

安信证券投资基金

2003 年年度报告



签发日期：二〇〇四年三月二十五日

重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2004 年 3 月 19 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: 安信证券投资基金
(简称: 基金安信)
交易代码: 500003
基金发起人: 上海国际信托投资公司
天同证券有限责任公司
(原山东证券有限责任公司)
华安基金管理有限公司
基金发行日期: 1998 年 6 月 16 日
基金成立日期: 1998 年 6 月 22 日
基金单位总份额: 20 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: 1998 年 6 月 26 日
- (二) 基金管理人: 华安基金管理有限公司
注册及办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 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: 中国工商银行
注册及办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号
(邮编: 100032)
法定代表人: 姜建清
托管部负责人: 周月秋
信息披露负责人: 庄为
电 话: (010) 66107333
传 真: (010) 66106904
- (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：曹勤、马海越

二. 主要财务指标

	2003 年		2002 年		2001 年	
	新指标	旧指标	新指标	旧指标	新指标	旧指标
加权平均单位基金本期净收益	-0.0137 元	0.0121 元	0.0121 元	0.0121 元	0.2371 元	0.2371 元
期末可供分配基金收益	20,951,163.05 元	-161,675,823.15 元	-161,675,823.15 元	-161,675,823.15 元	483,123,150.63 元	483,123,150.63 元
期末可供分配单位基金收益	0.0105 元	-0.0808 元	-0.0808 元	-0.0808 元	0.2416 元	0.2416 元
期末单位基金资产净值	1.0707 元	0.9192 元	0.9192 元	0.9192 元	1.2511 元	1.2511 元
加权平均基金净值收益率	-1.37%	1.14%	1.14%	1.18%	16.38%	17.05%
本期单位基金净值增长率	16.48%	-10.28%	-10.28%	-10.28%	-10.00%	-10.00%
单位基金累计净值增长率	126.96%	94.85%	94.85%	94.85%	117.17%	117.17%

(一) 提示：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 上述指标的编制遵照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号——主要财务指标的计算及披露》，部分指标计算公式如下：

$$1、\text{加权平均单位基金本期净收益} = \frac{P}{S_0 + \sum_{i=1}^n \frac{\Delta S_i \times (n-i)}{n}}$$

其中：P 为本期基金净收益， S_0 为期初基金单位总份额，n 为报告期内所含的交易天数，i 为报告期内的第 i 个交易日， $\Delta S_i = i$ 交易日基金单位总份额 - (i-1) 交易日基金单位总份额。

$$2、\text{期末可供分配基金收益} = \text{本期净收益} + \text{期初未分配收益} + \text{本期损益平准金} (\text{若有}) - \text{本期已分配收益} - \text{期末未实现利得损失} (\text{若有})$$

其中，期末未实现利得损失为“未实现利得”科目期末借方余额。

$$3、\text{封闭式基金加权平均净值收益率} = \frac{P}{NAV_0 + \sum_{k=1}^w \frac{\Delta NAV_k \times (w-k+0.5)}{w}}$$

其中：P 为本期基金净收益， NAV_0 为期初基金资产净值；w 为报告期内所含交易周数，k 为报告期内的第 k 个交易周数， $\Delta NAV_k = i$ 交易周披露的基金资产净值 - (i-1) 交易周披露的基金资产净值

- 4、本期单位基金净值增长率=（本期第一次分红或扩募前单位基金资产净值 ÷ 期初单位基金资产净值）×（本期第二次分红或扩募前单位基金资产净值 ÷ 本期第一次分红或扩募后单位基金资产净值）×……×（期末单位基金资产净值 ÷ 本期最后一次分红或扩募后单位基金资产净值）-1
- 5、单位基金累计净值增长率=（第一年度单位基金资产净值增长率+1）×（第二年度单位基金资产净值增长率+1）×……×（上年度单位基金资产净值增长率+1）×（本期单位基金资产净值增长率+1）-1

三. 基金管理人报告

（一）基金概述

安信证券投资基金（以下简称“基金”）系经中国证券监督管理委员会证监基金字（1998）22号文批准，由上海国际信托投资公司、天同证券有限责任公司（原山东证券有限责任公司）和华安基金管理有限公司发起，并向社会募集设立。基金单位为 20 亿份，每份基金单位面值人民币 1.00 元，发行价格人民币 1.01 元，已于 1998 年 6 月 22 日募足。基金存续期为 15 年，类型为契约型封闭式。基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行。

（二）基金经理简介

林彤彤 先生：工商管理硕士，12 年银行、证券从业经历。曾就职于中国银行漳州分行信贷管理处，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、基金安信、基金安顺、基金安瑞、基金安久的基金经理。现任基金安信的基金经理。

（三）基金经理报告

截止 2003 年 12 月 31 日，本基金单位资产净值为 1.0707 元，基金净值增长率为 16.48%，表现优于两市指数（上证综指上涨 10.27%，深综指下跌 2.61%）。

年度	净值增长率	上证综指涨跌	同期深综指涨跌	每基金单位 分红（元）
1998*	10.72%	-17.67%	-19.54%	0.042
1999	46.74%	19.18%	16.96%	0.320
2000	48.52%	51.73%	58.07%	0.575
2001	-10.00%	-20.62%	-25.13%	0.230
2002	-10.28%	-17.52%	-18.32%	0.000

2003	16.48%	10.27%	-2.61%	0.010
累计	126.96%	7.48%	-11.41%	1.177
年复合增长	15.98%	1.31%	-2.17%	

*自成立以来

2003 年是中国证券市场“价值投资”理念演绎较为充分的一年。在这一年里，股市彻底告别了个股齐涨齐跌、落差不大的现象，而是表现出了由上市公司基本面来决定股价的良性局面。年内出现的所谓“二八”现象，就如实勾画出市场投资理念和投资盈利模式的分水岭：以钢铁、石化、汽车等行业龙头企业为代表的少部分上市公司，由于受益于行业景气度的提高、市场需求的旺盛、以及企业盈利水平大幅提高等因素，股价逐步摆脱了大盘的相对弱势，走出持续上涨行情，以主导者的姿态成为推动市场上扬的中坚力量；与此同时，大多数的上市公司由于业绩较差、市盈率水平依然偏高而逆势下跌、落寞退场。

2003 年同样是坚持“价值投资”理念的证券投资基金取得成功的一年。得益于对大盘绩优蓝筹股的集中投资，90%以上的基金取得了超过沪深两市综合指数涨幅的收益水平。基金安信净值的年度涨幅尽管也超过指数平均涨幅，但在所有基金中排名相对靠后，在此，我们客观地总结出操作不理想的几点原因：第一，由于自 2001 年下半年以来，大盘一直处于持续下跌状态，导致以“熊市”心态来分析预测大盘走势，全年的股票仓位水平一直不高，尤其是对蓝筹股的爆发力度和持续时间缺乏信心，屡屡在大盘调整时将它们做为减仓的对象；第二，由于对宏观经济的高速增长、部分行业景气度空前高涨、少数上市公司业绩的快速上升等因素缺乏深入地研究和充分的认识，从而错过了最佳的投资时机；第三，资产配置不太合理，在钢铁、石化、电力、汽车等 2003 年主流行业的配置比例上低于基金同行平均水平。

展望 2004 年，我们有理由认为中国证券市场将开始新一轮的牛市，“价值投资”仍将是 2004 年的主线，盈利机会主要来自于上市公司业绩提升、PE 值的提升（对蓝筹股的重新估值）以及全流通等制度性变革所带来的套利机会。有如下几个因素支持我们的判断：第一，在重工业化、城市化、消费升级的推动下，中国经济从 2002 年已迈入新一轮增长周期，2004 年将继续保持快速增长，而 GDP 的持续增长始终是股市上升的原动力。第二，上市公司基本面总体良好，预计平均 EPS 将在 2003 年 20%增幅的基础上继续以 10%的速度增长，因此市场将出现业绩驱动型的上升。第三，《国务院关于推进资本市场改革开放和稳定发展的若干意见》的出台，消除了投资者对股市面临被“边缘化”的担忧，同时也向市场传达了一种信息：尽管“规范”仍是资本市场中长期的任务，但“发展”的重要性已经得到高层的高度重视。第四，人民币升值的预期以及 QFII 数量和投资金额的不断增长，使得以人民币计价的证券资产面临重新定价的可能。

根据上述的分析预测，2004 年度安信将会采取如下的操作策略：

一、基于对市场中长期发展前景的看好，大部分时间将会保持较高的股票仓位水平；

二、投资重点确定为大盘蓝筹股，尤其是景气行业中的龙头企业，同时高度关注成长性企业；

三、中期关注成本相对固定、而产品价格持续上涨的上游行业，如煤炭、有色、化工，而长期将会更多关注航空、消费电子、通讯、汽车、房地产等消费行

业的投资机会。

2003 年是基金安信成立以来表现相对较差的一年，辜负了广大基金持有人对我们的信赖，在此表达我们深深的歉意。展望 2004 年，我们期待能得到持有人一如既往的支持，同时我们将加倍努力，争取以良好的业绩来回报你们的信任。

（四） 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、《安信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。基金投资组合符合有关法规及基金契约的规定。

2、内部监察工作报告

2003 年公司业务发展平稳，年内公司顺利发行设立华安旗下第三只开放式基金--华安现金富利投资基金，使公司管理基金数量增加到 7 只，截止 2003 年底公司管理资产规模已达到约 142 亿份基金单位，总金额达到约 147 亿元人民币。公司 2000、2001、2002 连续三年被评为上海市 A 类纳税信用单位的称号，2001、2002 连续二年被评为上海市 A 类财务会计信用单位。

2003 年根据证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的规定，在公司管理层的支持下，我们牵头对公司各项制度和流程进行系统化整理，并联合业务部门对部分制度和流程给予了补充和完善。整理完成后，形成了由公司章程、内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章、岗位职责等组成的内控制度体系。

2003 年在证监会的指导下，我们还在全公司范围内推广风险控制自我评估（RCSR, Risk Control Self Assessment）技术，通过各业务部门的参与，我们对公司主要风险点进行了集中梳理，通过自我评估，我们明确了公司存在的重大风险点，找到了现有控制措施的不足、制定了拟采取的进一步控制措施、指定了负责人并确定了后续跟踪时间，使各风险点的控制落到实处。

2003 年度，我们根据年初制订的监察稽核计划及根据公司业务发展所作的调整，遵照独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过电脑监控、现场检查、人员询问、重点抽查等方法开展工作，各项检查工作已顺利完成。我们认为，公司各项业务能基本遵循国家法律法规、中国证监会规章制度和各项业务规范流程及内部规章制度，公司运行基本符合合法性、合规性的要求，主要内控制度基本有效。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在合规运作、稳健经营的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

四. 托管人报告

本托管人——中国工商银行，依据《安信证券投资基金基金契约》与《安信证券投资基金托管协议》，托管安信证券投资基金。

2003 年度，在对安信证券投资基金的托管过程中，本托管人严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对安信证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，没有发生任何损害基金持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为托管人所应尽的义务。

本托管人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，对安信证券投资基金的投资组合进行了监督，认为华安基金管理有限公司在安信证券投资基金的投资运作、基金资产净值及单位基金资产净值的计算上，遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其他有关法规的规定，没有发现任何损害基金持有人利益的行为。

本托管人依法对安信证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2003 年度内所编制和披露的安信证券投资基金资产净值公告、基金投资组合公告、基金中期报告等公告信息进行了复核，认为安信证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2003 年度内所编制和披露的基金信息是准确、真实、完整的。

中国工商银行资产托管部
2004 年 3 月 19 日

五. 基金年度财务报告

(一) 审计报告

审计报告

安永大华业字（2004）第 274 号

安信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 2003 年 12 月 31 日的资产负债表和 2003 年度经营业绩表、基金净值变动表以及基金收益分配表。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。

我们按照中国注册会计师独立审计准则计划和实施审计工作，以合理确信会计报表是否不存在重大错报。审计工作包括在抽查的基础上检查支持会计报表金额和披露的证据，评价管理当局在编制会计报表时采用的会计政策和作出的重大会计估计，以及评价会计报表的整体反映。我们相信，我们的审计工作为发表意见提供了合理的基础。

我们认为，上述会计报表符合《证券投资基金会计核算办法》和证券投资基金相关法规以及《安信证券投资基金基金契约》的有关规定，在所有重大方面公允反映了贵基金 2003 年 12 月 31 日的财务状况和 2003 年度经营业绩及基金净值变动情况。

安永大华会计师事务所有限责任公司

中国注册会计师：曹勤

中国注册会计师：马海越

中国 上海 昆山路 146 号

2004 年 3 月 19 日

(二) 基金会计报告书

安信证券投资基金

资产负债表

2003 年 12 月 31 日

金额单位：人民币元

资产	附注	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		197,326,012.91	38,457,668.73
清算备付金		-	8,337,254.23
交易保证金		750,000.00	750,000.00
应收证券清算款		-	7,767,833.81
应收股利		-	-
应收利息	3(1)	5,790,636.46	4,356,039.90
其他应收款	3(2)	-	30,000.00
股票投资市值	1(4)	1,565,436,709.36	1,214,825,366.31
其中：股票投资成本		1,447,655,286.54	1,423,174,188.33
债券投资市值	1(4)	546,730,682.90	570,220,862.90
其中：债券投资成本		544,017,498.23	571,813,115.37
配股权证		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,316,034,041.63	1,844,745,025.88

负债与基金持有人权益

负债：			
应付证券清算款		147,388,602.92	1,877,943.36
应付管理人报酬		2,648,638.34	2,365,715.18
应付托管费		441,439.72	394,285.87
应付佣金		2,489,590.11	282,904.62
应付利息		-	-
应付收益		-	-
其他应付款	3(3)	1,250,000.00	1,250,000.00
卖出回购证券款		20,000,000.00	-
预提费用	3(4)	370,000.00	250,000.00
其他负债		-	-
负债合计		174,588,271.09	6,420,849.03

持有人权益：

实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	120,494,607.49	-209,941,074.49
未分配收益	20,951,163.05	48,265,251.34
持有人权益合计	<u>2,141,445,770.54</u>	<u>1,838,324,176.85</u>
负债及持有人权益总计	<u>2,316,034,041.63</u>	<u>1,844,745,025.88</u>

安信证券投资基金
 经营业绩表
 2003 年 1 月 1 日
 至 2003 年 12 月 31 日

单位：人民币元

	附注	2003 年	2002 年
一. 已实现基金收入：		12,653,728.34	68,073,407.71
股票差价收入	1(6)	-7,271,018.76	-1,187,158.42
债券差价收入	1(6)	-14,933,808.09	28,916,830.63
债券利息收入	1(6)	16,566,032.77	23,961,438.01
存款利息收入	1(6)	2,679,453.75	4,662,390.33
股利收入	1(6)	15,292,416.63	10,896,577.31
买入返售证券收入	1(6)	38,255.00	513,960.00
其他收入	3(5)	282,397.04	309,369.85
二. 本期基金费用：		39,967,816.63	43,943,215.52
基金管理人报酬	2(4)	29,864,606.76	31,972,730.02
基金托管费	2(4)	4,977,434.49	5,328,788.32
卖出回购证券支出		4,512,871.82	4,238,024.56
利息支出		-	-
其他费用	3(6)	612,903.56	2,403,672.62
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		340,000.00	580,000.00
审计费用		130,000.00	260,000.00
三. 已实现基金净收益		-27,314,088.29	24,130,192.19
加：未实现利得		<u>330,435,681.98</u>	<u>-228,060,046.22</u>
四. 基金经营业绩		<u>303,121,593.69</u>	<u>-203,929,854.03</u>

安信证券投资基金
 收益分配表
 2003 年 1 月 1 日
 至 2003 年 12 月 31 日

单位：人民币元

	附注	2003 年	2002 年
本期基金净收益		-27,314,088.29	24,130,192.19
加：期初基金净收益		48,265,251.34	483,123,150.63
加：以前年度损益调整	1(10)	-	1,011,908.52
可供分配基金净收益		<u>20,951,163.05</u>	<u>508,265,251.34</u>
减：本期已分配基金净收益		-	460,000,000.00

期末基金净收益	20,951,163.05	48,265,251.34
---------	---------------	---------------

安信证券投资基金
 基金净值变动表
 2003 年 1 月 1 日
 至 2003 年 12 月 31 日

	附注	2003 年	单位：人民币元 2002 年
一、期初基金净值		1,838,324,176.85	2,502,254,030.88
二、本期经营活动：			
基金净收益		-27,314,088.29	24,130,192.19
未实现利得		330,435,681.98	-228,060,046.22
经营活动产生的基金净 值变动数		303,121,593.69	-203,929,854.03
三、本期向持有人分配收益：			
向基金持有人分配收益 产生的基金净值变动数		-	-460,000,000.00
四、期末基金净值		2,141,445,770.54	1,838,324,176.85

(三) 会计报告书附注

1、主要会计政策和会计政策变更

(1) 会计年度：公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计年度为 2003 年 1 月 1 日至 2003 年 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；如果市价等于或低于配股价，则估值为零。

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) 待摊费用和预付费用的核算方法

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帐，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帐。

(6) 收入的确认政策：

①证券买卖差价收入：

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计入债券投资成本，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计入债券投资成本，出售时按移动加权平均法结转成本。

(8) 税项

根据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55 号文和[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的征税范围，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 年年底以前暂免征收营业税和企业所得税。
- ③ 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，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 基金管理人运用基金买卖股票按照 2 %的税率征收印花税。

(9) 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。

(10) 会计政策变更及其影响：

中华人民共和国财政部于 2001 年 11 月 11 日颁布了《证券投资基金会计核算办法》，本基金从 2002 年 1 月 1 日起执行该办法。其主要影响为证交所交易债券的成本计价方法及利息收入确认方法的变更：成本计价方法由含息成本变更为不含息成本，利息收入确认方法由债券除息日确认变更为在债券持有期内逐日计提。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，具体为：应收利息调增人民币 7,141,617.42 元，债券投资成本调减人民币 6,129,708.90 元，两者差额人民币 1,011,908.52 元计入以前年度损益调整科目；同时，未实现利得和债券投资市值分别调减人民币 1,011,908.52 元。上述会计政策的变更不影响 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 基金发起人	提取管理费	基金契约
中国工商银行	基金托管人	提取托管费	基金契约
上海证券有限责任公司	与管理公司属同 一股东*	银行间回购交易 租用交易席位	回购交易合同 席位使用协议
天同证券有限责任公司	管理公司股东 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
申银万国证券股份有限公司	管理公司股东	租用交易席位	席位使用协议

*注：同一股东为上海国际信托投资公司，系基金发起人和基金管理公司发起

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 年的股票交易情况:

关联人	股票年成交量	占成交总量比例	年佣金	占佣金总量比例	平均佣金比率
天同证券有限责任公司	1,158,808,951.05	16.70%	926,590.43	16.67%	0.08%
上海证券有限责任公司	846,687,832.36	12.20%	672,485.85	12.10%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	555,507,115.26	8.00%	434,693.80	7.82%	0.08%
合计	2,561,003,898.67	36.90%	2,033,770.08	36.59%	

本基金通过关联人席位 2002 年的股票交易情况:

关联人	股票年成交量	占成交总量比例	年佣金	占佣金总量比例	平均佣金比率
申银万国证券股份有限公司	202,843,457.25	12.26%	158,728.88	12.84%	0.08%
上海证券有限责任公司	168,018,863.34	10.16%	123,314.87	9.98%	0.07%
天同证券有限责任公司	76,828,794.27	4.64%	57,193.69	4.63%	0.07%
合计	447,691,114.86	27.06%	339,237.44	27.45%	

② 本基金通过关联人席位 2003 年的债券及回购交易情况:

关联人	债券年成交量	占成交总量比例	回购年成交量	占成交总量比例
天同证券有限责任公司	1,045,163,213.40	16.64%	1,418,300,000.00	32.22%
上海证券有限责任公司	1,035,512,927.10	16.49%	477,900,000.00	10.85%
申银万国证券股份有限公司	307,765,563.10	4.90%	-	-
合计	2,388,441,703.60	38.03%	1,896,200,000.00	43.07%

本基金通过关联人席位 2002 年的债券及回购交易情况:

关联人	债券年成交量	占成交总量比例	回购年成交量	占成交总量比例
上海证券有限责任公司	1,217,779,320.80	19.20%	200,000,000.00	5.18%
天同证券有限责任公司	375,010,861.20	5.91%	204,800,000.00	5.31%
申银万国证券股份有限公司	11,374,968.00	0.18%	-	-
合计	1,604,165,150.00	25.29%	404,800,000.00	10.49%

(3) 本基金与关联人 2003 年进行银行间市场债券买卖和回购交易情况:

关联人	买入债券	卖出债券	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	229,000,000.00	169,460.27

本基金与关联人 2002 年进行银行间市场债券买卖和回购交易情况:

关联人	买入债券	卖出债券	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	380,000,000.00	734,279.56

(4) 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

本基金应支付基金管理人管理费, 按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提, 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费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提, 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	2002 年
基金管理费	29,864,606.76 元	31,972,730.02 元

② 基金托管费

本基金应支付基金托管人托管费, 按前一日基金资产净值的 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提, 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	2002 年
基金托管费	4,977,434.49 元	5,328,788.32 元

3、主要报表项目说明 (单位: 人民币元)

(1) 应收利息:

明细项目	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
银行存款和清算备付金利息	42,621.81	58,874.73
债券利息	5,748,014.65	4,297,165.17
合计	5,790,636.46	4,356,039.90

(2) 其他应收款:

明细项目	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
应收券商费用	-	30,000.00

(3) 其他应付款:

明细项目	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
券商代垫交易保证金	1,250,000.00	1,250,000.00

(4) 预提费用:

明细项目	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日

预提审计费	130,000.00	130,000.00
预提信息披露费	240,000.00	120,000.00
合计	370,000.00	250,000.00

(5) 其他收入:

明细项目	2003 年	2002 年
债券认购手续费返还	19,928.48	110,000.00
股票认购手续费返还	209,968.56	194,752.71
认购债券资金利息返还	52,500.00	-
印花税返还	-	4,617.14
合计	282,397.04	309,369.85

(6) 其他费用:

明细项目	2003 年	2002 年
审计费	130,000.00	260,000.00
信息披露费	340,000.00	580,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
分红手续费	-	1,380,000.00
返售与回购交易费	55,881.56	93,285.41
其他	27,022.00	30,387.21
合计	612,903.56	2,403,672.62

(7) 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	2002 年
交易所债券价息分离调整	-	1,011,908.52

(四) 流通转让受限的基金资产

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 12 月 31 日止，本基金持有流通受限的股票明细如下：

股票名称	申购方式	申购确认日	上市日期	可流通日期	申购价格	年末估值	成功申购股数	成本	估值
新赛股份	市值配售	03-12-24	04-01-07	04-01-07	6.67	6.67	30,000	200,100.00	200,100.00
长江电力	网下认购	03-11-10	03-11-18	04-05-18	4.30	8.84	1,058,821	4,552,930.30	9,359,977.64
合计								4,753,030.30	9,560,077.64

2、截至 2003 年 12 月 31 日止，本基金无流通受限的债券。

3、截至 2003 年 12 月 31 日止，本基金无流通受限的配股。

(五) 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	200,100.00	0.01%
B	采掘业	97,010,723.70	4.53%
C	制造业	612,157,641.50	28.59%
C0	其中：食品、饮料	9,400,000.00	0.44%
C1	纺织、服装、皮毛	163,699,200.00	7.64%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	171,130,851.50	7.99%
C5	电子	20,097,200.00	0.94%
C6	金属、非金属	75,993,410.00	3.55%
C7	机械、设备、仪表	138,068,085.45	6.45%
C8	医药、生物制品	29,240,000.00	1.37%
C99	其他	4,528,894.55	0.21%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	87,635,477.64	4.09%
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	373,876,560.61	17.46%
G	信息技术业	201,061,280.00	9.39%
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	167,757,925.91	7.83%
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	25,737,000.00	1.20%
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合 计	1,565,436,709.36	73.10%

2. 债券（不包括国债）合计

截止 2003 年 12 月 31 日，基金持有的债券（不含应收利息）合计为 113,043,433.00 元，占基金资产净值的 5.28%。

3. 国债、货币资金合计

截止 2003 年 12 月 31 日，基金持有的国债（不含应收利息）及货币资金合计为 483,624,659.89 元，占基金资产净值的 22.58%。

4. 基金投资股票明细

序号	名 称	数 量 (股)	市 值 (元)	占净值比例
1	中国联通	50,500,000	200,990,000.00	9.39%
2	海欣股份	12,789,000	163,699,200.00	7.64%

3	烟台万华	8,000,000	108,400,000.00	5.06%
4	南方航空	21,001,852	105,009,260.00	4.90%
5	招商银行	8,404,593	91,357,925.91	4.27%
6	上港集箱	5,800,000	83,172,000.00	3.88%
7	华能国际	4,450,000	78,275,500.00	3.66%
8	民生银行	8,000,000	76,400,000.00	3.57%
9	中海发展	7,500,000	64,350,000.00	3.00%
10	上海汽车	3,999,909	55,558,736.01	2.59%
11	招商局A	4,820,000	53,261,000.00	2.49%
12	盐湖钾肥	5,500,000	49,665,000.00	2.32%
13	山东铝业	2,000,000	35,620,000.00	1.66%
14	海油工程	2,450,000	35,402,500.00	1.65%
15	一汽轿车	3,396,642	35,053,345.44	1.64%
16	上海机场	3,435,277	34,112,300.61	1.59%
17	白云机场	3,800,000	33,972,000.00	1.59%
18	同仁堂	1,700,000	29,240,000.00	1.37%
19	中原油气	2,390,225	27,870,023.50	1.30%
20	兰花科创	2,584,990	25,798,200.20	1.20%
21	桂冠电力	2,300,000	25,737,000.00	1.20%
22	东风汽车	2,000,000	24,580,000.00	1.15%
23	上海电气	2,000,000	18,780,000.00	0.88%
24	士兰微	799,600	15,592,200.00	0.73%
25	宝钢股份	1,877,400	13,423,410.00	0.63%
26	三爱富	1,670,825	13,065,851.50	0.61%
27	中金岭南	1,700,000	12,495,000.00	0.58%
28	中集集团	500,000	9,975,000.00	0.47%
29	燕京啤酒	1,000,000	9,400,000.00	0.44%
30	长江电力	1,058,821	9,359,977.64	0.44%
31	神州股份	1,000,000	7,940,000.00	0.37%
32	紫江企业	444,445	4,528,894.55	0.21%
33	长电科技	500,000	4,505,000.00	0.21%
34	鞍钢新轧	800,000	4,480,000.00	0.21%
35	振华港机	293,200	4,096,004.00	0.19%
36	新赛股份	30,000	200,100.00	0.01%
37	恒生电子	4,000	71,280.00	0.00%
	合 计		1,565,436,709.36	73.10%

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 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额

20,659,031.71 元，与债券（不包括国债）市值 113,043,433.00 元、股票市值 1,565,436,709.36 元和国债及货币资金 483,624,659.89 元之和相减后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收利息、深交所交易保证金、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、卖出回购证券款、预提费用以及其他应付款等。

（六）本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场申购	二级市场买入	其他	
1	白云机场	663,000	8,550,163	-	5,413,163
2	东风汽车	-	2,000,000	-	-
3	民生银行	-	13,200,935	-	5,200,935
4	中海发展	-	16,069,224	-	8,569,224
5	南方航空	1,613,000	36,731,719	-	17,342,867
6	兰花科创	-	4,380,616	-	1,795,626
7	山东铝业	-	5,192,099	-	3,192,099
8	紫江企业	-	-	444,445	-
9	桂冠电力	-	2,536,348	-	236,348
10	士兰微	10,000	1,384,041	-	594,441
11	新赛股份	30,000	-	-	-
12	恒生电子	4,000	-	-	-
13	长电科技	39,000	1,676,530	-	1,215,530
14	长江电力	3,056,821	1,000,000	-	2,998,000
15	中集集团	-	320,000	1,401,270	1,221,270
16	中金岭南	-	3,181,648	-	1,481,648
17	燕京啤酒	-	1,300,000	-	300,000
18	一汽轿车	-	3,396,642	-	-
19	鞍钢新轧	-	5,934,211	-	5,134,211
20	神州股份	-	1,894,056	-	894,056

新增股票附注：本表中“其他”项目包括“配转送增”。

（七）本期剔除股票

序号	股票名称	期初结存	本期增加	本期卖出
1	浦发银行	-	11,956,816	11,956,816
2	齐鲁石化	-	1,213,012	1,213,012
3	武钢股份	-	1,000,000	1,000,000
4	皖通高速	373,000	-	373,000
5	华夏银行	-	1,169,000	1,169,000
6	中原高速	-	443,000	443,000
7	上海电力	-	340,000	340,000
8	中国石化	-	18,600,000	18,600,000
9	中信证券	586,000	-	586,000
10	三一重工	-	1,003,057	1,003,057

11	四川路桥	-	119,000	119,000
12	宇通客车	216,879	-	216,879
13	云天化	366,432	78,051	444,483
14	波导股份	-	236,700	236,700
15	中青旅	1,061,725	-	1,061,725
16	厦门建发	808,102	1,778,556	2,586,658
17	上海建工	150,000	-	150,000
18	雅戈尔	-	900,000	900,000
19	生益科技	-	1,972,284	1,972,284
20	新华光	-	18,000	18,000
21	兖州煤业	1,781,615	2,023,770	3,805,385
22	安彩高科	-	7,098,037	7,098,037
23	冠农股份	-	23,000	23,000
24	外运发展	1,871,019	1,116,986	2,988,005
25	航天信息	-	23,000	23,000
26	华芳纺织	-	99,000	99,000
27	恒瑞医药	5,392,884	254,780	5,647,664
28	江苏舜天	306,359	-	306,359
29	曙光股份	-	4,909,905	4,909,905
30	华泰股份	678,503	1,678,624	2,357,127
31	巢东股份	-	937,536	937,536
32	国祥股份	-	24,000	24,000
33	航天动力	-	64,000	64,000
34	长江通信	100,000	-	100,000
35	国阳新能	-	510,000	510,000
36	浙江龙盛	-	553,500	553,500
37	红星发展	293,367	145,347	438,714
38	三房巷	-	39,000	39,000
39	星马汽车	-	14,000	14,000
40	北京巴士	252,804	-	252,804
41	太工天成	-	11,000	11,000
42	江苏申龙	-	16,000	16,000
43	欣网视讯	-	12,000	12,000
44	国电南瑞	-	21,000	21,000
45	安泰集团	-	71,000	71,000
46	三友化工	-	122,000	122,000
47	湘电股份	70,000	-	70,000
48	江淮汽车	-	200,000	200,000
49	柳化股份	-	46,000	46,000
50	青松建化	-	48,000	48,000
51	中远航运	953,083	273,000	1,226,083
52	三元股份	-	228,000	228,000
53	吉恩镍业	-	50,000	50,000
54	冠豪高新	-	46,000	46,000

55	北方天鸟	-	24,000	24,000
56	片仔癀	-	24,000	24,000
57	瑞贝卡	-	10,000	10,000
58	金证股份	-	7,000	7,000
59	赛马实业	-	32,000	32,000
60	时代新材	19,000	-	19,000
61	贵研铂业	-	26,000	26,000
62	石岷纸业	-	36,000	36,000
63	风神股份	-	67,000	67,000
64	华光股份	-	45,000	45,000
65	湘邮科技	-	21,000	21,000
66	杭萧钢构	-	461,569	461,569
67	力元新材	-	25,000	25,000
68	凌云股份	-	66,000	66,000
69	双良股份	-	74,000	74,000
70	中创信测	-	6,000	6,000
71	亨通光电	-	18,000	18,000
72	中金黄金	-	103,000	103,000
73	中科合臣	-	18,000	18,000
74	中化国际	6,705,303	560,000	7,265,303
75	安徽水利	-	40,000	40,000
76	长力股份	-	33,000	33,000
77	上海能源	981,427	263,929	1,245,356
78	腾达建设	58,000	-	58,000
79	联环药业	-	7,000	7,000
80	第一投资	6,000	-	6,000
81	置信电气	-	9,000	9,000
82	华海药业	-	24,000	24,000
83	中天科技	65,000	-	65,000
84	江南高纤	-	16,000	16,000
85	山东药玻	-	223,820	223,820
86	华阳科技	28,000	-	28,000
87	天士力	42,100	-	42,100
88	海通集团	-	40,000	40,000
89	北海国发	-	36,000	36,000
90	新疆城建	-	55,000	55,000
91	中油化建	-	19,000	19,000
92	山东黄金	-	50,000	50,000
93	厦门钨业	8,531	-	8,531
94	方兴科技	23,000	-	23,000
95	茉织华	3,053,095	100,000	3,153,095
96	康缘药业	21,000	-	21,000
97	高淳陶瓷	-	15,000	15,000
98	法拉电子	36,000	666,311	702,311

99	迪马股份	7,000	-	7,000
100	惠泉啤酒	-	54,000	54,000
101	芜湖港	-	31,000	31,000
102	庆丰股份	-	50,000	50,000
103	海螺水泥	4,300,000	3,164,931	7,464,931
104	上海航空	173,000	-	173,000
105	光明乳业	835,767	20,000	855,767
106	北大荒	168,000	-	168,000
107	青岛啤酒	869,851	-	869,851
108	广电电子	-	4,037,025	4,037,025
109	金杯汽车	-	9,122,983	9,122,983
110	新世界	450,800	-	450,800
111	华联商厦	1,174,548	-	1,174,548
112	广电信息	2,408,500	1,776,916	4,185,416
113	新黄浦	339,483	399,259	738,742
114	申能股份	1,518,169	4,271,396	5,789,565
115	福耀玻璃	-	897,171	897,171
116	强生控股	1,687,300	-	1,687,300
117	上海石化	-	2,906,800	2,906,800
118	大商股份	-	547,749	547,749
119	彩虹股份	-	2,050,562	2,050,562
120	常林股份	-	2,402,900	2,402,900
121	巴士股份	1,161,772	200,000	1,361,772
122	鲁抗医药	-	90,310	90,310
123	国电电力	2,400,354	3,967,929	6,368,283
124	华北制药	-	2,731,523	2,731,523
125	益民百货	499,400	-	499,400
126	华联超市	396,940	731,150	1,128,090
127	通化东宝	109,920	-	109,920
128	伊利股份	105,273	-	105,273
129	万科A	836,939	984,551	1,821,490
130	中兴通讯	655,202	560,600	1,215,802
131	盐田港A	2,717,317	130,000	2,847,317
132	深圳机场	-	350,000	350,000
133	中联重科	583,033	349,542	932,575
134	许继电气	2,912,036	-	2,912,036
135	海虹控股	-	17,674	17,674
136	丽珠集团	3,099,479	200,000	3,299,479
137	中国凤凰	300,000	1,959,525	2,259,525
138	威孚高科	1,342,628	1,218,745	2,561,373
139	韶能股份	-	250,000	250,000
140	新钢钒	-	8,118,261	8,118,261
141	铜都铜业	-	3,688,065	3,688,065
142	格力电器	287,777	1,740,750	2,028,527

143	珠海中富	3,313,433	3,456,610	6,770,043
144	模塑科技	74,600	89,917	164,517
145	韶钢松山	-	2,645,400	2,645,400
146	新兴铸管	-	1,100,415	1,100,415
147	云铝股份	1,523,555	-	1,523,555
148	辽河油田	1,200,972	110,000	1,310,972
149	五粮液	880,000	1,257,000	2,137,000
150	扬子石化	3,950,777	2,728,400	6,679,177
151	张裕A	101,798	-	101,798
152	双汇发展	3,300,000	206,370	3,506,370
153	华菱管线	2,300,000	200,000	2,500,000
154	神火股份	84,486	50,000	134,486

六. 基金持有人结构及前十名持有人

截止 2003 年 12 月 31 日, 本基金发起人持有的基金份额为 0.36 亿基金单位, 占基金发行总份额的 1.80%, 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	18,000,000	0.90%
其中: 未上市流通份额	18,000,000	0.90%
华安基金管理有限公司	12,000,000	0.60%
其中: 未上市流通份额	6,000,000	0.30%
天同证券有限责任公司	6,000,000	0.30%
其中: 未上市流通份额	6,000,000	0.30%

社会公众持有的基金份额为 19.64 亿基金单位, 占基金发行总份额的 98.20%。

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	人寿股份	88,313,897	4.42%
2	中国太保	38,810,194	1.94%
3	中国人保	22,639,500	1.13%
4	中海信托	21,094,652	1.05%
5	上海国投	18,000,000	0.90%
6	人寿集团	15,004,454	0.75%
7	华安基金	12,000,000	0.60%
8	沈玉芳	9,880,000	0.49%
9	云天股份	6,342,400	0.32%
10	长江证券	6,148,300	0.31%

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上海分公司传送的截止 2003 年 12 月 31 日基金安信前 100 名持有人名册统计得出。

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. 本公司关于基金安信 2003 年分配方案决议如下：每 10 份基金单位分配 0.10 元，具体分红实施公告将另行公告；

3. 根据本公司 2003 年 9 月 18 日发布的公告，为进一步提高基金业绩，维护基金持有人权益，本公司对基金经理管理制度进行了改革和完善，其主要内容包括：① 试行基金经理岗位公开竞聘，优胜劣汰，为基金经理岗位输送更优秀人才；② 实行基金经理负责制，责任到人，量化考核，使基金经理职责更明确；③ 调整投资决策制度，进一步完善由投资决策委员会、基金投资部和基金经理构成的三级投资决策体制。

根据新的基金经理管理制度和公开竞聘结果，部分基金经理岗位人员发生变动，新的安排如下：成立封闭式基金经理小组，成员由本公司管理的各封闭式基金的基金经理和基金经理助理组成，成员之间互为备份。同时，聘任林彤彤先生为安信证券投资基金基金经理。

4. 根据本公司 2004 年 2 月 20 日发布的公告，决定免去尚健先生副总经理职务。

5. 2003 年各券商股票、债券及回购交易情况和佣金情况如下：

①股票交易情况与佣金情况：

券 商	成交量	占成交总量比例	佣金	占佣金总量比例
大鹏证券有限责任公司	1,686,384,747.18	24.30%	1,352,774.03	24.34%
招商证券股份有限公司	1,173,544,890.88	16.91%	952,152.38	17.13%
天同证券有限责任公司	1,158,808,951.05	16.70%	926,590.43	16.67%
上海证券有限责任公司	846,687,832.36	12.20%	672,485.85	12.10%
申银万国证券股份有限公司	555,507,115.26	8.00%	434,693.80	7.82%
光大证券有限责任公司	543,751,797.50	7.83%	440,298.16	7.92%
海通证券股份有限公司	507,211,647.91	7.31%	410,065.17	7.38%
国信证券有限责任公司	258,414,115.00	3.72%	202,582.33	3.64%
南方证券股份有限公司	210,739,869.06	3.03%	166,763.72	3.00%
合 计	6,941,050,966.20	100.00%	5,558,405.87	100.00%

②债券及回购交易情况：

券 商	债券成交量	占成交总量比例	回购成交量	占成交总量比例
大鹏证券有限责任公司	1,466,697,404.50	23.35%	1,087,900,000.00	24.71%
天同证券有限责任公司	1,045,163,213.40	16.64%	1,418,300,000.00	32.22%
上海证券有限责任公司	1,035,512,927.10	16.49%	477,900,000.00	10.85%
国信证券有限责任公司	655,224,161.80	10.43%	300,000,000.00	6.81%
招商证券股份有限公司	627,724,768.10	9.99%	520,000,000.00	11.81%
海通证券股份有限公司	610,479,740.50	9.72%	180,000,000.00	4.09%
申银万国证券股份有限公司	307,765,563.10	4.90%	-	-

光大证券有限责任公司	301,901,240.70	4.81%	270,000,000.00	6.13%
南方证券股份有限公司	230,130,448.50	3.67%	149,000,000.00	3.38%
合计	6,280,599,467.70	100.00%	4,403,100,000.00	100.00%

八. 备查文件目录

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

华安基金管理有限公司
2004 年3 月25 日