

安顺证券投资基金 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：二〇〇五年三月二十九日

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	5
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
3、	基金收益分配情况	6
四、	管理人报告	6
1、	基金经理	6
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	8
五、	托管人报告	8
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.....	11
(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	21
(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	23
(六)、	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	24
(一)、	基金份额持有人户数和持有人结构.....	24
(二)、	前十名持有人的名称.....	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:	安顺证券投资基金
基金简称:	基金安顺
交易代码:	500009
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1999 年 6 月 15 日
期末基金份额总额:	30 亿份
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

2、基金的投资

投资目标: 本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

本基金主要投资于成长型上市公司,并兼顾对收益型上市公司及债券的投资,从而使投资者在承受一定风险的情况下,有可能享受到较高的资本利得和稳定的收益。

投资策略: 本基金为平衡型基金,兼顾资本利得、红利及利息收入。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%,现金等货币性资产比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中,60%左右投资于具有良



好成长性的上市公司股票, 40%左右投资于收益型上市公司股票, 在此基础上各自上下浮动10%。

本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好, 在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势, 财务状况良好, 能保持较高的业绩增长, 预期收入或利润增长率不低于同期GDP的增长率。

本基金界定的收益型股票主要指经营状况良好、利润来源稳定, 具有良好分红能力, 预期每股收益高于市场平均水平, 预期市盈率低于市场平均水平的上市公司的股票。

业绩比较基准: 无
风险收益特征: 无

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：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 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

1、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	255,969,600.45	-7,809,380.23	42,034,297.09	42,034,297.09
基金份额本期净收益	0.0853	-0.0026	0.0140	0.0140
期末可供分配基金收益	33,062,073.64	68,255,840.78	-108,516,998.87	-108,516,998.87
期末可供分配基金份额收益	0.0110	0.0228	-0.0362	-0.0362
期末基金资产净值	3,033,062,073.64	3,240,554,278.00	2,891,483,001.13	2,891,483,001.13
期末基金份额净值	1.0110	1.0802	0.9638	0.9638
基金加权平均净值收益率	7.75%	-0.25%	1.31%	1.32%
本期基金份额净值增长率	2.24%	12.08%	-9.12%	-9.12%
基金份额累计净值增长率	55.93%	52.54%	36.10%	36.10%

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、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

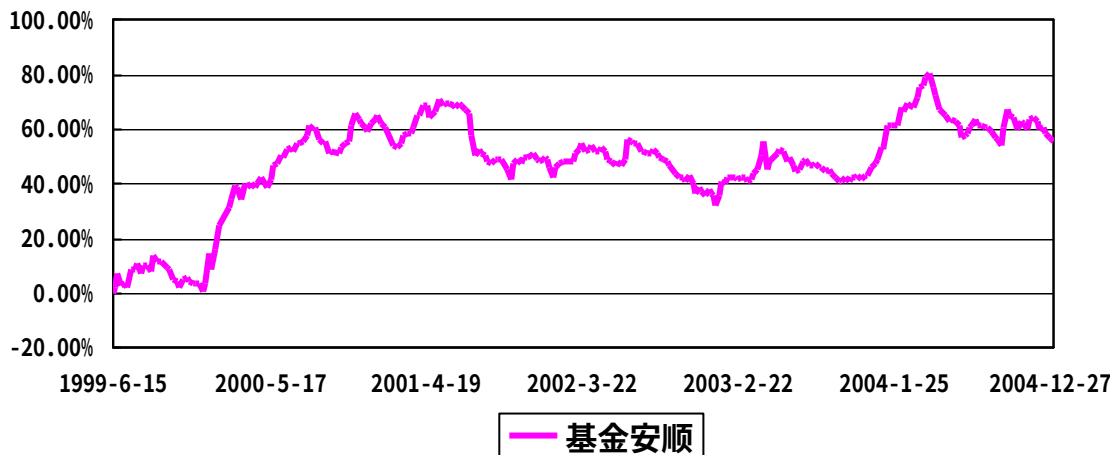
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
三个月	-5.36%	1.40%	-	-	-	-
六个月	-1.75%	1.69%	-	-	-	-
一年	2.24%	1.81%	-	-	-	-
三年	4.14%	1.68%	-	-	-	-
五年	50.31%	1.98%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	55.93%	2.06%	-	-	-	-

备注：本基金合同中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



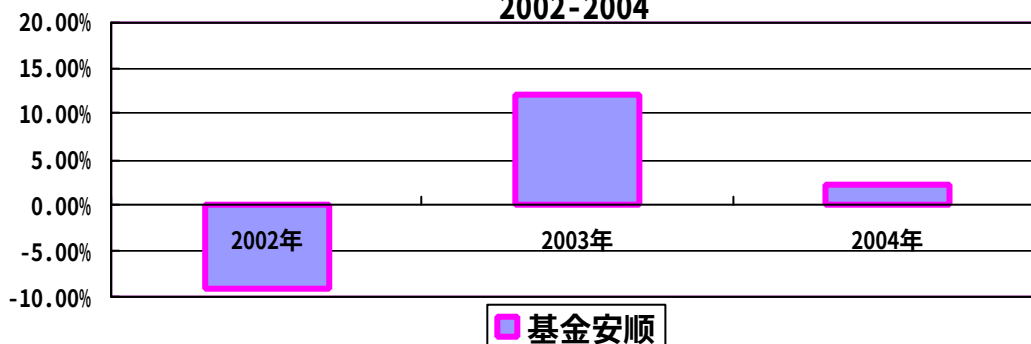
基金安顺份额累计净值增长率历史走势图
1999/6/15-2004/12/31



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

基金安顺过往三年每年的净值增长率的柱状图
2002-2004



3、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	0.970 元	—
2003 年度	-	—
2002 年度	1.100 元	—

四、 管理人报告

1、 基金经理

尚志民 先生：工商管理硕士，9 年证券、基金从业经验，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。现任基金投资部副总监、基金安顺基金经理。

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、《安顺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

2004 年 12 月 31 日，上证综合指数收于 1266.50 点，全年跌 15.4%。深证综合指数收于 315.81 点，全年跌 16.6%，与全球大多数股指表现形成鲜明对比。经过不懈努力，本基金业绩在逆市场取得正收益的同时，向基金投资者派送了较为丰厚的现金红利。

2004 年是中国 A 股投资者遭受重大心理挫折与财力挫折的一年，也是大事颇多的一年，例如国务院《关于推进资本市场改革开放和稳定发展的若干意见》的出台，开放式基金募集金额创出新纪录，中央政府加强宏观调控，中小板设立，诚信危机、投资者信心屡创新低等等。尽管股市获得了前所未有的政策支持，但市场难见起色，期间虽有阶段性上涨，但后又进入阴跌态势。上半年，本基金在景气度持续提高的周期性行业中的高比例配置获得较高回报的同时，积极在消费类股票中及时布局，在随后宏观调控对周期性行业产生负面影响的过程中，使组合仍取得持续稳定的超额收益。下半年，针对市场疲弱走势，本基金陆续降低股票仓位并采取了相当保守的投资策略，在 9 月中下旬的短暂反弹行情中表现较为逊色。

对于处于五年多来低位的股市，尽管结构调整及国际接轨压力犹存，且对未来股权分置问题的解决仍存在不确定性，上市公司总体质量及治理结构还不尽如人意，但经过充分调整后，随着具有估值优势的上市公司逐渐增多、理性投资理念的影响越来越大以及股市中中长期资金入市比例提高，新一轮上扬行情仍可期待。我们认为，经历过对周期性行业投资的起落后，投资者对成长性的关注更甚于对市盈率的关注。对上市公司的成长稳定性、成长空间、成长质量等方面的衡量是今后投资过程中重要考虑因素。我们长期以来一直关注具核心竞争力且持续增长能力突出以及具有独特资源优势的上市公司，将成为更多投资者的共识。我们将采取“抓大放小”策略，即在把握大市值蓝筹公司机会的同时，加强对中小市值公司的挖掘，相信部分极具成长潜力的小市值公司会带来超额回报。另外，我们也将努力把握制度因素变化引致的投资机会及机构博弈日趋激烈背景下产生的阶段性机会。

本基金在报告期内顺利完成了较高比例的现金分红，继续秉承努力回报基金持有人的传统。我们将努力以更好的业绩和分红回报增强饱受封闭式基金严重折价交易状况困扰的投资者的长期信心。

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，托管人在安顺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顺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顺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 10426 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 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《安顺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

周 琪

张 昕

中国·上海

二〇〇五年三月七日

七、财务会计报告

单位：人民币元

(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		339,471,111.58	132,739,785.05
清算备付金		22,717,957.97	17,093,370.39
交易保证金		250,000.00	250,000.00
应收证券清算款		65,404,832.11	9,739,305.88
应收利息	6(1)	11,839,890.42	8,694,690.28
股票投资市值		1,855,584,361.62	2,232,246,604.55
其中：股票投资成本		1,840,569,715.13	2,058,624,655.35
债券投资市值		744,699,564.30	878,782,186.30
其中：债券投资成本		759,877,578.01	880,105,698.28
资产合计		<u>3,039,967,718.00</u>	<u>3,279,545,942.45</u>
负债：			
应付证券清算款		-	30,954,654.05
应付管理人报酬		3,921,073.30	4,022,372.83
应付托管费		653,512.23	670,395.45
应付佣金	6(3)	1,581,058.83	2,474,242.12
其他应付款	6(4)	500,000.00	500,000.00
预提费用	6(5)	250,000.00	370,000.00
负债合计		<u>6,905,644.36</u>	<u>38,991,664.45</u>
所有者权益：			
实收基金	6(6)	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得	6(7)	-163,367.22	172,298,437.22
未分配收益		33,225,440.86	68,255,840.78
持有人权益合计		<u>3,033,062,073.64</u>	<u>3,240,554,278.00</u>
负债和所有者权益合计		<u>3,039,967,718.00</u>	<u>3,279,545,942.45</u>
所附附注为本会计报表的组成部分			

(二)、经营业绩表

项 目	附注	2004年度	2003年度
收入：			
股票差价收入	6(8)	289,365,574.62	11,626,586.00
债券差价收入	6(9)	-29,049,607.04	-17,650,658.84
债券利息收入		24,963,509.54	23,780,295.62
存款利息收入		4,264,182.57	3,909,146.11
股利收入		26,622,949.70	28,405,904.77
买入返售证券收入		1,041,315.07	588,639.15
其他收入	6(10)	210,283.85	307,967.96
收入合计		<u>317,418,208.31</u>	<u>50,967,880.77</u>
费用：			
基金管理人报酬		49,743,009.43	46,169,664.57
基金托管费		8,290,501.61	7,696,886.15
卖出回购证券支出		1,945,644.23	4,289,815.41
其他费用	6(11)	1,469,452.59	620,894.87
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		340,000.00	340,000.00
审计费用		130,000.00	130,000.00
费用合计		<u>61,448,607.86</u>	<u>58,777,261.00</u>
基金净收益		<u>255,969,600.45</u>	<u>-7,809,380.23</u>
加：未实现估值增值变动数		<u>-172,461,804.44</u>	<u>356,880,657.10</u>
基金经营业绩		<u>83,507,796.01</u>	<u>349,071,276.87</u>
所附附注为本会计报表的组成部分			

(三)、收益分配表

项 目	附注	2004年度	2003年度
本期基金净收益		255,969,600.45	-7,809,380.23
加：期初未分配收益		68,255,840.78	76,065,221.01
可供分配基金净收益		324,225,441.23	68,255,840.78
减：本期已分配基金净收益	6(12)	291,000,000.37	-
期末基金未分配净收益		<u>33,225,440.86</u>	<u>68,255,840.78</u>
所附附注为本会计报表的组成部分			

(四)、 净值变动表

项 目	附注	2004年度	2003年度
一、期初基金净值		3,240,554,278.00	2,891,483,001.13
二、本期经营活动：			
基金净收益		255,969,600.45	-7,809,380.23
未实现估值增值变动数		-172,461,804.44	356,880,657.10
经营活动产生的基金净值变动数		83,507,796.01	349,071,276.87
三、本期向持有人分配收益 6(12)		-291,000,000.37	-
四、期末基金净值		3,033,062,073.64	3,240,554,278.00

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

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[1999]15 号
核准文件名称：《关于同意设立安顺证券投资基金的批复》
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：1999 年 6 月 15 日
基金合同生效日的基金份额：3,000,000,000.00
基金募集期间：1999 年 6 月 9 日至 1999 年 6 月 15 日
募集资金总额：3,000,000,000.00
募集资金的银行存款利息（折算为投资者的基金份额）：0.00
验资机构名称：大华会计师事务所

2. 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

公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计年度为 2004 年 1 月 1 日至 2004 年 12 月 31 日。

3) 记账本位币
人民币。

4) 记账基础和计价原则
权责发生制。



5) 基金资产的估值原则

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。

6) 证券投资的成本计价方法

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计入债券投资成本,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计入债券投资成本,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

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。

9) 费用的确认和计量

①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，并按计提的金额入帐。

②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，并按计提的金额入帐。

③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帐。

④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

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。

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

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。

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

2004 年度无会计政策、会计估计变更。

13) 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。

3. 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。

4. 资产负债表日后事项

无。

5. 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、 银行间市场交易	基金合同、成 交确认书
天同证券有限责任公司	基金发起人、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	基金发起人、管理公司 股东	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
东方证券股份有限公司	管理公司股东	租用交易席位	席位使用协议
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、银行间市 场交易	席位使用协 议、成交确认 书

* 股东为上海国际信托投资公司，系基金发起人和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

①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	1,420,278,922.30	15.73%	1,143,060.80	15.69%	0.08%
天同证券有限责任公司	297,721,152.31	3.30%	240,062.64	3.30%	0.08%
方正证券有限责任公司	302,922,212.33	3.35%	237,039.85	3.25%	0.08%
东方证券股份有限公司	307,839,128.75	3.41%	240,887.28	3.31%	0.08%
合 计	2,328,761,415.69	25.79%	1,861,050.57	25.55%	

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	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%	

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

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

②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	217,686,024.59	14.63%	-	-
天同证券有限责任公司	17,826,518.60	1.20%	-	-
方正证券有限责任公司	30,276,414.27	2.04%	-	-
东方证券有限责任公司	90,982,518.29	6.12%	-	-
合 计	356,771,475.75	23.99%	-	-

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	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%

③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	348,785,000.00	59,772,000.00	-	-	-	-
上海证券	242,763,452.06	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	12,000,000.00	3,096.99

(3). 关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费，按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，具体计算方法如下：

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计算。

本基金成立六个月后，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。计算方法为：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金在本报告期间需支付基金管理费 49,743,009.43 元。（上年度：46,169,664.57 元）

② 基金托管费

本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

本基金在本报告期间需支付基金托管费 8,290,501.61 元。（上年度：7,696,886.15 元）

6. 基金会计报表重要项目的说明

(1). 应收利息明细：	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
明细项目		
银行存款利息	123,359.11	101,723.92
清算备付金利息	6,275.86	6,090.12
债券利息	11,710,255.45	8,586,876.24
买入返售证券利息	-	-
合计	11,839,890.42	8,694,690.28
(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	15,014,646.49	173,621,949.20
债券估值增值余额	-15,178,013.71	-1,323,511.98
合计	-163,367.22	172,298,437.22
(3). 应付佣金明细：	2004 年 12 月 31 日	2003 年 12 月 31 日
明细项目		
申银万国证券股份有限公司	152,971.55	665,043.79
天同证券有限责任公司	72,920.22	-
方正证券有限责任公司	29,705.24	7,638.09
华夏证券股份有限公司	207,325.53	224,074.29
招商证券股份有限公司	286,512.00	201,627.43
南方证券股份有限公司	9,898.16	-
东方证券股份有限公司	30,663.75	-
国泰君安证券股份有限公司	610,694.64	540,062.42
海通证券股份有限公司	-	835,796.10
中国国际金融有限公司	180,367.74	-
合计	1,581,058.83	2,474,242.12
(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	500,000.00	500,000.00
(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	120,000.00	240,000.00
审计费用	130,000.00	130,000.00
合计	250,000.00	370,000.00
(6). 实收基金变动明细：	2004 年	2003 年

19



分红手续费	873,000.00	-
交易所费用	26,608.59	59,413.17
其他	39,844.00	31,481.70
合计	1,469,452.59	620,894.87

(12). 基金收益分配：

	分红公告日	权益登记日	除息日	每10份基金份额收益分配金额	收益分配金额
本期第1次分红	2004-3-29	2004-4-1	2004-4-2	0.22 元	66,000,000.00
本期第2次分红	2004-6-19	2004-6-23	2004-6-24	0.75 元	225,000,000.37
本期累计收益分配金额				0.97 元	291,000,000.37

7. 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，则按当日市场平均价计价。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	受限期限
振华港机	765,374	6,697,022.50	7,049,094.54	市价	增发部分未上市	至 2005 年 3 月 31 日
金地集团	649,755	5,834,799.90	6,458,564.70	市价	增发部分未上市	至 2005 年 1 月 6 日
合计		12,531,822.40	13,507,659.24			

(2)、本基金截止本报告期末流通受限债券情况如下：

债券名称	数量	总成本	总市值	估值方法	转让受限原因	受限期限
-	-	-	-	-	-	-

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	1,855,584,361.62	61.04
2	债券	744,699,564.30	24.50
3	银行存款和清算备付金合计	362,189,069.55	11.91
4	其他资产	77,494,722.53	2.55
	合计	3,039,967,718.00	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	16,397,946.80	0.54
B	采掘业	175,864,600.00	5.80
C	制造业	1,376,853,195.61	45.40
C0	制造业—食品、饮料	186,122,475.45	6.14
C1	制造业—纺织、服装、皮毛	228,620,334.28	7.54
C4	制造业—石油、化学、塑胶、塑料	459,303,003.30	15.14
C5	制造业—电子	27,093,157.40	0.89
C6	制造业—金属、非金属	247,193,843.18	8.15
C7	制造业—机械、设备、仪表	195,492,870.00	6.45
C8	制造业—医药、生物制品	897,512.00	0.03
C99	制造业—其他	32,130,000.00	1.06
D	电力、煤气及水的生产和供应业	29,184,898.00	0.96
F	交通运输、仓储业	24,143,839.76	0.80
G	信息技术业	37,113,000.00	1.22
J	房地产业	134,466,881.45	4.43
K	社会服务业	61,560,000.00	2.03
	合计	1,855,584,361.62	61.18

(三)、 股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	市值(元)	占资产净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	35,888,001	216,404,646.03	7.13
2	600851	海欣股份	20,091,618	199,710,682.92	6.58
3	600028	中国石化	33,580,000	146,744,600.00	4.84
4	600519	贵州茅台	3,690,711	135,264,558.15	4.46
5	000402	金融街	12,300,475	122,143,716.75	4.03
6	000866	扬子石化	11,177,777	122,061,324.84	4.02
7	000792	盐湖钾肥	13,608,000	115,804,080.00	3.82
8	600309	烟台万华	8,050,000	102,235,000.00	3.37
9	000527	美的电器	12,000,000	86,640,000.00	2.86
10	600636	三爱富	8,200,900	66,919,344.00	2.21
11	600320	振华港机	7,100,000	65,391,000.00	2.16
12	000069	华侨城A	9,000,000	61,560,000.00	2.03
13	000911	南宁糖业	5,399,990	44,657,917.30	1.47
14	600406	国电南瑞	2,780,000	37,113,000.00	1.22
15	600367	红星发展	5,680,000	35,045,600.00	1.16
16	600210	紫江企业	9,000,000	32,130,000.00	1.06
17	000933	神火股份	2,000,000	29,120,000.00	0.96
18	000726	鲁泰A	2,680,000	25,486,800.00	0.84
19	600011	华能国际	2,888,800	20,857,136.00	0.69



20	600460	士 兰 微	1,700,000	19,975,000.00	0.66
21	002031	巨轮股份	1,989,900	19,222,434.00	0.63
22	600066	宇通客车	2,000,000	18,840,000.00	0.62
23	600598	北 大 荒	2,688,188	16,397,946.80	0.54
24	000960	锡业股份	2,500,000	16,025,000.00	0.53
25	600096	云 天 化	1,500,382	15,799,022.46	0.52
26	600009	上海机场	990,000	15,048,000.00	0.50
27	002032	苏 泊 尔	1,505,015	14,764,197.15	0.49
28	600383	金地集团	1,239,755	12,323,164.70	0.41
29	600333	长春燃气	1,075,700	8,239,862.00	0.27
30	600563	法拉电子	494,660	7,118,157.40	0.23
31	000895	双汇发展	500,000	6,200,000.00	0.20
32	600428	中远航运	498,652	5,624,794.56	0.19
33	002028	思源电气	214,800	5,277,636.00	0.17
34	002023	海特高新	199,945	3,471,045.20	0.11
35	002029	七 匹 狼	378,634	3,422,851.36	0.11
36	600352	浙江龙盛	190,800	1,438,632.00	0.05
37	000538	云南白药	58,280	897,512.00	0.03
38	600089	特变电工	10,000	121,800.00	0.00
39	600900	长江电力	10,000	87,900.00	0.00

(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动

1、 累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或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	占期初基金资产净值的比例(%)
1	600019	宝钢股份	462,496,278.05	14.27
2	600028	中国石化	288,570,759.19	8.90
3	600104	上海汽车	234,112,217.32	7.22
4	600900	长江电力	192,104,419.68	5.93
5	000402	金 融 街	188,291,949.46	5.81
6	000866	扬子石化	187,409,367.44	5.78
7	600002	齐鲁石化	168,781,647.89	5.21
8	600009	上海机场	140,676,105.12	4.34
9	000069	华侨城 A	124,216,667.92	3.83
10	600519	贵州茅台	123,316,952.28	3.81
11	600210	紫江企业	119,778,382.14	3.70
12	000527	美的电器	117,390,370.79	3.62
13	600636	三 爱 富	97,125,652.37	3.00
14	000088	盐田港 A	91,535,152.84	2.82
15	600497	驰宏锌锗	73,189,239.82	2.26
16	600036	招商银行	73,010,126.14	2.25

17	600320	振华港机	71,844,018.27	2.22
18	000911	南宁糖业	70,655,427.00	2.18
19	000012	南 玻 A	68,895,582.79	2.13
20	600367	红星发展	66,138,878.97	2.04

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	600009	上海机场	385,779,089.31	11.90
2	600002	齐鲁石化	323,262,229.36	9.98
3	600050	中国联通	306,674,393.79	9.46
4	600036	招商银行	254,972,315.35	7.87
5	600019	宝钢股份	241,070,948.88	7.44
6	600900	长江电力	219,025,502.14	6.76
7	600104	上海汽车	209,445,385.59	6.46
8	600028	中国石化	127,572,371.26	3.94
9	000866	扬子石化	123,249,850.58	3.80
10	600011	华能国际	111,789,498.19	3.45
11	600210	紫江企业	97,443,152.90	3.01
12	600367	红星发展	92,568,778.12	2.86
13	600016	民生银行	87,596,813.84	2.70
14	600591	上海航空	77,092,360.65	2.38
15	600583	海油工程	76,795,558.46	2.37
16	000088	盐田港 A	76,775,512.90	2.37
17	000659	珠海中富	76,414,841.77	2.36
18	600205	山东铝业	74,063,279.56	2.29
19	600584	长电科技	71,347,718.71	2.20
20	600497	驰宏锌锗	70,421,043.89	2.17
21	000024	招商地产	67,908,106.30	2.10
22	000012	南 玻 A	66,927,730.53	2.07

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：	4,329,178,937.94
卖出股票的收入总额：	4,840,683,097.30

(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	355,244,616.70	11.71
2	金融债券	327,128,900.00	10.79
3	企业债券	-	-
4	可转换债券	62,326,047.60	2.05
	合计	744,699,564.30	24.55

(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	040206	04 国开 06	2,300,000	230,598,000.00	7.60
2	010103	21 国债(3)	1,301,940	126,340,257.60	4.17
3	010405	04 国债(5)	1,083,830	101,880,020.00	3.36
4	020011	02 国债 11	1,000,000	91,510,000.00	3.02
5	040222	04 国开 22	500,000	49,295,000.00	1.63

(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，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。

本基金投资的前十名股票中，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	250,000.00
2	证券清算款	65,404,832.11
3	应收利息	11,839,890.42
	合计	77,494,722.53

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	100795	国电转债	270,630	29,076,487.20	0.96
2	100726	华电转债	183,610	19,115,637.10	0.63
3	100096	云化转债	2,000	291,160.00	0.01

九、基金份额持有人户数和持有人结构

(一)、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	99,595	-
平均每户持有基金份额	30,121.99	-

机构投资者持有的基金份额	1,322,404,004	44.08
个人投资者持有的基金份额	1,677,595,996	55.92

(二)、 前十名持有人的名称

序号	项目	份额(份)	占总份额的比例(%)
1	中国人寿保险股份有限公司	291,941,179	9.73
2	中国太平洋保险公司	216,804,465	7.23
3	中国人寿保险(集团)公司	160,426,552	5.35
4	中国人民财产保险股份有限公司	127,700,100	4.26
5	中国再保险公司	65,903,346	2.20
6	上海久事公司	61,366,393	2.05
7	中国平安保险(集团)股份有限公司	61,324,574	2.04
8	中卫国脉通信股份有限公司	40,912,900	1.36
9	中保再保险有限公司	15,890,000	0.53
10	中国铁道建筑总公司	15,300,000	0.51

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)、 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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。

	分红公告日	权益登记日	除息日	每10份基金 份额收益分 配金额	收益分配金额
本期第1次分红	2004-3-29	2004-4-1	2004-4-2	0.22 元	66,000,000.00
本期第2次分红	2004-6-19	2004-6-23	2004-6-24	0.75 元	225,000,000.37
本期累计收益分 配金额				0.97 元	291,000,000.37

(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：支付上海立信长江会计师事务所有限公司 130,000.00 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：

在本报告期内，基金新增租用中信证券股份有限公司和中国国际金融有限公司各一个专用交易席位。

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(%)
申银万国证券股份有限公司	2	1,420,278,922.30	15.73	1,143,060.80	15.69
海通证券股份有限公司	1	686,734,082.26	7.61	558,112.63	7.66
天同证券有限责任公司	2	297,721,152.31	3.30	240,062.64	3.30
方正证券有限责任公司	1	302,922,212.33	3.35	237,039.85	3.25
华夏证券股份有限公司	2	1,011,530,877.56	11.20	804,600.16	11.04

招商证券股份有限公司	2	987,368,361.74	10.94	789,665.48	10.84
南方证券股份有限公司	2	106,768,418.66	1.18	83,547.68	1.15
东方证券股份有限公司	2	307,839,128.75	3.41	240,887.28	3.31
中信证券股份有限公司	1	1,563,228,715.80	17.32	1,276,790.70	17.53
国泰君安证券股份有限公司	1	2,123,538,923.36	23.52	1,730,357.62	23.75
中国国际金融有限公司	1	219,961,049.55	2.44	180,367.74	2.48
合计	17	9,027,891,844.62	100.00	7,284,492.58	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	217,686,024.59	14.63	-	-
海通证券股份有限公司	32,857,535.30	2.21	480,500,000.00	23.05
天同证券有限责任公司	17,826,518.60	1.20	-	-
方正证券有限责任公司	30,276,414.27	2.04	-	-
华夏证券股份有限公司	136,691,715.34	9.19	-	-
招商证券股份有限公司	138,867,584.35	9.33	750,700,000.00	36.01
南方证券股份有限公司	197,534.90	0.01	-	-
东方证券股份有限公司	90,982,518.29	6.12	-	-
中信证券股份有限公司	149,413,942.60	10.04	401,600,000.00	19.27
国泰君安证券股份有限公司	672,996,008.10	45.23	451,600,000.00	21.67
中国国际金融有限公司	-	-	-	-
合计	1,487,795,796.34	100.00	2,084,400,000.00	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，并能为本基金提供全面的信息服；

(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，经与托管人交通银行协商，华安基金管理有限公司对《安顺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。

十一、备查文件目录

- 1、《安顺证券投资基金基金合同》
- 2、《安顺证券投资基金招募说明书》



- 3、《安顺证券投资基金托管协议》
- 4、《安顺证券投资基金 2004 年年度报告》
- 5、中国证监会批准安顺证券投资基金设立的文件；
- 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原件；
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 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