

华安现金富利投资基金投资组合公告

(2004 年第 1 号)

一、重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2004 年 4 月 12 日复核了本公告。

截至 2004 年 3 月 31 日, 华安现金富利投资基金资产净值为 5,122,022,443.28 元, 基金份额为 5,122,022,443.28 份, 基金单位资产净值为 1.00 元。

截至 2004 年 3 月 31 日, 华安现金富利投资基金于 2004 年第 1 季度每万份基金单位共实现收益 49.69800 元, 按公告期实际天数 91 天, 折算的年收益率为 1.993%。剔除闰年 2 月 29 日不计提债券利息对本季度收益的影响, 折算的年收益率为 2.014%。

二、基金投资组合

(一) 按投资品种分类的债券投资组合

序号	分 类	摊余成本 (元)	占净值比例
1	国家债券 (含政策性金融债)	1,333,428,280.85	26.03%
2	金融债券 (含央行票据)	2,037,265,370.75	39.77%
3	企业债券	-	-
4	可转换债券	-	-
	合 计	3,370,693,651.60	65.81%

(二) 买入返售证券合计

截至 2004 年 3 月 31 日, 基金持有的买入返售证券 (本金) 合计为 1,871,900,000.00 元, 占基金资产净值的 36.55%。

(三) 货币资金合计

截至 2004 年 3 月 31 日, 基金持有的货币资金合计为 279,935,300.41 元, 占基金资产净值的 5.47%。

(四) 卖出回购证券合计

截至 2004 年 3 月 31 日，基金持有的卖出回购证券（本金）合计为 446,490,000.00 元，占基金资产净值的 8.72%。

三、基金投资组合的剩余期限

截至 2004 年 3 月 31 日，基金持有的上述投资组合平均剩余期限为 105.43 天，剩余期限分布比例如下：

剩余期限	占净值比例
30 天以内	18.87%
30 天—60 天	6.54%
60 天—90 天	20.18%
90 天—180 天	44.00%
180 天以上	9.52%

四、基金投资前五名债券明细

序号	名称	面值（元）	摊余成本（元）	占净值比例
1	03 国开 30	1,020,000,000	1,013,664,866.98	19.79%
2	04 央票 02	660,000,000	655,463,682.57	12.80%
3	04 央票 04	440,000,000	436,754,044.36	8.53%
4	04 央票 11	300,000,000	293,087,888.83	5.72%
5	03 央票 09	200,000,000	199,296,639.19	3.89%

五、报告附注

（一）根据基金契约，本基金属于短期资金市场基金，投资短期资金市场工具。本基金通过每日分红使基金单位资产净值维持在 1.00 元。

（二）报告项目的计价方法

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

（三）截至 2004 年 3 月 31 日，本基金其他应收应付款项为借方余额 45,983,491.27 元。其他应收应付款项包括：应收利息、应收基金申购款、其他应收款、应付管理人报酬、应付托管费、应付营销费、应付收益、应付回购利息、应付银行间费用、其他应付款

以及预提费用。

华安基金管理有限公司

2004 年 4 月 16 日