

华安创新证券投资基金

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

本基金的托管人交通银行已于 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: 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)
法人代表： 吴港平
联系人： 陈兆欣
经办注册会计师： 肖峰、陈玲
电 话： 021-63863388
传 真： 021-63863300

二、主要财务指标

项 目	2003 年		2002 年		2001 年 9 月 21 日 至 2001 年 12 月 31 日	
	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	0.0026 元	0.0173 元	0.0178 元	0.0178 元	0.0069 元	0.0069 元
期末可供分配基金收益	-36,805,773.56 元	-392,686,270.79 元	-392,686,270.79 元	-392,686,270.79 元	34,445,977.47 元	34,445,977.47 元
期末可供分配单位基金收益	-0.0133 元	-0.0838 元	-0.0838 元	-0.0838 元	0.0069 元	0.0069 元
期末单位基金资产净值	1.060 元	0.916 元	0.916 元	0.916 元	1.012 元	1.012 元
加权平均基金净值收益率	0.27%	1.73%	1.69%	1.69%	0.69%	0.69%
本期单位基金净值增长率	17.84%	-7.51%	-7.51%	-7.51%	1.20%	1.20%
单位基金累计净值增长率	10.29%	-6.40%	-6.40%	-6.40%	1.20%	1.20%

(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、期末可供分配基金收益=本期净收益+期初未分配收益+本期损益平准金（若有）-本期已分配收益-期末未实现利得损失（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、开放式基金加权平均净值收益率=

$$\frac{P}{NAV_0 + \sum_{i=1}^n \Delta NAV_i \times (n-i) / n}$$

其中：P 为本期基金净收益， NAV_0 为期初基金资产净值；n 为报告期内所含交易天数，i 为报告期内的第 i 个交易日， $\Delta NAV_i = i$ 交易日基金资产净值 - (i-1) 交易日基金资产净值

- 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

华安创新证券投资基金(以下简称“本基金”)由基金发起人华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安创新证券投资基金基金契约》发起，经中国证券监督管理委员会证监基金字[2001] 33 号文批准，于 2001 年 9 月 21 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 5,000,001,124 份基金单位，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2001)第 84 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行。

根据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》和《华安创新证券投资基金基金契约》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证券监督管理委员会批准的允许基金投资的其他金融工具。

(二) 基金经理简介

刘新勇 先生：硕士，6 年证券从业经历，曾在淄博基金管理有限公司从事研究、投资工作。1999 年 5 月加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员、华安 180 基金的基金经理。现任华安创新基金经理。

(三) 基金经理工作报告

2003 年业绩：

2003 年，华安创新基金单位净值增幅为 17.84%，全年每份基金单位派发现金红利 0.018 元。同期上证指数上升了 10.27%，深圳综指下跌了 2.6%，两个市场平均上涨 3.83%。华安创新尽管跑赢了同期指数，但在开放式基金业绩排名处于中游水平。

2003 年回顾：

2003 年，经济周期和股票周期同时从底部回升，投资者的机构化已经初具规模，价值投资渐入人心，共同促使 2003 年成为中国资本市场转折性的一年。在中国经济的强劲增长和全球经济复苏背景下，由投资品和农产品共同推动，中国走出了持续 16 个月的通货紧缩。物价上涨推动业绩增长，巴菲特买入中国石油，全球市场尤其是香港市场 H 股大幅上涨，QFII 进入 A 股市场等等都决定了 2003 年是蓝筹股的市场，市场呈现“二八”现象。

操作反思：

我们较早觉察到市场的变化，随即逐步集中投资在石化、钢铁、汽车、银行、电力等行业的蓝筹股上，这是业绩大幅领先市场的原因。但业绩仍处于同类开放式基金的中游水平，经过反复的思考、讨论，我们找出问题所在。

1、 自上而下的研究方法掌握的不够熟练。习惯了自下而上的研究方法。对宏观经济把握不够深入，对行业的估值及从行业层面配置组合比较欠缺。对主流行业介入的早晚、深浅基本决定了 2003 年投资的成败。

2、 不能吐故纳新。价值投资并不是简单地死捂有价值的股票，应根据价值、机会成本、风险等因素综合判断，不断调整组合。不能吐故纳新的组合是平庸的组合。第三季度与第四季度华安创新的组合没有太大变化，耽误了许多投资机会。

3、 对影响行业或公司基本面的事件不够敏感。事件是驱动价值的因素，对事件预见和把握是任何主动型基金管理的基本功。理想的投资计划，应结合价值评估和信息流管理。2003 年下半年央行实施相对紧缩的货币政策，没有及时减持银行股是一个失误。

2004 年展望：

1、 全球经济复苏，中国经济高速增长，国务院发布《推进资本市场改革与发展若干意见》，2003 年大部分股票调整到位，决定了 2004 年的市场是牛市。因此，“八二”现象不足为怪。

2、 2002 年以来的全球汇率调整在 2004 年有望继续，币值变动改变资产资源价格。同时，人民币汇率调整预期在 2004 年将引起上市公司业绩和估值调

整；

3、 适度通胀将提升股票市场投资机会，但过快的通胀可能演变为渐趋激烈的紧缩，从而在业绩和资金层面共同对 A 股产生制约。

4、 QDII、机构投资者多元化、国有股减持的金融创新、财税改革、国债回购制度等制度性变革将进一步影响 A 股业绩和估值水平的调整；

结合对 2004 年市场展望，华安创新投资计划如下：

1、 全年绝大部分时间股票投资比例保持在 70% 以上水平。国债投资比例 20%。适量投资可转债。

2、 股票投资主要考虑以下主题：（1）供应短缺，产品价格上涨：如石化、钢铁、有色、煤炭、电力设备等行业；（2）消费升级：如汽车、食品饮料等行业；（3）稳定增长的公用事业：机场、港口、电力等；（4）金融创新：整体上市、国有股减持试点等。

3、 不但要投资有创新能力的、价值低估的上市公司，更要时刻关注影响市场重大事件，采用灵活的方法、策略投资。

总结 2003 年的失误和教训，华安公司改变了以前的决策模式，代之以新的“三级决策体系”，研究和投资的衔接更加顺畅。找出问题所在，依托华安扎实的研究，采用正确的思路投资，我们对 2004 年华安创新的业绩充满信心。

（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、《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。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（RC SR, 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

2003 年，交通银行作为华安创新证券投资基金的托管人，严格遵守了《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、《开放式证券投资基金试点办法》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，依法安全保管了基金的全部资产，按规定如实、独立地向证监会提交了本基金运作情况报告，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，按照《证券投资基金管理暂行办法》及各项实施准则、《开放式证券投资基金试点办法》、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、每份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，由华安创新证券投资基金管理人——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。

交通银行基金托管部
2004 年 3 月 10 日

五、基金财务报告

(一) 审计报告

审计报告

普华永道中天审字(2004)第 210 号

华安创新证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的华安创新证券投资基金(以下简称“华安创新基金”)2003 年 12 月 31 日的资产负债表及 2003 年度的经营业绩表和基金净值变动表。这些会计报表的编制是华安创新基金管理人华安基金管理有限公司的责任，我们的责任是在实施审计工作的基础上对这些会计报表发表意见。

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，评价基金管理人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，上述会计报表符合中华人民共和国国家颁布的企业会计准则、《证券投资基金会计核算办法》、《华安创新证券投资基金基金契约》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定，在所有重大方面公允反映了华安创新基金 2003 年 12 月 31 日的财务状况以及 2003 年度的经营成果和净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司
2004 年 2 月 5 日

注册会计师：肖峰
注册会计师：陈玲

(二) 基金会计报告书

1. 资产负债报告书

项 目	附注	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		55,902,945.25	119,414,302.77
清算备付金		26,080,175.66	745,349,406.22
交易保证金		250,000.00	1,304,879.14
应收证券清算款		6,322,867.90	-
应收股利		-	-
应收利息	3(1)	6,125,061.46	7,623,045.76
应收申购款		188,184.50	71,708.00
其他应收款		-	20,000.00
股票投资市值	1(6)	2,112,681,284.42	2,412,703,574.35
其中：股票投资成本	1(4)	1,895,356,363.17	2,833,540,056.56
债券投资市值	1(6)	808,377,739.70	1,059,581,673.10

其中：债券投资成本	1(5)	801,078,821.21	1,061,738,698.97
配股权证		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产合计		<u>3,015,928,258.89</u>	<u>4,346,068,589.34</u>
负债：			
应付证券清算款		6,720,813.69	43,250,207.49
应付赎回款		71,156,580.57	1,710,537.27
应付赎回费		351,403.36	105,741.52
应付管理人报酬		3,989,013.59	5,674,823.57
应付托管费		664,835.58	945,803.91
应付佣金		1,405,274.29	850,895.37
其他应付款		250,000.00	500,000.00
预提费用		130,000.00	276,000.00
负债合计		<u>84,667,921.08</u>	<u>53,314,009.13</u>
所有者权益：			
实收基金	1(11) 3(4)	2,766,022,171.38	4,685,440,851.00
未实现利得	1(12) 3(5)	202,043,939.99	-407,364,130.26
未分配收益		-36,805,773.56	14,677,859.47
持有人权益合计		<u>2,931,260,337.81</u>	<u>4,292,754,580.21</u>
负债和所有者权益合计		<u>3,015,928,258.89</u>	<u>4,346,068,589.34</u>

2. 基金经营业绩报告书

项 目	附注	2003 年	2002 年
收入：			
股票差价收入	1(7)	11,975,317.79	54,094,721.06
债券差价收入	1(7)	-9,223,172.38	6,305,962.46
债券利息收入	1(7)	26,434,986.29	45,979,786.64
存款利息收入	1(7)	7,310,571.24	21,797,430.00
股利收入	1(7)	32,154,607.22	31,755,641.22
买入返售证券收入	1(7)	426,094.00	3,456,665.00
其他收入	3(6)	8,440,467.75	7,399,167.65
收入合计		<u>77,518,871.91</u>	<u>170,789,374.03</u>
费用：			
基金管理人报酬	2(4)	55,854,800.15	72,818,768.43
基金托管费	2(4)	9,309,133.25	12,136,461.44
卖出回购证券支出	1(10)	1,838,022.00	182,536.00

其他费用	3(7)	517,631.17	2,022,999.70
其中：信息披露费		340,000.00	340,000.00
审计费用		130,000.00	150,000.00
费用合计		<u>67,519,586.57</u>	<u>87,160,765.57</u>
基金净收益		9,999,285.34	83,628,608.46
加：未实现估值增值变动数	3(5)	647,617,347.82	-451,154,758.35
基金经营业绩		<u>657,616,633.16</u>	<u>-367,526,149.89</u>

3. 收益分配报告书

项 目	附注	2003 年	2002 年
本期基金净收益		9,999,285.34	83,628,608.46
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(13)	-293,431.00	23,109,781.62
减：本期赎回基金单位的损 益平准金	1(13)	-2,617,833.18	23,141,507.14
可供分配基金净收益		<u>27,001,546.99</u>	<u>118,042,860.41</u>
减：本期已分配基金净收益	1(14)	63,807,320.55	103,365,000.94
期末基金未分配净收益		<u>-36,805,773.56</u>	<u>14,677,859.47</u>

4. 基金净值变动报告书

项 目	附注	2003 年	2002 年
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		9,999,285.34	83,628,608.46
未实现估值增值变动数	3(5)	647,617,347.82	-451,154,758.35
经营活动产生的基金净值变 动数		<u>657,616,633.16</u>	<u>-367,526,149.89</u>
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		64,762,345.90	1,146,484,966.88
基金赎回款		-2,020,065,900.91	-1,447,552,254.35
基金单位交易产生的基金净 值变动数		<u>-1,955,303,555.01</u>	<u>-301,067,287.47</u>
四、本期向持有人分配收益		-63,807,320.55	-103,365,000.94
五、期末基金净值		<u>2,931,260,337.81</u>	<u>4,292,754,580.21</u>

(三) 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) 记帐本位币

本基金的记帐本位币为人民币。

(3) 记帐基础和计价原则

本基金的记帐基础为权责发生制。除股票投资和债券投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

(4) 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。

(5) 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。

买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

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。

(6) 投资估值

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交易收盘价估值。

证券交易所交易的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。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，按估值日在证券交易所挂牌的该股票的市场交易收盘价高于配股价的差额估值，计入“配股权证”科目。若市场交易收盘价低于配股价，则估值为零。

实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(7) 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 股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

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。

(8) 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。

(9) 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。

(10) 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。

(11) 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额。每份基金单位面值为 1.00 元。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。

(12) 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。

(13) 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未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

(14) 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，不足以支付银行转账或其他手续费时，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，四舍五入，保留至 0.01 份。
- 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。

(15) 主要税项

根据财政部、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 基金买卖股票、债券的差价收入，在 2003 年底前暂免征收营业税。
- ③ 对基金买卖股票、债券的差价收入，在 2003 年底前暂免征收企业所得税；对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。
- 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	973,812,437.04	8.79%	775,014.82	8.67%	0.08%
东方证券有限责任公司	733,352,031.27	6.62%	594,218.09	6.65%	0.08%
合计	<u>1,707,164,468.31</u>	15.41%	<u>1,369,232.91</u>	15.33%	0.08%

2002 年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	599,719,541.69	9.76%	467,751.18	9.94%	0.08%
东方证券有限责任公司	363,549,826.23	5.92%	286,555.55	6.09%	0.08%
合计	<u>963,269,367.92</u>	15.68%	<u>754,306.73</u>	16.03%	0.08%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

② 2003 年本基金通过关联人席位的债券和回购成交量

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	241,962,230.20	4.40%	200,000,000.00	6.45%
东方证券有限责任公司	<u>92,823,834.40</u>	1.69%	-	-
合计	<u>334,786,064.60</u>	6.09%	<u>200,000,000.00</u>	6.45%

2002 年本基金通过关联人席位的债券和回购成交量

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	1.40%	500,000,000.00	7.43%
东方证券有限责任公司	<u>696,731,599.30</u>	3.96%	-	-
合计	<u>942,514,856.50</u>	5.36%	<u>500,000,000.00</u>	7.43%

(3) 2003 年本基金与关联人未进行银行间市场债券回购交易。(2002 年：同)

(4) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额

① 基金管理人的报酬

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。

本基金在本会计期间需支付基金管理费 55,854,800.15 元。（2002 年：72,818,768.43 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 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 9,309,133.25 元。（2002 年：12,136,461.44 元）

3. 主要报表项目说明

(1) 应收利息

项 目	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
应收债券利息	6,071,597.27	7,222,102.07
应收清算备付金利息	16,018.87	336,885.55
应收银行存款利息	37,445.32	64,058.14
合 计	<u>6,125,061.46</u>	<u>7,623,045.76</u>

(2) 其他应付款

截至 2003 年 12 月 31 日，其他应付款余额均为应付券商的席位保证金（2002 年：同）

(3) 预提费用

项 目	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
审计费	130,000.00	150,000.00
信息披露费	-	120,000.00
其他	-	6,000.00
合 计	<u>130,000.00</u>	<u>276,000.00</u>

(4) 实收基金

项 目	基金单位数	基金面值
2002 年 12 月 31 日	4,685,440,851.00	4,685,440,851.00
加：本期申购	44,719,796.35	44,719,796.35
减：本期赎回	1,985,092,144.97	1,985,092,144.97
红利再投资	20,953,669.00	20,953,669.00
2003 年 12 月 31 日	<u>2,766,022,171.38</u>	<u>2,766,022,171.38</u>

(5) 未实现利得：

项 目	未实现估值增值 /(减值) (a)	未实现利得/ (损 失) 平准金	合计
2002 年 12 月 31 日	-422,993,508.08	15,629,377.82	-407,364,130.26
加：本期未实现估值 增值变动数	647,617,347.82	-	647,617,347.82
加：本期申购基金单位	-	-17,418.12	-17,418.12
减：本期赎回基金单位	-	37,591,589.12	37,591,589.12
红利再投资	-	-600,270.33	-600,270.33
2003 年 12 月 31 日	<u>224,623,839.74</u>	<u>-22,579,899.75</u>	<u>202,043,939.99</u>

(a) 未实现估值增值/(减值)按投资类别分项列示如下：

	2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
股票投资	217,324,921.25	-420,836,482.21
债券投资	7,298,918.49	-2,157,025.87
合计	<u>224,623,839.74</u>	<u>-422,993,508.08</u>

(6) 其他收入

项 目	2003 年	2002 年
赎回基金补偿收入(b)	8,080,265.69	5,762,013.63
新股认购手续费返还	263,723.82	713,154.02
债券认购手续费返还	12,478.24	924,000.00
债券申购冻结利息返还	84,000.00	-
合 计	<u>8,440,467.75</u>	<u>7,399,167.65</u>

(b) 根据《华安创新证券投资基金招募说明书》的有关规定，基金赎回时按基金赎回款的 0.5%收取的赎回费，在扣除 0.1%作为基金注册与过户登记服务费后的余额，归基金资产，作为对其他基金持有人的补偿。

(7) 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	2002 年
审计费	130,000.00	150,000.00
信息披露费	340,000.00	340,000.00
发行费用摊销	-	1,398,889.02
其他	47,631.17	134,110.68
合 计	<u>517,631.17</u>	<u>2,022,999.70</u>

(8) 收益分配

2003 年 中期	宣告日	登记日/ 除权日	分红率	现金形式发放	再投资形式发 放	发放红利合计
分红	2003-6-17	2003-6-23	0.018 元/份	43,313,566.84	20,493,753.71	63,807,320.55

(四) 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

根据中国证券监督管理委员会的政策规定，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帐户，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网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外，根据中国证券监督管理委员会证监发行字[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》及其配套规定，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。

本基金流通受限、不能自由转让的资产为获配的新股和配股。在估值时如果该股票还未上市，则按成本计价；如已上市，则按当日收盘价计价。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 12 月 31 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	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	34,000	226,780.00	226,780.00
长江电力	网下认购	03-11-10	03-11-18	04-05-18	4.30	8.68	1,882,349	8,094,100.70	16,338,789.32
合计								8,320,880.70	16,565,569.32

2、本基金截止 2003 年 12 月 31 日流通受限债券情况如下：

债券名称	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	成功申购数量	成本	估值
03华源债	合同分销	03-9-22	未知	未知	100.00	100.00	30,000	3,000,000.00	3,000,000.00

(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	226,780.00	0.01%
B	采掘业	80,231,168.43	2.74%
C	制造业	1,187,598,259.13	40.51%
C0	其中：食品、饮料	16,060,000.00	0.55%
C1	纺织、服装、皮毛	22,316,629.44	0.76%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	140,639,259.49	4.80%

C5	电子	11,178,121.00	0.38%
C6	金属、非金属	471,646,968.19	16.09%
C7	机械、设备、仪表	506,399,705.21	17.28%
C8	医药、生物制品	19,357,575.80	0.66%
C99	其他	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	223,866,853.79	7.64%
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	427,021,691.52	14.57%
G	信息技术业	60,099,084.84	2.05%
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	133,637,446.71	4.56%
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	2,112,681,284.42	72.07%

2、债券（不包括国债）合计

截止 2003 年 12 月 31 日，基金持有债券（不含应收利息）199,911,621.10 元，占基金资产净值的 6.82%。

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 690,051,293.72 元，占基金资产净值的 23.54%。

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	39,245,895	277,468,477.65	9.47%
2	上海汽车	13,527,229	186,269,943.33	6.35%
3	上港集箱	12,432,870	176,546,754.00	6.02%
4	上海机场	14,978,963	149,490,050.74	5.10%
5	招商银行	12,362,391	133,637,446.71	4.56%
6	威孚高科	9,005,698	103,565,527.00	3.53%
7	上海电气	10,769,868	101,882,951.28	3.48%
8	烟台万华	6,320,443	86,147,638.09	2.94%
9	华能国际	4,701,085	82,504,041.75	2.81%
10	国电电力	5,503,672	64,723,182.72	2.21%
11	中国联通	15,292,388	60,099,084.84	2.05%
12	长江电力	5,495,349	47,699,629.32	1.63%
13	中集集团	2,341,449	46,922,637.96	1.60%
14	生益科技	5,500,000	44,275,000.00	1.51%
15	中国石化	8,748,105	43,303,119.75	1.48%
16	福耀玻璃	2,640,408	40,952,728.08	1.40%
17	海螺水泥	3,511,300	40,134,159.00	1.37%

18	南京水运	4,824,377	37,244,190.44	1.27%
19	海油工程	2,531,052	36,928,048.68	1.26%
20	格力电器	3,650,000	32,375,500.00	1.10%
21	铜都铜业	3,466,381	30,573,480.42	1.04%
22	申能股份	2,000,000	28,940,000.00	0.99%
23	云天化	2,615,500	26,599,635.00	0.91%
24	江淮汽车	1,697,600	24,767,984.00	0.84%
25	南方航空	4,817,946	23,848,832.70	0.81%
26	天津港	1,594,223	20,119,094.26	0.69%
27	招商局A	1,787,773	19,772,769.38	0.67%
28	新兴铸管	1,744,319	19,745,691.08	0.67%
29	恒瑞医药	2,307,220	19,357,575.80	0.66%
30	盐湖钾肥	2,145,600	19,310,400.00	0.66%
31	双汇发展	1,000,000	16,060,000.00	0.55%
32	鲁泰A	1,502,034	12,256,597.44	0.42%
33	法拉电子	800,725	11,178,121.00	0.38%
34	鞍钢新轧	2,000,000	11,060,000.00	0.38%
35	海欣股份	785,940	10,060,032.00	0.34%
36	齐鲁石化	1,191,887	8,581,586.40	0.29%
37	一汽轿车	820,830	8,306,799.60	0.28%
38	东风汽车	400,000	4,956,000.00	0.17%
39	酒钢宏兴	582,700	4,789,794.00	0.16%
40	新赛股份	34,000	226,780.00	0.01%
	合计		2,112,681,284.42	72.07%

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 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 71,383,861.43 元。股票市值 2,112,681,284.42 元、债券市值（不含国债）199,911,621.10 元、国债及货币资金 690,051,293.72 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、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) 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	铜都铜业	-	6,733,581	-	3,267,200
2	新兴铸管	-	1,744,319	-	-
3	一汽轿车	-	825,830	-	5,000
4	鞍钢新轧	-	3,966,379	-	1,966,379

5	齐鲁石化	-	1,191,887	-	-
6	东风汽车	-	400,000	-	-
7	上港集箱	-	14,563,476	1,300,450	3,431,056
8	中国石化	-	27,131,420	-	18,383,315
9	南方航空	2,182,000	11,506,101	-	8,870,155
10	招商银行	-	67,478,754	-	55,116,363
11	酒钢宏兴	-	582,700	-	-
12	新赛股份	34,000	-	-	-
13	申能股份	-	7,325,699	-	5,325,699
14	福耀玻璃	-	1,172,310	1,468,098	-
15	天津港	-	4,494,007	-	2,899,784
16	长江电力	5,045,349	1,976,000	-	1,526,000

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。

(七) 本期剔除股票

序号	股票名称	期初数量	本期买入	本期卖出
1	万科A	1,546,533	3,270,802	4,817,335
2	华联控股	-	546,406	546,406
3	农产品	25,000	-	25,000
4	盐田港A	5,100,900	322,408	5,423,308
5	深圳机场	200,000	7,164,691	7,364,691
6	中联重科	800,000	310,410	1,110,410
7	许继电气	1,800,330	600,195	2,400,525
8	东阿阿胶	1,104,238	-	1,104,238
9	晨鸣纸业	16,635	553,840	570,475
10	海虹控股	-	132,559	132,559
11	丽珠集团	2,532,330	-	2,532,330
12	佛山照明	1,131,644	530,006	1,661,650
13	TCL 通讯	292,224	430,233	722,457
14	万向钱潮	119,600	1,670,798	1,790,398
15	韶能股份	-	1,710,047	1,710,047
16	新钢钒	3,855,300	905,600	4,760,900
17	珠海中富	4,298,402	1,031,443	5,329,845
18	山推股份	-	850,200	850,200
19	模塑科技	705,000	-	705,000
20	韶钢松山	-	1,181,154	1,181,154
21	燕京啤酒	809,318	-	809,318
22	草原兴发	503,582	1,725,099	2,228,681
23	云铝股份	3,373,850	870,990	4,244,840
24	辽河油田	6,300,967	5,505,020	11,805,987
25	五粮液	1,249,648	1,423,407	2,673,055
26	国风塑业	380	1,700,959	1,701,339
27	扬子石化	11,820,979	27,033,794	38,854,773

28	新希望	800,354	868,530	1,668,884
29	华北高速	1,036,924	-	1,036,924
30	华菱管线	6,650,000	-	6,650,000
31	中原油气	100,728	-	100,728
32	佛塑股份	194,938	256,000	450,938
33	浦发银行	-	6,150,000	6,150,000
34	白云机场	-	22,196,453	22,196,453
35	首创股份	1,850,281	2,343,049	4,193,330
36	皖通高速	738,000	-	738,000
37	华夏银行	-	2,121,000	2,121,000
38	民生银行	-	3,639,576	3,639,576
39	中原高速	-	615,000	615,000
40	上海电力	-	607,000	607,000
41	中信证券	1,156,000	-	1,156,000
42	三一重工	-	51,000	51,000
43	歌华有线	343,672	905,280	1,248,952
44	四川路桥	-	126,000	126,000
45	宇通客车	2,751,433	-	2,751,433
46	中达股份	1,200,841	670,386	1,871,227
47	同仁堂	2,251,962	1,772,201	4,024,163
48	兰花科创	-	807,927	807,927
49	波导股份	221,220	539,040	760,260
50	厦门建发	2,778,829	-	2,778,829
51	巨化股份	-	500,499	500,499
52	福田汽车	200,209	-	200,209
53	上海建工	2,005,832	1,495,035	3,500,867
54	雅戈尔	330,175	2,184,653	2,514,828
55	新华光	-	12,000	12,000
56	兖州煤业	1,607,793	4,662,409	6,270,202
57	吉林森工	5,386,480	-	5,386,480
58	中牧股份	910,447	39,000	949,447
59	山东铝业	-	199,836	199,836
60	南山实业	700,603	1,050,013	1,750,616
61	冠农股份	-	22,000	22,000
62	海正药业	126,565	-	126,565
63	赣粤高速	4,373,818	462,871	4,836,689
64	外运发展	416,412	84,200	500,612
65	航天信息	-	24,000	24,000
66	华芳纺织	-	103,000	103,000
67	江苏舜天	1,702,336	-	1,702,336
68	曙光股份	-	1,818,732	1,818,732
69	华泰股份	3,358,578	1,479,357	4,837,935
70	振华港机	820,370	230,100	1,050,470
71	美克股份	54,680	-	54,680

72	国祥股份	-	21,000	21,000
73	航天动力	-	57,000	57,000
74	国阳新能	-	347,870	347,870
75	浙江龙盛	-	43,000	43,000
76	精伦电子	200,500	100,000	300,500
77	红星发展	396,772	458,713	855,485
78	三房巷	-	41,000	41,000
79	星马汽车	-	314,000	314,000
80	北京巴士	155,942	-	155,942
81	太工天成	-	11,000	11,000
82	江苏申龙	-	13,000	13,000
83	欣网视讯	-	14,000	14,000
84	国电南瑞	-	24,000	24,000
85	安泰集团	-	422,100	422,100
86	三友化工	-	109,000	109,000
87	湘电股份	70,000	370,300	440,300
88	柳化股份	-	52,000	52,000
89	青松建化	-	45,000	45,000
90	中远航运	3,650,810	906,251	4,557,061
91	三元股份	-	262,000	262,000
92	吉恩镍业	-	43,000	43,000
93	冠豪高新	-	48,000	48,000
94	北方天鸟	-	23,000	23,000
95	片仔癀	-	22,000	22,000
96	瑞贝卡	-	9,000	9,000
97	金证股份	-	5,000	5,000
98	赛马实业	-	29,000	29,000
99	时代新材	20,000	-	20,000
100	贵研铂业	-	22,000	22,000
101	士兰微	-	13,000	13,000
102	石岷纸业	-	36,000	36,000
103	风神股份	-	65,000	65,000
104	华光股份	-	51,000	51,000
105	湘邮科技	-	17,000	17,000
106	杭萧钢构	-	908,761	908,761
107	力元新材	-	23,000	23,000
108	凌云股份	-	60,000	60,000
109	双良股份	-	81,000	81,000
110	中创信测	-	7,000	7,000
111	亨通光电	-	19,000	19,000
112	天药股份	300,400	-	300,400
113	中金黄金	-	104,000	104,000
114	中科合臣	-	13,000	13,000
115	中化国际	1,399,098	-	1,399,098

116	安徽水利	-	46,000	46,000
117	ST 宏 智	27,000	-	27,000
118	长力股份	-	36,000	36,000
119	上海能源	4,100,692	978,113	5,078,805
120	黑 牡 丹	200,050	-	200,050
121	联环药业	-	7,000	7,000
122	海龙科技	81,000	-	81,000
123	置信电气	-	11,000	11,000
124	三佳模具	100,700	-	100,700
125	华海药业	-	20,000	20,000
126	菲达环保	23,000	-	23,000
127	江南高纤	-	18,000	18,000
128	栖霞建设	9,000	-	9,000
129	天 士 力	631,896	200,000	831,896
130	海通集团	-	41,000	41,000
131	北海国发	-	30,000	30,000
132	新疆城建	-	62,000	62,000
133	中油化建	-	23,000	23,000
134	山东黄金	-	56,000	56,000
135	高淳陶瓷	-	17,000	17,000
136	迪马股份	149,960	150,723	300,683
137	恒生电子	-	6,000	6,000
138	信 雅 达	6,000	200,567	206,567
139	惠泉啤酒	-	53,000	53,000
140	芜 湖 港	-	30,000	30,000
141	庆丰股份	-	51,000	51,000
142	天地科技	252,603	230,338	482,941
143	长电科技	-	543,000	543,000
144	新华医疗	7,000	-	7,000
145	光明乳业	5,000	-	5,000
146	青岛啤酒	80,000	298,717	378,717
147	大众交通	1,133,010	-	1,133,010
148	申达股份	3,041,325	883,132	3,924,457
149	新 世 界	2,154,488	-	2,154,488
150	强生控股	403,843	225,845	629,688
151	上海石化	-	8,002,232	8,002,232
152	大商股份	200,840	2,053,522	2,254,362
153	山西焦化	-	247,901	247,901
154	巴士股份	18,500,406	189,818	18,690,224
155	一汽四环	292,751	3,181,148	3,473,899
156	大显股份	18,207,924	1,024,193	19,232,117
157	华北制药	1,650,000	29,506,212	31,156,212
158	厦工股份	-	2,500,310	2,500,310
159	益民百货	617,400	-	617,400

160	华联超市	-	215,500	215,500
161	东方明珠	-	1,004,453	1,004,453
162	内蒙华电	320,854	-	320,854
163	通化东宝	12,000,933	2,073,936	14,074,869
164	亚泰集团	5,074,743	2,752,252	7,826,995
165	伊利股份	500,000	2,417,013	2,917,013

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、本公司于 2003 年 3 月 18 日发布公告，自 2003 年 3 月 18 日起，中国工商银行将代理销售本基金。投资者可以在中国工商银行 37 个一级分行遍布全国所有省、市、自治区（除西藏）的 3000 多个理财网点办理开户、申购、赎回、非交易过户等业务、相关信息查询并享受相应的售后服务。
- 3、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。详情请登录本公司网站www.huaan.com.cn或拨打客户服务热线：(021) 68604666。
- 4、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。详情请登录本公司网站www.huaan.com.cn或拨打客户服务热线：(021) 68604666。
- 5、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。
- 6、本基金于 2003 年 6 月 17 日公告实施第二次分红，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。
- 7、本基金于 2003 年 8 月 21 日以通讯表决方式召开第一次持有人大会，审议内容包括：1) 关于《华安创新证券投资基金基金契约》修改的议案；2)、关于调低基金赎回费率及调整赎回时注册与过户登记费的议案。会议表决结果已根据本基金契约规定报中国证监会审批，并将于中国证监会批准后公告。
- 8、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：成立开放式基金经理小组，成员由本公司管理的各

- 开放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，聘任刘新勇先生、孙正女士为华安创新证券投资基金基金经理。
- 9、根据本公司 2003 年 10 月 15 日发布的公告，自 2003 年 10 月 15 日起，本公司开通了开放式基金网上预约交易及定期定额投资计划。
 - 10、根据本公司 2003 年 11 月 22 日发布的公告，自 2003 年 11 月 24 日起，本公司旗下的开放式基金份额的最小变动单位由 1 份基金单位调整为 0.01 份基金单位。
 - 11、根据本公司 2004 年 2 月 5 日发布的公告，孙正女士不再担任华安创新证券投资基金基金经理职务。
 - 12、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。
 - 13、本基金于 2004 年 3 月 4 日公告实施第三次分红，以 2004 年 3 月 3 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 0.40 元，除息日为 2004 年 3 月 8 日。
 - 14、根据本公司 2004 年 3 月 18 日发布的公告，自 2004 年 3 月 22 日起，渤海证券有限责任公司成为本基金的代销机构。投资者可以在渤海证券有限责任公司在全国 11 个省、市、自治区 12 个主要城市的 31 家营业网点办理华安创新证券投资基金和华安上证 180 指数增强型证券投资基金的开户、申购、赎回等业务。
 - 15、投资者可从以下代销渠道网点购买本基金：交通银行、中国银行、中国工商银行、国泰君安证券股份有限公司、华夏证券股份有限公司、渤海证券有限责任公司。
 - 16、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。
 - 17、2003 年新增租用中银国际证券有限责任公司的交易席位。
 - 18、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	1,507,352,260.57	13.61%	1,219,423.78	13.65%
海通证券股份有限公司	764,862,954.76	6.91%	603,484.80	6.75%
申银万国证券股份有限公司	973,812,437.04	8.79%	775,014.82	8.67%
广发证券有限责任公司	700,292,066.78	6.32%	572,407.81	6.41%
大鹏证券有限责任公司	587,766,913.86	5.31%	472,716.60	5.29%
东方证券有限责任公司	733,352,031.27	6.62%	594,218.09	6.65%
中国民族证券有限责任公司	302,891,277.30	2.73%	237,016.60	2.65%
平安证券有限责任公司	443,942,730.41	4.01%	347,390.36	3.89%
大通证券有限责任公司	1,753,891,301.31	15.84%	1,427,027.61	15.97%
招商证券股份有限公司	866,836,748.95	7.83%	701,833.14	7.86%
中国国际金融有限公司	2,033,704,747.44	18.36%	1,654,431.58	18.52%
中银国际证券有限责任公司	406,181,445.97	3.67%	328,974.79	3.68%

合 计	11,074,886,915.66	100.00%	8,933,939.98	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	640,342,587.60	11.65%	20,000,000.00	0.65%
海通证券股份有限公司	695,976,776.70	12.66%	1,136,200,000.00	36.66%
申银万国证券股份有限公司	241,962,230.20	4.40%	200,000,000.00	6.45%
广发证券有限责任公司	265,951,787.90	4.84%	-	-
大鹏证券有限责任公司	155,029,238.60	2.82%	-	-
东方证券有限责任公司	92,823,834.40	1.69%	-	-
中国民族证券有限责任公司	87,586,282.10	1.59%	-	-
平安证券有限责任公司	669,241,867.30	12.17%	-	-
大通证券有限责任公司	957,149,157.00	17.41%	421,300,000.00	13.59%
招商证券股份有限公司	542,674,704.50	9.87%	441,800,000.00	14.26%
中国国际金融有限公司	835,732,893.00	15.20%	779,700,000.00	25.16%
中银国际证券有限责任公司	313,588,479.00	5.70%	100,000,000.00	3.23%
合 计	5,498,059,838.30	100.00%	3,099,000,000.00	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批准成立批件、营业执照、公司章程。
5. 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。
6. 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

2004 年 3 月 25 日