



# 安信证券投资基金 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 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
3、	基金收益分配情况	6
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	9
五、	托管人报告	9
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	12
(四)、	净值变动表	13
(五)、	会计报表附注	13
八、	投资组合报告	21
(一)、	基金资产组合	21
(二)、	股票投资组合	21
(三)、	股票明细	22
(四)、	报告期内股票投资组合的重大变动	23
(五)、	债券投资组合	25
(六)、	前五名债券明细	25
(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	26
(一)、	基金份额持有人户数和持有人结构	26
(二)、	前十名持有人的名称	26
十、	重大事件	26
十一、	备查文件目录	30

## 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

### 1、基金概况

基金名称:	安信证券投资基金
基金简称:	基金安信
交易代码:	500003
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1998 年 6 月 22 日
期末基金份额总额:	20 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:	1998 年 6 月 26 日

### 2、基金的投资

**投资目标:** 本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险,确保基金资产的安全,并谋求基金长期稳定的投资收益。

**投资策略:** 本基金为成长型基金,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,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。

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@huaan.com.cn  
客户服务热线： 021-68604666

### 4、 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  
( 邮政编码：100032 )  
法定代表人： 姜建清  
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

### 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.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

### 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	112,880,046.16	-27,314,088.29	24,130,192.19	24,130,192.19
基金份额本期净收益	0.0564	-0.0137	0.0121	0.0121
期末可供分配基金收益	13,831,209.21	20,951,163.05	-161,675,823.15	-161,675,823.15
期末可供分配基金份额收益	0.0069	0.0105	-0.0808	-0.0808
期末基金资产净值	2,035,119,374.06	2,141,445,770.54	1,838,324,176.85	1,838,324,176.85
期末基金份额净值	1.0176	1.0707	0.9192	0.9192
基金加权平均净值收益率	5.26%	-1.37%	1.14%	1.18%
本期基金份额净值增长率	0.70%	16.48%	-10.28%	-10.28%
基金份额累计净值增长率	128.54%	126.96%	94.85%	94.85%

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

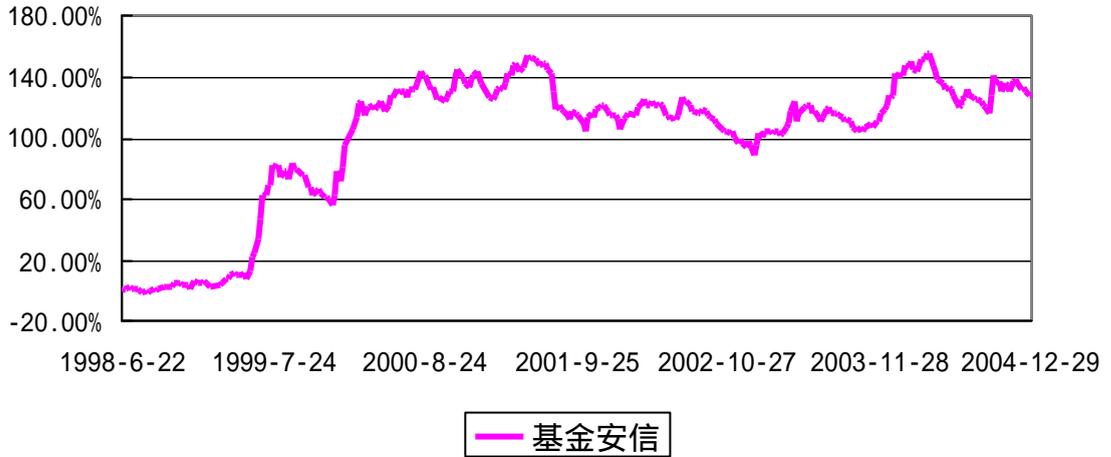
阶段	净值 增长率	净值增长率 标准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
三个月	-3.40%	1.47%	-	-	-	-
六个月	2.87%	2.06%	-	-	-	-
一年	0.70%	1.98%	-	-	-	-
三年	5.24%	1.77%	-	-	-	-
五年	40.67%	2.05%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	128.54%	2.30%	-	-	-	-

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

基金安信份额累计净值增长率历史走势图

1998/6/22-2004/12/31

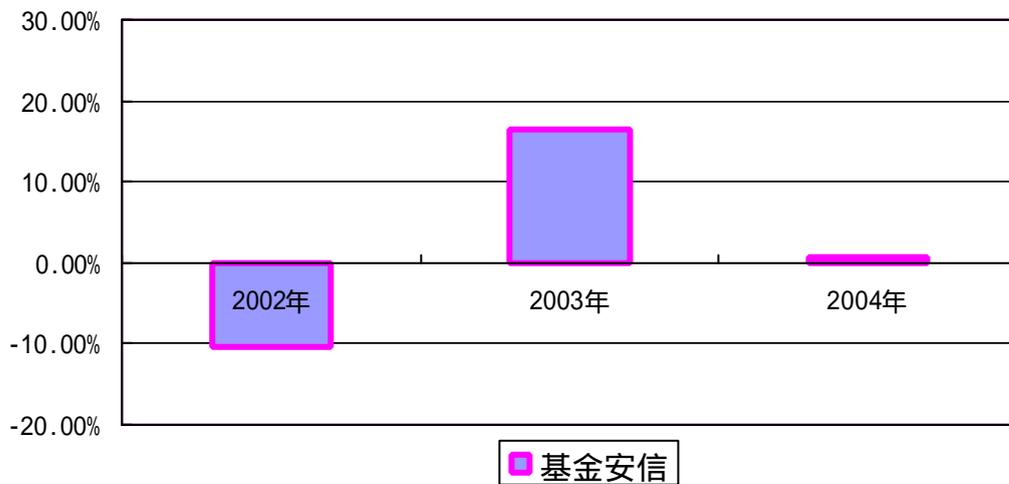


C、图示基金过往三年每年的净值增长率

基金过往三年每年的净值增长率的柱状图

基金安信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	0.600 元	-
2003 年度	-	-
2002 年度	2.300 元	-

## 四、 管理人报告

### 1、 基金经理

林彤彤先生：工商管理硕士，12 年银行、证券从业经历。曾就职于中国银行漳州分行信贷管理处，进入华安基金管理有限公司后先后担任研究发展部高级研究员、基金安信、基金安顺、基金安瑞、基金安久的基金经理。现任基金安信的基金经理。

### 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、《安信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，我国宏观经济继续保持快速运行，由于政府及时采取了“有保有压”的宏观经济调控政策，使得经济成功避免了因投资过热而可能产生的大起大落，GDP 增长速度在二季度创下 9.9% 的高点之后小幅回落，但全年仍保持在 9% 以上的高水平。

虽说 2004 年的中国股市并未明显扭转超过三年的熊市格局，但这一年里，股市的运行也呈现出与以往不同的几个特点。

首先是股市的涨跌与国民经济运行息息相关。与宏观经济前高后低的运行形态相似，2004 年的股市也呈现出典型的前高后低走势，固定资产投资增长速度及 GDP 一度达到 47.8% 及 9.9% 的增幅，上证综指及深综指也均在 4 月份达到了全年的高点。之后，伴随着宏观调控政策的出台及 GDP 增速的逐级滑落，两市大盘也再度陷入了持续阴跌的不利局面，不仅将四个月的涨幅尽数抹去，而且全年的跌幅超过 15%。

其次是上市公司基本面对股价的影响力得到淋漓尽致的体现。受益于超高的固定资产投资增长速度，与此高度相关的钢铁、有色、机械、石化等周期性行业盈利水平纷纷创下近几年最好水平，相关上市公司股价也屡创历史新高。而轿车类上市公司的股价走势则是另一个例证，由于轿车价格的持续下降及库存量的大量增加，市场担心相关上市公司的盈利能力会受到较大负面影响，为回避风险而纷纷抛售股票，导致轿车股票成了 2004 年度跌幅最大的板块之一。

最后，估值水平与国际接轨的步伐大大加快。估值问题是 2004 年中国股市讨论最多的话题之一，青岛啤酒、海螺水泥、兖州煤业、中兴通讯的 A 股股价接近甚至超过 H 股股价，使得国内投资者不得不感叹中国证券市场国际化进程的速度。

2004 年基金安信净值增长率为 0.70%，不仅远好于同期沪深两市股指表现，同时所有封闭式基金中也名列前四分之一，回顾全年的操作，有以下几点经验希望和投资者分享：

首先是股票选择方面。安信一直非常看重公司的成长性，并信守以下三条选股标准：第一，是否具有独特的、不可复制的核心竞争力；第二，企业的成长能否不受经济周期的影响，或者说影响程度很小；第三，成长性是否具备可较好的可持续性。基于以上标准，安信重点选择并持有了烟台万华、盐湖钾肥、海油工程等投资品种。上述品种对基金业绩的贡献也是很明显的，不仅成功避免了 4 月份宏观调控所带来的负面影响，而且全年表现遥遥领先。

其次是仓位控制方面。准确判断大势是前提，2004 年基金安信对市场的估计相对准确，仓位控制相对稳健，尤其是 4 月份之后一直将股票仓位控制在 70% 以下，避免了大盘下跌时的较大损失。

最后是投资心态。股市千变万化，稍有不慎便酿成大错，因此在任何时候保持良好的心态极其重要，在经历过股市的“大牛大熊”之后，基金经理的投资心态也逐渐成熟，但仍然不可避免的会受到市场大幅波动的影响，希望在以后会以更加平和的心态做好投资工作。

2005 年中国股市的整体走势在一定程度上与下述三个方面的解决结果相关：

一是股权分置问题。尽管分类表决等增加流通股股东话语权的措施在逐步实施，但客观的说，该问题的最终解决不会一帆风顺，或者说流通股股东的期望值不能过高。

二是估值水平与国际接轨问题。虽然说 A 股市场的总体估值偏高，与国际估值水平接轨是大势所趋，但我们认为这绝不是简单的市盈率接轨，或者说应该具体行业、具体公司分别考虑，部分行业、上市公司的市盈率水平高于香港、美国等发达市场水平是完全可能出现的，甚至是必然的。

三是资金面的供给。随着保险资金直接入市正式实施，开放式基金规模的不断壮大，二级市场资金供给会相对宽松，少数优质公司将日益成为众多资金的追逐对象。

综合以上分析，安信认为 2005 年的中国股市整体性机会不多，但个股盈利机会仍将层出不穷。自 2003 年开始，中国股市告别了齐涨齐跌的现象，“二八现象”将代表着中国股市的发展方向，只是“二”、“八”所代表的股票不是永远不变，而是伴随着企业基本面的变化情况而随时调整。

展望 2005 年，基金安信将充分发挥华安在研究方面的优势，坚持“精选个股”的投资原则，寻找一批具备核心竞争力及持续增长潜力的上市公司进行中长期的投资，为基金持有人提供长期而稳定的投资收益。

最后我们想感谢所有的基金持有人对我们的信任与支持，相信在未来的时间里我们会取得更好的成绩，争取给予你们更多的回报。

#### 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 年度，本托管人在对安信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 年度安信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。

本托管人依法对安信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信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 10430 号

安信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《安信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    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
<b>资产：</b>			
银行存款		148,812,821.79	197,326,012.91
交易保证金		750,000.00	750,000.00
应收证券清算款		11,678,991.68	-
应收利息	6(1)	8,680,480.59	5,790,636.46
股票投资市值		1,338,028,072.07	1,565,436,709.36
其中：股票投资成本		1,305,382,779.49	1,447,655,286.54
债券投资市值		532,623,267.69	546,730,682.90
其中：债券投资成本		543,980,395.42	544,017,498.23
资产合计		<u>2,040,573,633.82</u>	<u>2,316,034,041.63</u>
<b>负债：</b>			
应付证券清算款		-	147,388,602.92
应付管理人报酬		2,612,639.05	2,648,638.34
应付托管费		435,439.82	441,439.72
应付佣金	6(3)	906,180.89	2,489,590.11
其他应付款	6(4)	1,250,000.00	1,250,000.00
卖出回购证券款		-	20,000,000.00
预提费用	6(5)	250,000.00	370,000.00
负债合计		<u>5,454,259.76</u>	<u>174,588,271.09</u>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6(6)	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	6(7)	21,288,164.85	120,494,607.49
未分配收益		13,831,209.21	20,951,163.05
持有人权益合计		<u>2,035,119,374.06</u>	<u>2,141,445,770.54</u>
负债和所有者权益合计		<u>2,040,573,633.82</u>	<u>2,316,034,041.63</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
<b>收入：</b>			
股票差价收入	6(8)	150,792,990.78	-7,271,018.76
债券差价收入	6(9)	-31,233,114.15	-14,933,808.09
债券利息收入		15,418,942.67	16,566,032.77
存款利息收入		1,950,627.30	2,679,453.75
股利收入		15,306,589.59	15,292,416.63
买入返售证券收入		738,610.50	38,255.00
其他收入	6(10)	175,886.21	282,397.04
<b>收入合计</b>		<b>153,150,532.90</b>	<b>12,653,728.34</b>
<b>费用：</b>			
基金管理人报酬		32,296,915.57	29,864,606.76
基金托管费		5,382,819.28	4,977,434.49
卖出回购证券支出		1,650,829.73	4,512,871.82
其他费用	6(11)	939,922.16	612,903.56
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
<b>费用合计</b>		<b>40,270,486.74</b>	<b>39,967,816.63</b>
<b>基金净收益</b>		<b>112,880,046.16</b>	<b>-27,314,088.29</b>
加：未实现估值增值变动数		-99,206,442.64	330,435,681.98
<b>基金经营业绩</b>		<b>13,673,603.52</b>	<b>303,121,593.69</b>

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		112,880,046.16	-27,314,088.29
加：期初未分配收益		20,951,163.05	48,265,251.34
可供分配基金净收益		133,831,209.21	20,951,163.05
减：本期已分配基金净收益	6(12)	120,000,000.00	-
<b>期末基金未分配净收益</b>		<b>13,831,209.21</b>	<b>20,951,163.05</b>

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		2,141,445,770.54	1,838,324,176.85
二、 本期经营活动：			
基金净收益		112,880,046.16	-27,314,088.29
未实现估值增值变动数		-99,206,442.64	330,435,681.98
经营活动产生的基金净值变动数		13,673,603.52	303,121,593.69
三、 本期向持有人分配收益 6(12)		-120,000,000.00	-
四、 期末基金净值		2,035,119,374.06	2,141,445,770.54

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：证监基字[1998]22号  
核准文件名称：《关于同意设立安信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：中国工商银行  
基金合同生效日：1998年6月22日  
基金合同生效日的基金份额：2,000,000,000.00  
基金募集期间：1998年6月16日至1998年6月22日  
募集资金总额：2,000,000,000.00  
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

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。

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计入债券投资成本,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

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

额入帐。

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，并按计提的金额入帐。

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。

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。

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。

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
中国工商银行	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
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
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

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
-----	-----	-------------	----	------------	------------

天同证券有限责任公司	473,789,733.84	6.17%	373,904.54	6.05%	0.08%
上海证券有限责任公司	621,271,097.29	8.09%	500,500.15	8.10%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	1,587,233,998.65	20.66%	1,242,023.19	20.11%	0.08%
合 计	2,682,294,829.78	34.92%	2,116,427.88	34.26%	

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
天同证券有限责任公司	1,158,808,951.05	16.70%	926,590.43	16.67%	0.08%
上海证券有限责任公司	846,687,832.36	12.20%	672,485.85	12.10%	0.08%
申银万国证券股份有限公司	555,507,115.26	8.00%	434,693.80	7.82%	0.08%
合 计	2,561,003,898.67	36.90%	2,033,770.08	36.59%	

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
天同证券有限责任公司	98,542,454.68	11.01%	200,000,000.00	8.84%
上海证券有限责任公司	27,289,280.69	3.05%	331,600,000.00	14.66%
申银万国证券股份有限公司	78,861,260.63	8.81%	-	-
合 计	204,692,996.00	22.87%	531,600,000.00	23.50%

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
天同证券有限责任公司	1,045,163,213.40	16.64%	1,418,300,000.00	32.22%
上海证券有限责任公司	1,035,512,927.10	16.49%	477,900,000.00	10.85%
申银万国证券股份有限公司	307,765,563.10	4.90%	-	-
合 计	2,388,441,703.60	38.03%	1,896,200,000.00	43.07%

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
上海证券	118,810,712.33	-	-	-	-	-

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
-------	------	------	--------	------	--------	------

中国工商银行 - - - - 229,000,000.00 169,460.27

(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，具体计算方法如下：

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

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，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 32,296,915.57 元。（上年度：29,864,606.76 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 5,382,819.28 元。（上年度：4,977,434.49 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	56,498.60	42,621.81
债券利息	8,623,981.99	5,748,014.65
合计	8,680,480.59	5,790,636.46

(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	32,645,292.58	117,781,422.82
债券估值增值余额	-11,357,127.73	2,713,184.67
合计	21,288,164.85	120,494,607.49

(3). 应付佣金明细： 2004 年 12 月 31 日 2003 年 12 月 31 日

明细项目

上海证券有限责任公司	5,234.21	255,951.58
天同证券有限责任公司	36,672.02	441,183.71
招商证券股份有限公司	-	559,752.78
申银万国证券股份有限公司	193,879.50	212,113.40
光大证券有限责任公司	394,088.35	185,330.97
国信证券有限责任公司	15,180.12	-
南方证券有限责任公司	11,738.35	-
大鹏证券有限责任公司	1,164.28	835,257.67
国泰君安证券股份有限公司	132,750.96	-
红塔证券股份有限公司	115,473.10	-
合计	906,180.89	2,489,590.11
 (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	1,250,000.00	1,250,000.00
 (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
明细项目		
期初数	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
期末数	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
 (7). 未实现利得明细：		
	2004 年	2003 年
明细项目		
期初未实现利得：	120,494,607.49	-209,941,074.49
其中：投资估值增值数：	120,494,607.49	-209,941,074.49
本期投资估值增值发生数：	-99,206,442.64	330,435,681.98
期末未实现利得：	21,288,164.85	120,494,607.49
其中：投资估值增值数：	21,288,164.85	120,494,607.49
 (8). 卖出股票：		
	2004 年	2003 年
明细项目		
卖出股票成交总额	4,032,543,764.56	3,532,490,988.68
减：佣金	3,391,981.30	2,980,996.34
成本总额	3,878,358,792.48	3,536,781,011.10

股票差价收入	150,792,990.78	-7,271,018.76			
(9). 卖出债券：	2004 年	2003 年			
<b>明细项目</b>					
卖出债券成交总额	1,196,708,566.68	3,648,241,359.88			
减：成本总额	1,211,382,147.43	3,622,579,835.50			
应收利息总额	16,559,533.40	40,595,332.47			
债券差价收入	-31,233,114.15	-14,933,808.09			
(10). 其他收入：	2004 年	2003 年			
<b>明细项目</b>					
新股、配股手续费返还	170,329.01	209,968.56			
债券认购手续费返还	5,557.20	19,928.48			
认购债券资金利息返还	-	52,500.00			
合计	175,886.21	282,397.04			
(11). 其他费用：	2004 年	2003 年			
<b>明细项目</b>					
审计费	130,000.00	130,000.00			
信息披露费	340,000.00	340,000.00			
上市年费	60,000.00	60,000.00			
分红手续费	360,000.00	-			
交易所费用	22,382.16	55,881.56			
其他	27,540.00	27,022.00			
合计	939,922.16	612,903.56			
(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	0.10 元	20,000,000.00
本期第2次分红	2004-6-19	2004-6-23	2004-6-24	0.50 元	100,000,000.00
本期累计收益分 配金额				0.60 元	120,000,000.00

## 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	561,274	4,911,147.50	5,169,333.54	市价	增发部分未上市	至 2005 年 3 月 31 日
金地集团	266,066	2,389,272.68	2,644,696.04	市价	增发部分未上市	至 2005 年 1 月 6 日
合计		7,300,420.18	7,814,029.58			

(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	1,338,028,072.07	65.57
2	债券	532,623,267.69	26.10
3	银行存款和清算备付金合计	148,812,821.79	7.29
4	其他资产	21,109,472.27	1.04
	合计	2,040,573,633.82	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	20,552,894.70	1.01
B	采掘业	86,600,894.02	4.26
C	制造业	743,861,929.58	36.55
C0	制造业 - 食品、饮料	33,067,283.83	1.63
C1	制造业 - 纺织、服装、皮毛	140,722,313.20	6.91
C4	制造业 - 石油、化学、塑胶、塑料	292,721,940.55	14.38
C5	制造业 - 电子	5,721,850.50	0.28
C6	制造业 - 金属、非金属	73,125,204.39	3.59
C7	制造业 - 机械、设备、仪表	149,134,142.04	7.33
C8	制造业 - 医药、生物制品	37,350,197.45	1.84
C99	制造业 - 其他	12,018,997.62	0.59
D	电力、煤气及水的生产和供应业	41,331,251.58	2.03
F	交通运输、仓储业	263,467,260.58	12.95
G	信息技术业	48,622,318.54	2.39
I	金融、保险业	37,263,989.72	1.83
J	房地产业	26,141,215.09	1.28
K	社会服务业	70,186,318.26	3.45
	合计	1,338,028,072.07	65.75

### (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	600309	烟台万华	10,299,999	130,809,987.30	6.43
2	600851	海欣股份	12,789,000	127,122,660.00	6.25
3	000792	盐湖钾肥	14,399,999	122,543,991.49	6.02
4	600029	南方航空	13,999,999	73,079,994.78	3.59
5	600066	宇通客车	6,066,666	57,147,993.72	2.81
6	600591	上海航空	6,066,666	41,131,995.48	2.02
7	600005	武钢股份	9,999,999	40,899,995.91	2.01
8	600236	桂冠电力	3,813,666	37,793,430.06	1.86
9	000933	神火股份	2,426,636	35,331,820.16	1.74
10	600583	海油工程	1,766,666	33,937,653.86	1.67
11	600009	上海机场	2,166,666	32,933,323.20	1.62
12	000527	美的电器	4,449,006	32,121,823.32	1.58
13	600036	招商银行	3,466,666	29,050,661.08	1.43
14	000089	深圳机场	3,399,999	28,967,991.48	1.42
15	002023	海特高新	1,466,666	25,461,321.76	1.25
16	600019	宝钢股份	3,966,666	23,918,995.98	1.18
17	600406	国电南瑞	1,766,666	23,584,991.10	1.16
18	000625	长安汽车	3,716,666	21,407,996.16	1.05
19	000069	华侨城 A	3,099,930	21,203,521.20	1.04
20	600519	贵州茅台	566,666	20,768,308.90	1.02
21	600598	北大荒	3,369,327	20,552,894.70	1.01
22	000538	云南白药	1,266,766	19,508,196.40	0.96
23	600333	长春燃气	2,466,666	18,894,661.56	0.93
24	600050	中国联通	5,999,992	18,419,975.44	0.91
25	600115	东方航空	4,099,949	18,285,772.54	0.90
26	600085	同仁堂	847,601	17,842,001.05	0.88
27	600028	中国石化	3,966,000	17,331,420.00	0.85
28	600428	中远航运	1,466,666	16,543,992.48	0.81
29	600636	三爱富	1,999,999	16,319,991.84	0.80
30	000402	金融街	1,431,701	14,216,790.93	0.70
31	600398	凯诺科技	1,999,949	13,599,653.20	0.67
32	600026	中海发展	1,366,666	12,518,660.56	0.62
33	000869	张裕 A	966,141	12,298,974.93	0.60
34	600210	紫江企业	3,366,666	12,018,997.62	0.59
35	600900	长江电力	1,366,666	12,012,994.14	0.59
36	000866	扬子石化	1,066,666	11,647,992.72	0.57
37	002019	鑫富股份	499,999	11,399,977.20	0.56
38	600795	国电电力	1,686,666	10,423,595.88	0.51

39	600761	安徽合力	1,626,674	9,385,908.98	0.46
40	000024	招商地产	1,186,666	9,279,728.12	0.46
41	600033	福建高速	1,259,510	9,232,208.30	0.45
42	600875	东方电机	700,000	8,519,000.00	0.42
43	000039	中集集团	369,165	8,306,212.50	0.41
44	600000	浦发银行	1,166,666	8,213,328.64	0.40
45	002021	中捷股份	869,266	7,553,921.54	0.37
46	600104	上海汽车	1,466,666	7,083,996.78	0.35
47	000888	峨眉山 A	634,025	6,771,387.00	0.33
48	000063	中兴通讯	249,900	6,617,352.00	0.33
49	600320	振华港机	642,074	5,913,501.54	0.29
50	600460	士兰微	486,966	5,721,850.50	0.28
51	600717	天津港	800,000	5,312,000.00	0.26
52	600350	山东基建	1,099,000	4,417,980.00	0.22
53	600383	金地集团	266,066	2,644,696.04	0.13

#### (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	600029	南方航空	253,622,462.13	11.84
2	600036	招商银行	149,865,212.93	7.00
3	600050	中国联通	147,654,003.24	6.90
4	600028	中国石化	121,587,079.13	5.68
5	600066	宇通客车	99,455,214.38	4.64
6	000792	盐湖钾肥	93,527,071.13	4.37
7	600808	马钢股份	92,377,862.87	4.31
8	000933	神火股份	87,015,125.16	4.06
9	600309	烟台万华	81,088,994.58	3.79
10	600591	上海航空	79,366,578.83	3.71
11	600005	武钢股份	76,677,398.17	3.58
12	000089	深圳机场	76,489,807.84	3.57
13	000983	西山煤电	76,237,901.40	3.56
14	600019	宝钢股份	75,857,884.25	3.54
15	600205	山东铝业	72,944,908.75	3.41
16	600104	上海汽车	66,519,173.31	3.11
17	600002	齐鲁石化	64,124,387.94	2.99
18	600333	长春燃气	63,754,982.05	2.98
19	600900	长江电力	61,425,965.55	2.87
20	000625	长安汽车	60,198,573.58	2.81
21	002023	海特高新	58,720,072.21	2.74

22	000866	扬子石化	58,032,191.87	2.71
23	000063	中兴通讯	57,037,632.04	2.66
24	000100	TCL 集团	56,962,235.17	2.66
25	000898	鞍钢新轧	54,797,956.63	2.56
26	600026	中海发展	53,012,051.69	2.48
27	600009	上海机场	52,279,804.54	2.44
28	000402	金融街	50,762,827.07	2.37
29	000869	张裕 A	49,111,314.96	2.29
30	600320	振华港机	47,131,712.45	2.20
31	600236	桂冠电力	46,846,085.33	2.19
32	000528	桂柳工 A	46,719,213.38	2.18
33	000956	中原油气	43,501,518.75	2.03
34	000527	美的电器	43,254,597.32	2.02

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	600050	中国联通	357,996,940.31	16.72
2	600029	南方航空	297,871,146.97	13.91
3	600036	招商银行	203,672,555.98	9.51
4	600016	民生银行	123,936,719.60	5.79
5	600309	烟台万华	117,997,910.31	5.51
6	600026	中海发展	106,793,633.97	4.99
7	600205	山东铝业	99,756,669.48	4.66
8	600011	华能国际	96,324,473.31	4.50
9	600028	中国石化	94,134,259.16	4.40
10	600104	上海汽车	93,901,143.40	4.38
11	600808	马钢股份	91,340,739.94	4.27
12	600018	上港集箱	86,871,665.59	4.06
13	000983	西山煤电	77,866,064.77	3.64
14	600009	上海机场	68,942,207.62	3.22
15	000956	中原油气	65,450,491.90	3.06
16	000024	招商地产	63,213,882.19	2.95
17	600002	齐鲁石化	61,626,117.38	2.88
18	600900	长江电力	59,156,553.52	2.76
19	600019	宝钢股份	59,102,169.56	2.76
20	000063	中兴通讯	57,049,462.04	2.66
21	000898	鞍钢新轧	56,057,052.20	2.62
22	600583	海油工程	54,686,320.85	2.55
23	000933	神火股份	53,790,905.98	2.51
24	600460	士兰微	52,803,399.89	2.47
25	600320	振华港机	51,756,235.75	2.42
26	000800	一汽轿车	50,874,469.37	2.38
27	000968	煤气化	48,525,739.63	2.27



28	000792	盐湖钾肥	46,678,835.27	2.18
29	600591	上海航空	46,592,400.41	2.18
30	000528	桂柳工 A	45,485,896.24	2.12
31	000869	张裕 A	45,431,160.28	2.12

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：	3,736,086,285.43
卖出股票的收入总额：	4,032,543,764.56

(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	310,865,953.36	15.27
2	金融债券	117,411,000.00	5.77
3	企业债券	99,936,712.33	4.91
4	可转换债券	4,409,602.00	0.22
	合计	532,623,267.69	26.17

(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	010004	20 国债	1,235,450.00	114,686,823.50	5.64
2	048005	04 长油债	1,000,000.00	99,936,712.33	4.91
3	040206	04 国开 06	800,000.00	77,840,000.00	3.82
4	030011	03 国债 11	700,000.00	70,000,000.00	3.44
5	010010	20 国债	410,160.00	39,715,792.80	1.95

(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	750,000.00
2	证券清算款	11,678,991.68
3	应收利息	8,680,480.59
	合计	21,109,472.27

#### 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

### (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	151,465	-
平均每户持有基金份额	13,204.37	-
机构投资者持有的基金份额	386,124,683	19.31
个人投资者持有的基金份额	1,613,875,317	80.69

### (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	165,326,650	8.27
2	中国人寿保险(集团)公司	71,680,228	3.58
3	中国人民财产保险股份有限公司	22,639,500	1.13
4	上海国际信托投资有限公司	18,000,000	0.90
5	华安基金管理有限公司	12,000,000	0.60
6	中国太平洋保险公司	9,301,553	0.47
7	招商证券股份有限公司	7,004,500	0.35
8	中国人寿再保险股份有限公司	6,723,300	0.34
9	云南云天化股份有限公司	6,342,400	0.32
10	天同证券有限责任公司	6,000,000	0.30

## 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)、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	0.10 元	20,000,000.00
本期第2次分红	2004-6-19	2004-6-23	2004-6-24	0.50 元	100,000,000.00
本期累计收益分配金额				0.60 元	120,000,000.00

(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，基金新增租用国泰君安证券股份有限公司和红塔证券股份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(%)
上海证券有限责任公司	2	621,271,097.29	8.09	500,500.15	8.10
天同证券有限责任公司	2	473,789,733.84	6.17	373,904.54	6.05
招商证券股份有限公司	1	665,855,840.66	8.67	545,496.74	8.83
申银万国证券股份有限公司	1	1,587,233,998.65	20.66	1,242,023.19	20.11
光大证券有限责任公司	1	1,256,551,387.42	16.36	1,024,810.55	16.59
南方证券股份有限公司	2	201,712,039.21	2.63	161,763.63	2.62
国信证券有限责任公司	2	128,207,266.79	1.67	100,322.78	1.62
海通证券股份有限公司	1	1,143,361,184.18	14.88	928,581.22	15.03
国泰君安证券股份有限公司	1	768,130,337.15	10.00	626,742.10	10.15
大鹏证券有限责任公司	2	694,180,544.69	9.04	558,042.05	9.03
红塔证券股份有限公司	1	140,820,466.25	1.83	115,473.10	1.87
合计	16	7,681,113,896.13	100.00	6,177,660.05	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(%)
上海证券有限责任公司	27,289,280.69	3.05	331,600,000.00	14.66
天同证券有限责任公司	98,542,454.68	11.01	200,000,000.00	8.84
招商证券股份有限公司	22,318,717.20	2.49	50,000,000.00	2.21
申银万国证券股份有限公司	78,861,260.63	8.81	-	-
光大证券有限责任公司	126,176,073.40	14.09	460,000,000.00	20.34
南方证券股份有限公司	15,588,058.00	1.74	250,000,000.00	11.06
国信证券有限责任公司	24,818,017.90	2.77	-	-
海通证券股份有限公司	167,521,845.40	18.71	741,900,000.00	32.81
国泰君安证券股份有限公司	247,452,818.10	27.64	100,000,000.00	4.42
大鹏证券有限责任公司	83,794,292.80	9.36	128,000,000.00	5.66
红塔证券股份有限公司	2,937,235.50	0.33	-	-
合计	895,300,054.30	100.00	2,261,500,000.00	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《安信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、《安信证券投资基金基金合同》
- 2、《安信证券投资基金招募说明书》
- 3、《安信证券投资基金托管协议》
- 4、《安信证券投资基金 2004 年年度报告》
- 5、中国证监会批准安信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