



# 安瑞证券投资基金 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：中国工商银行

签发日期：二〇〇五年三月二十九日

## 目 录

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	7
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	8
	（四）基金内部监察报告	8
五、	托管人报告	9
六、	审计报告	9
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	12
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	21
	（五）、按债券品种分类的债券投资组合	24
	（六）、基金投资前五名债券明细	24
	（七）、投资组合报告附注	24
九、	基金份额持有人户数和持有人结构	25
十、	重大事件	25
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。

基金托管人中国工商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:	安瑞证券投资基金
基金简称:	基金安瑞
交易代码:	500013
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	本基金由金龙基金、沈阳万利基金、沈阳富民基金清理规范后合并而成。 2000 年 7 月 18 日华安基金管理有限公司开始管理基金安瑞
期末基金份额总额:	5 亿份
基金存续期:	15 年(1992 年 4 月 29 日至 2007 年 4 月 28 日)
基金上市地点:	上海证券交易所
基金上市日期:	2001 年 8 月 30 日

### (二) 基金的投资

投资目标:	本基金投资于小型上市公司,即公司市值低于市场平均市值的上市公司。投资目标是发掘小型上市公司中的投资机会,通过积极的投资策略,获取长期的资本增值。
投资策略:	本基金为小市值基金,本基金的主要投资方向是小型上市公司,指投资时上市公司的总市值或流通市值低于市场平均水平。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%,其中投资于债券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 40-80%,现金比例根据市场和运作情

况调整。在股票资产中,70%投资于合同规定的小市值股票,30%投资于包括新股在内的其他上市公司股票,在此基础上各自上下浮动 10%。当投资的股票市值因价格上涨等因素高于市场平均水平的 50%时,将作为非小市值股票进行统计。

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  
总经理: 韩方河  
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

### (四) 基金托管人

基金托管人: 中国工商银行  
注册及办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号  
( 邮编: 100032 )  
法定代表人: 姜建清  
托管部负责人: 周月秋  
信息披露负责人: 庄为  
联系电话: 010-66107333  
传真: 010-66106904  
电子邮箱: custodian@icbc.com.cn

### (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.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

### (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: 上海南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 楼  
登记注册机构: 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司  
办公地点: 上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

### 三、主要财务指标和基金净值表现

#### (一) 主要财务指标

	2004 年		2003 年		2002 年	
	新指标	新指标	新指标	新指标	旧指标	旧指标
基金本期净收益	-6,135,596.51 元	-51,635,740.19 元	11,029,415.05 元	11,029,415.05 元		
加权平均基金份额本期净收益	-0.0123 元	-0.1033 元	0.0221 元	0.0221 元		
期末可供分配基金收益	-47,191,897.67 元	-37,645,469.75 元	-33,592,231.57 元	-33,592,231.57 元		
期末可供分配基金份额收益	-0.0944 元	-0.0753 元	-0.0672 元	-0.0672 元		
期末基金资产净值	452,808,102.33 元	463,398,989.73 元	466,407,768.43 元	466,407,768.43 元		
期末基金份额净值	0.9056 元	0.9268 元	0.9328 元	0.9328 元		
基金加权平均净值收益率	-1.26%	-10.98%	2.11%	2.15%		
本期基金份额净值增长率	-2.29%	-0.64%	-9.10%	-9.10%		
基金份额累计净值增长率	5.53%	8.00%	8.70%	9.83%		

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、历史各时间段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	-	-
过去三个月	-5.46%	1.57%	-	-	-	-
过去六个月	-5.10%	2.28%	-	-	-	-
过去一年	-2.29%	2.26%	-	-	-	-
过去三年	-11.75%	1.80%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	5.53%	1.56%	-	-	-	-

备注：本基金合同中并没有规定业绩比较基准。

##### B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

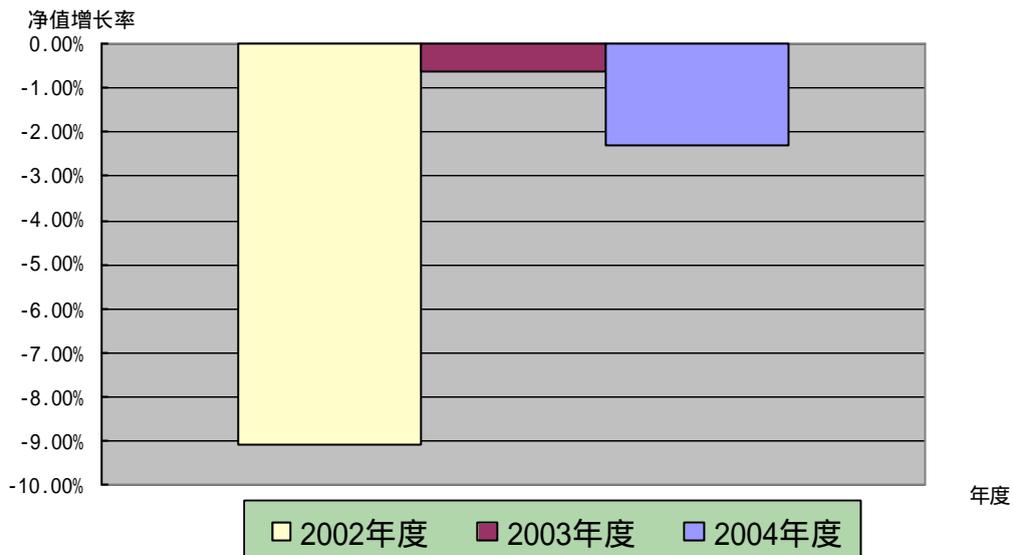
基金份额累计净值增长率历史走势图

### 基金安瑞份额累计净值增长率历史走势图 2000/7/18--2004/12/31



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的柱状图

基金安瑞过往三年每年的净值增长率



### （三）基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2004 年度	-	
2003 年度	-	
2002 年度	0.700 元	
合计	0.700 元	

## 四、 管理人报告

### （一）基金经理

陈苏桥 先生：经济学硕士，5 年基金从业经历。1998 年 7 月毕业于清华大学经济管理学院，1999 年 5 月进入华安基金管理有限公司后，曾任研究发展部高级研究员，从事交通运输行业及相关上市公司研究。2003 年 9 月起任基金安瑞的基金经理。

### （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、《安瑞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

#### 行情回顾

2004 年的证券市场是令人沮丧的一年。上证指数全年下跌 15%，2/3 的股票基金亏损，基金整体击败了指数的，但没有赚钱效应，基金公司拓展业务日显艰难。

2004 年市场是有机会的，上半年有一线蓝筹股行情，下半年有二线蓝筹股行情，抓住一次行情就可脱颖而出。2004 市场也充满风险，五朵金花退色、宏观紧缩、庄股跳水、券商出险等等，个股暴跌事件频频。

#### 操作回顾

对本基金而言，在上半年的行情中重点投资了石化、有色、电力设备、航空等，一度使净值脱颖而出，净值增长率一度达到 22%。但是下半年重点投资了汽车股和 TCL 集团亏损较大，未能守住利润，全年净值负增长。总体评价是上半年抓住了机会，下半年未能躲避风险，全年净值表现平平。作为安瑞的管理人，因没有能够为持有人获得净值增长而沮丧。

回顾 2004 年的操作，安瑞对大的行业机会把握得较好，因此上半年表现不错；但是对宏观调控应对不力和部分个股选择不当，致使下半年表现较差。这警示管理人要不断学习，提高对组合的风险管理水平。

#### 展望

2005 年将是证券市场转折之年。全流通问题的解决虽然没有时间表，但已成为全社会关注重点；上市公司的治理结构继续改善，分类表决的正面效果正在显现；企业年金、保险资金等长线合规资金正在有序地进入股市；优秀上市公司的群体正在壮大。我们对转折之年的证券市场仍然保持必要的谨慎，但可以肯定的是，她正在大踏步地向好的方向发展。

操作上，在重视把握行业机会的同时，本管理人将采取“精选个股、动态调整”的策略，积极地为持有人争取回报。行业上，重点关注航空、电力设备、客货车等行业可能的机会。个股选择上本管理人将持续寻找处在景气行业的优质公司。政策上，密切关注全流通问题的进展。

中小板自上市以来就受到市场的关注，经过两轮跌势之后，我们认为目前估值已经趋于合理，其中有许多公司富于活力，预期在未来的市场竞争中能够取得一席之地。

### (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 年度，本托管人在对安瑞证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，2004 年度安瑞证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对安瑞证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在 2004 年度所编制和披露的安瑞证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容具有真实、准确和完整性。

## 六、 审计报告

信长会师报字（2005）第 10428 号

安瑞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《安瑞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

二〇〇五年三月七日

## 七、财务会计报告

### (一)、资产负债表

二零零四年十二月三十一日

单位:人民币元

项 目	附注	2004年12月31日	2003年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款		64,626,610.03	30,156,696.22
清算备付金		-	-
交易保证金		750,000.00	750,000.00
应收证券清算款		11,636,087.37	4,711,717.89
应收股利		-	-
应收利息	7(1)	1,379,672.70	1,355,852.74
其他应收款		-	-
股票投资市值		265,417,883.33	296,683,996.26
其中:股票投资成本		265,849,944.88	294,885,919.68
债券投资市值		111,152,117.70	131,417,264.00
其中:债券投资成本		114,130,887.56	132,170,881.10
配股权证		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
<b>资产合计</b>		<b>454,962,371.13</b>	<b>465,075,527.11</b>

**负债:**

应付证券清算款		719,127.94	-
应付管理人报酬		582,503.35	574,161.36
应付托管费		97,083.88	95,693.55
应付佣金	7(3)	422,353.63	473,482.47
应付利息		-	-
应付收益		-	-
其他应付款	7(4)	263,200.00	263,200.00
卖出回购证券款		-	-
预提费用	7(5)	70,000.00	270,000.00
负债合计		<u>2,154,268.80</u>	<u>1,676,537.38</u>

**所有者权益：**

实收基金	7(6)	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	7(7)	-3,410,831.41	1,044,459.48
未分配收益		-43,781,066.26	-37,645,469.75
持有人权益合计		<u>452,808,102.33</u>	<u>463,398,989.73</u>
负债和所有者权益合计		<u>454,962,371.13</u>	<u>465,075,527.11</u>
基金份额净值		<u>0.9056</u>	<u>0.9268</u>

所附附注为本会计报表的组成部分

**(二)、经营业绩表**

自二零零四年一月一日至二零零四年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2004年度	2003年度
<b>收入：</b>			
股票差价收入	7(8)	2,312,401.91	-50,604,169.00
债券差价收入	7(9)	-6,525,347.25	402,069.58
债券利息收入		3,429,214.70	3,642,852.50
存款利息收入		494,285.34	532,278.49
股利收入		3,345,930.80	3,801,590.33
买入返售证券收入		-	-
其他收入	7(10)	52,666.56	88,649.21
收入合计		<u>3,109,152.06</u>	<u>-42,136,728.89</u>

**费用：**

基金管理人报酬		7,325,779.48	7,061,439.48
基金托管费		1,220,963.21	1,176,906.48
卖出回购证券支出		301,078.00	855,878.00
利息支出		-	-
其他费用	7(11)	396,927.88	404,787.34
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	70,000.00	70,000.00
费用合计	9,244,748.57	9,499,011.30
基金净收益	-6,135,596.51	-51,635,740.19
加：未实现估值增值变动数	-4,455,290.89	48,626,961.49
基金经营业绩	-10,590,887.40	-3,008,778.70

所附附注为本会计报表的组成部分

### (三)、收益分配表

自二零零四年一月一日至二零零四年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2004年度	2003年度
本期基金净收益		-6,135,596.51	-51,635,740.19
加：期初未分配收益		-37,645,469.75	13,990,270.44
可供分配基金净收益		-43,781,066.26	-37,645,469.75
减：本期已分配基金净收益		-	-
期末基金未分配净收益		-43,781,066.26	-37,645,469.75

所附附注为本会计报表的组成部分

### (四)、净值变动表

自二零零四年一月一日至二零零四年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2004年度	2003年度
一、期初基金净值		463,398,989.73	466,407,768.43
二、本期经营活动：			
基金净收益		-6,135,596.51	-51,635,740.19
未实现估值增值变动数		-4,455,290.89	48,626,961.49
经营活动产生的基金净值变动数		-10,590,887.40	-3,008,778.70
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		-	-
四、期末基金净值		452,808,102.33	463,398,989.73

所附附注为本会计报表的组成部分

### (五)、会计报表附注

#### 1. 基金的基本情况：

安瑞证券投资基金（以下简称“基金”）系按照《证券投资基金管理暂行办法》、《国务院办公厅转发证监会原有投资基金清理规范方案的通知》（国办发[1999]28号）中国证监会《关于辽宁省原有投资基金清理规范方案的批复》（证

监基金字[2000]30号)、《关于中国工商银行系统原有投资基金清理规范方案的批复》(证监基金字[2000]36号)和《关于上海市原有投资基金清理规范方案的批复》(证监基金字[2000]10号)由原沈阳富民基金、沈阳万利基金、金龙基金清理规范合并而成的契约型封闭式证券投资基金。截至2000年7月17日基金资产移交日止,每基金份额净值1.0004元。基金总份额为207,700,000份基金份额,存续期为10年(自1992年4月29日至2002年4月28日)。

根据中国证监会证监基金字[2001]19号文《关于同意安瑞证券投资基金上市、扩募和续期的批复》和上海证券交易所上证上字[2001]129号《上市通知书》审核同意,基金于2001年8月30日在上海证券交易所挂牌交易。

经原基金持有人临时持有人大会决议通过,并经中国证监会证监基金字[2001]19号文批准,基金于2001年11月2日完成扩募,基金总份额由207,700,000份基金份额扩募至500,000,000份基金份额,并经大华会计师事务所有限公司以“华业字(2001)第1158号”验资报告验证。扩募后基金存续期延长5年,至2007年4月28日止。

基金发起人为华安基金管理有限公司和北方证券有限责任公司,基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行。

## 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:

- a) 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》。
- b) 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。
- c) 记账本位币:本基金的记账本位币为人民币。
- d) 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。
- e) 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:

- 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。

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;如果市价等于或低于配股价,则估值为零。

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。

f) 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。

g) 待摊费用、预提费用的摊销方法和摊销期限：

待摊费用核算已经发生的、影响基金份额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账，在受益期内平均摊销。

预提费用核算预计将发生的、影响基金份额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账。

h) 收入的确认和计量：

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。

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。

i) 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。

j) 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%。

基金收益分配采取现金方式或法规允许的其他方式，每年分配一次。

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。

k) 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：

2004 年度无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。

l) 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：

2004 年度无会计政策、会计估计变更。

m) 重大会计差错的内容和更正金额：

2004 年度无重大会计差错更正。

#### 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：

2004 年度无资产负债表日后事项。

## 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	基金发起人、基金管理人	提取管理费	基金合同
中国工商银行	基金托管人	提取托管费	基金合同
上海证券有限责任公司	与管理公司属同一股东*	租用交易席位	席位使用协议

\*注：同一股东为上海国际信托投资公司，系基金管理公司发起人。

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%股权转让给上海工业投资(集团)有限公司。

### (2). 通过关联方席位进行的交易

本报告期(2004 年)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	平均佣金比率
上海证券有限责任公司	324,476,439.95	11.26%	264,249.87	11.35%	0.08%

本基金通过关联人席位 2003 年的股票交易情况：

关联人	交易量	占总交易量比例	佣金	占总佣金比例	平均佣金比率
上海证券有限责任公司	437,142,224.45	21.12%	349,490.83	21.07%	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。

席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款而订立的，因此基金交易佣金比率是公允的。

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（2004 年）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
上海证券有限责任公司	53,837,370.00	18.67%	122,000,000.00	26.30%

本基金通过关联人席位 2003 年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
上海证券有限责任公司	138,821,231.70	25.77%	160,100,000.00	16.53%

与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

本基金与关联人 2004 年末进行银行间市场债券买卖和回购交易。

本基金与关联人 2003 年末进行银行间市场债券买卖和回购交易。

### (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，本基金成立三个月后，若持有现金比例超过本基金资产净值的 20%，超过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 为每日应支付的管理费

E 为前一日的基金资产净值（扣除超过规定比例现金后的资产净值）

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 7,325,779.48 元。（2003 年 7,061,439.48 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 1,220,963.21 元。（2003 年 1,176,906.48 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	13,107.90	12,490.17
债券利息	1,366,564.80	1,343,362.57

合计	1,379,672.70	1,355,852.74
(2). 投资估值增值明细：	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
明细项目		
股票估值增值余额	-432,061.55	1,798,076.58
债券估值增值余额	-2,978,769.86	-753,617.10
合计	-3,410,831.41	1,044,459.48
(3). 应付佣金明细：	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
明细项目		
上海证券	1,078.03	61,047.83
民族证券	0.00	30,665.68
国泰君安	14,524.45	26,939.84
招商证券	127,476.88	86,507.50
兴业证券	115,002.49	157,435.79
长城证券	164,271.78	110,885.83
合计	422,353.63	473,482.47
(4). 其他应付款明细：	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
券商代垫交易保证金	250,000.00	250,000.00
其他	13,200.00	13,200.00
合计	263,200.00	263,200.00
(5). 预提费用明细：	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
明细项目		
信息披露费	0.00	200,000.00
审计费用	70,000.00	70,000.00
合计	70,000.00	270,000.00
(6). 实收基金变动明细：		
明细项目	2004 年度	2003 年度
期初数	500,000,000.00	500,000,000.00
期末数	500,000,000.00	500,000,000.00
(7). 未实现利得明细：		
明细项目	2004 年度	2003 年度
期初未实现利得：	1,044,459.48	-47,582,502.01
本期投资估值增值发生数：	-4,455,290.89	48,626,961.49

期末未实现利得： -3,410,831.41 1,044,459.48

(8). 卖出股票：

明细项目	2004 年度	2003 年度
卖出股票成交总额	1,472,345,627.93	1,059,817,633.83
减：佣金	1,239,723.19	888,843.41
成本总额	1,468,793,502.83	1,109,532,959.42
股票差价收入	2,312,401.91	-50,604,169.00

(9). 卖出债券：

明细项目	2004 年度	2003 年度
卖出债券成交总额	294,536,348.87	313,521,487.35
减：成本总额	297,267,707.19	310,058,047.14
应收利息总额	3,793,988.93	3,061,370.63
债券差价收入	-6,525,347.25	402,069.58

(10). 其他收入：

明细项目	2004 年度	2003 年度
债券认购手续费返还	0.00	1,598.74
股票认购手续费返还	52,666.56	73,925.47
认购债券资金利息返还	0.00	13,125.00
合计	52,666.56	88,649.21

(11). 其他费用：

明细项目	2004 年度	2003 年度
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	70,000.00	70,000.00
交易所费用	3,977.88	11,629.50
其他费用	22,950.00	23,157.84
合计	396,927.88	404,787.34

(12). 基金收益分配：

本基金本年度未进行收益分配

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，则按当日平均价计价。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	881,558.72	按当日 平均价	增发部分未上市	至2005-1-6上市
合 计		796,418.24	881,558.72			

(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	265,417,883.33	58.34%
2	债券	111,152,117.70	24.43%
3	银行存款和清算备付金合计	64,626,610.03	14.20%
4	其他资产	13,765,760.07	3.03%
	合计	454,962,371.13	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	9,216,594.00	2.04%
C	制造业	195,402,764.61	43.15%
C1	其中：纺织、服装、皮毛	33,697,512.19	7.44%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	19,699,300.00	4.35%
C5	电子	2,833,124.75	0.63%
C6	金属、非金属	66,278,002.41	14.64%
C7	机械、设备、仪表	72,894,825.26	16.10%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,650.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	29,908,740.00	6.61%
G	信息技术业	20,934,936.00	4.62%
I	金融、保险业	5,491,200.00	1.21%
J	房地产业	881,558.72	0.19%
K	社会服务业	3,574,440.00	0.79%
	合计	265,417,883.33	58.62%

### (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	6,200,000	25,358,000.00	5.60%
2	600029	南方航空	4,480,000	23,385,600.00	5.16%
3	600406	国电南瑞	1,568,160	20,934,936.00	4.62%
4	600166	福田汽车	2,880,276	19,211,440.92	4.24%
5	600875	东方电机	1,490,295	18,136,890.15	4.01%
6	600066	宇通客车	1,700,000	16,014,000.00	3.54%
7	600019	宝钢股份	2,180,000	13,145,400.00	2.90%
8	002034	美欣达	990,000	11,889,900.00	2.63%
9	600031	三一重工	640,000	11,059,200.00	2.44%
10	002019	鑫富股份	460,000	10,488,000.00	2.32%
11	000630	铜都铜业	1,900,000	10,260,000.00	2.27%
12	600851	海欣股份	990,000	9,840,600.00	2.17%
13	000060	中金岭南	1,444,400	8,666,400.00	1.91%
14	600367	红星发展	1,390,000	8,576,300.00	1.89%
15	002032	苏泊尔	692,461	6,793,042.41	1.50%
16	002023	海特高新	375,500	6,518,680.00	1.44%
17	000726	鲁泰A	683,573	6,500,779.23	1.44%
18	002021	中捷股份	632,911	5,499,996.59	1.21%
19	600000	浦发银行	780,000	5,491,200.00	1.21%
20	600028	中国石化	1,100,000	4,807,000.00	1.06%
21	600547	山东黄金	353,900	4,409,594.00	0.97%
22	600236	桂冠电力	360,000	3,567,600.00	0.79%
23	600469	风神股份	508,256	2,973,297.60	0.66%
24	600460	士兰微	241,117	2,833,124.75	0.63%
25	002029	七匹狼	302,049	2,730,522.96	0.60%
26	600398	凯诺科技	401,500	2,730,200.00	0.60%
27	000012	南玻A	230,000	2,047,000.00	0.45%
28	600383	金地集团	88,688	881,558.72	0.19%
29	600309	烟台万华	50,000	635,000.00	0.14%
30	600585	海螺水泥	1,000	8,160.00	0.00%
31	600886	国投电力	1,000	7,650.00	0.00%
32	000069	华侨城A	1,000	6,840.00	0.00%
33	600493	凤竹纺织	1,000	5,510.00	0.00%
34	600115	东方航空	1,000	4,460.00	0.00%

### (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% 的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

净值的比例

1	600028	中国石化	93,397,655.98	20.15%
2	600002	齐鲁石化	88,004,345.45	18.99%
3	600029	南方航空	80,263,799.57	17.32%
4	000100	TCL 集团	57,739,305.08	12.46%
5	600019	宝钢股份	54,077,520.66	11.67%
6	600282	南钢股份	47,773,503.41	10.31%
7	600475	华光股份	46,998,200.79	10.14%
8	600104	上海汽车	46,432,394.05	10.02%
9	600406	国电南瑞	44,194,705.45	9.54%
10	000630	铜都铜业	43,242,192.47	9.33%
11	600688	上海石化	42,701,958.74	9.21%
12	000060	中金岭南	42,041,859.65	9.07%
13	000866	扬子石化	33,325,313.48	7.19%
14	600000	浦发银行	33,207,033.48	7.17%
15	600360	华微电子	29,729,148.96	6.42%
16	600210	紫江企业	27,998,923.03	6.04%
17	600005	武钢股份	27,149,816.34	5.86%
18	600166	福田汽车	22,092,223.75	4.77%
19	600089	特变电工	21,681,261.97	4.68%
20	000800	一汽轿车	21,367,688.74	4.61%
21	600795	国电电力	20,216,488.02	4.36%
22	000983	西山煤电	18,003,802.76	3.89%
23	600031	三一重工	17,495,983.78	3.78%
24	600875	东方电机	15,970,017.10	3.45%
25	000012	南 玻 A	15,453,576.88	3.33%
26	600066	宇通客车	15,446,967.74	3.33%
27	600016	民生银行	14,967,214.39	3.23%
28	600036	招商银行	14,719,060.15	3.18%
29	000625	长安汽车	14,639,990.27	3.16%
30	002034	美 欣 达	13,611,747.67	2.94%
31	002021	中捷股份	13,565,888.23	2.93%
32	600050	中国联通	12,755,499.59	2.75%
33	002019	鑫富股份	12,628,806.31	2.73%
34	600460	士 兰 微	12,403,920.19	2.68%
35	000528	桂柳工 A	12,367,825.64	2.67%
36	600367	红星发展	12,288,970.50	2.65%
37	600123	兰花科创	11,820,768.68	2.55%
38	600563	法拉电子	11,743,602.61	2.53%
39	600205	山东铝业	11,726,014.03	2.53%
40	600143	金发科技	11,447,671.22	2.47%
41	600690	青岛海尔	10,778,438.10	2.33%

42	002023	海特高新	10,743,238.70	2.32%
43	600220	江苏阳光	10,248,034.62	2.21%
44	600547	山东黄金	10,174,616.24	2.20%
<b>序号</b>	<b>股票代码</b>	<b>股票名称</b>	<b>本期累计卖出金额</b>	<b>占期初基金资产 净值的比例</b>
1	600002	齐鲁石化	102,432,938.89	22.10%
2	600028	中国石化	84,103,169.53	18.15%
3	600029	南方航空	62,825,280.89	13.56%
4	600019	宝钢股份	59,352,155.38	12.81%
5	600475	华光股份	53,151,990.91	11.47%
6	000630	铜都铜业	53,105,207.02	11.46%
7	600210	紫江企业	49,567,737.21	10.70%
8	600688	上海石化	45,133,328.26	9.74%
9	000024	招商地产	44,028,307.82	9.50%
10	000866	扬子石化	42,650,947.49	9.20%
11	600031	三一重工	41,538,978.16	8.96%
12	600282	南钢股份	40,769,677.80	8.80%
13	000100	TCL 集团	40,142,400.74	8.66%
14	600584	长电科技	34,969,140.98	7.55%
15	600104	上海汽车	34,293,345.17	7.40%
16	600360	华微电子	31,950,442.35	6.89%
17	600406	国电南瑞	30,656,659.36	6.62%
18	600016	民生银行	28,777,756.07	6.21%
19	000060	中金岭南	28,154,887.70	6.08%
20	600000	浦发银行	25,520,225.36	5.51%
21	600036	招商银行	24,827,380.24	5.36%
22	600367	红星发展	21,129,121.44	4.56%
23	600795	国电电力	19,948,668.43	4.30%
24	600089	特变电工	19,343,767.75	4.17%
25	000983	西山煤电	16,736,443.35	3.61%
26	600707	彩虹股份	15,218,424.77	3.28%
27	000800	一汽轿车	14,108,082.33	3.04%
28	000012	南玻 A	14,010,286.34	3.02%
29	600308	华泰股份	12,945,807.62	2.79%
30	600123	兰花科创	12,841,870.56	2.77%
31	600207	安彩高科	12,600,373.72	2.72%
32	600563	法拉电子	12,438,055.66	2.68%
33	600050	中国联通	12,224,424.48	2.64%
34	000528	桂柳工 A	12,021,580.00	2.59%
35	600205	山东铝业	10,613,965.25	2.29%
36	000625	长安汽车	10,433,147.75	2.25%
37	000825	太钢不锈	10,413,082.77	2.25%

38	600547	山东黄金	10,070,209.30	2.17%
39	600740	山西焦化	9,601,973.50	2.07%
40	600690	青岛海尔	9,438,871.55	2.04%
41	000898	鞍钢新轧	9,414,852.49	2.03%
42	000933	神火股份	9,398,989.19	2.03%
43	600362	江西铜业	9,371,047.52	2.02%

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：	1,439,757,528.03
卖出股票的收入总额：	1,472,345,627.93

(五)、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	68,008,484.00	15.02%
2	金融债券	25,000,000.00	5.52%
3	可转换债券	18,143,633.70	4.01%
	合计	111,152,117.70	24.55%

(六)、基金投资前五名债券明细

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	010103	21 国债(3)	313,950	30,465,708.00	6.73%
2	040404	04 农发 04	250,000	25,000,000.00	5.52%
3	010004	20 国债(4)	251,200	23,318,896.00	5.15%
4	110010	钢联转债	183,510	18,143,633.70	4.01%
5	010401	04 国债(1)	102,000	9,963,360.00	2.20%

(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	深圳结算保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	11,636,087.37
3	应收利息	1,379,672.70
	合计	13,765,760.07

### 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
-	-	-	-	-	-

## 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	29,199	-
平均每户持有基金份额	17,124	-
机构投资者持有的基金份额	263,509,510	52.70%
个人投资者持有的基金份额	236,490,490	47.30%

### 前十名持有人的名称

序号	持有人名称	份额(份)	占总份额的比例
1	中国人民财产保险股份有限公司	43,536,552	8.71%
2	中国人寿保险(集团)公司	43,021,930	8.60%
3	中国人寿保险股份有限公司	42,205,416	8.44%
4	中国太平洋保险公司	26,969,699	5.39%
5	泰康人寿保险股份有限公司	18,045,672	3.61%
6	中国再保险公司	10,887,393	2.18%
7	中国平安保险(集团)股份有限公司	8,862,021	1.77%
8	新华人寿保险股份有限公司	7,082,218	1.42%
9	天安保险股份有限公司	5,100,360	1.02%
10	招商证券股份有限公司	4,513,408	0.90%

## 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

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:70,000.00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)基金租用证券公司专用交易席位的有关情况:

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	占总成交量比例	佣金	占总佣金比例
上海证券有限责任公司	2	324,476,439.95	11.26%	264,249.87	11.35%
中国民族证券有限责任公司	1	328,714,316.04	11.40%	268,828.94	11.55%
国泰君安证券股份有限公司	1	406,728,687.49	14.11%	318,271.88	13.67%
招商证券股份有限公司	1	360,717,863.41	12.51%	282,267.08	12.12%
兴业证券股份有限公司	1	805,677,813.24	27.95%	658,201.81	28.27%
长城证券有限责任公司	1	656,378,164.87	22.77%	536,175.01	23.03%
合计	7	2,882,693,285.00	100.00%	2,327,994.59	100.00%

(2). 债券及回购交易情况:

券商名称	债券成交量	占总成交量比例	回购成交量	占总成交量比例
------	-------	---------	-------	---------

上海证券有限责任公司	53,837,370.00	18.67%	122,000,000.00	26.30%
中国民族证券有限责任公司	16,402,771.60	5.69%	55,000,000.00	11.86%
国泰君安证券股份有限公司	16,581,092.49	5.75%	0.00	0.00%
招商证券股份有限公司	18,165,017.40	6.30%	0.00	0.00%
兴业证券股份有限公司	75,741,235.00	26.27%	185,800,000.00	40.06%
长城证券有限责任公司	107,590,428.30	37.32%	101,000,000.00	21.78%
合 计	<u>288,317,914.79</u>	100.00%	<u>463,800,000.00</u>	100.00%

### 3、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。

### 4、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；

(4)、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，经与托管人中国工商银行协商，华安基金管理有限公司对《安瑞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。

前款所涉重大事件已作为临时报告在中国证券报、上海证券报、证券时报上披露。

## 十一、备查文件目录

- 1、中国证监会批准安瑞证券投资基金设立的文件；
- 2、《安瑞证券投资基金基金合同》；
- 3、《安瑞证券投资基金扩募说明书》；
- 4、《安瑞证券投资基金托管协议》；
- 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