



# 安久证券投资基金 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
	(一) 基金概况	3
	(二) 基金的投资	3
	(三) 基金管理人	4
	(四) 基金托管人	4
	(五) 信息披露	4
	(六) 其他有关资料	4
三、	主要财务指标和基金净值表现	5
	(一) 主要财务指标	5
	(二) 净值表现	5
	(三) 基金收益分配情况	6
四、	管理人报告	7
	(一) 基金经理	7
	(二) 基金运作合规性声明	7
	(三) 基金经理工作报告	7
	(四) 基金内部监察报告	9
五、	托管人报告	9
六、	审计报告	10
七、	财务会计报告	10
	(一) 资产负债表	10
	(二) 经营业绩表	11
	(三) 收益分配表	12
	(四) 净值变动表	12
	(五) 会计报表附注	13
八、	投资组合报告	20
	(一) 基金资产组合	20
	(二) 股票投资组合	20
	(三) 股票明细	21
	(四) 报告期内股票投资组合的重大变动	22
	(五) 债券投资组合	24
	(六) 前五名债券明细	24
	(七) 投资组合报告附注	25
九、	基金份额持有人户数和持有人结构	25
十、	重大事件	26
十一、	备查文件目录	28

## 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

### (一) 基金概况

基金名称:	安久证券投资基金
基金简称:	基金安久
交易代码:	184709
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1992 年 8 月 31 日(原四川国信投资基金成立日期) 2000 年 7 月 4 日华安基金管理有限公司开始管理基金安久
期末基金份额总额:	5 亿份
基金存续期:	15 年(自 1992 年 8 月 31 日至 2007 年 8 月 30 日)
基金上市地点:	深圳证券交易所
基金上市日期:	2001 年 8 月 31 日

### (二) 基金的投资

投资目标:	本基金为积极成长型基金,本基金投资于积极应用新技术的上市公司。
投资策略:	本基金将通过努力提高自身综合决策能力来减少风险。同时也通过分散投资来减少风险。 本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%,其中投资于国债的比例控制在基金资产净值的 20-50%,股票资产的比例控制在 45-80%,现金比例根据运作情况调整。 在股票资产中,至少 70%投资于具有良好成长性

的上市公司股票。本基金界定的成长型股票主要指单一主业或多主业有良好成长性的公司股票，该类公司的特征是：(1) 预期利润总额增长速度超过行业平均水平或同期 GDP 增长速度；(2) 新技术应用对公司的主营业务贡献明显。

业绩比较基准：无  
风险收益特征：无

### (三) 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@huaan.com.cn  
客户服务热线：021-68604666

### (四) 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  
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

### (五) 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.huaan.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

### (六) 其他有关资料

会计师事务所：上海立信长江会计师事务所有限公司  
办公地址：上海市南京东路 61 号四楼  
登记注册机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司  
办公地点：深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

### 三、主要财务指标和基金净值表现

#### (一) 主要财务指标

财务指标	2004 年度	2003 年度	2002 年度	
	新指标	新指标	新指标	旧指标
基金本期净收益	25,176,809.13	-14,055,289.59	1,131,478.56	1,131,478.56
加权平均基金份额本期净收益	0.0504	-0.0281	0.0027	0.0023
期末可供分配基金收益	-64,777,031.85	-72,064,722.50	-111,828,644.06	-111,828,644.06
期末可供分配基金份额收益	-0.1296	-0.1441	-0.2237	-0.2237
期末基金资产净值	435,222,968.15	463,876,169.43	388,171,355.94	388,171,355.94
期末基金份额净值	0.8704	0.9278	0.7763	0.7763
基金加权平均净值收益率	5.39%	-3.37%	0.33%	0.33%
本期基金份额净值增长率	-6.19%	19.52%	-9.86%	-9.85%
基金份额累计净值增长率	-19.07%	-13.73%	-27.82%	-27.82%

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。

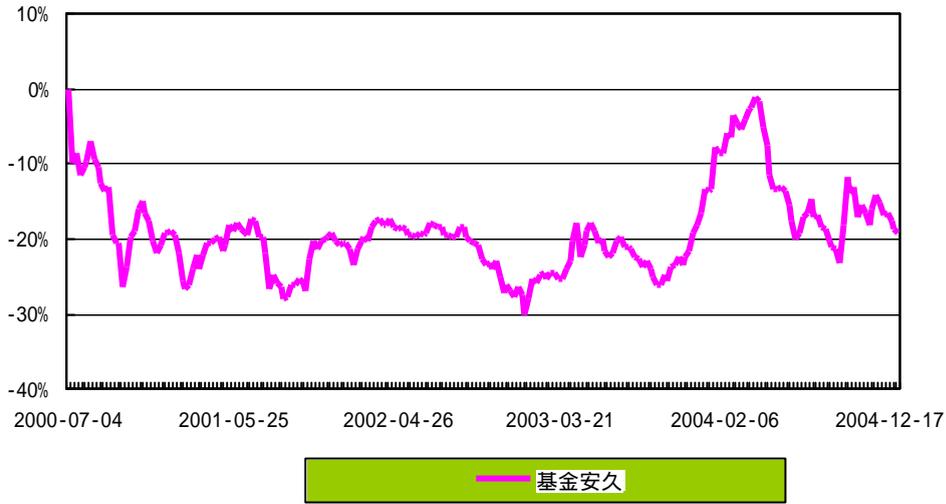
#### (二) 净值表现

##### 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	-5.99%	1.99%	-	-	-	-
六个月	0.17%	2.73%	-	-	-	-
一年	-6.19%	2.53%	-	-	-	-
三年	1.07%	1.96%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-19.07%	2.22%	-	-	-	-

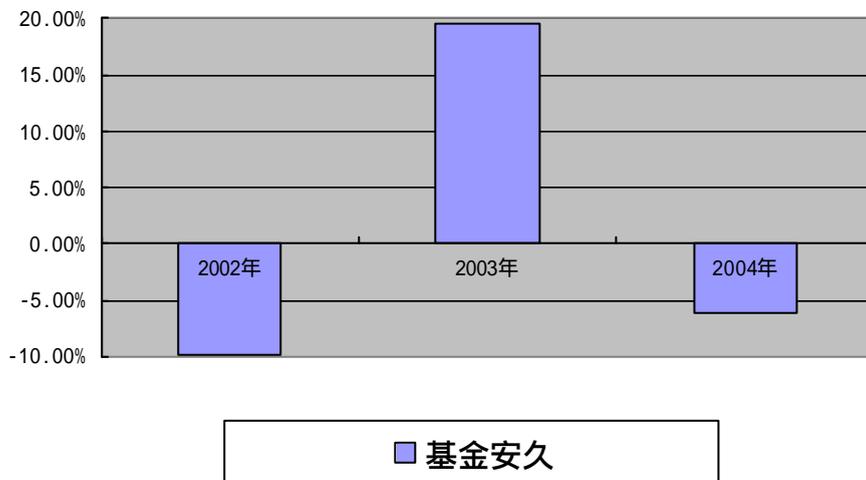
##### B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金安久份额累计净值增长率历史走势图  
2000/7/4--2004/12/31



C、图示基金过往三年每年的净值增长率

基金安久过往三年的净值增长率



(三) 基金收益分配情况

本基金过往三年未分红。

## 四、 管理人报告

### (一) 基金经理

王国卫 先生：经济学硕士、EMBA，11 年证券、基金从业经历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作。1998 年进入华安基金管理有限公司投资部任基金安信的基金经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部总监，华安 180 和基金安久的基金经理。

吴娜 女士：工商管理硕士。1994 年 4 月起在上海交通大学管理学院从事金融教学工作，期间曾先后参与上海证交所等研究课题。1997 年赴美国，2001 年毕业于南加州大学马歇尔商学院并获得 MBA 学位，曾在美国美林证券实习工作。2002 年 2 月加入华安基金管理有限公司后，在研究发展部从事行业/个股研究和行业配置分析工作。现任基金安久的基金经理助理。

### (二) 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、《安久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。

### (三) 基金经理工作报告

2004 年回顾：

2004 年成为 2001 年以来股市调整的又一年，年末上证综指和深证综指分别收于 1267 点和 316 点，比年初分别下降 15.4% 和 16.6%，一年间深沪流通市值缩水超过一成。年中股票市场指数波动幅度较大，总体呈先升后抑态势。始于投资者对 2004 年经济高速发展，以及《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》公布后政策面因素好转的良好预期，年初沪、深股指在波动中大幅上扬，4 月上旬上证综指、深证综指最高分别升至 1783 点和 472.18 点。此后，市场在宏观调控的担忧中持续波动下滑，尽管 9 月有所反弹，但中国股市中一些深层次问题和矛盾的悬而未决影响了市场信心的恢复，全年股市维持了一个弱市形态。

2004 年安久基金的业绩表现没有达到预期。一年投资收益为 -6.19%，好于两市的跌幅，但在同业中排名不理想，在 54 家封闭式基金中仅名列 39。

	2004 年一 季度	2004 年二 季度	2004 年三 季度	2004 年四 季度
期间净值增长	13.19%	-17.26%	6.56%	-5.99%
同期上证指数涨跌幅	16.33%	-19.66%	-0.17%	-9.32%
54 家封闭式基金期间排名	19	50	11	43

安久基金业绩在 2004 年 4 个季度间呈现比较大的波动性（见上表）。仔细分析一下原因，除了本基金一向坚持比较充分的股票投资策略以外，2004 年操作也存在着对市场部分负面因素警觉度不够的缺陷。特别在二季度，本基金对宏观调控程度和效果认识不足，减仓、换仓不及时，引致期间净值表现落后，直接影响了全年的业绩表现。安久基金将在以后的操作中，加强市场风险防范意识。

#### 2005 年展望：

从宏观经济、资金供给、估值水平、市场环境四个层面分析，基金经理认为 2005 年 A 股市场提供的投资机会将超过 2004 年：

- 中国宏观经济的良好运行态势给 A 股市场形成一个良好的支撑。2004 年以来的市场下跌已经隐含了对 2005 年中国经济发展大幅回落的预期，但中国经济没有显示出大幅回调的迹象，2005 年经济增长速度仍会保持在 8% 以上，甚至可能超过预期。
- 2005 年市场资金供求关系在供给一方发生积极变化：1) QFII 投资额持续上升，企业年金入市细则公布，保险类资金即将直接入市，以及商业银行获准设立基金管理公司，机构投资者队伍不断壮大使市场的长线资金持续流入得到保障；2) 尽管 2005 年预计货币供应增速 15% 与新增贷款 2.5 亿两个指标，低于 2004 年的调控目标，但高于 2004 年 14.5% 与 2.2 万亿的实际水平，预示 2005 年货币供应仍会相对充裕；3) 房地产等市场收益的安全边际在缩小，资本可能回流到证券市场。
- 市场估值水平具有吸引力。2004 年年末，A 股总股本加权平均市盈率（扣除亏损股）为 19 倍，A 股总股本加权平均市净率（扣除负资产类股）为 2.09，估值水平比 99 年“5.19”行情前低 30% 左右，其中一些板块已经具有国际估值的比较优势。
- 金融产品创新、资产证券化、优质蓝筹公司 A 股发行等有助于提升中国股票市场内在吸引力。同时，随着平准基金的筹备推出、印花税改革以及解决股权分置问题框架等一系列改革措施逐步清晰，将从市场外部政策环境方面帮助证券市场恢复活力。

我们也清醒意识到 A 股市场历来存在的结构扭曲问题，毫无疑问，结构演变将成为近几年市场主题之一。2005 年，局部的投资机会将远盛于市场整体投资机会。安久基金在新一年中将遵循“淡化指数，精选个股”的投资原则，继续沿用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法来构建投资组合，严格从板块/个股基本面、估值水平两个角度来分析、挑选具体投资对象。

安久基金“自上而下”进行投资分析时，关注 2005 年市场中可能出现的以下投资机会：

- 从中长期来看，央行将改变人民币汇率形成机制，逐渐放宽人民币对美元的波动范围。若人民币汇率发生变动，航空公司、电力设备行业、造纸行业中一些公司及房地产业等将不同程度受益。
- 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速度将超越整体经济发展速度。
- 3G、数字电视将给相关产业链带来异乎寻常的投资机会。

- 价格严格管制的板块，例如铁路和水务，在改革趋势中呈现的增长潜力。
- 国有资本密集的行业因制度创新、金融创新给相关上市公司带来投资活力。

“自下而上”精选个股时，将考量上市公司在行业中的地位、综合竞争实力、公司治理等非财务报表因素，同时采用板块差异化方法对目标公司估值，积极进行“国际视野”的横向比较，坚决重仓具有国际估值比较优势的板块/个股。

#### (四) 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/申购和赎回以及 TA 系统流程、投资风险管理、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，托管人在安久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安久证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、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安久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

信长会师报字(2005)第 10429 号

安久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 2004 年 12 月 31 日的资产负债表和 2004 年度的经营业绩表、基金收益分配表以及基金净值变动表。这些会计报表由贵基金的管理人负责,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《金融企业会计制度》和证券投资基金相关法规以及《安久证券投资基金基金合同》的有关规定,在所有重大方面公允反映了贵基金 2004 年 12 月 31 日的财务状况和 2004 年度的经营业绩及基金净值变动情况。

上海立信长江会计师事务所有限公司 中国注册会计师

戴定毅

罗芳

中国·上海

二 00 五年三月七日

## 七、 财务会计报告

### (一) 资产负债表

项 目	附注	2004年12月31日	2003年12月31日
资产:			
银行存款		4,475,601.01	1,095,984.50
清算备付金		13,695,805.81	348,895.88
交易保证金		750,000.00	500,000.00
应收证券清算款		534,649.09	4,087,901.62

应收股利		-	-
应收利息	7(1)	504,958.24	1,242,181.61
其他应收款		-	-
股票投资市值		322,792,121.35	325,194,914.81
其中：股票投资成本		338,016,852.65	289,802,096.28
债券投资市值		94,554,543.70	147,208,195.50
其中：债券投资成本		97,218,930.88	146,660,122.10
配股权证		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产合计		<u>437,307,679.20</u>	<u>479,678,073.92</u>

负债：

应付证券清算款		553,982.40	4,287,544.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		562,809.94	567,888.76
应付托管费		93,801.68	94,648.11
应付佣金	7(3)	244,117.03	281,822.89
其他应付款	7(4)	500,000.00	500,000.00
预提费用	7(5)	130,000.00	70,000.00
卖出回购证券款		-	10,000,000.00
负债合计		<u>2,084,711.05</u>	<u>15,801,904.49</u>

所有者权益：

实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		-17,889,118.48	35,940,891.93
未分配收益		-46,887,913.37	-72,064,722.50
持有人权益合计		<u>435,222,968.15</u>	<u>463,876,169.43</u>
负债和所有者权益合计		<u>437,307,679.20</u>	<u>479,678,073.92</u>

(二) 经营业绩表

项 目	附注	2004年度	2003年度
收入：			
股票差价收入	7(6)	29,710,389.29	-13,604,009.41
债券差价收入	7(7)	-1,653,328.89	1,383,564.00
债券利息收入		3,302,171.63	3,427,154.39

存款利息收入		288,314.74	554,295.25
股利收入		2,687,940.75	2,726,170.90
买入返售证券收入		0.00	2,000.00
其他收入	7(8)	76,527.03	73,609.86
收入合计		<u>34,412,014.55</u>	<u>-5,437,215.01</u>

**费用：**

基金管理人报酬		7,021,005.32	6,249,780.24
基金托管费		1,170,167.63	1,041,629.96
卖出回购证券支出		662,842.72	924,585.27
其他费用	7(9)	381,189.75	402,079.11
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		240,000.00	240,000.00
审计费用		50,000.00	70,000.00
费用合计		<u>9,235,205.42</u>	<u>8,618,074.58</u>

基金净收益		25,176,809.13	-14,055,289.59
加：未实现估值增值变动数		-53,830,010.41	89,760,103.08
基金经营业绩		<u>-28,653,201.28</u>	<u>75,704,813.49</u>

**(三) 收益分配表**

项 目	附注	2004年度	2003年度
本期基金净收益		25,176,809.13	-14,055,289.59
加：期初未分配收益		-72,064,722.50	-58,009,432.91
可供分配基金净收益		<u>-46,887,913.37</u>	<u>-72,064,722.50</u>
减：本期已分配基金净收益		-	-
期末基金未分配净收益		<u>-46,887,913.37</u>	<u>-72,064,722.50</u>

**(四) 净值变动表**

项 目	附注	2004年度	2003年度
一、期初基金净值		463,876,169.43	388,171,355.94
二、本期经营活动：			
基金净收益		25,176,809.13	-14,055,289.59
未实现估值增值变动数		-53,830,010.41	89,760,103.08
经营活动产生的基金净值变动数		<u>-28,653,201.28</u>	<u>75,704,813.49</u>
四、本期向持有人分配收益		-	-
五、期末基金净值		<u>435,222,968.15</u>	<u>463,876,169.43</u>

## (五) 会计报表附注

### 1. 基金的基本情况

历史沿革：安久证券投资基金（以下简称“基金”）系根据中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]28号文《关于四川国信投资基金清理规范方案的批复》，经2000年6月四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议通过，由四川国信投资基金清理规范而成。经原四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议通过并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]56号文《关于同意四川国信投资基金规范为安久证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》批准，基金于2002年5月21日完成扩募，基金总份额由200,000,020份基金份额扩募至500,000,000份基金份额，扩募后基金存续期延长5年，至2007年8月30日止。

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[2000]第28号

核准文件名称：关于四川国信投资基金清理规范方案的批复

基金运作方式：契约型封闭式

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

基金合同生效日：2000年7月4日

基金合同生效日的基金份额：200,000,020

### 2. 基本会计假设

本年度会计报表的编制遵守基本会计假设。

### 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  
《金融企业会计制度》及《证券投资基金会计核算办法》。

2) 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。

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。



未上市的股票应区分以下情况处理：

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；

首次公开发行的股票，按成本估值。

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。

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；如果市价低于配股价，按零估值。

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。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6) 证券投资的成本计价方法

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。

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。

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。

#### 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、大于基金净值十万分之一的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、大于基金净值十万分之一的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。

#### 8) 收入的确认和计量

证券买卖差价收入：

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。

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。

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。

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。

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。

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。

其他收入：在实际收到时确认。

#### 9) 费用的确认和计量

管理人报酬和基金托管费：按照基金合同和招募说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入账。

卖出回购证券支出：在该证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。

利息支出：在借款期内逐日计提，并按借款本金与适用的利率计提的金额入账。

其他费用：发生额大于基金净值十万分之一，采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益；发生额小于基金净值十万分之一，于发生时直接计入基金损益。

#### 10) 基金的收益分配政策

基金收益分配比例不低于可供分配基金净收益的 90%。

基金收益分配采用现金方式。

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。

基金投资当年亏损，则不进行收益分配。

每一基金份额享有同等分配权。

#### 11) 为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计

无。

#### 12) 会计政策、会计估计变更的内容、理由、影响数或影响数不能合理确定的理由

无。

#### 13) 重大会计差错的内容和更正金额

无。

### 4. 税项

根据财政部、国家税务总局财税字（1998）55 号、（2001）61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》和财税字（2004）78 文《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. 关联方关系和关联方交易

##### (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	基金合同
交通银行	基金托管人	提取托管费	基金合同
		银行间市场交易	成交确认书
申银万国证券股份有限公司	基金管理公司股东	租用交易席位	席位使用协议
东方证券股份有限公司	基金管理公司股东	租用交易席位	席位使用协议
上海证券有限责任公司	与基金管理公司同一股东*	租用交易席位	席位使用协议
方正证券有限责任公司	基金管理公司股东	租用交易席位	席位使用协议

\* 股东为上海国际信托投资公司，系基金管理公司发起人。

根据 2004 年 12 月 21 日《华安基金管理有限公司关于股东出资转让的公告》，华安基金管理有限公司股东天同证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、方正证券有限责任公司和东方证券股份有限公司将其所持股权全部转让，该转让事项已经公司股东会审议通过，并报经中国证监会以证监基金字[2004]207 号文批准，相关工商变更登记手续正在办理之中。

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(%)
申银万国证券股份公司	318,993,428.25	17.73	257,703.47	17.97	0.08
东方证券股份有限公司	318,573,437.52	17.70	254,622.67	17.75	0.08
方正证券有限责任公司	239,595,056.44	13.31	193,352.93	13.48	0.08
上海证券有限责任公司	157,740,790.55	8.77	123,434.08	8.61	0.08

合 计	<u>1,034,902,712.76</u>	57.51	<u>829,113.15</u>	57.81	0.08
-----	-------------------------	-------	-------------------	-------	------

上年度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	307,859,201.67	20.11	248,957.49	20.28	0.08
东方证券股份有限公司	295,334,359.73	19.29	236,755.01	19.28	0.08
上海证券有限责任公司	186,523,943.85	12.18	145,958.85	11.89	0.08
方正证券有限责任公司	213,018,445.08	13.91	173,010.82	14.09	0.08
合 计	<u>1,002,735,950.33</u>	65.50	<u>804,682.17</u>	65.54	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。

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	57,294,450.50	28.46	335,000,000.00	30.88
东方证券股份有限公司	30,028,558.69	14.91	252,700,000.00	23.30
方正证券有限责任公司	33,111,702.50	16.45	284,000,000.00	26.18
上海证券有限责任公司	12,523,438.50	6.22	-	-
合 计	<u>132,958,150.19</u>	66.04	<u>871,700,000.00</u>	80.36

上年度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	119,170,945.10	18.67	249,000,000.00	23.33
东方证券股份有限公司	205,940,299.50	32.27	283,000,000.00	26.52
上海证券有限责任公司	96,183,016.25	15.07	-	-
方正证券有限责任公司	60,825,753.80	9.53	134,000,000.00	12.56
合 计	<u>482,120,014.65</u>	75.54	<u>666,000,000.00</u>	62.41

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	-	-	-	-	19,600,000.00	8,457.53

上年度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	-	-	-	-	20,000,000.00	18,380.27

(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 1.5%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。

本基金在本报告期间需支付基金管理费 7,021,005.32 元。(上年度：6,249,780.24 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 1,170,167.63 元。(上年度：1,041,629.96 元)

## 7. 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 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
银行存款利息	3,414.83	806.21
清算备付金利息	1,772.58	2,189.73
债券利息	499,770.83	1,239,185.67
买入返售证券利息	-	-
合计	504,958.24	1,242,181.61

### (2). 投资估值增值明细：

明细项目	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
股票估值增值余额	-15,224,731.30	35,392,818.53
债券估值增值余额	-2,664,387.18	548,073.40
合计	-17,889,118.48	35,940,891.93

### (3). 应付佣金明细：

明细项目	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
东方证券股份有限公司	58,765.47	61,543.04
申银万国证券股份有限公司	8,743.29	74,257.20
上海证券有限责任公司	-	55,346.57
平安证券有限责任公司	-	78,092.37
光大证券股份有限公司	114,806.71	12,583.71

方正证券有限责任公司	61,801.56	-
合计	244,117.03	281,822.89
 (4). 其他应付款明细：		
2004 年 12 月 31 日	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
明细项目		
券商垫付交易保证金	500,000.00	500,000.00
合计	500,000.00	500,000.00
 (5). 预提费用明细：		
2004 年 12 月 31 日	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
明细项目		
信息披露费	80,000.00	-
审计费用	50,000.00	70,000.00
合计	130,000.00	70,000.00
 (6). 卖出股票：		
明细项目	2004 年	2003 年
卖出股票成交总额	907,090,688.77	779,467,814.15
减：佣金	758,630.96	657,211.17
成本总额	876,621,668.52	792,414,612.39
股票差价收入	29,710,389.29	-13,604,009.41
 (7). 卖出债券：		
明细项目	2004 年	2003 年
卖出债券成交总额	171,210,645.28	347,254,868.25
减：成本总额	170,909,576.92	342,676,736.44
应收利息总额	1,954,397.25	3,194,567.81
债券差价收入	-1,653,328.89	1,383,564.00
 (8). 其他收入：		
明细项目	2004 年	2003 年
新股、配股申购手续费返还	76,527.03	54,973.30
债券申购手续费返还	-	9,186.56
债券申购冻结利息	-	9,450.00
合计	76,527.03	73,609.86
 (9). 其他费用：		
明细项目	2004 年	2003 年



审计费	50,000.00	70,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
交易所费用	9,257.96	12,107.61
其他	21,931.79	19,971.50
合计	381,189.75	402,079.11

#### 8. 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
振华港机	127,562	1,116,167.50	1,174,846.02	按市价	增发部分未上市	至 2005-3-31 上市
合计		1,116,167.50	1,174,846.02			

##### (2)、本基金截止本报告期末无流通受限的债券。

## 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	322,792,121.35	73.81
2	债券	94,554,543.70	21.62
3	银行存款和清算备付金合计	18,171,406.82	4.16
4	其他资产	1,789,607.33	0.41
	合计	437,307,679.20	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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	27,890,596.69	6.41
C	制造业	205,191,254.85	47.15
C0	其中：食品、饮料	8,614,495.12	1.98
C1	纺织、服装、皮毛	8,140,687.60	1.87
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	22,736,506.69	5.22
C4	石油、化学、塑胶、塑料	27,611,718.30	6.34

C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	99,303,587.02	22.82
C7	机械、设备、仪表	28,194,188.27	6.48
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他	10,590,071.85	2.44
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,060,288.50	3.69
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	46,938,616.09	10.78
G	信息技术业	2,779,040.90	0.64
H	批发和零售贸易	3,531,841.20	0.81
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	12,421,500.00	2.85
K	社会服务业	7,978,983.12	1.84
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	322,792,121.35	74.17

### (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	600005	武钢股份	5,200,000	21,268,000.00	4.89
2	600026	中海发展	2,166,000	19,840,560.00	4.56
3	000060	中金岭南	3,060,252	18,361,512.00	4.22
4	000983	西山煤电	970,403	14,371,668.43	3.30
5	600636	三爱富	1,717,814	14,017,362.24	3.22
6	600308	华泰股份	1,156,500	13,820,175.00	3.18
7	600296	兰州铝业	3,029,910	13,755,791.40	3.16
8	600123	兰花科创	1,226,763	13,518,928.26	3.11
9	600205	山东铝业	1,200,000	12,708,000.00	2.92
10	000002	万科A	2,366,000	12,421,500.00	2.85
11	600795	国电电力	1,999,000	12,353,820.00	2.84
12	600428	中远航运	999,200	11,270,976.00	2.59
13	600660	福耀玻璃	1,666,300	11,047,569.00	2.54
14	000969	安泰科技	1,041,305	10,590,071.85	2.43
15	000825	太钢不锈	2,299,628	10,555,292.52	2.43
16	600426	华鲁恒升	717,747	9,316,356.06	2.14
17	000778	新兴铸管	1,133,690	8,944,814.10	2.06
18	000911	南宁糖业	1,041,656	8,614,495.12	1.98
19	000069	华侨城A	1,166,518	7,978,983.12	1.83
20	002028	思源电气	300,700	7,388,199.00	1.70
21	600033	福建高速	888,820	6,515,050.60	1.50
22	000488	晨鸣纸业	566,825	6,002,676.75	1.38

23	000089	深圳机场	570,800	4,863,216.00	1.12
24	000527	美的电器	665,300	4,803,466.00	1.10
25	600302	标准股份	860,586	4,526,682.36	1.04
26	600851	海欣股份	455,000	4,522,700.00	1.04
27	600423	柳化股份	600,000	4,278,000.00	0.98
28	000767	漳泽电力	640,150	3,706,468.50	0.85
29	600398	凯诺科技	532,057	3,617,987.60	0.83
30	600029	南方航空	666,000	3,476,520.00	0.80
31	600875	东方电机	266,000	3,237,220.00	0.74
32	000528	桂柳工 A	600,000	2,970,000.00	0.68
33	600963	岳阳纸业	412,699	2,913,654.94	0.67
34	600066	宇通客车	300,000	2,826,000.00	0.65
35	002017	东信和平	199,931	2,779,040.90	0.64
36	600585	海螺水泥	326,300	2,662,608.00	0.61
37	600361	华联综超	272,762	2,072,991.20	0.48
38	600320	振华港机	179,171	1,650,164.91	0.38
39	600825	华联超市	179,000	1,458,850.00	0.34
40	600012	皖通高速	156,569	972,293.49	0.22
41	600550	天威保变	127,200	792,456.00	0.18

#### (四) 报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	000927	一汽夏利	44,857,175.37	9.67
2	600205	山东铝业	39,300,732.43	8.47
3	600005	武钢股份	34,096,408.91	7.35
4	000898	鞍钢新轧	31,201,529.84	6.73
5	600591	上海航空	29,293,095.03	6.31
6	600808	马钢股份	26,469,147.43	5.71
7	600028	中国石化	21,441,947.93	4.62
8	600500	中化国际	21,414,928.91	4.62
9	000060	中金岭南	20,775,288.01	4.48
10	600026	中海发展	20,387,384.81	4.40
11	000629	新 钢 钒	19,352,356.06	4.17
12	000800	一汽轿车	18,755,923.60	4.04
13	000968	煤 气 化	18,113,892.80	3.90
14	600795	国电电力	17,940,401.56	3.87
15	600296	兰州铝业	17,867,115.42	3.85



16	600123	兰花科创	15,978,999.65	3.44
17	000063	中兴通讯	15,697,998.38	3.38
18	600050	中国联通	15,582,225.98	3.36
19	000983	西山煤电	15,534,911.86	3.35
20	000528	桂柳工 A	15,415,685.82	3.32
21	000027	深能源 A	14,842,772.73	3.20
22	600710	常林股份	14,422,399.52	3.11
23	600000	浦发银行	14,207,278.96	3.06
24	600029	南方航空	13,890,616.77	2.99
25	000969	安泰科技	13,671,868.99	2.95
26	600428	中远航运	13,306,107.06	2.87
27	600002	齐鲁石化	13,265,568.06	2.86
28	600660	福耀玻璃	12,942,313.92	2.79
29	600220	江苏阳光	12,322,233.01	2.66
30	000002	万科 A	12,321,980.92	2.66
31	000677	山东海龙	11,816,311.27	2.55
32	000866	扬子石化	11,526,476.03	2.48
33	600584	长电科技	11,343,829.35	2.45
34	000625	长安汽车	10,987,244.68	2.37
35	002028	思源电气	10,744,299.80	2.32
36	000825	太钢不锈	10,680,085.58	2.30
37	002017	东信和平	9,803,883.97	2.11
38	000911	南宁糖业	9,736,388.06	2.10
39	600125	铁龙股份	9,513,221.93	2.05

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金 额	占期初基金资产净 值的比例 (%)
1	000898	鞍钢新轧	57,594,011.07	12.42
2	600205	山东铝业	35,641,337.21	7.68
3	600036	招商银行	34,992,152.56	7.54
4	000927	一汽夏利	33,270,497.38	7.17
5	000063	中兴通讯	31,384,915.23	6.77
6	600591	上海航空	30,817,199.41	6.64
7	600028	中国石化	24,910,603.17	5.37
8	600500	中化国际	23,536,505.44	5.07
9	600005	武钢股份	23,285,839.22	5.02
10	600795	国电电力	22,957,062.03	4.95
11	600808	马钢股份	21,446,353.91	4.62
12	600019	宝钢股份	20,494,112.93	4.42
13	600000	浦发银行	20,129,098.03	4.34
14	600104	上海汽车	19,363,616.69	4.17
15	000968	煤气化	18,772,865.94	4.05

16	000651	格力电器	18,018,934.01	3.88
17	000629	新 钢 钒	17,912,507.11	3.86
18	000630	铜都铜业	17,108,895.88	3.69
19	600710	常林股份	15,467,227.84	3.33
20	000581	威孚高科	15,326,507.50	3.30
21	000027	深能源 A	15,086,029.61	3.25
22	600002	齐鲁石化	14,443,618.14	3.11
23	000677	山东海龙	14,128,151.61	3.05
24	600585	海螺水泥	14,109,381.63	3.04
25	600183	生益科技	14,063,569.90	3.03
26	000800	一汽轿车	13,926,941.46	3.00
27	600050	中国联通	13,884,244.86	2.99
28	600309	烟台万华	13,353,603.66	2.88
29	600029	南方航空	12,603,903.17	2.72
30	600220	江苏阳光	12,556,029.68	2.71
31	000778	新兴铸管	12,289,102.53	2.65
32	000866	扬子石化	11,412,759.82	2.46
33	600125	铁龙股份	11,363,141.67	2.45
34	600584	长电科技	10,758,344.34	2.32
35	600009	上海机场	10,260,150.08	2.21

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	924,836,424.89
卖出股票的收入总额	907,090,688.77

(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	72,585,150.10	16.68
2	金融债券	19,992,000.00	4.59
3	可转换债券	1,977,393.60	0.46
	合计	94,554,543.70	21.73

(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	010115	21 国债(15)	290,000	27,431,100.00	6.30
2	010010	20 国债(10)	236,470	22,897,390.10	5.26
3	040402	04 农发 02	200,000	19,992,000.00	4.59
4	010214	02 国债(14)	110,000	10,621,600.00	2.44

5	010401	04 国债(1)	62,000	6,056,160.00	1.39
---	--------	----------	--------	--------------	------

### (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）的市场平均价计算，已发行未上市股票采用成本价计算。

#### 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	应收证券清算款	534,649.09
2	深圳结算保证金	750,000.00
3	应收利息	504,958.24
	合计	1,789,607.33

#### 4、 处于转股期的可转换债券明细

截止 12 月 31 日止，本基金未持有转股期的可转换债。

## 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	10,111	-
平均每户持有基金份额	49,451	-
机构投资者持有的基金份额	343,761,289	68.75
个人投资者持有的基金份额	156,238,711	31.25

### 前十名持有人的名称

序号	项目	份额(份)	占总份额的比例(%)
1	海通证券股份有限公司	230,500,000	46.10
2	中国人寿保险(集团)公司	47,457,034	9.49
3	中国人寿保险股份有限公司	30,750,796	6.15
4	新华人寿保险股份有限公司	9,569,896	1.91
5	泰康人寿保险股份有限公司	7,519,093	1.50
6	华安基金管理有限公司	5,000,000	1.00
7	中国再保险公司	3,262,857	0.65
8	陈莹	3,232,543	0.65

9	唐朝	2,579,551	0.52
10	吴少勋	2,000,000	0.40

## 十、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。

本基金托管人高管人员变更如下：蒋超良同志担任交通银行董事长、党委书记，张建国同志担任交通银行行长、副董事长、党委副书记；方诚国同志不再担任交通银行行长、副董事长、党委书记职务，殷介炎同志不再担任交通银行董事长职务。

(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：

本基金管理人于 2004 年 12 月 13 日公告：经公司董事会审议通过，并已报中国证券监督管理委员会备案，本公司聘任上海立信长江会计师事务所有限公司担任基金安信、基金安顺、基金安久、基金安瑞的审计机构，安永大华会计师事务所有限公司不再担任上述基金的审计机构。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：50,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2004 年 12 月 13 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：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 (%)
光大证券股份有限公司	1	520,835,228.45	28.94	407,559.14	28.42
申银万国证券股份有限公司	1	318,993,428.25	17.73	257,703.47	17.97
东方证券股份有限公司	2	318,573,437.52	17.70	254,622.67	17.75
平安证券有限责任公司	1	243,774,313.64	13.55	197,505.49	13.77
方正证券有限责任公司	1	239,595,056.44	13.31	193,352.93	13.48
上海证券有限责任公司	1	157,740,790.55	8.77	123,434.08	8.61
合计	7	<u>1,799,512,254.85</u>	100.00	<u>1,434,177.78</u>	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 (%)
申银万国证券股份有限公司	57,294,450.50	28.46	335,000,000.00	30.88
光大证券股份有限公司	41,333,113.10	20.53	-	-
方正证券有限责任公司	33,111,702.50	16.44	284,000,000.00	26.18
东方证券股份有限公司	30,028,558.69	14.91	252,700,000.00	23.30
平安证券有限责任公司	27,053,446.90	13.44	213,000,000.00	19.64
上海证券有限责任公司	12,523,438.50	6.22	-	-
合计	<u>201,344,710.19</u>	100.00	<u>1,084,700,000.00</u>	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) 其他重要事项：

#### 1、修改基金合同：

本基金管理人于 2004 年 11 月 16 日发布公告：根据中国证监会《关于实施证券投资基金运作管理办法 有关问题的通知》，遵照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关法律法规和目前情况，经与托管人交通银行协商，华安基金管理有限公司对《安久证券投资基金基金契约》进行了修改并已报中国证监会备案。

#### 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，东方证券股份有限公司将所持本公司 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。

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。

## 十一、备查文件目录

### 1、《安久证券投资基金基金合同》；



- 2、《安久证券投资基金招募说明书》；
- 3、《安久证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准安久证券投资基金设立的文件；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、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