

重要提示：本基金的托管人交通银行已于 2002 年 8 月 21 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

久富证券投资基金是根据中国证券监督管理委员会《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久嘉证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2002]11 号)批准,由原富岛基金、兴沈基金、久盛基金经清理规范、合并而成的契约型封闭式证券投资基金,基金发起人为长城证券有限责任公司和长城基金管理有限公司。基金久富于 2002 年 4 月 18 日在深交所上市,基金存续期延长五年(至 2007 年 5 月 20 日)。本基金于 2002 年 5 月 28 日成功扩募至 5 亿份基金单位,每份基金单位面值 1 元,发起人认购 500 万份,其余 49500 万份由社会公众持有,扩募部分于 2002 年 6 月 6 日在深交所上市交易。

(一)基金简称:基金久富

基金久富交易代码:184720

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

基金上市地:深圳证券交易所

(二)基金管理人法定名称:长城基金管理有限公司

注册地址:深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

邮政编码:518031

法定代表人:杨光裕

总经理:汪滨

负责信息管理事务人员:李建中

联系地址:深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

电话:0755-83662688

传真:0755-83662600

(三)基金托管人法定名称:交通银行

注册地址:上海市仙霞路 18 号

办公地址:上海市仙霞路 18 号

邮政编码:200336

国际互联网网址:www.bankcomm.com

法定代表人:方诚国

托管部总经理:谢红兵

负责信息管理事务人员:江永珍

联系地址:上海市仙霞路 18 号

电话:021-62751234

传真:021-62750005

电子邮件:webmaster@hq.bankcomm.com

二、主要财务指标

2001 年 12 月 18 日—2002 年 6 月 30 日

| 序号 | 项目 | |
|----|-----------|---------------|
| 1 | 基金本期净收益 | 12,288,484.13 |
| 2 | 单位基金本期净收益 | 0.0246 |
| 3 | 基金可分配净收益 | 12,625,691.77 |

| | | |
|----|-------------|----------------|
| 4 | 单位基金可分配净收益 | 0.0253 |
| 5 | 期末基金资产总值 | 634,079,221.57 |
| 6 | 期末基金资产净值 | 527,136,351.70 |
| 7 | 单位基金资产净值 | 1.0543 |
| 8 | 基金资产净值收益率 | 3.94% |
| 9 | 本期基金资产净值增长率 | 5.98% |
| 10 | 累计资产净值增长率 | 5.98% |

上述部分指标计算公式:

基金资产净值收益率 = 基金本期净收益 / (期初资产净值 * 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

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

(一) 基金管理人报告

1、基金经理简介

许良胜,男,31岁,经济学硕士。1997年毕业于北京大学光华管理学院,1997年7月至2001年就职于长城证券有限责任公司,先后任投资银行总部项目经理、资产管理部总经理助理等职。有5年证券从业经历,4年证券投资经历。

2、本基金的投资风格和投资策略

本基金为价值型基金,主要投资于价值被低估的股票,通过组合投资,在注重流动性和规避投资风险的前提下,谋求基金资产的稳定增长。在投资策略方面,主要采取主动型投资,注重股票相对投资价值的研究,关注股票价格明显低于市场合理预期价值(价格)的公司股票,同时注重市场机构投资者行为的研究,把握处于转型阶段的新兴市场的发展方向。

3、本基金本报告期业绩表现

截止到2002年6月30日,本基金单位资产净值为1.0543元,由于本基金2002年5月28日完成扩募工作,本报告期内基金净值增长率为5.98%,同期沪深综合指数平均涨幅为3.055%。

4、行情回顾及分析

尽管2002年上半年我国宏观经济走出了增长率持续下滑的低谷,保持了比较快速的生长,但是,沪深市场总体走势仍然比较软弱,一方面,这是对过去两年市场持续走牛的正常调整,也是上市公司2001年业绩普遍出现下滑的正常反应,另一方面,具备“新兴”+“转轨”市场特征的沪深股市仍受政策面的较大影响,政策面和消息面成为左右指数走势的最主要因素。年初对国有股减持方案的讨论导致指数一路下行,国有股减持阶段性成果的出台使指数下跌到最低点;随后在降息、浮动佣金制的实施、新股市值配售发行、外资参股券商基金规则出台、提高增发门槛、国有股停止减持等一系列政策陆续推出的刺激下,指数多次出现反弹,尤其国有股停止在国内证券市场减持的政策出台后,出现了指数涨幅超过9%,成交量超过900亿元的火爆行情。

5、基金运作情况回顾

本基金今年年初正式开始运作,针对上半年证券市场受政策面影响显著、市场热点持续性不明显的特点,本基金采取了相对稳健的投资策略,一方面控制股票投资的比重,在政策面和市场走势不明朗的情况下保持了比较低的股票比重;一方面秉承价值型投资理念,重点选取业绩稳定、市盈率低的价值型品种进行长期投资,同时加强了对机构投资者投资行为的

研究，以及根据国家产业政策的变化对外资并购可能发生的领域如金融业、电子、机械、设备制造业、商品批发零售业等行业予以重点关注；在国有股减持停止实施的政策出台后，本基金认为影响国内证券市场的主要因素中期内已经消除，因而较大幅度的增加了股票投资的比重。

6、2002年下半年投资策略

久富基金认为，根据对中国证券市场“新兴”+“转轨”的市场特征的认识，宏观经济形势、政策面和资金面仍是影响下半年证券市场整体走势的重要因素。

从宏观层面分析：2002年下半年党的“十六大”即将召开，宏观政治环境将继续保持稳定；在国家积极财政政策和国际经济复苏带来对外贸易强劲增长的带动下，宏观经济扭转了去年经济增长持续下跌的不利局面，上半年GDP增长达到7.5%，预计全年有望保持这一水平，宏观经济的稳定发展将在证券市场上得到反映；上半年国家出台了较多的对证券市场偏暖的政策，尤其是国有股停止通过国内证券市场减持政策的出台解决了近一年来困扰证券市场的最主要的问题，预计2002年下半年政策面将会比较平稳，不会有大的政策出台，稳定发展将是主基调，双向扩容仍将是主要特色。

从资金层面分析：我们预计管理层会继续采取措施大力发展包括证券投资基金、商业保险和社保基金在内的机构投资者，积极引导储蓄资金转化为证券投资资金，适度开放国内证券市场，对国内证券市场资金供求关系产生积极影响。

从上市公司基本面分析：随着管理层一系列监管措施的实施，上市公司的法人治理结构将日趋完善，公司信息披露将日趋规范，同时宏观经济的向好将推动企业效益的回升；更为重要的是，随着中国加入WTO后有关产业政策的对内对外开放，外资并购和国内企业积极参与国际化竞争将推动国内各产业的结构调整、战略性重组和产业升级，上市公司的基本面将发生根本性变化。

综合以上几方面的因素的分析，久富基金对2002年下半年的证券市场持相对乐观态度。

基于以上判断，久富基金将采取相对比较积极的投资策略。针对全球经济的复苏，我国宏观经济的稳健发展，以及随着政府相关政策的逐步放开，大的产业整合背景下的战略性重组将逐渐展开，久富基金将对以下行业给予更多的关注：技术密集型行业中出现行业复苏的电子、设备制造业和信息技术业；有可能引入外资参股提升经营管理能力的金融业、信托业；向新业态扩展、存在较多行业战略性重组机会的商品批发零售业；具有一定国际竞争优势的钢铁、医药制造业；市场前景广阔、有可能吸引外资从而引进国际先进技术和提升竞争力、盈利能力的汽车制造业；拥有自然垄断地位的公用事业、港口运输业等。

久富基金也注意到，影响证券市场长期发展的制度性因素还将继续对证券市场产生不确定性的影响，这些因素主要有：国有股流通问题还没有从根本上解决，任何相关政策的出台都将对证券市场的基础产生重大影响；QDII、QFII等政策出台的方式、时机等也将对证券市场产生结构性的影响；创业板或者科技板及指数期货的推出、三板市场、B股市场的政策变化、CDR以及A股上市公司在海外增发新股等都将对A股市场产生不确定的影响，这些因素将增加下半年基金投资管理的难度。久富基金将继续坚持价值型投资理念，尊重中国证券市场所处的发展阶段和历史投资习惯，注重借鉴西方成熟资本市场的经验，规范运作、勤勉尽责，为基金持有人谋求长期稳定的投资回报。

（二）内部监察稽核报告

1、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《久富证券投资基金基金契约》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作，在控制和防范风险的前提下，为基金持有人谋求基金资产的

长期稳定增值。基金久富的投资组合符合有关法律法规的规定及基金契约的约定，无损害投资者利益的行为。

2、内部监察稽核工作报告

本报告期内，本基金管理人从保障基金持有人利益、防范运作风险出发，通过公司风险控制委员会、合规控制委员会、督察员和监察稽核部、各业务部门和具体岗位实施三层内部控制和风险防范措施，严格履行契约承诺，强化内控机制和纪律程序，保证各项法规规定和管理制度的落实，保护基金持有人的合法权益。

本报告期内，监察稽核工作的重点是建立合理的监察稽核工作体系，监察稽核项目包含了基金投资、基金交易、市场开发、研究策划、运作保障、综合管理等业务的各个环节，由独立的内部监察稽核工作人员，以实时监控、定期和不定期稽核相结合的工作方式，通过各种监察方法和稽核程序，检查基金投资运作的合法合规情况，发现业务隐患和工作中存在的问题，及时提出改进意见并督促整改，定期作出监察稽核报告，上报公司管理层和行政监管部门。

内部控制的重点是确保本基金管理人所管理基金运作的合规性，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格履行信息披露义务，保证履行基金契约的承诺。在本报告期内，本基金运作中无操纵市场行为、内幕交易和不当关联交易，保障了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的职业素养和守法意识，细化投资监控程序，加强电子监控手段，使风险控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将取信于市场，取信于社会，诚实信用，勤勉尽责，以专业化的经营方式管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

四、基金托管人报告

2002 上半年度，交通银行作为久富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《久富证券投资基金契约》和《久富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，安全保管久富基金的所有资产，做好久富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，切实维护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。

2002 上半年度，交通银行作为久富证券投资基金的托管人，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，由基金管理人编制和披露的 2002 上半年度久富证券投资基金每周资产净值公告、每季度投资组合公告和中期财务报告是合法、真实和完整的。

五、基金中期财务报告（未经审计）

（一）基金会计报告书

1. 资产负债报告书

单位：人民币元
2002 年 6 月 30 日

| 资 产 | 附 注 | |
|---------|------|---------------|
| 银行存款 | | 3,453,999.02 |
| 清算备付金 | 3(4) | 55,542,375.88 |
| 交易保证金 | | 1,250,000.00 |
| 应收证券清算款 | 3(5) | 55,869,263.84 |
| 应收股利 | | 89,774.21 |

| | | |
|---------------|--------------|----------------|
| 应收利息 | 5(3) | 1,219,732.98 |
| 股票投资市值 | 3(6) | 373,693,657.84 |
| 其中：股票投资成本 | | 358,283,957.16 |
| 债券投资市值 | 3(7) | 142,960,417.80 |
| 其中：债券投资成本 | | 143,859,458.55 |
| 资产合计： | | 634,079,221.57 |
| 负 债 | | |
| 应付证券清算款 | 3(5) | 2,316,769.53 |
| 应付管理人报酬 | 3(9)、4(3-1) | 608,562.06 |
| 应付基金托管费 | 3(10)、4(3-2) | 103,214.14 |
| 应付佣金 | | 579,127.16 |
| 卖出回购证券款 | 3(11) | 100,000,000.00 |
| 预提费用 | 5(4) | 228,108.87 |
| 其他应付款项 | 5(5) | 3,107,088.11 |
| 负债合计： | | 106,942,869.87 |
| 基金持有人权益 | | |
| 实收基金 | 3(13)、5(6) | 500,000,000.00 |
| 未实现利得 | 5(8) | 14,510,659.93 |
| 未分配收益 | 3(14) | 12,625,691.77 |
| 持有人权益合计： | | 527,136,351.70 |
| 负债及基金持有人权益合计： | | 634,079,221.57 |
| 基金单位发行总份额 | | 500,000,000.00 |
| 基金资产净值 | | 527,136,351.70 |
| 每份基金单位资产净值 | | 1.0543 |

2. 基金经营业绩及收益分配报告书

单位：人民币元

2001年12月18日——2002年6月30日

| 收 入 | 附 注 | |
|----------|--------------|---------------|
| 股票差价收入 | 3(8-1) | 5,407,884.35 |
| 债券差价收入 | 3(8-2) | 2,768,103.66 |
| 债券利息收入 | 3(8-3) | 1,871,841.43 |
| 存款利息收入 | 3(8-4) | 4,393,848.74 |
| 股利收入 | 3(8-5) | 1,152,608.68 |
| 其他收入 | 3(8-7)、5(7) | 25,297.28 |
| 收入合计 | | 15,619,584.14 |
| 费 用 | | |
| 基金管理人报酬 | 3(9)、4(3-1) | 2,495,436.08 |
| 基金托管费 | 3(10)、4(3-2) | 420,746.82 |
| 卖出回购证券支出 | 3(12) | 177,077.74 |
| 其他费用 | | 237,839.37 |
| 其中：信息披露费 | 5(4) | 178,520.30 |
| 会计师费用 | 5(4) | 49,588.57 |
| 其他 | | 9,730.50 |
| 费用合计 | | 3,331,100.01 |

| | |
|--------------|---------------|
| 基金净收益 | 12,288,484.13 |
| 加：未实现利得 | 14,510,659.93 |
| 基金经营业绩 | 26,799,144.06 |
| 本期基金净收益 | 12,288,484.13 |
| 加：期初未分配收益 | 337,207.64 |
| 减：本期已分配基金净收益 | 0.00 |
| 期末未分配净收益 | 12,625,691.77 |

3. 基金净值变动报告书

单位：人民币元

2001年12月18日——2002年6月30日

| | |
|------------------|----------------|
| 期初基金净值 | 254,034,767.64 |
| 本期经营活动 | |
| 已实现基金净收益 | 12,288,484.13 |
| 未实现利得 | 14,510,659.93 |
| 经营活动产生的基金净值变动数 | 26,799,144.06 |
| 本期基金单位交易 | |
| 基金申购款(扩募) | 246,302,440.00 |
| 基金赎回款 | 0.00 |
| 基金单位交易产生的基金净值变动数 | 246,302,440.00 |
| 本期向持有人分配收益 | 0.00 |
| 期末基金净值 | 527,136,351.70 |

(二) 会计报告书附注

1. 基金设立说明

久富证券投资基金是根据中国证券监督管理委员会《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久嘉证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2002]11号)批准,由原富岛基金、兴沈基金、久盛基金经清理规范、合并而成的契约型封闭式证券投资基金,基金发起人为长城证券有限责任公司和长城基金管理有限公司。基金久富于2002年4月18日在深交所上市,基金存续期延长五年(至2007年5月20日)。本基金于2002年5月28日成功扩募至5亿份基金单位,每份基金单位面值1元,发起人认购500万份,其余49500万份由社会公众持有,扩募部分于2002年6月6日在深交所上市交易。

2. 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照中华人民共和国《企业会计准则》、财政部2001年11月11日颁布的《证券投资基金会计核算办法》、证监发[1999]11号《证券投资基金管理暂行办法》实施准则第五号——“证券投资基金信息披露指引”、证监基金字[2000]35号关于《证券投资基金信息披露指引》的补充通知、2001年9月17日颁布的证监基金字[2001]43号《关于证券投资基金业绩报酬有关问题的通知》及基金契约的规定而编制。

自设立日起,本基金执行《证券投资基金会计核算办法》。

3. 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。本会计期间为2001年12月18日(基金成立日)至2002年6月30日止。

(2) 记帐本位币

以人民币为记帐本位币。记帐单位为元。

(3) 记帐原则和计价基础

本基金的会计核算以权责发生制为记帐原则，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。

(4)清算备付金

为证券交易的资金交割与交收而存入证券登记结算机构的款项。

(5)证券清算款

因买卖证券、回购证券、申购新股、配售股票等业务而发生的，应与证券登记结算机构办理资金清算的款项。

如果卖出证券成交总额大于买入证券成交总额为应收证券清算款。

如果买入证券成交总额大于卖出证券成交总额为应付证券清算款。

(6)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资(成本)。股票投资(成本)按成交日应支付的全部价款入帐。

卖出股票于成交日确认股票差价收入，股票差价收入按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。卖出股票应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

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平均价估值；估值日无交易的，以最近一交易日的市场交易平均价估值。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未上市股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易平均价估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

(7)债券投资

买入上市债券应于成交日确认债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，应支付的全部价款中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。买入非上市债券应于实际支付价款时确认债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，如果实际支付的价款中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。

卖出上市债券于成交日确认债券差价收入。债券差价收入按卖出债券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。卖出非上市债券应于实际收到全部价款时确认债券差价收入，债券差价收入按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。卖出债券的成本应逐日进行结转，结转的方法采用移动加权平均法。

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

(8)收入确认

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、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、存款利息收入逐日计提，并按本金与适用的利率计提的金额入账。

5、股利收入于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

6、 买入返售证券收入应在证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。
7、 除上述收入以外的其他各项收入，如新股、配股手续费返还等，在实际收到时确认收入。

(9) 基金管理人报酬

基金管理人报酬按《久富证券投资基金基金契约》和《久富证券投资基金基金扩募说明书》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；基金成立三个月后，如持有现金比例高于基金资产净值的 20%，超过部分不计提基金管理费，基金管理人报酬按月支付。

(10) 基金托管费

基金托管费按《久富证券投资基金基金契约》和《久富证券投资基金基金扩募说明书》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。

(11) 卖出回购证券款

通过国家规定的场所进行证券回购业务卖出证券取得的款项。期末贷方余额反映卖出尚未回购的证券款。

(12) 卖出回购证券支出

卖出回购证券在融资期限内采用直线法逐日计提的融资利息支出。

(13) 实收基金

实收基金为实际收到的基金单位发行总额。

(14) 基金的收益分配原则

1、 基金收益分配采取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。

(15) 主要税项

A. 印花税

根据财税字[1998]55 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》，对基金管理人运用基金买卖股票按照 0.4% 的税率征收印花税；自 2001 年 11 月 16 日起，财政部决定将印花税率减半，按照 0.2% 的税率计缴。

B. 营业税

根据财税字[1998]55 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2001]61 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》，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；基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入，在 2003 年 12 月 31 日止以前暂免征收营业税。

C. 企业所得税

根据财税字[1998]55 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》，基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的价差收入，股票的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 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 |
|------------|-------------------|--------|--------|
| 长城基金管理有限公司 | 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 |
| 长城证券有限责任公司 | 基金管理人的股东 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 | 基金管理人的股东 | 租用交易席位 | 席位使用协议 |
| 西北证券有限责任公司 | 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

2001年12月18日(基金成立日)至2002年6

月30日止期间

| 佣金 关联人 佣金 占佣金总 量比例% | 买卖股票成交量 | | 买卖债券成交量 | |
|---------------------------------|----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| | 本期成交量 | 占本期成 交总量的 比例 | 本期成交量 | 占本期成 交总量的 比例 |
| 长城证券有限 254,309.38 31.79% | 321,773,054.63 | 31.74% | 624,781,489.90 | 43.59% |
| 东方证券有限 116,465.19 14.56% | 148,195,082.26 | 14.62% | 170,245,720.10 | 11.88% |
| 西北证券有限 377,873.60 47.24% | 478,835,898.08 | 47.24% | 503,998,940.20 | 35.16% |
| 合计 748,648.17 93.59% | 948,804,034.97 | 93.60% | 1,299,026,150.20 | 90.63% |

(3)管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额

1 基金管理人报酬

支付基金管理人长城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；基金成立三个月后，如持有现金比例高于基金资产净值的 20%，超过部分不计提基金管理费；基金管理人报酬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。

本基金于本期应付基金管理人基金管理费人民币 2,495,436.08 元，其中已支付人民币 1,886,874.02 元，尚余人民币 608,562.06 元未支付。

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。

本基金于本期应付基金托管人基金托管费人民币 420,746.82 元，其中已支付人民币 317,532.68 元，尚余人民币 103,214.14 元未支付。

5. 主要报表项目说明

(1) 清理、合并上市费用明细及结余情况

收到基金清理、合并上市费用 2,562,602.37
该笔费用尚未支付。

(2) 扩募发行费用明细及结余情况

收到扩募发行费 2,463,024.40
减：付券商手续费 311,318.99
付 A1 配股登记费 723,907.36
付长城证券有限责任公司有关费用 1,427,798.05
合 计 0.00

根据《久富证券投资基金扩募说明书》，本次扩募总数量为 246,302,440 份基金单位。

根据《长城基金管理有限公司与长城证券有限责任公司关于久富基金扩募至 5 亿份基金单位之主承销协议》，长城证券有限责任公司从扩募的每份基金单位中提取 0.01 元扩募费用，本次扩募费用包括：公告费、承销商的承销费、会计师和律师的中介费，交易所上网发行有关费用等，以上具体费用均由主承销商统一支付。

本基金扩募支付长城证券有限责任公司有关费用为：收到的扩募发行费扣除交易所上网发行的券商手续费、A1 配股登记费后的其他所有费用。

本基金扩募期认购资金所产生的配股利息收入共计人民币 6,191.93 元，归基金所有。

(3) 应收利息

应收银行存款利息 12,132.15
应收清算备付金利息 17,450.60
应收债券利息 1,190,150.23
合 计 1,219,732.98

(4) 预提费用

根据《证券投资基金会计核算办法》预计将发生的、影响基金单位净值小数点后第五位的费用，应预提计入本期的费用。

本基金预计全年会计师费为人民币 100,000.00，信息披露费为人民币 360,000.00，按全年 365 天逐日预提。截止 2002 年 6 月 30 日止预提费用共计人民币 228,108.87。

预提会计师费 49,588.57
预提信息披露费 178,520.30
合 计 228,108.87

(5) 其他应付款

基金清理、合并上市费用 2,562,602.37
长城证券有限责任公司缴纳深交所两金 500,000.00
应付卖出回购证券利息 44,485.74
合 计 3,107,088.11

(6) 实收基金

| | 基金单位数 | 实收基金 |
|---------|-------------|----------------|
| 期初数 | 253,697,560 | 253,697,560.00 |
| 加：本期扩募数 | 246,302,440 | 246,302,440.00 |
| 期末数 | 500,000,000 | 500,000,000.00 |

(7) 其他收入

其他收入主要包括本基金扩募期认购资金所产生的利息收入、新股申购而产生手续费返还款项。

| | |
|-------------------|-----------|
| 基金扩募期认购资金所产生的利息收入 | 6,191.93 |
| 新股申购手续费返还 | 19,105.35 |
| 合计 | 25,297.28 |

(8) 未实现利得

未实现利得根据《证券投资基金会计核算办法》规定的估值原则，以及基金契约和招募说明书载明的估值事项，对资产估值时所形成的未实现利得。

本基金本期未实现利得共计人民币 14,510,659.93。

(三) 流通转让受到限制的基金资产

1、基金获配新股，从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。

2000年5月18日起，根据中国证监会的有关政策，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签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与新股网上申购从新股中签日至新股上市日，为流通受限制而不能自由转让的资产。

本基金截至2002年6月30日作为一般法人投资者配售股份流通受到限制的股票情况如下：

| 股票名称 | 网下申购 市值 | 上市日期 | 可流通日期 | 发行 价格 | 估值 价格 | 中签数量 |
|------|----------------------------|------------|------------|----------|----------|---------|
| 招商银行 | 2002.04.01 1,400,256.00 | 2002.04.09 | 2002.07.10 | 7.30 | 11.44 | 122,400 |

2、基金参加二级市场投资者配售方式获配新股，从新股获配日至新股上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。

2002年5月21日起，根据2002年5月21日证监发行字[2002]54号《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》沪深两市投资者均可根据其持有的上市流通股票的市值自愿申购新股。发行公司及其主承销商采用向二级市场投资者配售方式发行新股的，其基本原则是优先满足市值申购部分，在此前提下，配售比例应在50%至100%之间确定。发行公司及其主承销商在招股意向书刊登后，根据市场情况或累计投标结果确定股票发行价格，并以此价格向二级市场投资者配售。证券投资基金(包括开放式基金)可以参与申购和配售。投资者持有的基金暂不计入市值参与配售。

本基金截至2002年6月30日参加二级市场投资者配售方式获配新股，其获配新股流通受到限制的股票情况如下：

| 股票名称 | 二级市场配 市值 | 上市日期 | 可流通日期 | 发行 价格 | 估值 价格 | 中签数量 |
|------|-------------------------|------------|------------|----------|----------|--------|
| 安源股份 | 2002.06.20 77,870.00 | 2002.07.02 | 2002.07.02 | 5.99 | 5.99 | 13,000 |
| 宏智科技 | 2002.06.27 43,400.00 | 2002.07.09 | 2002.07.09 | 8.68 | 8.68 | 5,000 |
| 泰豪科技 | 2002.06.24 19,040.00 | 2002.07.03 | 2002.07.03 | 4.76 | 4.76 | 4,000 |

(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) | 市值占净值比例 |
|----|------------------|----------------|---------|
| 1 | A 农、林、牧、渔业 | —— | —— |
| 2 | B 采掘业 | —— | —— |
| 3 | C 制造业 | 102,627,332.31 | 19.47% |
| | 其中: C0 食品、饮料 | 15,367,830.45 | 2.92% |
| | C1 纺织、服装、皮毛 | 1,114,500.00 | 0.21% |
| | C2 木材、家具 | —— | —— |
| | C3 造纸、印刷 | 941,442.00 | 0.18% |
| | C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 2,703,600.00 | 0.51% |
| | C5 电子 | 41,869,354.61 | 7.94% |
| | C6 金属、非金属 | 5,701,828.58 | 1.08% |
| | C7 机械、设备、仪表 | 17,059,872.96 | 3.24% |
| | C8 医药、生物制品 | 13,326,903.71 | 2.53% |
| | C9 其他制造业 | 4,542,000.00 | 0.86% |
| 4 | D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 20,305,132.90 | 3.85% |
| 5 | E 建筑业 | 16,161,880.76 | 3.07% |
| 6 | F 交通运输、仓储业 | 16,444,935.17 | 3.12% |
| 7 | G 信息技术业 | 119,069,046.89 | 22.59% |
| 8 | H 批发和零售贸易 | 12,137,337.82 | 2.30% |
| 9 | I 金融、保险业 | 53,383,040.90 | 10.13% |
| 10 | J 房地产业 | —— | —— |
| 11 | K 社会服务业 | 9,264,700.00 | 1.76% |
| 12 | L 传播与文化产业 | 14,131,052.16 | 2.68% |
| 13 | M 综合类 | 10,169,198.93 | 1.93% |
| | 合 计 | 373,693,657.84 | 70.89% |

2、债券(不包括国债)合计

截止 2002 年 6 月 30 日, 本基金持有的债券(不包括国债)市值合计为 19,371,877.50 元(不包括应计利息), 占基金资产净值的 3.67%。

3、国债、货币资金合计

截止 2002 年 6 月 30 日, 基金持有的国债市值及货币资金合计为元 236,137,409.51 国债不包括应计利息, 货币资金含当日证券清算款), 占基金资产净值的 44.80%。

4、基金投资前十名股票明细

| 序号 | 名称 | 市值(元) | 市值占净值比例(%) |
|----|-------|---------------|------------|
| 1 | 中信国安 | 29,191,203.06 | 5.54% |
| 2 | 深发展 A | 28,590,527.40 | 5.42% |
| 3 | 清华同方 | 27,774,009.52 | 5.27% |
| 4 | 东软股份 | 18,649,400.00 | 3.54% |
| 5 | 中兴通讯 | 18,312,939.48 | 3.47% |
| 6 | 上海贝岭 | 15,039,097.60 | 2.85% |
| 7 | 中铁二局 | 15,030,880.76 | 2.85% |
| 8 | 歌华有线 | 14,131,052.16 | 2.68% |
| 9 | 长城电脑 | 12,381,848.71 | 2.35% |
| 10 | 贵州茅台 | 11,770,354.44 | 2.23% |

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报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 2002 年 6 月 30 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 102,066,593.15 元，与股票市值 373,693,657.84 元、债券市值(不包括国债)19,371,877.50 元、国债市值及货币资金 236,137,409.51 元之和相抵后等于基金净值。其他应收应付款项包括：深圳交易保证金、应收股利、应收利息、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、应付利息、其他应付款、卖出回购证券款、预提费用等。

(五) 基金投资股票明细(见附表)

(六) 本期新增股票(见附表)

(七) 本期剔除股票(见附表)

六、基金持有人结构及基金前十名持有人

(一) 截止 2002 年 6 月 30 日，本基金份额结构为：

| | 六月末持有份额 | 占总份额比例 |
|---------------|-------------|---------|
| 发起人持有 | 5,000,000 | 1.00% |
| 其中：长城基金管理有限公司 | 2,500,000 | 0.50% |
| 长城证券有限责任公司 | 2,500,000 | 0.50% |
| 社会公众持有 | 495,000,000 | 99.00% |
| 合计 | 500,000,000 | 100.00% |

(注：长城证券有限责任公司共持有久富基金 37,784,223 份基金单位，其中 2,500,000 份基金单位为发起人持有)

(二) 截止 2002 年 6 月 30 日，前十名持有人名称、持有份额及比例如下：

| 序号 | 持有人名称 | 期末持份额 | 持有比例% |
|----|---------------|------------|-------|
| 1 | 长城证券有限责任公司 | 37,784,223 | 7.56% |
| 2 | 贵州省贵财投资有限责任公司 | 8,626,651 | 1.73% |
| 3 | 张海欣 | 4,582,598 | 0.92% |
| 4 | 成都三实立科技实业有限公司 | 4,080,278 | 0.82% |
| 5 | 广州证券有限责任公司 | 3,997,420 | 0.80% |
| 6 | 潘卫红 | 3,700,000 | 0.74% |
| 7 | 王薇 | 3,631,105 | 0.73% |
| 8 | 陈晓 | 3,600,000 | 0.72% |
| 9 | 陕西秦龙电力股份有限公司 | 3,000,000 | 0.60% |
| 10 | 苗永英 | 2,970,000 | 0.59% |

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、 2002 年 5 月 25 日，长城基金管理有限公司股东会 2002 年第一次会议决议通过，选举刁锋同志担任公司监事，同时免去于克祥同志的监事职务。此项任免决议已公开披露并报中国证监会备案。

3、 根据证监会关于基金交易专用席位管理的有关规定，我公司经认真研究，租用了长城证券有限责任公司、东方证券有限责任公司、西北证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司的证券交易席位作为久富基金的专用交易席位。我们选择证券经营机构的依据是：

(1) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到管理部门的处罚；

(2) 内部管理规范，具有完善的内控制度，并能够满足基金运作有关资料、数据安全性和完整性的要求；

(3) 公司经营稳定，财务状况良好；

(4) 公司具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易条件满足基金进行投资交易的需求；

(5) 公司研究实力较强，有专门的研究机构和专业研究人员，能为基金投资提供有效的咨询服务，并能够按照基金投资的特定需求及时提供高质量的专题研究报告。

4、本基金租用专用交易席位的情况

截止 6 月 30 日，本基金通过各机构的交易席位的成交及佣金情况见下表：

| 券商名称 | 买卖股票成交量 | | 买卖债券成交量 | |
|--------------|------------------|------------|------------------|------------|
| | 本期成交量 | 占本期成交总量的比例 | 本期成交量 | 占本期成交总量的比例 |
| 佣金 | | | | |
| 佣金 | 占佣金总量比例% | | | |
| 长城证券有限公司 | 321,773,054.63 | 31.74% | 624,781,489.90 | 43.59% |
| 254,309.38 | 31.79% | | | |
| 东方证券有限公司 | 148,195,082.26 | 14.62% | 170,245,720.10 | 11.88% |
| 116,465.19 | 14.56% | | | |
| 西北证券有限公司 | 478,835,898.08 | 47.24% | 503,998,940.20 | 35.16% |
| 377,873.60 | 47.24% | | | |
| 申银万国证券股份有限公司 | 52,765,842.98 | 5.21% | 56,768,379.70 | 3.96% |
| 42,452.59 | 5.31% | | | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 12,095,095.70 | 1.19% | 77,477,957.40 | 5.41% |
| 8,843.22 | 1.10% | | | |
| 合计 | 1,013,664,973.65 | 100% | 1,433,272,487.30 | 100% |
| 799,943.98 | 100% | | | |

八、备查文件目录

- 1、关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募的批复
- 2、久富证券投资基金契约
- 3、久富证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的公告原件
- 5、长城基金管理有限公司章程、企业法人营业执照、基金管理公司法人许可证

长城基金管理有限公司

二〇〇二年八月二十三日