

# **安久证券投资基金**

**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 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: 安久证券投资基金  
(简称: 基金安久)
- 交易代码: 184709
- 基金发起人: 华安基金管理有限公司
- 基金成立日期: 1992 年 8 月 31 日 (原四川国信投资基金成立日期)  
2000 年 7 月 4 日华安基金管理有限公司开始管理基金安久
- 基金单位总份额: 5 亿份基金单位
- 基金类型: 契约型封闭式
- 基金存续期: 15 年 (自 1992 年 8 月 31 日至 2007 年 8 月 30 日)
- 基金上市地点: 深圳证券交易所
- 基金上市日期: 2001 年 8 月 31 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: 冯颖
- 电话: 021-58881111
- 传真: 021-58406138
- 客户服务热线: 021-68604666
- 国际互联网地址: <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 (邮政编码: 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: 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

|             | 2003年1-6月        | 2002年1-6月       |
|-------------|------------------|-----------------|
| 基金本期净收益:    | -5,689,932.45 元  | 3,144,859.94元   |
| 单位基金本期净收益:  | -0.0114 元        | 0.0063元         |
| 基金可分配净收益:   | -85,609,969.43 元 | -58,072,780.99元 |
| 单位基金可分配净收益: | -0.1712 元        | -0.1161元        |
| 期末基金资产总值:   | 416,589,469.94 元 | 460,902,396.70元 |
| 期末基金资产净值:   | 414,390,030.57 元 | 441,927,219.01元 |
| 单位基金资产净值:   | 0.8288 元         | 0.8839元         |
| 基金资产净值收益率:  | -1.47%           | 1.27%           |
| 本期基金净值增长率:  | 6.76%            | 2.65%           |
| 累计资产净值增长率:  | -22.94%          | -17.81%         |

上述部分指标计算公式:

1. 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]
2. 基金资产净值收益率 = 本期净收益 / (期初基金资产净值 \* 本期天数 + 扩募日资金流入额 \* 扩募日至本期末天数) / 本期天数
3. 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
4. 基金累计净值增长率 = (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

### (一) 基金管理人报告

#### 基金简介

安久证券投资基金是由原四川国信投资基金清理规范而成的契约型封闭式证券投资基金。根据中国证监会证监基金字[2000]28 号文《关于四川国信投资基金清理规范方案的批复》，经 2000 年 6 月 15 日原四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议通过，四川国信投资基金更名为安久证券投资基金，基金管理人变更为华安基金管理有限公司，基金托管人变更为交通银行。截至 2000 年 7 月 3 日止，基金资产过户移交时基金资产净值为人民币 168,608,719.99 元，基金总份额为 200,000,020 份基金单位，每基金单位净值为 0.8430 元。2000 年 7 月 4 日起华安基金管理有限公司正式开始管理本基金。

根据中国证监会证监基金字[2000]56 号文《关于四川国信投资基金规范为安久证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》和深圳证券交易所深证上[2001]77 号《上市通知书》审核同意，基金安久于 2001 年 8 月 31 日在深圳证券交易所挂牌交易。

根据 2000 年 6 月 15 日原四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决

议，中国证监会证监基金字[2000]56 号文《关于四川国信投资基金规范为安久证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》，以及 2002 年 3 月 7 日基金安久第一次持有人大会审议通过的关于部分变更本次扩募方式的决议，基金安久于 2002 年 5 月 21 日完成扩募，基金总份额由 200,000,020 份基金单位扩募至 5 亿份基金单位，扩募后基金存续期延长 5 年，至 2007 年 8 月 30 日止。

### 基金经理简介

王国卫先生，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，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。

### 基金业绩表现

本基金自 2000 年 7 月 4 日成立以来，历年的业绩表现总结如下：

|         | 净值增长率   | 上证综指涨幅  | 深证综指涨幅  | 单位分红 |
|---------|---------|---------|---------|------|
| 2000*   | -19.16% | 9.38%   | 7.56%   | -    |
| 2001    | -0.95%  | -20.62% | -25.13% | -    |
| 2002    | -9.85%  | -17.52% | -18.32% | -    |
| 2003 中期 | 6.76%   | 9.46%   | 4.78%   | -    |
| 累计      | -22.94% | -21.61% | -31.08% | -    |

\*自成立之日起计算

### 基金经理工作报告

#### 上半年回顾

2003 年上半年，在中国经济高速发展的大环境下，中国股票市场走出一轮上升行情，期间出现了两大特点：

- 1) 价值主导。一月份，钢铁、汽车、石化板块以及中国联通作为大市值股票的代表，在盈利大幅增长的预期下，引领大盘走出第一波行情。四月份，银行、电力利润大幅改善的迹象显现，五大板块联袂走出第二波行情，主流板块呈现出强者恒强的特征。五大板块具有的共同特征是市值大，盈利面趋好。与五大板块优异的市场表现形成强烈反差的是，57% 的个股股价在上半年下跌。我们可以推定，上半年的上涨是一个价值主导的，以机构参与为主的行情。涨幅前 5 名中的 4 个汽车股，成交金额前 10 名中的 4 个银行股，机构都有不同程度的涉足。
- 2) 国际化。上半年 H 股上涨了 35%，其中推动指数上涨的主要是钢铁、石化、电力等大市值、盈利大幅增长的股票。虽然 A 股中的银行和汽车类股票没有涵盖 H 股，但是 A 股中五大板块引领的强者恒强的两波行情与 H 股如出一辙。中国股市的投资风格逐渐向国际化靠拢。

上半年安久净值累计增长了6.76%，增长略落后于大盘。年初本基金在石化上配置较多，但是在汽车、钢铁板块投资比重不高，在第一波上涨中一度非常被动，此后我们迅速对持仓结构作了调整，增加汽车、钢铁、银行、电力的比重，逐步缩小了与表现优异基金之间的差距。对部分热点品种的果断介入，为基金的收益做出了较大的贡献。

## 下半年展望

在国际化潮流下，价值投资理念被越来越多的投资者接受，盈利上升成为股价上涨的主要推动力量，而大市值的股票由于流通性好往往成为机构投资的首选。

在取得抗击“非典”战役胜利后，我国经济将保持快速稳定发展。上半年融资额在去年同比大幅下降的基础上，又减少了一半，下半年扩容压力比较大。银监会的成立将强化银行监管，影响股市资金的供给。我们认为，在基本面向好的大趋势下，机会大于风险。在加强基本面研究的前提下，我们将积极投资长期享受中国经济高速发展机遇的行业和个股，重点考虑原材料、电力、银行、机械等行业，发挥本基金规模小灵活性高的优势，在合理判断行情的基础上积极调节基金仓位，以获得因市场波动带来的超额收益。此外，积极挖掘可转债中的赢利机会。

## （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、《安久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) 对安久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

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，交通银行作为安久证券投资基金的托管人，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《安久证券投资基金基金契约》和《安久证券投资基金托管协议》中的条款，依法安全保管了基金的全部资产，做好安久证券投资基金的投资监管和清算核算工作，妥善保管了基金所有会计帐册，勤勉尽责地履行了基金托管人的义务，未发生任何损害基金持有人利益的事件和行为。

2003 年上半年，按照《证券投资基金管理暂行办法》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安久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。

本托管人确认，2003 年上半年，由安久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的有关安久证券投资基金的信息披露合法、真实、完整。

## 五. 基金年度财务报告（未经审计）

### （一）基金会计报告书

#### 安久证券投资基金 资产负债表

|           |      | 单位：人民币元               |                       |
|-----------|------|-----------------------|-----------------------|
| 资产        | 附注   | 2003 年 6 月 30 日       | 2002 年 12 月 31 日      |
| 资产：       |      |                       |                       |
| 银行存款      |      | 3,646,203.17          | 168,491.93            |
| 清算备付金     |      | 17,558,664.18         | 11,924,428.59         |
| 交易保证金     |      | 750,000.00            | 750,000.00            |
| 应收证券清算款   |      | -                     | 4,394,154.43          |
| 应收股利      |      | -                     | -                     |
| 应收利息      | 3(1) | 1,586,190.61          | 875,709.82            |
| 其他应收款     |      | -                     | -                     |
| 股票投资市值    | 1(4) | 272,415,507.10        | 253,812,941.82        |
| 其中：股票投资成本 |      | 293,476,070.22        | 307,104,429.77        |
| 债券投资市值    | 1(4) | 120,406,945.50        | 136,648,469.30        |
| 其中：债券投资成本 |      | 121,482,945.83        | 137,176,192.50        |
| 配股权证      |      | 225,959.38            | -                     |
| 买入返售证券    |      | -                     | -                     |
| 待摊费用      |      | -                     | -                     |
| 其他资产      |      | -                     | -                     |
| 资产总计      |      | <u>416,589,469.94</u> | <u>408,574,195.89</u> |

#### 负债与基金持有人权益

|         |      |            |               |
|---------|------|------------|---------------|
| 负债：     |      |            |               |
| 应付证券清算款 |      | 164,723.68 | 19,004,697.60 |
| 应付管理人报酬 |      | 525,135.14 | 500,552.71    |
| 应付托管费   |      | 87,522.53  | 83,425.47     |
| 应付佣金    |      | 546,580.13 | 58,164.17     |
| 应付利息    |      | -          | -             |
| 应付收益    |      | -          | -             |
| 其他应付款   | 3(2) | 512,000.00 | 500,000.00    |
| 卖出回购证券款 |      | -          | -             |
| 预提费用    |      | 363,477.89 | 256,000.00    |

|            |                |                |
|------------|----------------|----------------|
| 其他负债       |                | -              |
| 负债合计       | 2,199,439.37   | 20,402,839.95  |
| 持有人权益:     |                |                |
| 实收基金       | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 |
| 未实现利得      | -21,910,604.07 | -53,819,211.15 |
| 未分配收益      | -63,699,365.36 | -58,009,432.91 |
| 持有人权益合计    | 414,390,030.57 | 388,171,355.94 |
| 负债及持有人权益总计 | 416,589,469.94 | 408,574,195.89 |

安久证券投资基金  
经营业绩表

|             |      | 2003 年 1-6 月  | 2002 年 1-6 月 |
|-------------|------|---------------|--------------|
|             | 附注   |               | 单位: 人民币元     |
| 一. 已实现基金收入: |      | -1,429,751.12 | 5,888,943.55 |
| 股票差价收入      | 1(6) | -9,360,887.65 | 4,036,548.09 |
| 债券差价收入      | 1(6) | 3,606,596.46  | -321,170.38  |
| 债券利息收入      | 1(6) | 1,704,631.99  | 1,346,221.23 |
| 存款利息收入      | 1(6) | 399,079.78    | 435,483.65   |
| 股利收入        | 1(6) | 2,187,907.22  | 309,150.90   |
| 买入返售证券收入    | 1(6) | 2,000.00      | 29,500.00    |
| 其他收入        | 3(3) | 30,921.08     | 53,210.06    |
| 二. 本期基金费用:  |      | 4,260,181.33  | 2,744,083.61 |
| 基金管理人报酬     | 2(3) | 3,077,471.24  | 1,822,604.83 |
| 基金托管费       | 2(3) | 512,911.88    | 305,643.34   |
| 卖出回购证券支出    |      | 472,076.27    | 322,425.00   |
| 利息支出        |      | -             | -            |
| 其他费用        | 3(4) | 197,721.94    | 293,410.44   |
| 其中: 上市年费    |      | 29,752.78     | 29,752.78    |
| 信息披露费       |      | 119,012.93    | 178,520.30   |
| 审计费用        |      | 34,712.18     | 74,793.38    |
| 三. 已实现基金净收益 |      | -5,689,932.45 | 3,144,859.94 |
| 加: 未实现利得    |      | 31,908,607.08 | 3,776,815.32 |
| 四. 基金经营业绩   |      | 26,218,674.63 | 6,921,675.26 |

安久证券投资基金  
收益分配表

|               |       | 2003 年 1-6 月   | 2002 年 1-6 月   |
|---------------|-------|----------------|----------------|
|               | 附注    |                | 单位: 人民币元       |
| 本期基金净收益       |       | -5,689,932.45  | 3,144,859.94   |
| 加: 期初基金净收益    |       | -58,009,432.91 | -59,142,415.58 |
| 加: 以前年度损益调整   | 1(10) | -              | 1,504.11       |
| 可供分配基金净收益     |       | -63,699,365.36 | -55,996,051.53 |
| 减: 本期已分配基金净收益 |       | -              | -              |



|         |                |                |
|---------|----------------|----------------|
| 期末基金净收益 | -63,699,365.36 | -55,996,051.53 |
|---------|----------------|----------------|

### 安久证券投资基金 基金净值变动表

|                | 附注 | 2003 年 1-6 月   | 单位：人民币元<br>2002 年 1-6 月 |
|----------------|----|----------------|-------------------------|
| 一. 期初基金净值      |    | 388,171,355.94 | 135,005,563.75          |
| 二. 本期经营活动：     |    |                |                         |
| 基金净收益          |    | -5,689,932.45  | 3,144,859.94            |
| 未实现利得          |    | 31,908,607.08  | 3,776,815.32            |
| 经营活动产生的基金净值变动数 |    | 26,218,674.63  | 6,921,675.26            |
| 三. 本期扩募基金单位    |    | -              | 299,999,980.00          |
| 四. 本期向持有人分配收益： |    | -              | -                       |
| 五. 期末基金净值      |    | 414,390,030.57 | 441,927,219.01          |

### (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。

(2) 记账原则：权责发生制。

(3) 记账本位币：人民币元。

#### (4) 基金资产的估值方法：

①上市流通的股票和国债，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（平均价）估值；上市流通的可转换债券和企业债券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（平均价）扣除债券起息日或上次除息日至估值日的利息后的净价估值。估值日无交易的，以最近交易日的市价（平均价）估值。

②未上市的股票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（平均价）估值；

b. 首次公开发行的股票，按成本估值。

③在银行间债券市场交易的债券以及未上市的债券按成本估值。

④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，按配股价估值。

⑤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。

⑥如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### (5) 待摊费用和预提费用的核算方法

待摊费用核算已经发生的、影响基金单位净值小数点后第五位，应分摊计入本期和以后各期的费用，如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和

律师费用等，待摊费用在实际发生时入账，在受益期内平均摊销。

预提费用核算预计将发生的、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，如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和律师费用等，预提费用在预计发生时入账。

(6) 收入的确认政策：

① 证券买卖价差收入：

a. 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。

b. 债券差价收入：卖出上市债券，应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。

② 股利收入：

在被投资股票股权除息日确认，并按上市公司宣告分红派息比例计算的金额入账。

③ 债券利息收入：

债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额入账。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 其他收入：

在实际收到时确认。

(7) 证券交易的成本计价方法：

① 买入股票时，于成交日按应支付的全部价款（包括成交价格和相关费用）计入股票投资成本，出售时按移动加权平均法结转成本。

② 买入上市债券时，于成交日按应支付的全部价款扣除债券起息日或上次除息日至购买日的利息后记入债券投资成本，出售时按移动加权平均法结转成本。

③ 买入非上市债券时，于实际支付价款日按支付的全部价款扣除债券起息日或上次除息日至购买日的利息后记入债券投资成本，出售时按移动加权平均法结转成本。

(8) 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》，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。

## (9) 基金的收益分配政策:

①基金收益分配采用现金方式或法规允许的其他方式, 每年分配一次, 管理人应在基金每一会计年度结束后 90 个工作日内公布上一会计年度的收益分配方案并于 120 个工作日内完成分配方案的实施;

②基金收益分配比例不得低于基金当年可分配收益的 90%, 其具体分配数额及比例由基金管理人拟定;

③基金当年收益应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。

## (10) 会计政策的变更及其影响

根据中华人民共和国财政部 2001 年 11 月 11 日颁布的《证券投资基金会计核算办法》, 本基金从 2002 年 1 月 1 日起, 证券交易所债券交易的成本计价及利息收入确认方法作如下会计政策变更: 成本计价方法由含息成本变更为不含息成本, 利息收入由收到时确认变更为在债券持有期内按日计提确认。

按照新的会计政策, 本基金于 2002 年 1 月 1 日对有关科目进行调整。此次变更影响数为: 应收利息调增人民币 5,264.38 元, 债券投资成本调减人民币 3,760.27 元, 两者差额人民币 1,504.11 元计入以前年度损益调整科目; 同时, 债券投资市值和未实现利得分别调减人民币 1,504.11 元。上述调整不影响 2002 年初基金资产净值。

## 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<br>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   |
| 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 |
| 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 |
| 上海证券有限责任公司   | 与基金管理人<br>同属一股东* | 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           | 租用交易席位 | 席位使用协议 |

\*该股东为上海国际信托投资公司, 系基金管理公司发起人

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        | 股票年成交量         | 占总成交量比例 | 年佣金        | 占总佣金量比例 | 平均佣金比率 |
|--------------|----------------|---------|------------|---------|--------|
| 申银万国证券股份有限公司 | 163,789,892.16 | 18.47%  | 133,570.19 | 18.69%  | 0.08%  |
| 东方证券有限责任公司   | 203,554,282.15 | 22.96%  | 164,131.35 | 22.97%  | 0.08%  |
| 上海证券有限责任公司   | 69,499,460.71  | 7.84%   | 54,384.98  | 7.61%   | 0.08%  |

|            |                |        |            |        |       |
|------------|----------------|--------|------------|--------|-------|
| 浙江证券有限责任公司 | 164,671,288.58 | 18.57% | 133,946.39 | 18.75% | 0.08% |
| 合 计        | 601,514,923.60 | 67.84% | 486,032.91 | 68.02% | 0.08% |

**本基金通过关联人席位 2002 年 1-6 月的股票交易情况:**

| 关 联 人        | 股票年成交量         | 占总成交量比例 | 年佣金        | 占总佣金量比例 | 平均佣金比率 |
|--------------|----------------|---------|------------|---------|--------|
| 申银万国证券股份有限公司 | 78,310,241.01  | 23.44%  | 57,696.22  | 22.47%  | 0.07%  |
| 东方证券有限责任公司   | 95,660,385.88  | 28.63%  | 75,393.15  | 29.36%  | 0.08%  |
| 上海证券有限责任公司   | 74,893,746.75  | 22.41%  | 58,606.18  | 22.83%  | 0.08%  |
| 浙江证券有限责任公司   | -              | -       | -          | -       | -      |
| 合 计          | 248,864,373.64 | 74.48%  | 191,695.55 | 74.66%  | 0.08%  |

**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        | 债券年成交量         | 比例     | 回购年成交量         | 比例     |
|--------------|----------------|--------|----------------|--------|
| 申银万国证券股份有限公司 | 53,506,021.80  | 13.44% | 30,000,000.00  | 9.49%  |
| 东方证券有限责任公司   | 136,240,967.90 | 34.21% | 90,000,000.00  | 28.48% |
| 上海证券有限责任公司   | 33,646,198.60  | 8.45%  | -              | -      |
| 浙江证券有限责任公司   | 58,224,054.20  | 14.62% | 76,000,000.00  | 24.05% |
| 合 计          | 281,617,242.50 | 70.72% | 196,000,000.00 | 62.03% |

**本基金通过关联人席位 2002 年 1-6 月的债券及回购交易情况:**

| 关 联 人        | 债券年成交量         | 比例     | 回购年成交量         | 比例     |
|--------------|----------------|--------|----------------|--------|
| 申银万国证券股份有限公司 | 499,636,315.20 | 53.13% | 160,000,000.00 | 41.07% |
| 东方证券有限责任公司   | 138,295,275.40 | 14.70% | 50,000,000.00  | 12.83% |
| 上海证券有限责任公司   | -              | -      | -              | -      |
| 浙江证券有限责任公司   | -              | -      | -              | -      |
| 合 计          | 637,931,590.60 | 67.83% | 210,000,000.00 | 53.90% |

**(3) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额**

**①基金管理费**

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 为每日应支付的基金管理费

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。

|       |                |                |
|-------|----------------|----------------|
|       | 2003 年 1-6 月   | 2002 年 1-6 月   |
| 基金管理费 | 3,077,471.24 元 | 1,822,604.83 元 |

**②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。

|     | 2003 年 1-6 月 | 2002 年 1-6 月 |
|-----|--------------|--------------|
| 托管费 | 512,911.88 元 | 305,643.34 元 |

### 3. 主要报表项目说明（单位：人民币元）

#### （1）应收利息

|              | 2003 年 6 月 30 日 | 2002 年 12 月 31 日 |
|--------------|-----------------|------------------|
| 银行存款和清算备付金利息 | 17,362.20       | 11,683.64        |
| 债券利息         | 1,568,828.41    | 864,026.18       |
| 合计           | 1,586,190.61    | 875,709.82       |

#### （2）其他应付款

|              | 2003 年 6 月 30 日 | 2002 年 12 月 31 日 |
|--------------|-----------------|------------------|
| 券商垫付交易保证金    | 500,000.00      | 500,000.00       |
| 暂收券商深圳通信站运行费 | 12,000.00       | -                |
| 合计           | 512,000.00      | 500,000.00       |

#### （3）其他收入

|            | 2003 年 1-6 月 | 2002 年 1-6 月 |
|------------|--------------|--------------|
| 新股申购手续费返还  | 17,395.08    | 31,047.01    |
| 债券申购手续费返还  | 4,076.00     | -            |
| 债券申购冻结利息   | 9,450.00     | -            |
| 印花税返还      | -            | 1,311.60     |
| 基金额定扩募费用结余 | -            | 19,999.80    |
| 基金扩募期间冻结利息 | -            | 851.65       |
| 合计         | 30,921.08    | 53,210.06    |

#### （4）其他费用

|              | 2003 年 1-6 月 | 2002 年 1-6 月 |
|--------------|--------------|--------------|
| 审计费          | 34,712.18    | 74,793.38    |
| 信息披露费        | 119,012.93   | 178,520.30   |
| 上市年费         | 29,752.78    | 29,752.78    |
| 交易所返售和回购交易费用 | 6,600.05     | 8,143.75     |
| 其他           | 7,644.00     | 2,200.23     |
| 合计           | 197,721.94   | 293,410.44   |

#### （5）以前年度损益调整

以前年度损益调整反映本年度发生的调整以前年度损益的事项。具体

调整情况，参见主要会计政策部分的“会计政策的变更及其影响”。

|             | 2003 年 1-6 月 | 2002 年 1-6 月 |
|-------------|--------------|--------------|
| 交易所债券价息分离调整 | -            | 1,504.11     |

### (三) 流通受限资产明细

1. 基金获配新股，自新股获配日至新股上市日或以下规定期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。

截至 2003 年 6 月 30 日，本基金持有流通受限的股票明细如下：

| 序号 | 股票名称 | 配售或申购确认日期 | 上市日期     | 数量     | 成本         | 市值         | 流通受限期        |
|----|------|-----------|----------|--------|------------|------------|--------------|
| 1  | 三一重工 | 03-06-23  | 03-07-03 | 33,000 | 513,480.00 | 513,480.00 | 03-07-03 起流通 |
| 2  | 北方天鸟 | 03-06-24  | 03-07-04 | 10,000 | 96,000.00  | 96,000.00  | 03-07-04 起流通 |
| 3  | 瑞贝卡  | 03-06-30  | 03-07-10 | 8,000  | 83,200.00  | 83,200.00  | 03-07-10 起流通 |
|    | 合计   |           |          |        | 692,680.00 | 692,680.00 |              |

2. 截至 2003 年 6 月 30 日，本基金无流通受限的债券。

3. 截至 2003 年 6 月 30 日，本基金无流通受限的配股。

### (四) 基金投资组合

#### 1. 按行业分类的股票投资组合

| 序号  | 分 类            | 市 值 (元)        | 占净值比例  |
|-----|----------------|----------------|--------|
| A   | 农、林、牧、渔业       | --             | --     |
| B   | 采掘业            | 14,421,864.97  | 3.48%  |
| C   | 制造业            | 210,880,991.02 | 50.89% |
| C0  | 其中：食品、饮料       | 6,633,903.36   | 1.60%  |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 5,701,120.00   | 1.38%  |
| C2  | 木材、家具          | --             | --     |
| C3  | 造纸、印刷          | 7,952,576.00   | 1.92%  |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 34,791,282.54  | 8.40%  |
| C5  | 电子             | 4,965,394.00   | 1.20%  |
| C6  | 金属、非金属         | 51,538,070.99  | 12.44% |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 88,503,123.90  | 21.36% |
| C8  | 医药、生物制品        | 10,795,520.23  | 2.61%  |
| C99 | 其他             | --             | --     |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 23,705,342.71  | 5.72%  |
| E   | 建筑业            | --             | --     |
| F   | 交通运输、仓储业       | --             | --     |
| G   | 信息技术业          | --             | --     |
| H   | 批发和零售贸易        | 9,222,638.40   | 2.23%  |
| I   | 金融、保险业         | 14,184,670.00  | 3.42%  |
| J   | 房地产业           | --             | --     |
| K   | 社会服务业          | --             | --     |
| L   | 传播与文化产业        | --             | --     |

|   |     |                |        |
|---|-----|----------------|--------|
| M | 综合类 | --             | --     |
|   | 合 计 | 272,415,507.10 | 65.74% |

## 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）合计为 23,708,511.90 元，占基金资产净值的 5.72%。

## 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 117,738,577.27 元，占基金资产净值的 28.41%。

## 4. 基金投资的股票明细

| 序号 | 股票名称  | 数量        | 市值            | 占净值比例 |
|----|-------|-----------|---------------|-------|
| 1  | 国电电力  | 1,779,289 | 17,348,067.75 | 4.19% |
| 2  | 宝钢股份  | 3,025,972 | 15,432,457.20 | 3.72% |
| 3  | 上海汽车  | 1,250,406 | 14,854,823.28 | 3.58% |
| 4  | 海螺水泥  | 1,885,129 | 14,666,303.62 | 3.54% |
| 5  | 威孚高科  | 1,252,725 | 14,180,847.00 | 3.42% |
| 6  | 曙光股份  | 1,409,374 | 13,374,959.26 | 3.23% |
| 7  | 常林股份  | 1,398,200 | 10,668,266.00 | 2.57% |
| 8  | 海油工程  | 741,547   | 10,448,397.23 | 2.52% |
| 9  | 生益科技  | 1,150,000 | 10,166,000.00 | 2.45% |
| 10 | 民生银行  | 1,000,000 | 10,010,000.00 | 2.42% |
| 11 | 珠海中富  | 1,276,607 | 9,306,465.03  | 2.25% |
| 12 | 华联超市  | 833,120   | 9,222,638.40  | 2.23% |
| 13 | 三 爱 富 | 843,942   | 8,144,040.30  | 1.97% |
| 14 | 上海电气  | 767,422   | 8,088,627.88  | 1.95% |
| 15 | 铜都铜业  | 1,111,915 | 7,961,311.40  | 1.92% |
| 16 | 华泰股份  | 725,600   | 7,952,576.00  | 1.92% |
| 17 | 烟台万华  | 681,585   | 7,913,201.85  | 1.91% |
| 18 | 上海石化  | 1,620,528 | 7,033,091.52  | 1.70% |
| 19 | 金杯汽车  | 900,016   | 6,777,120.48  | 1.64% |
| 20 | 宇通客车  | 500,000   | 6,750,000.00  | 1.63% |
| 21 | 双汇发展  | 504,096   | 6,633,903.36  | 1.60% |
| 22 | 华北制药  | 911,801   | 5,680,520.23  | 1.37% |
| 23 | 海欣股份  | 462,000   | 5,617,920.00  | 1.36% |
| 24 | 恒瑞医药  | 500,000   | 5,115,000.00  | 1.23% |
| 25 | 鞍钢新轧  | 1,207,309 | 4,889,601.45  | 1.18% |
| 26 | 山东铝业  | 423,460   | 4,869,790.00  | 1.18% |
| 27 | 安彩高科  | 496,100   | 4,683,184.00  | 1.13% |
| 28 | 华能国际  | 289,000   | 4,303,210.00  | 1.04% |
| 29 | 招商银行  | 364,600   | 4,174,670.00  | 1.01% |

|    |      |         |                |        |
|----|------|---------|----------------|--------|
| 30 | 兰花科创 | 457,246 | 3,973,467.74   | 0.96%  |
| 31 | 巢东股份 | 537,371 | 3,718,607.32   | 0.90%  |
| 32 | 厦工股份 | 450,000 | 3,033,000.00   | 0.73%  |
| 33 | 红星发展 | 178,161 | 2,394,483.84   | 0.58%  |
| 34 | 韶能股份 | 237,739 | 2,054,064.96   | 0.50%  |
| 35 | 三一重工 | 33,000  | 513,480.00     | 0.12%  |
| 36 | 长电科技 | 23,000  | 282,210.00     | 0.07%  |
| 37 | 北方天鸟 | 10,000  | 96,000.00      | 0.02%  |
| 38 | 瑞贝卡  | 8,000   | 83,200.00      | 0.02%  |
|    | 合 计  |         | 272,415,507.10 | 65.74% |

## 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（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借方余额 527,434.30 元，股票市值 272,415,507.10 元、债券（不包括国债）23,708,511.90 元、国债及货币资金 117,738,577.27 元之和与其相加后等于基金净值。其他应收应付款项包括：深圳交易保证金、应收利息、配股权证、应付管理费、应付托管费、应付券商佣金、其他应付款、预提费用等。

### (五) 本期新增股票

| 序号 | 股票名称 | 本期增加   |           |    | 本期卖出      |
|----|------|--------|-----------|----|-----------|
|    |      | 一级市场认购 | 二级市场买入    | 其它 |           |
| 1  | 韶能股份 | -      | 1,204,200 | -  | 966,461   |
| 2  | 铜都铜业 | -      | 1,411,915 | -  | 300,000   |
| 3  | 鞍钢新轧 | -      | 2,707,309 | -  | 1,500,000 |
| 4  | 华能国际 | -      | 289,000   | -  | -         |
| 5  | 民生银行 | -      | 1,300,000 | -  | 300,000   |
| 6  | 三一重工 | 33,000 | -         | -  | -         |
| 7  | 上海汽车 | -      | 1,600,406 | -  | 350,000   |
| 8  | 兰花科创 | -      | 457,246   | -  | -         |
| 9  | 生益科技 | -      | 1,152,700 | -  | 2,700     |
| 10 | 山东铝业 | -      | 828,429   | -  | 404,969   |
| 11 | 安彩高科 | -      | 1,762,620 | -  | 1,266,520 |
| 12 | 曙光股份 | -      | 2,310,274 | -  | 900,900   |
| 13 | 巢东股份 | -      | 537,371   | -  | -         |
| 14 | 北方天鸟 | 10,000 | -         | -  | -         |
| 15 | 瑞贝卡  | 8,000  | -         | -  | -         |
| 16 | 长电科技 | 23,000 | -         | -  | -         |
| 17 | 金杯汽车 | -      | 4,350,340 | -  | 3,450,324 |



|    |      |   |           |   |         |
|----|------|---|-----------|---|---------|
| 18 | 上海石化 | - | 1,620,528 | - | -       |
| 19 | 常林股份 | - | 1,798,200 | - | 400,000 |
| 20 | 华北制药 | - | 911,801   | - | -       |
| 21 | 厦工股份 | - | 450,000   | - | -       |

### 新增股票附注

本表中“其他”项目包括：配股、转增、送股、增发、债转股。

### (六) 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  | 招商局A | 17,851    | -         | 17,851    |
| 2  | 深桑达A | -         | 210,000   | 210,000   |
| 3  | 深天马A | -         | 534,446   | 534,446   |
| 4  | 许继电气 | 300,000   | -         | 300,000   |
| 5  | 海虹控股 | -         | 17,674    | 17,674    |
| 6  | 丽珠集团 | 1,300,000 | 50,000    | 1,350,000 |
| 7  | 海螺型材 | 451,073   | -         | 451,073   |
| 8  | 格力电器 | -         | 250,000   | 250,000   |
| 9  | 模塑科技 | 37,300    | 58,602    | 95,902    |
| 10 | 韶钢松山 | -         | 1,549,175 | 1,549,175 |
| 11 | 云铝股份 | 350,000   | 50,000    | 400,000   |
| 12 | 辽河油田 | -         | 344,950   | 344,950   |
| 13 | 扬子石化 | 50,000    | 1,858,942 | 1,908,942 |
| 14 | 张裕A  | 320,711   | -         | 320,711   |
| 15 | 华菱管线 | 2,100,000 | 300,000   | 2,400,000 |
| 16 | 浦发银行 | -         | 1,100,000 | 1,100,000 |
| 17 | 白云机场 | -         | 841,000   | 841,000   |
| 18 | 上海机场 | 1,133,300 | 1,684,889 | 2,818,189 |
| 19 | 皖通高速 | 84,000    | -         | 84,000    |
| 20 | 中信证券 | 143,000   | -         | 143,000   |
| 21 | 四川路桥 | -         | 41,000    | 41,000    |
| 22 | 中国联通 | 947,632   | 1,591,900 | 2,539,532 |
| 23 | 同仁堂  | 525,046   | -         | 525,046   |
| 24 | 云天化  | 69,500    | -         | 69,500    |
| 25 | 波导股份 | 80,211    | 20,000    | 100,211   |
| 26 | 上海建工 | 410,184   | 420,000   | 830,184   |
| 27 | 冠农股份 | -         | 25,000    | 25,000    |
| 28 | 华芳纺织 | -         | 25,000    | 25,000    |
| 29 | 振华港机 | 1,260,700 | 180,000   | 1,440,700 |
| 30 | 航天动力 | -         | 28,000    | 28,000    |
| 31 | 精伦电子 | -         | 70,000    | 70,000    |
| 32 | 恒丰纸业 | -         | 137,000   | 137,000   |

|    |       |           |         |           |
|----|-------|-----------|---------|-----------|
| 33 | 三 房 巷 | -         | 14,000  | 14,000    |
| 34 | 星马汽车  | -         | 12,000  | 12,000    |
| 35 | 北京巴士  | 264,728   | -       | 264,728   |
| 36 | 太工天成  | -         | 14,000  | 14,000    |
| 37 | 安泰集团  | -         | 26,000  | 26,000    |
| 38 | 三友化工  | -         | 43,000  | 43,000    |
| 39 | 江淮汽车  | -         | 10,000  | 10,000    |
| 40 | 冠豪高新  | -         | 28,000  | 28,000    |
| 41 | 片 仔 癯 | -         | 26,000  | 26,000    |
| 42 | 时代新材  | 15,000    | 40,000  | 55,000    |
| 43 | 贵研铂业  | -         | 17,000  | 17,000    |
| 44 | 士 兰 微 | -         | 15,000  | 15,000    |
| 45 | 双良股份  | -         | 36,000  | 36,000    |
| 46 | 中科合臣  | -         | 12,000  | 12,000    |
| 47 | 中化国际  | 1,375,375 | -       | 1,375,375 |
| 48 | 安徽水利  | -         | 23,000  | 23,000    |
| 49 | 宏智科技  | -         | 150,000 | 150,000   |
| 50 | 腾达建设  | 23,000    | -       | 23,000    |
| 51 | 联环药业  | -         | 10,000  | 10,000    |
| 52 | 第一投资  | 4,000     | -       | 4,000     |
| 53 | 华海药业  | -         | 17,000  | 17,000    |
| 54 | 中天科技  | 30,000    | -       | 30,000    |
| 55 | 山东药玻  | -         | 219,370 | 219,370   |
| 56 | 华阳科技  | 20,000    | -       | 20,000    |
| 57 | 海通集团  | -         | 17,000  | 17,000    |
| 58 | 北海国发  | -         | 17,000  | 17,000    |
| 59 | 厦门钨业  | 11,000    | -       | 11,000    |
| 60 | 方兴科技  | 2,800     | -       | 2,800     |
| 61 | 茉 织 华 | 324,044   | 150,000 | 474,044   |
| 62 | 康缘药业  | 13,000    | -       | 13,000    |
| 63 | 高淳陶瓷  | -         | 8,000   | 8,000     |
| 64 | 法拉电子  | 18,000    | -       | 18,000    |
| 65 | 迪马股份  | 4,000     | -       | 4,000     |
| 66 | 惠泉啤酒  | -         | 20,000  | 20,000    |
| 67 | 芜 湖 港 | -         | 17,000  | 17,000    |
| 68 | 庆丰股份  | -         | 16,000  | 16,000    |
| 69 | 黄海股份  | -         | 106,600 | 106,600   |
| 70 | 上海航空  | 58,000    | -       | 58,000    |
| 71 | 光明乳业  | 279,766   | -       | 279,766   |
| 72 | 青岛啤酒  | 78,806    | -       | 78,806    |
| 73 | 广电电子  | -         | 945,205 | 945,205   |
| 74 | 第一食品  | 126,450   | -       | 126,450   |
| 75 | 华联商厦  | 450,000   | -       | 450,000   |
| 76 | 新 黄 浦 | 420,821   | 162,863 | 583,684   |

|    |      |           |         |           |
|----|------|-----------|---------|-----------|
| 77 | 申能股份 | -         | 902,417 | 902,417   |
| 78 | 兆维科技 | 215,976   | 356,355 | 572,331   |
| 79 | 强生控股 | 608,800   | -       | 608,800   |
| 80 | 大商股份 | -         | 416,580 | 416,580   |
| 81 | 彩虹股份 | -         | 273,778 | 273,778   |
| 82 | 巴士股份 | 1,503,223 | 299,130 | 1,802,353 |
| 83 | 通化东宝 | 200,000   | -       | 200,000   |
| 84 | 伊利股份 | 33,750    | -       | 33,750    |

## 六. 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 0.05 亿基金单位, 占基金发行总份额的 1.00%, 其中:

| 发 起 人       | 持有份额(单位)  | 占总份额比例 |
|-------------|-----------|--------|
| 华安基金管理有限公司  | 5,000,000 | 1.00%  |
| 其中: 未上市流通份额 | 2,500,000 | 0.50%  |

社会公众持有的基金份额为 495,000,000 基金单位, 占基金发行总份额的 99.00%。

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  | 海通证券股份有限公司   | 230,500,000 | 46.10% |
| 2  | 国泰君安证券股份有限公司 | 5,000,000   | 1.00%  |
| 3  | 华安基金管理有限公司   | 5,000,000   | 1.00%  |
| 4  | 陈莹           | 4,786,490   | 0.96%  |
| 5  | 唐朝           | 2,579,551   | 0.52%  |
| 6  | 中国再保险公司      | 2,299,026   | 0.46%  |
| 7  | 梅县坝头水电站      | 1,500,000   | 0.30%  |
| 8  | 渤海证券有限责任公司   | 1,407,000   | 0.28%  |
| 9  | 吴少勋          | 1,246,600   | 0.25%  |
| 10 | 聂彬           | 1,116,000   | 0.22%  |

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深圳分公司传送的截止 2003 年 6 月 30 日基金安久前 100 名持有人名册汇总统计而来。

## 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. 本基金本期不分配。
3. 本期新增浙江证券有限责任公司的席位作为本基金的交易席位。
4. 券商 2003 年 1-6 月成交量及年佣金情况如下:

## ①股票交易情况:

| 券 商          | 股票年成交量         | 占总成交量<br>比例 | 年佣金        | 占总佣金<br>量比例 | 平均佣金<br>比率 |
|--------------|----------------|-------------|------------|-------------|------------|
| 东方证券有限责任公司   | 203,554,282.15 | 22.96%      | 164,131.35 | 22.97%      | 0.08%      |
| 申银万国证券股份有限公司 | 163,789,892.16 | 18.47%      | 133,570.19 | 18.69%      | 0.08%      |
| 上海证券有限责任公司   | 69,499,460.71  | 7.84%       | 54,384.98  | 7.61%       | 0.08%      |
| 平安证券有限责任公司   | 183,222,568.94 | 20.66%      | 148,729.08 | 20.81%      | 0.08%      |
| 光大证券有限责任公司   | 101,964,437.03 | 11.50%      | 79,788.78  | 11.17%      | 0.08%      |
| 浙江证券有限责任公司   | 164,671,288.58 | 18.57%      | 133,946.39 | 18.75%      | 0.08%      |
| 合 计          | 886,701,929.57 | 100.00%     | 714,550.77 | 100.00%     | 0.08%      |

## ②债券和回购交易情况:

| 券 商          | 债券年成交量         | 比例      | 回购年成交量         | 比例      |
|--------------|----------------|---------|----------------|---------|
| 东方证券有限责任公司   | 136,240,967.90 | 34.21%  | 90,000,000.00  | 28.48%  |
| 申银万国证券股份有限公司 | 53,506,021.80  | 13.44%  | 30,000,000.00  | 9.49%   |
| 上海证券有限责任公司   | 33,646,198.60  | 8.45%   | -              | -       |
| 平安证券有限责任公司   | 49,309,467.20  | 12.38%  | 120,000,000.00 | 37.97%  |
| 光大证券有限责任公司   | 67,290,669.50  | 16.90%  | -              | -       |
| 浙江证券有限责任公司   | 58,224,054.20  | 14.62%  | 76,000,000.00  | 24.05%  |
| 合 计          | 398,217,379.20 | 100.00% | 316,000,000.00 | 100.00% |

## 八. 备查文件目录

1. 中国证监会批准安久证券投资基金设立的文件。
2. 《安久证券投资基金基金契约》。
3. 《安久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. 安久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。

华安基金管理有限公司

2003 年 8 月 29 日