



华安宝利配置证券投资基金 2004 年年度报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

签发日期：二 五年三月二十九日



一、	重要提示	3
二、	基金产品概况	3
	1、基金概况	3
	2、基金的投资	3
	3、基金管理人	4
	4、基金托管人	4
	5、信息披露	4
	6、其他有关资料	4
三、	主要财务指标和基金净值表现	5
	1、主要财务指标	5
	2、净值表现	5
四、	管理人报告	7
	1. 基金经理	7
	2. 基金运作合规性声明	7
	3. 基金经理工作报告	7
	4. 基金内部监察报告	10
五、	托管人报告	10
六、	审计报告	10
七、	财务会计报告	11
	(一)、资产负债表	11
	(二)、经营业绩表	12
	(三)、收益分配表	13
	(四)、净值变动表	13
	(五)、会计报表附注	13
八、	投资组合报告	23
	(一)、基金资产组合	23
	(二)、股票投资组合	23
	(三)、股票明细	24
	(四)、报告期内股票投资组合的重大变动	24
	(五)、债券投资组合	26
	(六)、前五名债券明细	26
	(七)、投资组合报告附注	26
九、	基金份额持有人户数和持有人结构	27
十、	开放式基金份额变动	27
十一、	重大事件	27
十二、	备查文件目录	31

一、重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定,于 2005 年 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

二、基金产品概况

1、基金概况

基金名称:	华安宝利配置证券投资基金
基金简称:	华安宝利
交易代码:	040004
深交所行情代码:	160404
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2004 年 8 月 24 日
期末基金份额总额:	595,725,509.60 份
基金存续期:	不定期

2、基金的投资

投资目标: 本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。

投资策略: 基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。

业绩比较基准: $35\% \times \text{天相转债指数收益率} + 30\% \times \text{天相 280 指数收益率} + 30\% \times \text{天相国债全价指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$

风险收益特征： 本基金面临与其他开放式基金相同的风险（例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等），但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险，政策风险，经济周期风险，信用风险，再投资风险，上市公司经营风险，新产品创新带来的风险，购买力风险，流动性风险，现金管理风险，技术风险，管理风险，巨额赎回风险等。

3、基金管理人

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
信息披露负责人： 冯颖
联系电话： 021-58881111
传真： 021-68863414
电子邮箱： fengying@huan.com.cn
客户服务热线： 021-68604666

4、基金托管人

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： 蒋超良
信息披露负责人： 江永珍
联系电话： 021-58408846
传真： 021-58408836
电子邮箱： jiangyz@bankcomm.com

5、信息披露

信息披露报纸： 中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网地址： <http://www.huan.com.cn>
报告置备地点： 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

6、其他有关资料

会计师事务所： 普华永道中天会计师事务所有限公司

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
 登记注册机构：华安基金管理有限公司
 办公地点：上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

财务指标	2004 年 8 月 24 日 (基金合同生效 日) 至 2004 年 12 月 31 日
基金本期净收益：	5,471,991.16
基金加权份额本期净收益：	0.0104
期末可供分配基金收益	1,411,692.73
期末可供分配基金份额收益	0.0024
期末基金资产净值：	597,137,202.33
期末基金份额净值：	1.002
基金加权平均净值收益率	1.030%
本期基金份额净值增长率	0.200%
基金份额累计净值增长率	0.200%

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。

2、净值表现

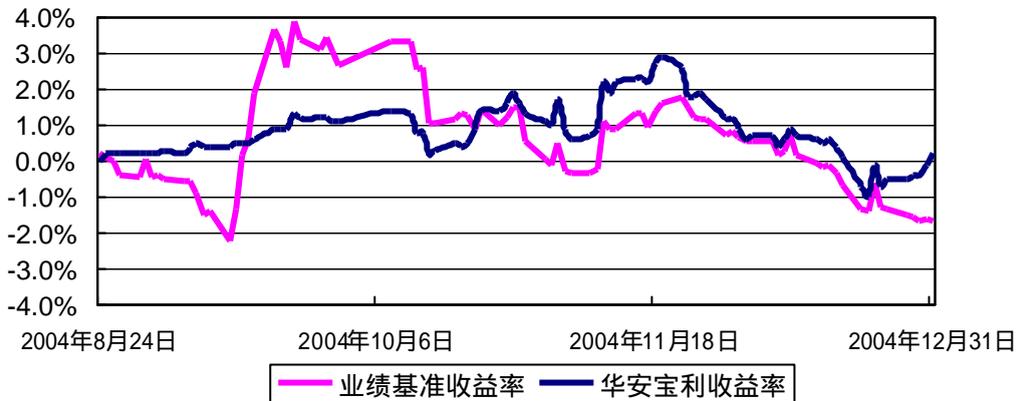
A、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值 增长率	净值增长率 标准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
三个月 自基金合同 生效起至今	-0.89%	0.38%	-4.09%	0.43%	3.20%	-0.05%
	0.20%	0.32%	-1.66%	0.52%	1.86%	-0.20%

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

**华安宝利份额累计净值增长率和业绩比较基准收益率
 历史走势对比图2004/8/24--2004/12/31**



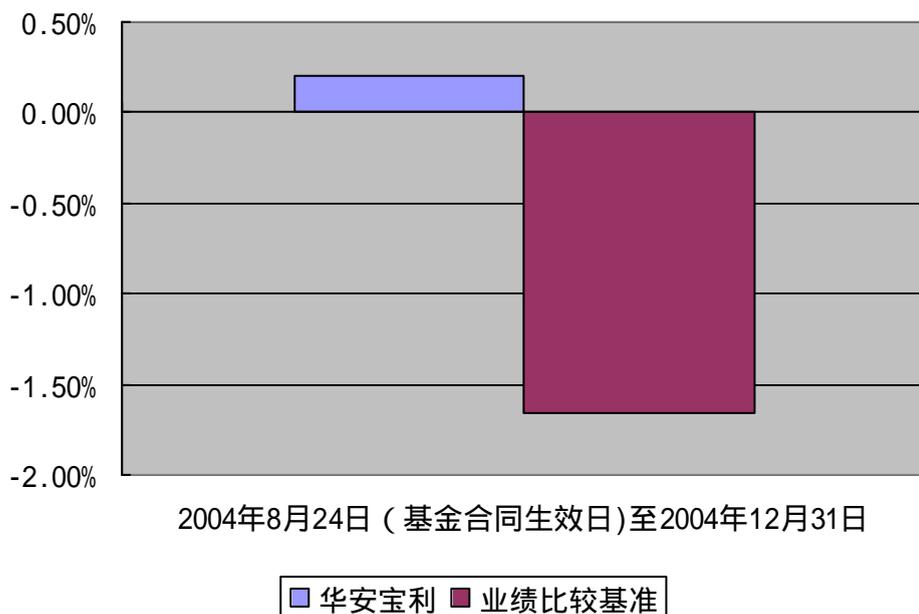
注: 1、华安宝利配置证券投资基金成立于 2004 年 8 月 24 日, 截至本报告期末, 不满一年。

2、根据《华安宝利配置证券投资基金基金合同》, 自本基金成立 90 个工作日内, 本基金投资可转换债券及其对应的基础股票的比例应达到 10%-70% (可转换债券所对应的基础股票的投资比例不超过基金净资产的 20%) 其它债券(除可转换债券外)的比例应达到 10%-65%、其它股票(除可转换债券所对应的基础股票外)的比例应达到 10%-65%。截止本报告期末, 本基金已符合上述投资比例限制。

C、图示基金过往三年每年的净值增长率

基金过往三年每年的净值增长率与同期业绩比较基准的收益率对比图

华安宝利净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



四、 管理人报告

1. 基金经理

袁蓓女士:经济学学士,五年证券从业经历。曾在中国平安保险(集团)股份有限公司投资管理中心工作。2003年1月加入华安基金管理有限公司,在基金投资部从事证券投资和研究工作。现任华安宝利配置基金的基金经理。

2. 基金运作合规性声明

本报告期间,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套管理办法、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》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合同的规定。

3. 基金经理工作报告

(1) 本基金业绩表现

本基金于2004年8月24日成立并开始运作,截止2004年12月31日,本基金单位净值为1.002元,成立以来上升0.20%,同期衡量业绩的比较基准下跌1.66%,上证综指下跌5.17%。

(2) 2004年宏观经济和证券市场回顾

2004年对中国经济而言是具有转折意义的一年,彻底走出了困扰多年的通缩阴霾,居民消费物价平均上涨3.9%,实现了温和通胀下的国民经济高速增长。全年国内生产总值达到13.65万亿元,比上年增长9.5%,其它各主要经济指标均反映出中国综合国力的全面提高。与此同时,全球经济全面复苏,各主要经济体的经济步入上升周期,国际经济环境进一步好转。

然而,纵观全年的经济数据,2004年中国经济波动较大。在投资冲动的带动下和宏观调控的作用下,各项主要经济指标均出现了冲高后大幅回落的现象,经济发展中的众多瓶颈也在这期间有了较为充分的暴露。

2004年的中国证券市场伴随着经济的冲高回落,在对政策的期待中,经历了全面的洗礼,债券市场和股票市场全年都出现了宽幅的振荡和调整。年内上证综指、深圳综指和上证国债指数分别下跌了15.4%、16.6%、3.8%。在经济高速增长的带动下、利好政策的良好预期下和市场资金的推动下,股票市场第一季度表现不俗,但随后的宏观调控和深层次矛盾的进一步暴露使得市场一路下挫,

于年末创出五年新低；在股市的带动下，转债市场也演绎相似的行情走势，但由于转债本身的特性，2004 年转债市场整体还是有一定的正面回报，全年天相转债指数上涨了 4.51%；在居民消费物价指数（CPI）逐步走高过程中，伴随着违规资金的清查，普通债券市场在上半年延续了 03 年的走势，出现了大幅的下跌，但随着四季度 CPI 同比数值的回落和首次升息的完成，债券市场投资者的信心再次点燃，市场出现了不俗的阶段性的表现。

（3）基金运作情况回顾

资产配置：基于对经济增速下降与股市政策的担忧以及物价指数回落的判断，本基金自成立以来，在完成建仓的同时，发挥了积极配置的优势，选择了偏债性的资产配置策略，有效的回避了股市反弹后的大幅下挫，适度的分享了升息后债市的反弹。

债券投资（转债除外）：基于对长期物价的担忧和短期物价指数回落的判断，自成立以来，本基金在维持低久期的债券投资策略下，在升息后债市下跌过程中小幅提高了组合的久期，在一定的范围内，提升了债券组合的盈利能力。

可转债投资：综合转债市场风险释放不充分和相对估值吸引力不足判断，自成立以来，本基金在可转债的投资上采用了比较保守的投资策略，仅维持了较低的基本仓位，主要从转债条款和公司基本面出发挑选优势品种。

股票投资：基于自上而下控制风险和自下而上精选个股的策略，本基金自成立以来，谨慎提升仓位，从业绩的持续性特别是业绩增长的持续性出发，结合国际估值标准构建积极的股票组合。

（4）市场展望和投资策略

从宏观经济的角度来看，经济走势将趋于明朗，宏观经济在实现平稳回落后，在 2005 年中后期进一步走强的可能性较大，GDP 的增长将保持在 8% 以上，达到并超过政府工作目标，但会低于 2004 年的水平。在原材料价格上涨和工资成本上升的推动下，物价上涨趋势难以改变。本基金判断，从全年来看，2005 年物价将继续维持温和的上涨，物价指数在年初出现低点后继续上涨，全年 CPI 的平均涨幅超过 3% 的可能性较大。消费、投资和进出口这三驾马车，在 2005 年将会延续 2004 年的快速增长，有力保证经济的高速增长。在居民实际收入上升与温和通胀预期的共同作用下，消费能够保持较快增长；投资增速在宏观调控的作用下虽得到控制，但在良好的盈利驱动下和瓶颈环节的建设压力下，投资增速很难大幅降低；在国际产业转移、成本竞争力和 WTO 等原因的共同作用下进出口的增长也将保持较高的增长。同时，双稳健的宏观经济政策和宏观调控的持续也决定了 2005 年的经济增长很难超过 2004 年。预期 2005 年人民币的币值压力和名义利率的上升压力较大，利率和汇率的市场化进程有望进一步加快。

依据上述对宏观经济的分析和判断，结合各证券子市场间的相对估值，本基金将进一步提升在股票市场和转债市场的配置比重，调低普通债券市场的配置比重，将偏债性的资产配置在年初逐步调整为中性略偏股性的资产配置。2005 年的运作过程中将重点关注货币政策对证券市场的影响，结合相对估值的变化积极主动地调整配置，构建相对稳健并具有较强盈利能力的投资组合。

可转债市场，市场容量会在 2005 年进一步扩大，个券在债性、条款和股票基本面上的差异也将进一步拉开，对期权价值和上市公司基本面研究的附加值将决定投资效果的差异，可转债市场的投资机遇将再次到来，未来本基金将继续以条款和基本面为主要依据，从收益能力出发提升投资比重。

普通债券市场，出于对公用事业收费价格、原材料价格和居民收入上升对 CPI 的直接与间接影响，在 2005 年将继续维持低久期的组合并调低组合的比重。结合供求状况和物价指数的波动以及估值水平，阶段性小幅提高组合的久期，提升盈利组合的能力。此外，2005 年债券市场会推出众多创新品种，并有可能出现新的交易方式，本基金将积极做好研究，在法律法规允许的范围内积极主动地参与新品种的投资。

股票市场，股票是证券市场分享中国经济高速增长的重要投资工具，前期市场的大幅下跌也使得很多优秀的上市公司的估值达到了国际水平。本基金在 2005 年度将继续沿用精选细分行业和个股的主要策略，选择基本面透明、管理规范、具有垄断优势、品牌优势、核心竞争力、现金创造能力强的优质公司，稳健地提高股票组合的配置。同时，继续通过自上而下的方法，控制组合的整体风险。组合的构建中将重点考虑业绩增长的持续性，此外还将着重从以下几个角度挑选细分行业和个股：

通胀环境下的负利率的积累作用和利润幻觉，关注周期性行业的利润变化；

居民实际可支配收入增长和社会消费品零售总额维持高速增长对消费品和零售行业的持续正面影响；

消费升级过程中量变到质变的转折，3G、数字电视等产业及其相关产业链的投资机会；

瓶颈环节的建设，如电网设备的投资和铁路网的建设等；

价格体制改革，特别是被严格管制的铁路、电力、水务等行业的收费体制改革；

第二产业高增长对第三产业的推动作用，关注服务业的增长潜力；

经济增长模式从追求速度向追求质量的转化过程中，新材料、节能设备等板块的发展；

医疗保健体制的进一步改革和医保制度的完善，关注医药行业的盈利前景；

企业治理结构的改善和管理能力的提高，重点关注国企改革及其试点和民营企业的经营效率；

金融创新和制度变革给上市公司的发展机遇和重新估值的机会。

我们期望通过切实的努力，使华安宝利基金真正成为中等收益、风险偏小的理财平台。

4. 基金内部监察报告

2004 年内公司顺利发行设立华安第四只开放式基金--华安宝利配置证券投资基金,使公司管理基金数量增加到 8 只,截止 2004 年底公司管理资产规模达到约 271 亿元人民币,较 2003 年末 147 亿元人民币的规模有了大幅增长,增幅达到 84.35%,主要原因是货币市场基金在过去一年得到了迅猛发展。公司的投资客户数量也大幅度增加。从 2003 年末的 25 万户增加到 35.3 万户,增长 41.2%。一些知名大机构、大企业也成为华安的新客户,优化了华安客户结构。

为进一步通过加强内部控制提升公司的核心竞争力,我公司于去年 10 月起首次聘请安永会计师事务所(香港)对我内部控制政策及程序进行评估。该次评估范围涵盖了投资研究和分析,资产配置、投资组合和证券选择、股票交易、新股认购、银行间市场交易、财务结算与会计流程、基金的认/申购和赎回遗迹 TA 系统流程、投资风险、内部审计和监察稽核等各个关键领域。本次评估结束后,安永还将我公司的内控政策及程序与他们认同的中国大陆基金管理行业的“最佳做法”,及国际基金管理行业的最佳方案(如适当)进行了比较,而这些经验来自于安永在中国大陆、亚洲、欧洲和美国的工作。在进行上述比较之后,安永向我公司提交了“Gap Analysis Report”,对有关领域给予了进一步改进建议,我们将根据国内实际情况吸收其大部分建议,进一步完善公司内部控制政策和程序。

2004 年度,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,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,主要内控制度有效。

五、 托管人报告

2004 年,托管人在华安宝利配置证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2004 年,华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。基金管理人遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。

2004 年,由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利配置证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

六、 审计报告

普华永道中天审字(2005)第 376 号
华安宝利配置证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华安宝利配置证券投资基金(以下简称“华安宝利配置基金”)2004 年 12 月 31 日的资产负债表以及 2004 年 8 月 24 日(基金成立日)至 2004 年 12 月 31 日止期间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宝利配置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，上述会计报表符合国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度 - 证券投资基金会计核算办法》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》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宝利配置基金 2004 年 12 月 31 日的财务状况以及 2004 年 8 月 24 日(基金成立日)至 2004 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天会计师事务所有限公司
中国·上海市

注册会计师 汪棣
注册会计师 薛竞
2005 年 2 月 7 日

七、 财务会计报告

(一)、 资产负债表

项 目	附注	2004年12月31日
资产：		
银行存款		6,021,781.47
清算备付金		1,843,785.91
交易保证金		500,000.00
应收证券清算款		665,849.47
应收利息	7(1)	3,366,989.84
应收申购款		49,760.00
其他应收款		-
股票投资市值		171,628,171.98
其中：股票投资成本		171,351,541.96
债券投资市值		325,802,722.60
其中：债券投资成本		326,059,223.74
配股权证		-
买入返售证券		89,600,000.00
待摊费用		-
其他资产		-
资产合计		<u>599,479,061.27</u>

负债：

应付证券清算款		911,345.07
应付赎回款		149,526.57
应付赎回费		563.54
应付管理人报酬		420,685.73
应付托管费		87,642.87
应付佣金	7(3)	172,095.16
其他应付款	7(4)	500,000.00
预提费用	7(5)	100,000.00
负债合计		<u>2,341,858.94</u>

所有者权益：

实收基金	7(6)	595,725,509.60
未实现利得	7(7)	-3,990,339.27
未分配收益		5,402,032.00
持有人权益合计		<u>597,137,202.33</u>
负债和所有者权益合计		<u>599,479,061.27</u>

(二)、经营业绩表

项 目	附注	2004年度
收入：		
股票差价收入	7(8)	65,907.65
债券差价收入	7(9)	2,804,825.96
债券利息收入		3,321,867.20
存款利息收入		1,074,348.71
股利收入		-
买入返售证券收入		127,878.26
其他收入	7(10)	1,027,624.87
收入合计		<u>8,422,452.65</u>
费用：		
基金管理人报酬	6(3)	2,192,337.12
基金托管费	6(3)	456,736.92
卖出回购证券支出		185,342.74
其他费用	7(11)	116,044.71
其中：信息披露费		-
审计费用		100,000.00
费用合计		<u>2,950,461.49</u>
基金净收益		<u>5,471,991.16</u>
加：未实现估值增值变动数		<u>20,128.88</u>

基金经营业绩	5,492,120.04
--------	--------------

(三)、收益分配表

项 目	附注	2004年度
本期基金净收益		5,471,991.16
加：期初未分配收益		-
加：本期申购基金单位的损益平准金		2,205,084.97
减：本期赎回基金单位的损益平准金		2,275,044.13
可供分配基金净收益		5,402,032.00
减：本期已分配基金净收益		-
期末基金未分配净收益		5,402,032.00

(四)、净值变动表

项 目	附注	2004年度
一、期初基金净值		1,130,480,770.08
二、本期经营活动：		
基金净收益		5,471,991.16
未实现估值增值变动数		20,128.88
经营活动产生的基金净值变动数		5,492,120.04
三、本期基金单位交易：		
基金申购款		280,943,820.62
基金赎回款		819,779,508.41
基金单位交易产生的基金净值变动数		-538,835,687.79
四、本期向持有人分配收益		-
五、期末基金净值		597,137,202.33

(五)、会计报表附注

1. 基金的基本情况

募集申请的核准机构：中国证券监督管理委员会

核准文号：证监基金字[2004] 97号

批准核准文件名称：关于同意华安宝利配置证券投资基金设立的批复

基金运作方式：契约型开放式

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

基金备案情况：本基金已于2004年8月23日收到中国证券监督管理委员会基金部函[2004]75号“关于华安宝利配置证券投资基金备案确认的函”。

基金合同生效日：2004年8月24日

基金合同生效日的基金份额：1,130,461,912.15

基金募集期间：2004年7月16日至2004年8月17日

募集资金总额：1,130,443,054.22

募集资金的银行存款利息（折算为投资者的基金份额）：18,857.93

募集期间相关费用明细及节余：本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司承担，与本基金无关。

验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

2. 基本会计假设

本会计报表的编制均遵守基本会计假设。

3. 主要会计政策、会计估计及其变更：

1) 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定。

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制，会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会颁布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》、证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号《年度报告的内容与格式》、证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第4号《基金投资组合报告的编制及披露》进行编制及披露。

2) 会计年度。

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2004年8月24日(基金成立日)至2004年12月31日。

3) 记账本位币。

本基金的记账本位币为人民币。

4) 记账基础和计价原则。

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和配股权证按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

5) 基金资产的估值原则

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。

证券交易所市场实行净价交易的国债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。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价计算所得的净价估值。未上市流通的债券按成本估值。银行间同业市场交易的债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑市场成交价、报价、收益率曲线、成本价等因素确定的反映公允价值的价格估值。

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。

6) 证券投资基金成本计价方法

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/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

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；买入银行间同业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/(损失)；卖出银行间同业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/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

7) 待摊费用的摊销方法和摊销期限：

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。在实际受益期间（一年内）按直线法摊销，并以实际支出减去累计摊销后的净额列示。

预提费用核算预计将发生的、影响基金份额净值小数点后第五位，应预提计入本期的费用，如信息披露费、审计费用和律师费用等，预提费用在预计发

生时入账。

8) 收入的确认和计量

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。

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认；银行间同业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全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

9) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

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。

10) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

11) 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份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(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。

12) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，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)。

13) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。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份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至少一次；如当年基金成立未满三个月，则不需分配收益。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。基金收益分配后，每基金份额净值不能低于面值。

经宣告的基金收益分配方案于分红除权日从持有人权益转出。

4. 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》、财税字 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 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，自2004年1月1日起继续免征营业税。
- 3) 基金买卖股票、债券的差价收入，自2004年1月1日起继续免征企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4) 基金买卖股票按照0.2%的税率征收印花税。

5. 资产负债表日后事项：

无。

6. 重大会计差错的内容和更正金额：

无。

7. 关联方关系和关联方交易：

根据华安基金管理有限公司于2004年12月21日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字(2004)207号文批准，公司股东天同证券有限责任公司将其持有的华安基金管理有限公司20%股权转让给上海电气(集团)总公司，申银万国证券股份有限公司将其持有的华安基金管理有限公司20%股权转让给上海广电(集团)有限公司，上海国际信托投资有限公司将其持有的华安基金管理有限公司20%股权转让给上海沸点投资发展有限公司，方正证

券有限责任公司将其持有的华安基金管理有限公司 10%股权转让给上海国际信托投资有限公司,东方证券有限责任公司将其持有的华安基金管理有限公司 20%股权转让给上海工业投资(集团)有限公司。

(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	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构	提取管理费	基金合同
交通银行	基金托管人、基金代销机构	提取托管费 债券买卖	基金合同 成交通知单
上海国际信托投资有限公司	基金管理人股东		
上海电气(集团)总公司	基金管理人股东 (2004 年 12 月 21 日之后)		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人股东 (2004 年 12 月 21 日之后)		
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人股东 (2004 年 12 月 21 日之后)		
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人股东 (2004 年 12 月 21 日之后)		
申银万国证券股份有限公司	基金管理人原股东 (2004 年 12 月 21 日之前)、 基金代销机构	租用交易席位	席位使用协议
天同证券有限责任公司	基金管理人原股东 (2004 年 12 月 21 日之前)		
方正证券有限责任公司	基金管理人原股东 (2004 年 12 月 21 日之前)		
东方证券股份有限公司	基金管理人原股东 (2004 年 12 月 21 日之前)		

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

本报告期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	55,418,785.61	20.07%	44,021.07	20.70%	0.08%
合计	<u>55,418,785.61</u>		<u>44,021.07</u>		

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。

本报告期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	118,778,613.10	29.71%	79,000,000.00	10.17%
合 计	118,778,613.10		79,000,000.00	

本报告期与关联人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
交通银行	48,750,000.00	197,187,972.60	-	-	-	-

(3). 关联方报酬

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 1.2% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

本基金在本报告期间需支付基金管理费 2,192,337.12 元。

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。

本基金在本报告期间需支付基金托管费 456,736.92 元。

(4). 关联方持有的基金份额

	2004 年 12 月 31 日	
	基金份额	净值
华安基金管理有限公司	50,000,000.00	50,100,000.00

8. 基金会计报表重要项目的说明：

(1). 应收利息明细：

明细项目	2004 年度末金额
银行存款利息	23,425.64
清算备付金利息	3,635.01
债券利息	3,316,416.93
买入返售证券利息	23,512.26
合计	3,366,989.84

(2). 投资估值增值明细：

明细项目	2004 年度末金额
股票估值增值余额	276,630.02
债券估值增值余额	-256,501.14
合计	20,128.88

(3). 应付佣金明细：

明细项目	2004 年度末金额
渤海证券有限责任公司	44,475.29
海通证券股份有限公司	20,102.97
华夏证券股份有限公司	36,821.70
申银万国证券股份有限公司	11,175.59
兴业证券股份有限公司	59,519.61
合计	172,095.16

(4). 其他应付款明细：

应付券商席位保证金	2004 年度末金额
	500,000.00
合计	500,000.00

(5). 预提费用明细：

明细项目	2004 年度末金额
信息披露费	-
审计费用	100,000.00
合计	100,000.00

(6). 实收基金变动明细：

	2004 年 8 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2004 年 12 月 31 日
明细项目	
期初数	1,130,480,770.08
加：本期因申购增加数	281,730,854.99
减：本期因赎回减少数	816,486,115.47
期末数	595,725,509.60

(7). 未实现利得明细：

	2004 年 8 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2004 年 12 月 31 日
明细项目	
期初未实现利得：	-
其中：投资估值增值数：	-
未实现利得平准金：	-
本期投资估值增值发生数：	20,128.88
本期申购的未实现利得平准金：	-2,992,119.34
本期赎回的未实现利得平准金：	1,018,348.81
期末未实现利得：	-3,990,339.27
其中：投资估值增值数：	20,128.88
未实现利得平准金：	-4,010,468.15

(8). 卖出股票：

	2004 年 8 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2004 年 12 月 31 日
明细项目	
卖出股票成交总额	56,235,748.53
减：佣金	47,116.57
成本总额	56,122,724.31
股票差价收入	65,907.65

(9). 卖出债券：

	2004 年 8 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2004 年 12 月 31 日
明细项目	
卖出债券成交总额	1,574,124,163.89
减：成本总额	1,552,965,586.88
应收利息总额	18,353,751.05
债券差价收入	2,804,825.96

(10). 其他收入：

	2004 年 8 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2004 年 12 月 31 日
明细项目	
开放式基金赎回费收入	1,024,749.32
新股、配股手续费返还	2,875.55

(11). 其他费用：

	2004 年 8 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2004 年 12 月 31 日
明细项目	
银行费用	4,727.50
交易所费用	4,627.21
其他费用其他	6,690.00
审计费用	100,000.00

9. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

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)、本基金截止本报告期末流通受限股票情况如下：

股票名称	数量	总成本	总市值	估值方法	转让受限原因	流通受限期限
金地集团	88,688	796,418.24	876,237.44	市价	增发部分未上市	2005/01/06
振华港机	255,124	2,232,335.00	2,342,038.32	市价	增发部分未上市	2005/03/31
合计		3,028,753.24	3,218,275.76			

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

八、投资组合报告

(一)、基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例
1	股票	171,628,171.98	28.63%
2	债券	325,802,722.60	54.35%
3	银行存款和清算备付金合计	7,865,567.38	1.31%
4	其他资产	94,182,599.31	15.71%
	合计	599,479,061.27	100.00%

(二)、股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
B	采掘业	21,565,729.66	3.61%
C	制造业	91,866,372.37	15.38%
C0	其中：食品、饮料	5,904,043.00	0.99%
C1	纺织、服装、皮毛	1,916,000.00	0.32%
C3	造纸印刷	1,024,300.00	0.17%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	33,818,991.89	5.66%
C6	金属、非金属	13,311,800.00	2.23%
C7	机械、设备、仪表	19,615,724.32	3.28%
C8	医药、生物制品	16,275,513.16	2.73%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,025,089.17	2.52%
F	交通运输、仓储业	27,484,357.92	4.60%
G	信息技术业	6,685,359.20	1.12%
K	社会服务业	2,998,216.00	0.50%
J	房地产业	6,003,047.66	1.01%
	合计	171,628,171.98	28.74%

(三)、 股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	600636	三 爱 富	1,756,783.00	14,335,349.28	2.40%
2	600875	东方电机	1,000,000.00	12,220,000.00	2.05%
3	600019	宝钢股份	2,000,000.00	12,000,000.00	2.01%
4	600348	国阳新能	850,238.00	11,537,729.66	1.93%
5	600029	南方航空	2,000,000.00	10,660,000.00	1.79%
6	600028	中国石化	2,300,000.00	10,028,000.00	1.68%
7	600795	国电电力	1,600,000.00	9,968,000.00	1.67%
8	000792	盐湖钾肥	1,151,207.00	9,865,843.99	1.65%
9	000423	东阿阿胶	1,200,000.00	9,720,000.00	1.63%
10	600309	烟台万华	751,978.00	9,617,798.62	1.61%
11	600033	福建高速	1,200,184.00	8,857,357.92	1.48%
12	600406	国电南瑞	499,280.00	6,685,359.20	1.12%
13	000538	云南白药	419,956.00	6,555,513.16	1.10%
14	000911	南宁糖业	703,700.00	5,904,043.00	0.99%
15	600900	长江电力	575,323.00	5,057,089.17	0.85%
16	000402	金 融 街	457,337.00	4,600,810.22	0.77%
17	600717	天 津 港	500,000.00	3,350,000.00	0.56%
18	600012	皖通高速	500,000.00	3,095,000.00	0.52%
19	002021	中捷股份	288,600.00	2,536,794.00	0.42%
20	600320	振华港机	255,124.00	2,342,038.32	0.39%
21	600236	桂冠电力	234,400.00	2,318,216.00	0.39%
22	000726	鲁 泰 A	200,000.00	1,916,000.00	0.32%
23	600761	安徽合力	300,000.00	1,731,000.00	0.29%
24	600009	上海机场	100,000.00	1,522,000.00	0.25%
25	600529	山东药玻	140,000.00	1,311,800.00	0.22%
26	600383	金地集团	88,688.00	876,237.44	0.15%
27	600066	宇通客车	82,900.00	785,892.00	0.13%
28	000069	华侨城 A	100,000.00	680,000.00	0.11%
29	600308	华泰股份	50,000.00	595,500.00	0.10%
30	000002	万 科 A	100,000.00	526,000.00	0.09%
31	000488	晨鸣纸业	40,000.00	428,800.00	0.07%

(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动

1、 累计买入、 累计卖出价值前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值的比例
1	600019	宝钢股份	17,323,582.31	2.90%
2	600875	东方电机	17,156,726.85	2.87%
3	600636	三 爱 富	17,061,618.75	2.86%

4	600795	国电电力	14,183,065.35	2.38%
5	000911	南宁糖业	11,630,092.10	1.95%
6	600348	国阳新能	11,185,058.89	1.87%
7	600309	烟台万华	10,998,727.09	1.84%
8	600028	中国石化	10,582,712.74	1.77%
9	000423	东阿阿胶	10,030,927.78	1.68%
10	600029	南方航空	9,531,245.23	1.60%
11	600900	长江电力	9,459,273.66	1.58%
12	000792	盐湖钾肥	8,932,219.52	1.50%
13	600033	福建高速	8,702,236.53	1.46%
14	000866	扬子石化	8,585,469.33	1.44%
15	600406	国电南瑞	7,884,666.80	1.32%
16	000538	云南白药	7,113,705.85	1.19%
17	002021	中捷股份	4,813,494.10	0.81%
18	600717	天津港	4,607,238.99	0.77%
19	000402	金融街	4,410,509.32	0.74%
20	002019	鑫富股份	3,939,136.13	0.66%
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值的比例
1	000866	扬子石化	8,285,409.77	1.39%
2	600875	东方电机	5,736,173.65	0.96%
3	000911	南宁糖业	4,815,484.62	0.81%
4	600900	长江电力	4,617,076.39	0.77%
5	600019	宝钢股份	4,155,838.15	0.70%
6	002019	鑫富股份	3,975,883.75	0.67%
7	600636	三爱富	3,881,081.05	0.65%
8	600406	国电南瑞	2,697,370.98	0.45%
9	600000	浦发银行	2,258,982.39	0.38%
10	600795	国电电力	2,247,760.31	0.38%
11	002021	中捷股份	1,801,035.37	0.30%
12	600963	岳阳纸业	1,390,651.38	0.23%
13	600309	烟台万华	1,217,024.92	0.20%
14	600426	华鲁恒升	1,173,934.63	0.20%
15	600717	天津港	1,163,151.00	0.19%
16	000898	鞍钢新轧	1,027,746.87	0.17%
17	600460	士兰微	1,019,753.55	0.17%
18	600236	桂冠电力	981,615.68	0.16%
19	600584	长电科技	873,684.83	0.15%
20	600123	兰花科创	624,227.96	0.10%

2、整个报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额。

买入股票的成本总额：	227,474,266.27
------------	----------------

卖出股票的收入总额：	56,235,748.53
------------	---------------

(五)、 债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	67,827,168.40	11.36%
2	金融债券	210,027,347.70	35.17%
3	企业债券	6,980.40	0.00%
4	可转换债券	47,941,226.10	8.03%
	合计	325,802,722.60	54.56%

(六)、 前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	040217	04 国开 17	500,000	50,072,307.70	8.39%
2	040402	04 农发 02	400,000	40,128,000.00	6.72%
3	040212	04 国开 12	400,000	40,084,000.00	6.71%
4	040213	04 国开 13	400,000	40,048,000.00	6.71%
5	040209	04 国开 09	396,000	39,695,040.00	6.65%

(七)、 投资组合报告附注

1、 本基金的估值方法

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。在银行间债券市场挂牌交易的债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑市场成交价、报价、收益率曲线、成本价等因素确定的反映公允价值的价格估值。

2、 本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、 其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	深圳结算保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	665,849.47
3	应收利息	3,366,989.84

4	买入返售证券	89,600,000.00
5	应收申购款	49,760.00
	合计	94,182,599.31

4、处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	100236	桂冠转债	19,350	1,996,146.00	0.33%
2	100726	华电转债	35,810	3,727,462.90	0.62%
3	100795	国电转债	38,420	4,149,744.20	0.69%
4	110001	邯钢转债	41,200	4,117,940.00	0.69%
5	110418	江淮转债	5,000	525,100.00	0.09%
6	125069	侨城转债	32,282	3,872,225.90	0.65%
7	125959	首钢转债	59,460	5,701,619.40	0.95%

九、基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数和持有人结构

项目	份额(份)	占总份额的比例
基金份额持有人户数	3,159	-
平均每户持有基金份额	188,580.41	-
机构投资者持有的基金份额	533,029,828.20	89.48%
个人投资者持有的基金份额	62,695,681.40	10.52%

十、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	1,130,480,770.08
期初基金份额总额	1,130,480,770.08
加：本期申购基金份额总额	281,730,854.99
减：本期赎回基金份额总额	816,486,115.47
期末基金份额总额	595,725,509.60

十一、重大事件

(一)、 基金份额持有人大会决议：无。

(二)、 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

本基金管理人于 2004 年 2 月 20 日公告：经公司董事会审议通过，并报经中国证监会证监基金字〔2004〕14 号文核准，决定免去尚健先生副总经理职务。

本基金管理人于 2004 年 6 月 5 日公告：经华安基金管理有限公司董事会审议通过，并报经中共上海市金融工作委员会沪金融工委干〔2004〕33 号文和中国证

监会证监基金字[2004]66 号文核准,我公司决定聘任姚毓林先生为公司副总经理。

本基金管理人于 2004 年 11 月 2 日公告:经华安基金管理有限公司董事会审议通过,并报经中共上海市金融工作委员会沪金融工委干[2004] 022 号文和中国证监会证监基金字[2004]137 号文核准,我公司决定聘任李炳旺先生为公司副总经理,聘任章国富先生为公司督察长。

(三)、本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四)、基金投资策略的改变:无。

(五)、基金收益分配事项:无。

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况:本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况如下:100,000 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限:自基金合同生效日起至今。

(七)、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形,包括稽查或处罚的次数、原因及结论,如监管部门提出整改意见的,应简单说明整改情况:无。

(八)、本报告期间租用证券公司席位情况如下:

1. 报告期内租用证券公司席位的变更情况:无。

2. 交易成交量及佣金情况:

(1). 股票交易情况:

券商名称	租用席位数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
渤海证券有限责任公司	1	62,091,423.83	22.49%	44,475.29	20.92%
海通证券股份有限公司	1	35,530,750.16	12.87%	27,802.89	13.08%
华夏证券股份有限公司	1	47,056,127.10	17.04%	36,821.70	17.31%
申银万国股份有限公司	1	55,418,785.61	20.07%	44,021.07	20.70%
兴业证券股份有限公司	1	76,023,927.65	27.53%	59,519.61	27.99%
合计		276,121,014.35	100.00%	212,640.56	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
渤海证券有限责任公司	153,346,399.40	38.36%	496,400,000.00	63.90%
海通证券股份有限公司	12,230,574.16	3.06%	-	0.00%
华夏证券股份有限公司	23,468,214.85	5.87%	-	0.00%
申银万国股份有限公司	118,778,613.10	29.71%	79,000,000.00	10.17%
兴业证券股份有限公司	91,909,912.90	22.99%	-	25.93%

				201,400,000.00	
合	计	399,733,714.41	100.00%	776,800,000.00	100.00%

券商专用席位选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- 1、资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 2、财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；
- 3、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 4、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 5、研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

券商专用席位选择程序：

1、对席位候选券商的综合服务进行评估

由基金经理和研究员等相关人员根据上述席位选择标准和《券商服务评价办法》，对候选席位的券商服务质量和综合实力进行评估。

2、候选席位名单提交公司经理办公会议讨论

汇总对各候选席位券商的综合评估结果，报公司经理办公会议进行讨论，讨论确定候选席位名单。

3、候选席位名单提交董事会讨论

公司经理办公会议讨论确定的候选席位名单，报董事会进行讨论，并最终确定席位券商的选择。

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易席位使用协议》，报中国证监会备案并公告并通知基金托管人。

(九) 其他事项：

1. 基金成立事项：

华安宝利配置证券投资基金（“本基金”）根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，本基金募集符合有关条件，华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于

2004 年 8 月 24 日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

本基金于 2004 年 7 月 13 日在《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上刊登了招募说明书、基金合同以及《华安宝利配置证券投资基金发行公告》。并于 2004 年 8 月 25 日在上述报纸上刊登了《华安宝利配置证券投资基金合同生效公告》。

2、基金管理人股东及其出资比例发生变更：

本基金管理人于 2004 年 12 月 21 日公告：华安基金管理有限公司（以下简称本公司）股东出资转让经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字[2004]207 号文批准。

本次转让中，天同证券有限责任公司将所持本公司 20%的出资转让给上海电气（集团）总公司，申银万国证券股份有限公司将所持本公司 20%的出资转让给上海广电（集团）有限公司，上海国际信托投资有限公司将所持本公司 20%的出资转让给上海沸点投资发展有限公司，方正证券有限责任公司（原浙江证券有限责任公司）将所持本公司 10%的出资转让给上海国际信托投资有限公司，东方证券有限责任公司将所持本公司 20%的出资转让给上海工业投资（集团）有限公司。出资转让并新增股东后，本公司注册资本不变，股东及出资比例为上海国际信托投资有限公司 20%、上海电气（集团）总公司 20%、上海广电（集团）有限公司 20%、上海沸点投资发展有限公司 20%、上海工业投资（集团）有限公司 20%。相关工商变更登记手续正在办理之中。

3. 变更基金份额发售机构：

1) 本基金管理人于 2004 年 7 月 13 日发布公告，开放式基金电子交易业务增加兴业银行“银基通”资金结算方式；

2) 本基金管理人于 2004 年 7 月 16 日发布公告，“华安特快”基金电子交易业务开通全国其他部分地区和城市“银联通”资金结算方式；

3) 本基金管理人于 2004 年 7 月 20 日发布公告，新增中国银河证券有限责任公司为代销机构；

4) 本基金管理人于 2004 年 7 月 23 日发布公告，新增广发证券股份有限公司为代销机构；

5) 本基金管理人于 2004 年 7 月 27 日发布公告，新增国信证券有限责任公司为华安宝利配置证券投资基金代销机构；

6) 本基金管理人于 2004 年 11 月 18 日发布公告，直销渠道开通华安宝利配置证券投资基金的基金转换业务；

7) 本基金管理人于 2004 年 11 月 29 日发布公告，新增长城证券有限责任公司为代销机构。

4. 其他重大事项：

1) 本基金管理人于 2004 年 9 月 1 日发布公告，华安宝利配置证券投资基金于 2004 年 9 月 6 日起开放日常申购、赎回业务。

2) 本基金管理人于 2004 年 11 月 15 日发布提示性公告，华安宝利配置证券投资基金自 2004 年 11 月 18 日起，如基金份额持有人未选择收益分配方式，则默认为“现金红利”方式分配收益。

上述作为临时公告披露的重大事项均刊登于《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上。



十二、备查文件目录

- 1、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宝利配置证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宝利配置证券投资基金设立的文件；
- 5、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；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；
- 9、上述文件的存放地点和查阅方式如下：

存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

查阅方式：投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
2005 年 3 月 29 日