东新区东昌路 568 号
(邮编： 200120)
办公地址： 上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼
(邮编： 200021)
法定代表人： Kent Watson
经办注册会计师： 肖峰、陈玲

二、主要财务指标

项 目	2003 年 1-6 月	2002 年 1-6 月
基金本期净收益	79,572,987.12 元	160,264,312.95 元
单位基金本期净收益	0.0224 元	0.0354 元
基金可分配净收益	-81,888,019.06 元	82,424,998.50 元
单位基金可分配净收益	-0.0230 元	0.0182 元
期末基金资产总值	3,522,489,173.66 元	5,128,053,261.03 元
期末基金资产净值	3,473,083,722.94 元	4,750,236,472.58 元
单位基金资产净值	0.977 元	1.050 元
基金资产净值收益率	1.88%	3.16%
本期基金资产净值增长率	8.61%	6.01%
累计资产净值增长率	1.66%	7.28%

上述部分指标计算公式：

基金可分配净收益 = 期末基金未分配收益 + MIN[0,期末未实现利得]

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

本期基金净值增长率 = (分红或扩募前单位净值/期初单位净值) * (期末单位净值/分红或扩募后单位净值) - 1

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) * (第 3 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

基金经理简介：

尚志民先生：基金投资部总监助理，工商管理硕士，9 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，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，基金安顺、基金安瑞基金经理。

刘耀军先生：美国杜兰大学工商管理硕士，美国投资管理与研究协会会员，特许金融分析师（CFA）。9 年证券从业经历。曾在广发证券、美国所罗门兄弟（香港）有限公司研究部、美国环球投资管理公司工作。进入华安基金管理有限公司后曾担任研究发展部高级研究员。

孙正女士：经济学硕士，8 年证券从业经历，曾先后任职于中教信证券交易部、投资银行部、研究发展部。1999 年进入华安基金管理有限公司，任华安基金管理有限公司北京分公司总经理。

（一）基金经理工作报告

2003 年上半年，华安创新基金单位净值增幅为 8.61%，同期上证指数上升了 9.46%，深圳综指上升了 4.78%，两个市场平均上涨 7.12%。华安创新不仅实现了资产增值，而且跑赢了同期指数。在红利分配方面，基金上半年向全体基金持有人按每 10 份基金单位派发现金红利 0.18 元。

在经历了 2002 年的大幅调整之后，上半年股票市场显示出了恢复上涨势头。尤其值得关注的是市场出现的有别于以往行情的深刻变化，即宏观经济及行业层面的积极因素非常鲜明地反映到股票市场中的股价结构大调整中，而理性投资、价值投资的理念得到了前所未有的认同和充分演绎。1 月份的突发上涨给了我们一个调整持仓结构重新部署的机会。2、3 月份，我们加快了向石化、钢铁、汽车、银行、电力等行业的配置速度，并顺应市场加大了投资的集中度。尽管期间行情曾受到 SARS 疫情的意外影响，基金净值仍稳步增长。在上半年的操作中也有不少遗憾和失误：

1. 尽管重视股票仓位控制，但年初在行业配置上不够积极主动，造成之后的调整成本较高；
2. 顾虑实现亏损致使个股调整不够坚决果断，错失了不少减亏时机，在行情发展过程中有效仓位不足；
3. 强调开放式基金的分散投资，未充分发挥我们传统的集中投资、重点投资特长，没有适应上半年部分股票强势上涨的市场环境。

上半年我国 GDP 增长继续保持 8.2% 的高速度，对比国际范围内的大环境，我国宏观经济对股票市场的支持程度也是显而易见。尤其是我们预期汽车、电力、钢铁、港口等行业仍将维持较快的增长速度。在资金面上，诸如证券投资基金、社保基金、QFII 等的陆续入市，为证券市场提供了稳定的、长期的增量资金。而广大投资者对上市公司基本面的越加注重，有助于市场的投资理念进一步向价值推动型发展，流动性强的绩优成长性股票将更受青睐。

我们认为国内股票市场在逐步成熟、开放的大背景下，行业和个股表现将继续呈现差异加剧的局面。我们仍将重点投资高速成长行业的蓝筹股，不断将价值低估的股票纳入投资组合，争取以良好的业绩回报投资者。

（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、《开放式证券投资基金试点办法》、《华安创新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、保障投资者利益的原则，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) 对华安创新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

去年年底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、岗位职责相结合的制度体系。

3) 全面开展风险控制自我评估，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风险控制自我评估的要求，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，我们在公司内部分阶段推进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，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中

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营运的能力。

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、托管人报告

2003 年上半年，交通银行在华安创新证券投资基金的托管业务中，严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》及其实行准则的规定，依据《华安创新证券投资基金基金契约》和《华安创新证券投资基金托管协议》中的条款和其他有关规定，依法安全保管了基金的全部资产，勤勉尽责地履行了基金托管人的义务，不存在损害基金持有人利益的行为。

2003 年上半年，按照《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》及实施准则、基金契约、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人——华安基金管理有限公司在华安创新证券投资基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值、基金单位净值和其他财务费用计算上进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金持有人利益的行为。

2003 年上半年，由华安创新证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司编制并经交通银行基金托管部复核审查的有关华安创新证券投资基金的信息披露合法、真实、完整。

五、基金财务报告（未经审计）

（一）基金会计报告书

1. 资产负债报告书

项 目	附注	2003 年6 月30 日	2002 年12 月31 日
资产：			
银行存款		19,349,479.54	119,414,302.77
清算备付金		123,319,067.81	745,349,406.22
交易保证金		1,261,462.78	1,304,879.14
应收证券清算款		228,494,380.78	--
应收股利		--	--

应收利息	3(1)	10,628,025.70	7,623,045.76
应收申购款		176,990.00	71,708.00
股票投资市值	1(3)	2,292,985,388.05	2,412,703,574.35
其中：股票投资成本		2,395,155,600.78	2,833,540,056.56
债券投资市值	1(4)	845,767,904.00	1,059,581,673.10
其中：债券投资成本		852,568,523.68	1,061,738,698.97
配股权证		506,475.00	--
其他应收款		--	20,000.00
资产合计		<u>3,522,489,173.66</u>	<u>4,346,068,589.34</u>

负债：

应付证券清算款		29,518,683.39	43,250,207.49
应付赎回款		9,479,214.05	1,710,537.27
应付赎回费		55,222.86	105,741.52
应付管理人报酬		4,503,284.58	5,674,823.57
应付托管费		750,547.42	945,803.91
应付佣金		4,485,511.35	850,895.37
其他应付款		250,000.00	500,000.00
预提费用		362,987.07	276,000.00
负债合计		<u>49,405,450.72</u>	<u>53,314,009.13</u>

所有者权益：

实收基金	1(9)3(2)	3,554,971,742.00	4,685,440,851.00
未实现利得	1(10)3(5)	-104,939,675.10	-407,364,130.26
未分配收益		23,051,656.04	14,677,859.47
持有人权益合计		<u>3,473,083,722.94</u>	<u>4,292,754,580.21</u>
基金份额		3,554,971,742	4,685,440,851
每份基金单位资产净值		0.977	0.916

2. 基金经营业绩报告书

项 目	附注	2003 年1-6 月	2002 年1-6 月
收入：			
股票差价收入	1(5)	56,510,390.88	84,714,142.19
债券差价收入	1(5)	9,372,704.47	53,588,694.25
债券利息收入	1(5)	15,078,663.89	26,396,746.26
存款利息收入	1(5)	5,617,190.80	15,914,806.26
股利收入	1(5)	24,673,595.62	15,593,899.96
买入返售证券收入	1(5)	309,389.00	3,253,665.00
其他收入	3(3)	4,917,952.09	5,049,425.52
收入合计		<u>116,479,886.75</u>	<u>204,511,379.44</u>
费用：			
基金管理人报酬	1(6)	31,340,010.50	36,802,813.74

基金托管费	1(7)	5,223,335.05	6,133,802.37
卖出回购证券支出	1(8)	85,830.00	--
其他费用	3(4)	257,724.08	1,310,450.38
其中：信息披露费		168,603.31	178,520.30
审计费用		74,383.76	74,383.76
费用合计		<u>36,906,899.63</u>	<u>44,247,066.49</u>
基金净收益		<u>79,572,987.12</u>	<u>160,264,312.95</u>
加：未实现估值增值变动数	1(3)(4)	314,529,150.67	120,656,140.69
基金经营业绩		<u>394,102,137.79</u>	<u>280,920,453.64</u>

3. 收益分配报告书

项 目	附注	2003 年1-6 月	2002 年1-6 月
本期基金净收益		79,572,987.12	160,264,312.95
加：期初未分配收益		14,677,859.47	34,445,977.47
加：本期申购基金单位的损益平准金	1(11)	134,176.20	8,274,191.49
减：本期赎回基金单位的损益平准金	1(11)	<u>7,526,046.20</u>	<u>17,194,482.47</u>
可供分配基金净收益		<u>86,858,976.59</u>	<u>185,789,999.44</u>
减：本期已分配基金净收益	1(12)	63,807,320.55	103,365,000.94
期末基金未分配净收益		<u>23,051,656.04</u>	<u>82,424,998.50</u>

4. 基金净值变动报告书

项 目	附注	2003 年1-6 月	2002 年1-6 月
一、期初基金净值		4,292,754,580.21	5,064,713,018.51
二、本期经营活动：			
基金净收益		79,572,987.12	160,264,312.95
未实现估值增值变动数	1(10)	<u>314,529,150.67</u>	<u>120,656,140.69</u>
经营活动产生的基金净值变动数		<u>394,102,137.79</u>	<u>280,920,453.64</u>
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		36,454,983.26	415,917,670.67
基金赎回款		<u>-1,186,420,657.77</u>	<u>-907,949,669.30</u>
基金单位交易产生的基金净值变动数		<u>-1,149,965,674.51</u>	<u>-492,031,998.63</u>
四、本期向持有人分配收益		<u>-63,807,320.55</u>	<u>-103,365,000.94</u>
五、期末基金净值		<u>3,473,083,722.94</u>	<u>4,750,236,472.58</u>

（二）会计报告书附注

1. 主要会计政策

（1）会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

（2）记账原则和计价基础

本基金的会计核算以权责发生制为记账原则，除股票投资和债券投资按市值计价外，其余均以历史成本为计价基础。

（3）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。

卖出股票于成交日确认股票差价收入，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

股票包括上市交易股票和未上市交易股票。上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场收盘价估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

（4）债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行同业间市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入；卖出银行同业间市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

上市流通债券按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。未上市流通债券和银行间债券按成本估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

（5）收入确认

① 股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

② 证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认、银行同业间市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入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确认。

③ 债券利息收入于债券实际持有期内按债券票面价值与票面利率逐日计提。

④ 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提。

⑤ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认。

⑥ 买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在返售期限内采用直线法逐

日计提。

(6) 基金管理人报酬

基金管理人报酬为按《华安创新证券投资基金基金契约》的规定计提的基金管理人的管理费。基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率逐日计提，按月支付。

(7) 基金托管费

基金托管费为按《华安创新证券投资基金基金契约》的规定计提的基金托管人的托管费。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率逐日计提，按月支付。

(8) 卖出回购证券支出

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(9) 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

(10) 未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金单位时，申购或赎回款项中包含的按上一交易日的未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(11) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金单位时，申购或赎回款项中包含的按基金未分配净收益占基金净值比例计算的一部分金额。损益平准金于基金申购确认日及基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配收益。

(12) 基金的收益分配原则

① 每一基金单位享有同等分配权。

② 本基金收益以现金形式分配，但投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金单位净值自动转为基金单位进行再投资。

③ 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费应由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册与过户登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的基金单位净值自动转为基金单位，不足一份基金单位的，四舍五入。

④ 基金收益分配每年至少一次，收益分配比例不低于基金净收益的 90%，成立不满 3 个月，收益不分配。

⑤ 基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金当年亏损，则不进行收益分配。

⑥ 基金收益分配后，每基金单位净值不能低于面值。

(13) 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55 号文及[2001] 61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》，以及财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，主要税项规定如下：

- ① 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- ② 基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，在 2003 年年底前暂免征收营业税和企业所得税。
- ③ 基金从证券市场中取得的其他收入包括股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- ④ 基金买卖股票按成交额的 0.2% 缴纳证券（股票）交易印花税。

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 基金注册与过户登记人 基金销售机构	提取管理费	基金契约
交通银行	基金托管人 基金代销机构	提取托管费	基金契约
申银万国证券股份有限公司	基金管理人的股东	租用交易席位	席位使用协议
东方证券有限责任公司	基金管理人的股东	租用交易席位	席位使用协议

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易

① 2003 年 1-6 月本基金通过关联人席位的股票成交量

关 联 人	交易量	占总交易量比例	佣金	占总佣金比例	平均佣金比例
申银万国证券股份有限公司	744,296,805.78	9.35%	595,415.42	9.26%	0.08%
东方证券有限责任公司	733,352,031.27	9.21%	594,218.09	9.24%	0.08%
合 计	<u>1,477,648,837.05</u>	<u>18.56%</u>	<u>1,189,633.51</u>	<u>18.50%</u>	<u>0.08%</u>

2002 年 1-6 月本基金通过关联人席位的股票成交量

关 联 人	交易量	占总交易量比例	佣金	占总佣金比例	平均佣金比例
申银万国证券股份有限公司	285,551,590.68	9.77%	221,910.58	10.18%	0.08%
东方证券有限责任公司	118,972,861.38	4.07%	93,097.08	4.27%	0.08%
合 计	<u>404,524,452.06</u>	<u>13.84%</u>	<u>315,007.66</u>	<u>14.45%</u>	<u>0.08%</u>

② 2003 年 1-6 月本基金通过关联人席位的国债和回购成交量

关 联 人	债券交易量	比例	回购交易量	比例
申银万国证券股份有限公司	195,424,817.80	6.08%	200,000,000.00	21.45%
东方证券有限责任公司	92,823,834.40	2.89%	-	-
合 计	288,248,652.20	8.97%	200,000,000.00	21.45%

2002 年 1-6 月本基金通过关联人席位的国债和回购成交量

关 联 人	债券交易量	比例	回购交易量	比例
申银万国证券股份有限公司	245,783,257.20	2.11%	500,000,000.00	8.29%
东方证券有限责任公司	-	-	-	-
合 计	245,783,257.20	2.11%	500,000,000.00	8.29%

(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

支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 * 1.5% ÷ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理费 31,340,010.50 元。

② 基金托管费

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 * 0.25% ÷ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 5,223,335.05 元。

3. 主要报表项目说明

(1) 应收利息

项 目	2003 年 6 月 30 日	2002 年 12 月 31 日
应收债券利息	10,373,720.48	7,222,102.07
应收清算备付金利息	183,229.87	336,885.55
应收银行存款利息	71,075.35	64,058.14
合 计	10,628,025.70	7,623,045.76

(2) 实收基金

项 目	2003 年 1-6 月	2002 年 1-6 月
期初数	4,685,440,851.00	5,002,284,701.00
加：本期申购	37,456,885.00	403,215,881.00
减：本期赎回	1,167,925,994.00	880,541,733.00
期末数	3,554,971,742.00	4,524,958,849.00

(3) 其他收入

其他收入主要包括按基金赎回款 0.4%计算的赎回基金补偿收入和因新股申购及国债认购而产生手续费返还款项。

项 目	2003 年1-6 月	2002 年1-6 月
赎回基金补偿收入	4,745,682.96	3,631,799.54
新股认购手续费返还	83,000.43	493,625.98
债券认购手续费返还	5,268.70	924,000.00
债券申购冻结利息返还	84,000.00	-
合 计	4,917,952.09	5,049,425.52

(4) 其他费用

其他费用主要包括审计费、信息披露费、发行费用摊销以及其它费用。

项 目	2003 年1-6 月	2002 年1-6 月
审计费	74,383.76	74,383.76
信息披露费	168,603.31	178,520.30
发行费用摊销	-	962,733.57
其他	14,737.01	94,812.75
合 计	257,724.08	1,310,450.38

(5) 未实现利得

项 目	2003 年1-6 月	2002 年1-6 月
期初未实现利得	-407,364,130.26	27,982,340.04
加：本期未实现估值增值变动数	314,529,150.67	120,656,140.69
加：本期申购基金单位的未实现利得平准金	-1,136,077.94	4,427,598.18
减：本期赎回基金单位的未实现利得平准金	10,968,617.57	10,213,453.83
期末未实现利得	-104,939,675.10	142,852,625.08

(三) 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

基金获配新股，从新股获配日至新股上市日或在规定期间内，为流通受限而不能自由转让的资产。

根据中国证监会的政策规定，2000 年 5 月 18 日起新股发行时不再单独向基金配售新股。基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订的申购协议的规定，在约定期限内不能自由转让。

根据中国证监会证监发行字[2002]54 号文《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》，自 2002 年 5 月 20 日起，恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股票市值参与配售，但累计申购总额不得超过基金按规定可申购的总额。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

1、本基金截止 2003 年 6 月 30 日流通受限股票情况如下：

股票名称	申购方式	申购确认日	上市日期	数 量	成 本	市 值	流通受限期
三一重工	市值配售	03-06-23	03-07-03	51,000	793,560.00	793,560.00	03-07-03 起流通
北方天鸟	市值配售	03-06-24	03-07-04	23,000	220,800.00	220,800.00	03-07-04 起流通
瑞 贝 卡	市值配售	03-06-30	03-07-10	9,000	93,600.00	93,600.00	03-07-10 起流通
合 计					1,107,960.00	1,107,960.00	

2、本基金截止 2003 年 6 月 30 日流通受限债券情况如下：

债券名称	申购确认日	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
山鹰转债	03-06-19	03-07-01	27,730	2,773,000.00	2,773,000.00	03-07-01 起流通

(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	4,752,000.00	0.14%
B	采掘业	60,724,985.36	1.75%
C	制造业	1,619,643,245.74	46.63%
C0	其中：食品、饮料	62,002,019.52	1.79%
C1	纺织、服装、皮毛	49,142,012.10	1.41%
C2	木材、家具	609,682.00	0.02%
C3	造纸、印刷	38,614,219.38	1.11%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	185,144,325.58	5.33%
C5	电子	50,835,498.44	1.46%
C6	金属、非金属	369,071,394.54	10.63%
C7	机械、设备、仪表	647,303,869.25	18.64%
C8	医药、生物制品	216,920,224.93	6.25%
C99	其他	--	--
D	电力、煤气及水的生产和供应业	188,694,211.57	5.43%
E	建筑业	4,650,000.00	0.13%
F	交通运输、仓储业	274,616,505.21	7.91%
G	信息技术业	14,495,300.68	0.42%
H	批发和零售贸易	9,866,813.01	0.28%
I	金融、保险业	113,209,463.52	3.26%
J	房地产业	2,124,462.96	0.06%
K	社会服务业	--	--
L	传播与文化产业	--	--
M	综合类	208,400.00	0.01%
	合 计	2,292,985,388.05	66.02%

2、债券（不包括国债）合计

截止 2003 年 6 月 30 日，基金持有债券（不含应收利息）136,688,369.40 元，占基金资产净值的 3.94%。

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 1,050,723,779.34 元，占基金资产净值的 30.25%。

4. 基金投资股票明细

序号	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	宝钢股份	55,807,674	285,177,214.14	8.21%

2	上海电气	17,846,231	188,991,586.29	5.44%
3	上海汽车	14,596,339	173,550,470.71	5.00%
4	上海机场	14,778,639	157,244,718.96	4.53%
5	华北制药	20,149,179	126,335,352.33	3.64%
6	威孚高科	10,905,307	123,229,969.10	3.55%
7	招商银行	10,000,836	113,209,463.52	3.26%
8	华能国际	6,800,989	100,994,686.65	2.91%
9	烟台万华	5,780,153	67,165,377.86	1.93%
10	通化东宝	7,200,000	54,936,000.00	1.58%
11	生益科技	5,900,000	52,097,000.00	1.50%
12	盐湖钾肥	6,600,330	50,690,534.40	1.46%
13	铜都铜业	6,503,581	47,346,069.68	1.36%
14	华泰股份	3,545,842	38,614,219.38	1.11%
15	双汇发展	2,935,821	38,517,971.52	1.11%
16	国电电力	3,910,753	38,208,056.81	1.10%
17	申能股份	3,096,139	36,658,285.76	1.06%
18	白云机场	4,200,196	36,499,703.24	1.05%
19	格力电器	4,253,757	35,093,495.25	1.01%
20	大显股份	4,717,067	33,349,663.69	0.96%
21	海油工程	2,250,956	31,715,970.04	0.91%
22	南京水运	2,945,526	31,605,493.98	0.91%
23	海螺水泥	4,000,000	31,080,000.00	0.89%
24	恒瑞医药	2,503,613	25,536,852.60	0.74%
25	辽河油田	2,969,332	25,269,015.32	0.73%
26	云天化	2,600,000	24,648,000.00	0.71%
27	珠海中富	3,376,500	24,310,800.00	0.70%
28	江淮汽车	1,806,813	23,488,569.00	0.68%
29	伊利股份	950,800	21,564,144.00	0.62%
30	招商局A	2,019,920	20,502,188.00	0.59%
31	厦工股份	2,500,310	16,652,064.60	0.48%
32	鲁泰A	2,400,301	16,394,055.83	0.47%
33	雅戈尔	1,400,767	14,301,831.07	0.41%
34	韶能股份	1,500,957	12,833,182.35	0.37%
35	红星发展	855,485	11,343,731.10	0.33%
36	法拉电子	800,725	10,817,794.75	0.31%
37	盐田港A	500,000	10,130,000.00	0.29%
38	波导股份	539,894	9,766,682.46	0.28%
39	深圳机场	1,100,691	9,377,887.32	0.27%
40	申达股份	1,200,000	9,228,000.00	0.27%
41	海欣股份	749,140	9,124,525.20	0.26%
42	大商股份	1,100,481	9,034,949.01	0.26%
43	中远航运	1,065,315	8,575,785.75	0.25%
44	天士力	600,000	7,440,000.00	0.21%
45	山推股份	700,000	6,979,000.00	0.20%
46	长电科技	543,000	6,668,040.00	0.19%

47	万向钱潮	750,507	6,349,289.22	0.18%
48	天地科技	482,941	5,679,386.16	0.16%
49	吉林森工	600,000	4,752,000.00	0.14%
50	上海建工	600,000	4,650,000.00	0.13%
51	信 雅 达	200,567	4,637,109.04	0.13%
52	宇通客车	300,004	4,044,053.92	0.12%
53	巨化股份	500,499	3,893,882.22	0.11%
54	中国石化	1,000,000	3,740,000.00	0.11%
55	湘电股份	374,100	3,460,425.00	0.10%
56	星马汽车	170,000	3,359,200.00	0.10%
57	佛山照明	300,000	3,315,000.00	0.10%
58	中集集团	200,000	3,166,000.00	0.09%
59	山东铝业	199,836	2,302,110.72	0.07%
60	万 科A	365,028	2,124,462.96	0.06%
61	同 仁 堂	100,000	1,970,000.00	0.06%
62	新 希 望	199,990	1,919,904.00	0.06%
63	佛塑股份	200,000	1,616,000.00	0.05%
64	南京中达	200,000	1,294,000.00	0.04%
65	华联超市	75,900	831,864.00	0.02%
66	三一重工	51,000	793,560.00	0.02%
67	上港集箱	57,156	680,727.96	0.02%
68	美克股份	54,680	609,682.00	0.02%
69	华海药业	20,000	382,800.00	0.01%
70	片 仔 癯	22,000	319,220.00	0.01%
71	北方天鸟	23,000	220,800.00	0.01%
72	东方明珠	10,000	208,400.00	0.01%
73	中科合臣	13,000	182,000.00	0.01%
74	瑞 贝 卡	9,000	93,600.00	0.00%
75	中国联通	28,419	91,509.18	0.00%
	合 计		2,292,985,388.05	66.02%

5. 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场认购	二级市场买入	其他	
1	韶能股份	-	1,500,957	-	-
2	铜都铜业	-	6,503,581	-	-
3	山推股份	-	850,200	-	150,200
4	白云机场	1,255,000	18,811,333	-	15,866,137
5	上港集箱	-	1,357,606	1,300,450	2,600,900
6	中国石化	-	1,000,000	-	-
7	三一重工	51,000	-	-	-
8	招商银行	-	55,866,363	-	45,865,527
9	巨化股份	-	500,499	-	-
10	山东铝业	-	199,836	-	-
11	星马汽车	14,000	170,000	-	14,000

12	北方天鸟	23,000	-	-	-
13	片仔癀	22,000	-	-	-
14	瑞贝卡	9,000	-	-	-
15	中科合臣	13,000	-	-	-
16	华海药业	20,000	-	-	-
17	长电科技	43,000	500,000	-	-
18	申能股份	-	3,096,139	-	-
19	厦工股份	-	2,500,310	-	-
20	华联超市	-	75,900	-	-
21	东方明珠	-	1,000,453	-	990,453

注：一级市场认购包括网上、网下新股认购和二级市场市值配售。

其它项包括送股、配股、转增、增发、债转股。

6. 本期剔除股票

序号	股票名称	期初数量	本期增加	本期卖出
1	农产品	25,000	-	25,000
2	中联重科	800,000	310,410	1,110,410
3	许继电气	1,800,330	600,195	2,400,525
4	东阿阿胶	1,104,238	-	1,104,238
5	晨鸣纸业	16,635	553,840	570,475
6	海虹控股	-	132,559	132,559
7	丽珠集团	2,532,330	-	2,532,330
8	TCL 通讯	292,224	430,233	722,457
9	新 钢 钒	3,855,300	-	3,855,300
10	模塑科技	705,000	-	705,000
11	韶钢松山	-	1,181,154	1,181,154
12	燕京啤酒	809,318	-	809,318
13	草原兴发	503,582	1,725,099	2,228,681
14	一汽轿车	-	5,000	5,000
15	云铝股份	3,373,850	870,990	4,244,840
16	五 粮 液	1,249,648	1,423,407	2,673,055
17	国风塑业	380	1,700,959	1,701,339
18	扬子石化	11,820,979	27,033,794	38,854,773
19	华北高速	1,036,924	-	1,036,924
20	华菱管线	6,650,000	-	6,650,000
21	中原油气	100,728	-	100,728
22	浦发银行	-	4,000,000	4,000,000
23	首创股份	1,850,281	2,343,049	4,193,330
24	皖通高速	738,000	-	738,000
25	中信证券	1,156,000	-	1,156,000
26	歌华有线	343,672	905,280	1,248,952
27	四川路桥	-	126,000	126,000
28	厦门建发	2,778,829	-	2,778,829
29	福田汽车	200,209	-	200,209
30	兖州煤业	1,607,793	2,598,091	4,205,884

31	中牧股份	910,447	39,000	949,447
32	南山实业	700,603	1,050,013	1,750,616
33	冠农股份	-	22,000	22,000
34	海正药业	126,565	-	126,565
35	赣粤高速	4,373,818	462,871	4,836,689
36	外运发展	416,412	84,200	500,612
37	华芳纺织	-	103,000	103,000
38	江苏舜天	1,702,336	-	1,702,336
39	曙光股份	-	1,818,732	1,818,732
40	振华港机	820,370	230,100	1,050,470
41	航天动力	-	57,000	57,000
42	精伦电子	200,500	100,000	300,500
43	三房巷	-	41,000	41,000
44	北京巴士	155,942	-	155,942
45	太工天成	-	11,000	11,000
46	安泰集团	-	68,000	68,000
47	三友化工	-	109,000	109,000
48	冠豪高新	-	48,000	48,000
49	时代新材	20,000	-	20,000
50	贵研铂业	-	22,000	22,000
51	士兰微	-	13,000	13,000
52	双良股份	-	81,000	81,000
53	天药股份	300,400	-	300,400
54	中化国际	1,399,098	-	1,399,098
55	安徽水利	-	46,000	46,000
56	宏智科技	27,000	-	27,000
57	上海能源	4,100,692	549,600	4,650,292
58	黑牡丹	200,050	-	200,050
59	联环药业	-	7,000	7,000
60	海龙科技	81,000	-	81,000
61	三佳模具	100,700	-	100,700
62	菲达环保	23,000	-	23,000
63	栖霞建设	9,000	-	9,000
64	海通集团	-	41,000	41,000
65	北海国发	-	30,000	30,000
66	高淳陶瓷	-	17,000	17,000
67	迪马股份	149,960	150,723	300,683
68	惠泉啤酒	-	53,000	53,000
69	芜湖港	-	30,000	30,000
70	庆丰股份	-	51,000	51,000
71	新华医疗	7,000	-	7,000
72	光明乳业	5,000	-	5,000
73	青岛啤酒	80,000	-	80,000
74	大众交通	1,133,010	-	1,133,010
75	新世界	2,154,488	-	2,154,488

76	强生控股	403,843	225,845	629,688
77	上海石化	-	8,002,232	8,002,232
78	巴士股份	18,500,406	189,818	18,690,224
79	一汽四环	292,751	3,181,148	3,473,899
80	益民百货	617,400	-	617,400
81	内蒙华电	320,854	-	320,854
82	亚泰集团	5,074,743	2,752,252	7,826,995

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（或最近交易日）的市场收盘价计算，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 7,313,813.85 元。股票市值 2,292,985,388.05 元、债券市值（不含国债）136,688,369.40 元、国债及货币资金 1,050,723,779.34 元，合计与其相减后等于基金净值。其他应收应付款项包括：深圳交易保证金、应收利息、应收基金申购款、配股权证、应付基金赎回款、应付赎回费、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、其他应付款以及预提费用。

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、中国工商银行自 2003 年 3 月 18 日起开始成为本基金的销售代理人。
- 3、华安基金管理有限公司上海投资理财中心和北京投资理财中心已开通 10 万元（含 10 万元）人民币以上个人投资者的直销业务。
- 4、本基金管理人自 2003 年 4 月 7 日起推出上海地区个人投资者“华安特快”基金电子交易业务，使用“银基通”作为基金电子交易的资金结算途径。详情请参阅 2003 年 4 月 7 日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。该业务推广期从 2003 年 4 月 7 日至 2003 年 10 月 7 日。
- 5、本基金管理人自 2003 年 4 月 28 日起在“华安特快”基金电子交易业务中增加“银联通”资金结算方式。详情请参阅 2003 年 4 月 28 日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。
- 6、本基金管理人自 2003 年 6 月 9 日起调低首次申购数额限制，投资者在交通银行、中国银行、国泰君安证券股份有限公司、华夏证券股份有限公司等代销机构的网点首次申购华安创新的最低金额从原人民币 5,000 元调整为人民币 1,000 元。在中国工商银行的网点进行首次申购的最低金额的调整日期，以中国工商银行网点公告为准。
- 7、本基金于 2003 年 6 月 17 日公告实施分红，以 2003 年 6 月 13 日已实现的可分配收益为基准，每 10 份基金单位派发现金红利 0.18 元，除息日为 2003 年 6 月 23

日。

8、本基金管理人于 2003 年 7 月 30 日发布召开华安创新证券投资基金第一次持有人大会（通讯方式）的公告，本次会议权利登记日为 2003 年 8 月 8 日，会议时间为 2003 年 8 月 21 日，会议内容：

- 1) 审议关于修改《华安创新证券投资基金基金契约》的议案；
- 2) 审议关于调低赎回费率及调整赎回时注册与过户登记费用的议案。

详情请参阅 2003 年 7 月 30 日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。

9、本会计期间内各券商交易成交量及佣金情况如下：

① 股票交易情况：

券商名称	成交量	占总成交 总量比例	佣金	占总佣金 总量比例
国泰君安证券股份有限公司	1,108,455,833.13	13.93%	898,640.61	13.97%
海通证券股份有限公司	636,024,751.85	7.99%	506,365.49	7.87%
申银万国证券股份有限公司	744,296,805.78	9.35%	595,415.42	9.26%
广发证券有限责任公司	700,292,066.78	8.80%	572,407.81	8.90%
大鹏证券有限责任公司	406,130,212.07	5.10%	324,488.81	5.05%
东方证券有限责任公司	733,352,031.27	9.21%	594,218.09	9.24%
中国民族证券有限责任公司	302,891,277.30	3.81%	237,016.60	3.69%
平安证券有限责任公司	373,790,427.49	4.70%	292,495.14	4.55%
大通证券有限责任公司	1,256,452,159.99	15.79%	1,024,460.28	15.93%
招商证券股份有限公司	611,256,402.80	7.68%	496,923.92	7.73%
中国国际金融有限公司	1,086,611,198.66	13.65%	889,080.92	13.82%
合 计	7,959,553,167.12	100.00%	6,431,513.09	100.00%

② 债券及回购交易情况：

券商名称	债券成交量	占总成交 总量比例	回购成交量	占总成交 总量比例
国泰君安证券股份有限公司	323,609,326.20	10.07%	-	-
海通证券股份有限公司	448,178,594.20	13.95%	532,300,000.00	57.10%
申银万国证券股份有限公司	195,424,817.80	6.08%	200,000,000.00	21.45%
广发证券有限责任公司	265,951,787.90	8.28%	-	-
大鹏证券有限责任公司	79,894,953.40	2.49%	-	-
东方证券有限责任公司	92,823,834.40	2.89%	-	-
中国民族证券有限责任公司	87,586,282.10	2.73%	-	-
平安证券有限责任公司	527,449,606.10	16.41%	-	-
大通证券有限责任公司	428,695,695.10	13.34%	200,000,000.00	21.45%
招商证券股份有限公司	510,368,819.80	15.88%	-	-
中国国际金融有限公司	253,851,627.90	7.90%	-	-
合 计	3,213,835,344.90	100.00%	932,300,000.00	100.00%

七、备查文件目录

1. 中国证监会批准华安创新证券投资基金设立的文件。
2. 《华安创新证券投资基金基金契约》、《华安创新证券投资基金招募说明书》、《华安创新证券投资基金发行公告》、《华安创新证券投资基金成立公告》、《华安创新证券投资基金申购、赎回公告》、《华安创新证券投资基金公开说明书》。
3. 《华安创新证券投资基金托管协议》。
4. 《华安基金管理有限公司开放式基金定期定额业务规则》。
5. 华安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
6. 华安创新证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注。
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

2003 年 8 月 29 日