

安顺证券投资基金

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 22 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: 安顺证券投资基金
(简称: 基金安顺)

交易代码: 500009

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)
方正证券有限责任公司
(原浙江证券有限责任公司)
华安基金管理有限公司

基金发行日期: 1999 年 6 月 9 日

基金成立日期: 1999 年 6 月 15 日

基金单位总份额: 30 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: 1999 年 6 月 22 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
(邮政编码: 200336)

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：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	-0.0026 元	0.0140 元	0.0140 元	0.0140 元	0.1093 元	0.1093 元
期末可供分配基金收益	68,255,840.78 元	-108,516,998.87 元	-108,516,998.87 元	-108,516,998.87 元	361,034,236.23 元	361,034,236.23 元
期末可供分配单位基金收益	0.0228 元	-0.0362 元	-0.0362 元	-0.0362 元	0.1203 元	0.1203 元
期末单位基金资产净值	1.0802 元	0.9638 元	0.9638 元	0.9638 元	1.1692 元	1.1692 元
加权平均基金净值收益率	-0.25%	1.31%	1.32%	1.32%	8.44%	8.58%
本期单位基金净值增长率	12.08%	-9.12%	-9.12%	-9.12%	-8.33%	-8.33%
单位基金累计净值增长率	52.54%	36.10%	36.10%	36.10%	49.76%	49.76%

(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。

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

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 个交易日， $\Delta NAV_k = i$ 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

$$4、\text{本期单位基金净值增长率} = \left(\frac{\text{本期第一次分红或扩募前单位基金资产净值} + \text{本期第二次分红或扩募前单位基金资产净值} + \text{本期第一次分红或扩募后单位基金资产净值}}{\text{期初单位基金资产净值}} \right) \times \dots \times \left(\frac{\text{期末单位基金资产净值} + \text{本期最后一次分红或扩募后单位基金资产净值}}{\text{本期第一次分红或扩募前单位基金资产净值}} \right) - 1$$

$$5、\text{单位基金累计净值增长率} = (1 + \text{第一年度单位基金资产净值增长率}) \times (1 + \text{第二年度单位基金资产净值增长率}) \times \dots \times (1 + \text{上年度单位基金资产净值增长率}) \times (1 + \text{本期单位基金资产净值增长率}) - 1$$

三. 基金管理人报告

(一) 基金概述

安顺证券投资基金（以下简称“基金”）经中国证券监督管理委员会证监基金字（1999）15 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）、方正证券有限责任公司（原浙江证券有限责任公司）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 30 亿份，每份基金单位面值人民币 1.00 元，发行价格为 1.01 元，已于 1999 年 6 月 15 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的、上市的股票、债券以及经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。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。

(二) 基金经理简介

尚志民 先生：工商管理硕士，9 年证券从业经验，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员、基金安顺、基金安瑞、华安创新基金经理。现任基金投资部总监助理、基金安顺基金经理。

(三) 基金经理报告

2003 年安顺基金单位净值上扬 12.08%，同期上证指数上涨 10.27%，深圳综指下跌 2.6%。安顺基金将向全体基金持有人按每 10 份基金单位派发现金红利 0.22 元。尽管安顺基金净值增长跑赢两市大盘，但与部分基金同行的优异表现相比很

不理想。

本基金自 1999 年 6 月 15 日成立以来，历年的业绩表现总结如下，

年度	净值增长率	上证综指涨幅	深证综指涨幅	单位分红
1999 年*	3.74%	-4.28%	-4.83%	0.035 元
2000 年	57.48%	51.73%	58.07%	0.320 元
2001 年	-8.33%	-20.62%	-25.13%	0.110 元
2002 年	-9.12%	-17.52%	-18.32%	-
2003 年	12.08%	10.27%	-2.61%	0.022 元
累计	52.54%	4.86%	-10.40%	0.487 元
年复合增长	9.73%	1.05%	-2.39%	-

*自基金成立以来

2003 年既是我国证券市场历史上罕见的结构大调整年，也是价值投资理念大放异彩的一年。尽管较早地预见到这一点，但市场反映仍大大超出我们意料。在下半年调整仓位过程中，虽然持续减轻仓位有效回避了指数下跌风险，但对股价两极分化的估计不足使我们操作保守。而组合有效仓位偏低，期望能够多实现收益以备分红的考虑，使得处理低效资产时患得患失并存侥幸心理，未能大刀阔斧。四季度重新调整部署后，才扭转了被动局面。

我们认为国务院发布的《推进资本市场改革与发展若干意见》从全局的角度对资本市场进行了战略性的重新定位。明确了保护投资者合法权益和重视资本市场回报；明确全流通的发展方向，并重申了“切实保护投资者特别是公众投资者的合法权益”的指导政策；强调了追究损害中小股东权益的控股股东的责任；提出了健全有利于资本市场稳定发展和投资者权益保护的法规体系。《若干意见》的出台有利于形成保护投资者合法利益的资本市场环境，也有利于投资者形成长期投资的理念，极大提高了二级市场投资者对证券市场长远发展的信心。

我们认为 GDP 的持续增长是支持中国资本市场长期向好的源动力。对中国今后经济发展的良好预期使我们相信 2004 年的证券市场将稳步健康发展。而结构调整作为今后相当长时期内证券市场的主旋律在 2004 年将继续延伸和深化。这种结构调整不仅体现在宏观经济及其行业层面上，也体现在上市公司自身产业结构、产品结构、治理结构、股权结构方面。上述的结构调整将促使证券市场资源配置功能得到更好体现和加强。国民经济的持续健康发展和证券市场规模的逐步壮大，使相当数量的上市公司作为各行各业的优秀代表和行业龙头涌现出来，构成了我国证券市场上的蓝筹股群体。随着我国证券市场投资者基础构成由散户为主向机构投资者为主过渡，蓝筹股将成为投资理念长期化、理性化的机构投资者日益重视的投资对象，也是吸引市场资金的主要群体。值得注意的是经历了 2003 年的全面挖掘，蓝筹股板块内部的分化将在 2004 年有所体现。

我们坚持认为行业景气度和上市公司的基本面最终会反映到二级市场股票价格中。因此，在继续积极关注国民经济支柱行业景气度持续提升的大市值上市公司的同时，还将努力挖掘发展迅速的中小行业中的个股投资机会。在政府重点扩大和刺激消费的大背景下，预计与国民消费升级及消费量持续稳定增长密切相关公司的投资机会有望出现，而其中具资源及品牌优势的企业尤其值得关注。

随着 QFII 在国内 A 股市场的全面进入，预计 QDII 也将诞生。在机构博弈日益激烈的背景下，国内投资者视野和投资标的的国际化趋势将使 A 股市场的估值体系经受进一步考验，这也是我们在今后投资管理过程中重点考虑的问题。

作为封闭式基金的管理人，努力追求给基金持有人持续稳定的分红回报依然是我们的长期目标。

（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、《安顺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

2003 年, 交通银行作为安顺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》及其实施准则的规定, 依据《安顺证券投资基金基金契约》和《安顺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、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顺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, 由安顺基金管理人——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安顺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. 基金年度财务报告

(一) 审计报告

审计报告

安永大华业字(2004)第 275 号

安顺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《安顺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

安顺证券投资基金

资产负债表

2003 年 12 月 31 日

资产	附注	金额单位：人民币元	
		2003 年 12 月 31 日	2002 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		132,739,785.05	101,468,478.05
清算备付金		17,093,370.39	177,142,112.23
交易保证金		250,000.00	441,869.76
应收证券清算款		9,739,305.88	53,002,585.71
应收股利		-	-
应收利息	3(1)	8,694,690.28	8,281,669.76
其他应收款	3(2)	-	60,000.00
股票投资市值	1(4)	2,232,246,604.55	1,780,104,463.66
其中：股票投资成本		2,058,624,655.35	1,960,341,603.36
债券投资市值	1(4)	878,782,186.30	776,608,730.70
其中：债券投资成本		880,105,698.28	780,953,810.88
配股权证		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,279,545,942.45	2,897,109,909.87

负债与基金持有人权益

负债：			
应付证券清算款		30,954,654.05	-
应付管理人报酬		4,022,372.83	3,713,094.25
应付托管费		670,395.45	618,849.03
应付佣金		2,474,242.12	538,965.46
应付利息		-	-
应付收益		-	-
其他应付款	3(3)	500,000.00	500,000.00
卖出回购证券款		-	-
预提费用	3(4)	370,000.00	256,000.00
其他负债		-	-

负债合计	38,991,664.45	5,626,908.74
持有人权益：		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得	172,298,437.22	-184,582,219.88
未分配收益	68,255,840.78	76,065,221.01
持有人权益合计	3,240,554,278.00	2,891,483,001.13
负债及持有人权益总计	3,279,545,942.45	2,897,109,909.87

安顺证券投资基金
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：		50,967,880.77	106,639,308.97
股票差价收入	1(6)	11,626,586.00	12,816,199.51
债券差价收入	1(6)	-17,650,658.84	28,689,659.90
债券利息收入	1(6)	23,780,295.62	39,212,616.47
存款利息收入	1(6)	3,909,146.11	7,621,196.14
股利收入	1(6)	28,405,904.77	17,471,175.44
买入返售证券收入	1(6)	588,639.15	184,000.00
其他收入	3(5)	307,967.96	644,461.51
二. 本期基金费用：		58,777,261.00	64,605,011.88
基金管理人报酬	2(4)	46,169,664.57	48,362,233.28
基金托管费	2(4)	7,696,886.15	8,062,720.17
卖出回购证券支出		4,289,815.41	6,009,711.60
利息支出		-	-
其他费用	3(6)	620,894.87	2,170,346.83
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		340,000.00	700,000.00
审计费用		130,000.00	260,000.00
三. 已实现基金净收益		-7,809,380.23	42,034,297.09
加：未实现利得		356,880,657.10	-328,034,176.01
四. 基金经营业绩		349,071,276.87	-285,999,878.92

安顺证券投资基金
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		-7,809,380.23	42,034,297.09

加：期初基金净收益		76,065,221.01	361,034,236.23
加：以前年度损益调整	1(10)	-	2,996,687.69
可供分配基金净收益		68,255,840.78	406,065,221.01
减：本期已分配基金净收益		-	330,000,000.00
期末基金净收益		68,255,840.78	76,065,221.01

安顺证券投资基金
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		2,891,483,001.13	3,507,482,880.05
二、本期经营活动：			
基金净收益		-7,809,380.23	42,034,297.09
未实现利得		356,880,657.10	-328,034,176.01
经营活动产生的基金净值变动数		349,071,276.87	-285,999,878.92
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		-	330,000,000.00
四、期末基金净值		3,240,554,278.00	2,891,483,001.13

(三) 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。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帐。

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，利息收入由债券除息日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 12,272,037.21 元，债券投资成本调减人民币 9,275,349.52 元，两者差额人民币 2,996,687.69 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 2,996,687.69 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
交通银行	基金托管人	提取托管费 银行间回购交易	基金契约 回购交易合同
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
 方正证券有限责任公司 管理公司股东 租用交易席位 席位使用协议
 基金发起人
 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
 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 2003 年本基金通过关联人席位的股票交易情况:

关联人	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	1,768,093,665.75	17.16%	1,417,733.63	17.08%	0.08%
天同证券有限责任公司	771,889,570.75	7.49%	622,179.44	7.50%	0.08%
方正证券有限责任公司	273,699,724.50	2.66%	214,175.02	2.58%	0.08%
东方证券有限责任公司	776,437,024.97	7.53%	619,862.04	7.47%	0.08%
合计	3,590,119,985.97	34.84%	2,873,950.13	34.63%	0.08%

2002 年本基金通过关联人席位的股票交易情况:

关联人	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	394,414,788.66	12.93%	294,606.54	12.82%	0.07%
天同证券有限责任公司	61,051,266.97	2.00%	47,773.40	2.08%	0.08%
方正证券有限责任公司	70,024,604.14	2.30%	51,147.71	2.23%	0.07%
东方证券有限责任公司	365,641,991.23	11.99%	276,792.39	12.04%	0.08%
合计	891,132,651.00	29.22%	670,320.04	29.17%	0.08%

② 2003 年本基金通过关联人席位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	495,951,508.80	16.42%	625,000,000.00	12.18%
天同证券有限责任公司	47,703,810.30	1.58%	72,700,000.00	1.42%
方正证券有限责任公司	119,783,130.80	3.97%	-	-
东方证券有限责任公司	385,991,645.40	12.78%	300,000,000.00	5.85%
合计	1,049,430,095.30	34.75%	997,700,000.00	19.45%

2002 年本基金通过关联人席位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	1,626,079,420.50	14.38%	725,000,000.00	14.90%
天同证券有限责任公司	-	-	-	-
方正证券有限责任公司	627,215,121.30	5.55%	-	-
东方证券有限责任公司	973,504,182.50	8.61%	470,000,000.00	9.66%
合计	3,226,798,724.30	28.54%	1,195,000,000.00	24.56%

(3) 本基金在 2003 年与关联人发生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
交通银行	-	-	-	-	12,000,000.00	3,096.99

本基金在 2002 年与关联人未发生银行间市场债券买卖和回购交易。

(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，本基金成立六个月后，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	2002 年
基金管理费	46,169,664.57 元	48,362,233.28 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	2002 年
基金托管费	7,696,886.15 元	8,062,720.17 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	107,814.04	162,232.29
债券利息	8,586,876.24	8,119,437.47
合计	8,694,690.28	8,281,669.76

(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	-	60,000.00

(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	500,000.00	500,000.00

(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
预提债券帐户维护费	-	6,000.00
合计	370,000.00	256,000.00

(5) 其他收入

明细项目	2003 年	2002 年
债券认购手续费返还	3,542.24	220,000.00
股票认购手续费返还	241,425.72	418,410.93
认购债券资金利息返还	63,000.00	-
印花税返还	-	6,050.58
合计	307,967.96	644,461.51

(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	700,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
分红手续费	-	990,000.00
返售与回购交易费	59,413.17	122,520.30
其他	31,481.70	37,826.53
合计	620,894.87	2,170,346.83

(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	-	2,996,687.69

(四) 本基金流通受限、不能自由转让的资产

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	36,000	240,120.00	240,120.00
长江电力	网下认购	03-11-10	03-11-18	04-05-18	4.30	8.84	2,823,524	12,141,153.20	24,959,952.16

合 计

12,381,273.20 25,200,072.16

- 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. 按行业分类的股票投资组合

代码	分 类	市值 (元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	240,120.00	0.01%
B	采掘业	74,534,000.00	2.30%
C	制造业	1,242,484,875.73	38.34%
C0	其中： 食品、饮料	70,512,665.92	2.18%
C1	纺织、服装、皮毛	275,212,710.40	8.49%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	43,327,000.00	1.34%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	429,054,627.05	13.24%
C5	电子	81,494,299.60	2.51%
C6	金属、非金属	111,273,313.98	3.43%
C7	机械、设备、仪表	165,460,785.32	5.11%
C8	医药、生物制品	30,960,000.00	0.96%
C99	其他	35,189,473.46	1.08%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	148,635,029.87	4.59%
E	建筑业	938,500.00	0.03%
F	交通运输、仓储业	254,859,472.23	7.86%
G	信息技术业	237,609,280.00	7.33%
H	批发和零售贸易	20,525,326.72	0.63%
I	金融、保险业	240,770,000.00	7.43%
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	11,650,000.00	0.36%
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	总计	2,232,246,604.55	68.88%

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 221,426,981.50 元，占基金资产净值的 6.83%。

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 785,973,012.07 元，占基金资产净值的 24.25%。

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	海欣股份	20,091,618	257,172,710.40	7.94%
2	中国联通	55,900,000	222,482,000.00	6.87%
3	上海机场	18,809,111	186,774,472.23	5.76%
4	招商银行	16,000,000	173,920,000.00	5.37%
5	齐鲁石化	13,000,000	93,860,000.00	2.90%
6	盐湖钾肥	9,000,000	81,270,000.00	2.51%
7	华能国际	4,509,669	79,325,077.71	2.45%
8	红星发展	5,600,000	72,968,000.00	2.25%
9	烟台万华	5,000,000	67,750,000.00	2.09%
10	民生银行	7,000,000	66,850,000.00	2.06%
11	扬子石化	5,198,685	56,821,627.05	1.75%
12	上海电气	5,803,800	54,497,682.00	1.68%
13	上海汽车	3,800,000	52,782,000.00	1.63%
14	招商局A	4,500,000	49,725,000.00	1.53%
15	山东铝业	2,550,158	45,418,313.98	1.40%
16	韶能股份	5,000,000	44,350,000.00	1.37%
17	华泰股份	3,700,000	43,327,000.00	1.34%
18	宝钢股份	5,500,000	39,325,000.00	1.21%
19	海油工程	2,700,000	39,015,000.00	1.20%
20	珠海中富	6,000,000	38,700,000.00	1.19%
21	紫江企业	3,453,334	35,189,473.46	1.08%
22	同仁堂	1,800,000	30,960,000.00	0.96%
23	五粮液	2,600,592	29,282,665.92	0.90%
24	贵州茅台	1,000,000	25,320,000.00	0.78%
25	彩虹股份	2,850,195	25,309,731.60	0.78%
26	长江电力	2,823,524	24,959,952.16	0.77%
27	东风汽车	2,000,000	24,580,000.00	0.76%
28	福耀玻璃	1,500,000	23,730,000.00	0.73%
29	特变电工	2,140,408	23,202,022.72	0.72%
30	法拉电子	1,452,300	20,564,568.00	0.63%
31	上海航空	2,000,000	18,360,000.00	0.57%
32	雅戈尔	2,000,000	18,040,000.00	0.56%
33	长电科技	2,000,000	18,020,000.00	0.56%
34	浙江龙盛	1,500,000	17,685,000.00	0.55%
35	安彩高科	2,000,000	17,600,000.00	0.54%
36	厦门建发	2,000,656	16,245,326.72	0.50%
37	双汇发展	1,000,000	15,910,000.00	0.49%
38	神火股份	1,200,000	15,492,000.00	0.48%
39	中兴通讯	800,000	15,056,000.00	0.46%
40	首创股份	1,000,000	11,650,000.00	0.36%
41	威孚高科	800,000	9,128,000.00	0.28%
42	山东黄金	425,000	7,106,000.00	0.22%
43	辽河油田	700,000	7,091,000.00	0.22%

44	中原油气	500,000	5,830,000.00	0.18%
45	中化国际	500,000	4,280,000.00	0.13%
46	鞍钢新轧	500,000	2,800,000.00	0.09%
47	生益科技	129,730	1,066,380.60	0.03%
48	杭萧钢构	50,000	938,500.00	0.03%
49	新赛股份	36,000	240,120.00	0.01%
50	国祥股份	23,000	204,700.00	0.01%
51	恒生电子	4,000	71,280.00	0.00%
	合计		2,232,246,604.55	68.88%

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 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为借方余额 907,679.88 元，与股票市值 2,232,246,604.55 元、债券（不包括国债）221,426,981.50 元、国债及货币资金 785,973,012.07 元之和相加后等于基金净值。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、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
		一级市场认购	二级市场买入	其他	
1	齐鲁石化	-	21,761,390	-	8,761,390
2	东风汽车	-	2,000,000	-	-
3	民生银行	-	16,386,296	958,596	10,344,892
4	特变电工	-	2,140,408	-	-
5	雅戈尔	-	3,968,934	-	1,968,934
6	山东铝业	-	6,231,371	-	3,681,213
7	安彩高科	-	7,053,334	-	5,053,334
8	紫江企业	-	2,120,000	1,333,334	-
9	国祥股份	23,000	-	-	-
10	浙江龙盛	43,000	3,500,271	-	2,043,271
11	杭萧钢构	10,000	2,100,622	-	2,060,622
12	贵州茅台	-	1,000,000	-	-
13	新赛股份	36,000	-	-	-
14	山东黄金	43,000	425,000	-	43,000
15	恒生电子	4,000	-	-	-
16	长电科技	41,000	4,062,932	-	2,103,932
17	福耀玻璃	-	500,000	1,386,537	386,537
18	彩虹股份	-	6,672,653	-	3,822,458
19	长江电力	5,260,524	1,018,650	-	3,455,650

20	韶能股份	-	12,719,731	-	7,719,731
21	鞍钢新轧	-	5,900,045	-	5,400,045
22	中原油气	-	5,000,557	100,000	4,600,557

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。

(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	-	15,858,523	15,858,523
2	白云机场	-	2,099,000	2,099,000
3	皖通高速	584,000	-	584,000
4	华夏银行	-	1,268,000	1,268,000
5	上港集箱	-	14,547,647	14,547,647
6	中原高速	-	678,000	678,000
7	上海电力	-	465,000	465,000
8	中国石化	-	31,749,950	31,749,950
9	南方航空	-	2,611,000	2,611,000
10	中信证券	978,000	-	978,000
11	三一重工	-	47,000	47,000
12	歌华有线	431,851	184,823	616,674
13	四川路桥	-	122,000	122,000
14	海信电器	-	600,000	600,000
15	兰花科创	-	799,998	799,998
16	福田汽车	-	5,078	5,078
17	新华光	-	14,000	14,000
18	兖州煤业	-	1,193,330	1,193,330
19	桂冠电力	-	5,421,090	5,421,090
20	冠农股份	-	23,000	23,000
21	北京城建	732,684	964,052	1,696,736
22	外运发展	366,378	3,165,722	3,532,100
23	航天信息	-	25,000	25,000
24	华芳纺织	-	103,000	103,000
25	恒瑞医药	2,360,888	300,000	2,660,888
26	江苏舜天	2,377,866	-	2,377,866
27	振华港机	2,345,548	-	2,345,548
28	航天动力	-	60,000	60,000
29	国阳新能	-	284,000	284,000
30	山东基建	-	4,078,081	4,078,081
31	三房巷	-	41,000	41,000
32	星马汽车	-	14,000	14,000
33	太工天成	-	9,000	9,000

34	江苏申龙	-	13,000	13,000
35	欣网视讯	-	13,000	13,000
36	国电南瑞	-	24,000	24,000
37	安泰集团	-	69,000	69,000
38	三友化工	-	123,000	123,000
39	柳化股份	-	49,000	49,000
40	青松建化	-	47,000	47,000
41	中远航运	222,000	-	222,000
42	三元股份	-	261,000	261,000
43	吉恩镍业	-	51,000	51,000
44	冠豪高新	-	46,000	46,000
45	北方天鸟	-	23,000	23,000
46	片仔癀	-	22,000	22,000
47	瑞贝卡	-	10,000	10,000
48	金证股份	-	7,000	7,000
49	赛马实业	-	32,000	32,000
50	时代新材	19,000	-	19,000
51	贵研铂业	-	22,000	22,000
52	士兰微	-	52,000	52,000
53	石岷纸业	-	35,000	35,000
54	风神股份	-	68,000	68,000
55	华光股份	-	48,000	48,000
56	湘邮科技	-	20,000	20,000
57	力元新材	-	24,000	24,000
58	凌云股份	-	61,000	61,000
59	双良股份	-	82,000	82,000
60	中创信测	-	6,000	6,000
61	亨通光电	-	18,000	18,000
62	中金黄金	-	135,000	135,000
63	中科合臣	-	14,000	14,000
64	安徽水利	-	51,000	51,000
65	长力股份	-	35,000	35,000
66	上海能源	1,269,493	3,112,133	4,381,626
67	黑牡丹	216,018	-	216,018
68	腾达建设	54,000	-	54,000
69	联环药业	-	7,000	7,000
70	置信电气	-	10,000	10,000
71	三佳模具	92,000	29,450	121,450
72	华海药业	-	18,000	18,000
73	中天科技	54,000	-	54,000
74	长园新材	10,000	-	10,000
75	菲达环保	22,000	-	22,000
76	江南高纤	-	16,000	16,000
77	天士力	115,315	-	115,315

78	海通集团	-	45,000	45,000
79	北海国发	-	32,000	32,000
80	新疆城建	-	51,000	51,000
81	中油化建	-	23,000	23,000
82	茉织华	76,582	2,105,798	2,182,380
83	裕丰股份	24,000	-	24,000
84	高淳陶瓷	-	16,000	16,000
85	信雅达	7,000	-	7,000
86	惠泉啤酒	-	53,000	53,000
87	芜湖港	-	31,000	31,000
88	庆丰股份	-	50,000	50,000
89	精达股份	6,000	-	6,000
90	卧龙科技	33,000	-	33,000
91	天地科技	66,000	19,800	85,800
92	海螺水泥	3,700,000	3,943,475	7,643,475
93	新华医疗	8,000	-	8,000
94	龙溪股份	36,000	-	36,000
95	中孚实业	400	-	400
96	光明乳业	2,648,674	1,323,100	3,971,774
97	北大荒	-	3,413,664	3,413,664
98	青岛啤酒	23,500	-	23,500
99	广电电子	-	5,392,242	5,392,242
100	金杯汽车	-	650,000	650,000
101	新世界	1,013,223	-	1,013,223
102	华联商厦	1,310,165	-	1,310,165
103	广电信息	3,311,714	3,642,290	6,954,004
104	申能股份	-	2,700,000	2,700,000
105	兆维科技	750,603	189,453	940,056
106	上海石化	-	11,787,261	11,787,261
107	青岛海尔	-	1,475,845	1,475,845
108	大显股份	1,630,000	652,389	2,282,389
109	国电电力	-	2,392,382	2,392,382
110	华北制药	-	4,400,000	4,400,000
111	益民百货	562,310	-	562,310
112	华联超市	857,902	295,400	1,153,302
113	通化东宝	2,164,530	100,000	2,264,530
114	伊利股份	233,384	-	233,384
115	万科A	-	8,756,922	8,756,922
116	深南电A	-	1,530,000	1,530,000
117	中集集团	-	1,401,270	1,401,270
118	盐田港A	3,725,000	-	3,725,000
119	深圳机场	-	200,000	200,000
120	中联重科	100,000	-	100,000
121	冀东水泥	-	4,388,230	4,388,230

122	海虹控股	-	26,511	26,511
123	丽珠集团	1,700,100	-	1,700,100
124	新 钢 钒	-	369,565	369,565
125	铜都铜业	-	700,909	700,909
126	格力电器	-	100,000	100,000
127	模塑科技	524,500	-	524,500
128	韶钢松山	-	783,826	783,826
129	鲁 泰 ^A	1,837,472	-	1,837,472
130	华东科技	-	1,479,500	1,479,500
131	燕京啤酒	8,830	-	8,830
132	云铝股份	746,817	-	746,817
133	太钢不锈	-	300,000	300,000
134	国风塑业	-	2,306,633	2,306,633
135	张 裕 ^A	1,547,900	259,060	1,806,960
136	华菱管线	4,511,690	600,000	5,111,690
137	九 芝 堂	-	3,700,647	3,700,647

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 0.1875 亿基金单位, 占基金发行总份额的 0.625%, 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	3,750,000	0.125%
天同证券有限责任公司	3,750,000	0.125%
方正证券有限责任公司	3,750,000	0.125%
华安基金管理有限公司	7,500,000	0.25%

其中: 每个发起人持有未上市流通份额都为 3,750,000 份基金单位, 各占总份额比例的 0.125%。

社会公众持有的基金份额为 29.8125 亿基金单位, 占基金发行总份额的 99.375%。

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	264,686,499	8.82%
2	中国太保	258,618,079	8.62%
3	中国人保	127,700,100	4.26%
4	久事公司	73,002,080	2.43%
5	平安保险	69,532,074	2.32%
6	再保险	66,724,446	2.22%
7	人寿集团	55,116,608	1.84%
8	联通国脉通	40,912,900	1.36%

9	高新咨询	20,000,000	0.67%
10	中保再	15,890,000	0.53%

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 日基金安顺前 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. 本公司关于基金安顺 2003 年分配方案决议如下：每 10 份基金单位分配 0.22 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，聘任尚志民先生为安顺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. 本基金的关联人浙江证券有限责任公司，经批准名称变更为方正证券有限责任公司。
6. 2003 年各券商股票、债券及回购成交量和佣金情况如下：

①股票交易情况：

券商	股票年成交量	占总成交量		年佣金	占总佣金	
		比例	比例		量比例	比例
国泰君安证券股份有限公司	2,284,126,431.50	22.16%		1,851,365.67	22.31%	
海通证券股份有限公司	1,796,961,093.43	17.44%		1,456,138.07	17.55%	
申银万国证券股份有限公司	1,768,093,665.75	17.16%		1,417,733.63	17.08%	
华夏证券有限公司	1,202,829,428.82	11.67%		963,993.20	11.62%	
招商证券有限责任公司	964,048,163.41	9.35%		779,482.10	9.39%	
东方证券有限责任公司	776,437,024.97	7.53%		619,862.04	7.47%	
天同证券有限责任公司	771,889,570.75	7.49%		622,179.44	7.50%	
南方证券有限责任公司	467,685,402.05	4.54%		374,054.65	4.51%	
方正证券有限责任公司	273,699,724.50	2.66%		214,175.02	2.58%	
合计	10,305,770,505.18	100.00%		8,298,983.82	100.00%	

②债券及回购交易情况：

券商	债券年成交量	比例	回购年成交量	比例
国泰君安证券股份有限公司	639,299,005.20	21.17%	1,647,500,000.00	32.11%

华夏证券有限公司	566,460,555.00	18.76%	551,800,000.00	10.76%
海通证券股份有限公司	527,928,105.60	17.48%	1,284,900,000.00	25.04%
申银万国证券股份有限公司	495,951,508.80	16.42%	625,000,000.00	12.18%
东方证券有限责任公司	385,991,645.40	12.78%	300,000,000.00	5.85%
南方证券有限责任公司	162,560,700.00	5.38%	497,400,000.00	9.69%
方正证券有限责任公司	119,783,130.80	3.97%	-	-
招商证券有限责任公司	73,970,809.84	2.45%	151,200,000.00	2.95%
天同证券有限责任公司	47,703,810.30	1.58%	72,700,000.00	1.42%
合计	3,019,649,270.94	100.00%	5,130,500,000.00	100.00%

八. 备查文件目录

1. 中国证监会批准安顺证券投资基金设立的文件。
2. 《安顺证券投资基金基金契约》。
3. 《安顺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. 安顺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
2004 年 3 月 25 日