

安顺证券投资基金

一九九九年年度报告

华安基金管理有限公司

二〇〇〇年三月二十九日

重要提示

本基金的托管人交通银行已于 2000 年 3 月 29 日复核了本报告。

本基金的管理人、托管人愿就本报告中所载资料的真实性、准确性、完整性负责。本报告书中的内容由基金管理人负责解释。

一. 基金简介

(一)基金名称:	安顺证券投资基金 (简称:基金安顺)
交易代码:	500009
基金发起人:	上海国际信托投资公司 山东证券有限责任公司 浙江证券有限责任公司 华安基金管理有限公司
基金发行日期:	1999 年 6 月 9 日
基金成立日期:	1999 年 6 月 15 日
基金单位总份额:	30 亿份基金单位
基金类型:	契约型封闭式
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
- (二)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: 孙昌海
电话: 021-58881111
传真: 021-58406138
- (三)基金托管人: 交通银行
注册及办公地址: 上海市仙霞路 18 号
(邮政编码: 200336)
- 法定代表人: 王明权
托管部负责人: 谢红兵
信息披露负责人: 苏玉平
电话: 021-62082517
传真: 021-62750017
- (四)会计师事务所: 大华会计师事务所有限公司

注册及办公地址： 上海市昆山路 146 号

法定代表人： 汤云为

经办注册会计师： 吕秋萍、曹培青

二. 基金管理人报告

本基金业绩表现

截止 1999 年 12 月 31 日,基金单位资产净值达到 1.0374 元,年净值增长率为 6.83%,超过同期银行存款利率和同期沪深指数涨幅。扣除当年配售新股对基金净值增长的贡献因素,本基金净值增长率为-4.12%,同期上证综合指数增长率为-4.28%,深证综合指数增长率为-4.83%,基金表现好于同期大盘表现。

本基金投资风格

坚持“精选个股、重点投资、长期持有、稳健操作”的原则,合理分配成长类股票和收益类股票的投资比例,通过基金仓位和品种结构的动态调整,严格控制市场风险和个股风险,力争为基金持有人谋求长期、稳定的投资收益。

基金经理简介

尚志民先生,基金经理,经济学硕士。5 年证券从业经验,曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司

工作，担任基金经理前为华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员。

李匆先生，基金经理，管理学博士。6 年证券从业经验，曾在海南华银国际信托投资公司上海证券业务部工作。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、安信基金基金经理助理等职。

（一） 基金经理工作报告

1999 年是我国证券市场自成立以来发展较快、变化较大的一年，证券市场在国民经济中的地位和作用得到充分肯定和体现。《证券法》的颁布和实施，为证券市场的健康、有序发展奠定了坚实的法律基础。投资者队伍不断扩大，机构投资者比重稳步上升。市场结构的变化推动投资理念的变化，以证券投资基金为代表的理性投资理念逐步得到投资者的认同，证券市场资源配置的作用得到加强。证券市场出现“恢复性”上涨，市场交投空前活跃。

作为首批同一基金管理公司管理多家基金的试点基金，本基金在成立前制定了详尽的投资、操作计划。基金 6 月 15 日正式成立时，市场状况发生了较大变化，两市股指处于快速上扬途中，市场投资热情极为高涨。在此氛围的感染下，本基金在初期操作中出现急躁情绪，许多品种的

建仓成本偏高，组合的结构也不太合理，致使基金净值在随后出现的调整行情中表现不尽如人意。

面对不利局面，本基金管理人从制度、人员等多方面及时进行了调整，再次明确了“精选、重点、长期、稳健”的投资原则。根据对市场状况的判断，并结合平衡基金的特点，对基金组合进行了大幅度的调整，在维持收益类资产的投资比例、合理控制投资风险的同时，适当加大了对成长性较好的电子通讯、网络科技等类股票的投资，并结合国有企业改革重组的形势，充分利用增发及职工股上市等市场契机，低成本、大批量地吸纳了具有潜在获利能力的股票。经过近半年耐心细致的调整，组合的结构基本趋于合理，为本基金的长期发展奠定了基础。

经过半年多的投资实践与探索，总结正反两方面的经验和教训，我们对基金操作积累了一些初步体会，主要有以下三点：

第一，要树立并始终坚持科学、理性的投资理念。证券市场的短期波动，使人们对短期的收益产生过度幻想，总以为通过短期的追涨杀跌可以达到一夜暴富的效果，然而事实的结果多以总体亏损而告终，原因在于短期的收益终究逃不出概率的制约。只有树立并坚持理性投资的原则，才能抵住证券市场中贪婪和恐惧的诱惑，才能在错综复杂的市场面前保持清醒的头脑、作出冷静的判断，否则，再好

的事前努力也难以化成正确的投资行为，从而难以获得良好的投资回报。我们倡导并坚持理性投资、长期投资的理由在于：1. 现行交易制度和业已形成的市场心态使得好公司的价值需要时间来证明；2. 对大投资者而言，短期投资的投入量不可能很大，因此对整体投资收益帮助不大；3. 短期投资操作不当，面临的风险更大，其效果无异于火中取栗，得不偿失。

第二，要注重对时机的判断和机会的把握。市场的机会无限，但属于你的机会却有限，而你能够抓住的机会则更少，但必须抓住市场的重大转折。时机不成熟时要耐心等待，切忌浮躁；而机会来临时一定要坚决果断，决不能犹豫。只要能抓住关键的几次机会，便能获得满意的投资回报；而只有抓住关键的机会，才能立于不败之地。

第三，要集中资源，有的放矢。我们的精力有限，资金也有限。只有将有限的资源用于能够做好的事情上，才能获得最好的效果。这种“有所为、有所不为；有所投，有所不投”的理念，可以使整个团队保持良好的心态，专致于少数重点领域的研究和投资。由此进行的“重点投资”，风险自然也会大大减少。

进入新世纪，我国证券市场将迎来第十个春秋，其发展也将迈上一个新台阶。2000 年我国将继续实行积极稳健的财政政策和货币政策，宏观经济仍将保持较快的发展速度。

加入 WTO 和西部开发战略的实施，会大大推动我国产业结构、区域经济结构的优化调整，彻底打破条块分割和地域壁垒，提高企业经营行为的市场化程度。面对世界范围内的新知识经济浪潮，国家又制定了促进科技进步和技术创新的一系列政策。上述经济结构、产业结构、区域结构、市场结构等的重大变革，将使诸多的行业和企业或面临严峻的生存危机、或面临难得的发展机遇，由此会加剧证券市场已经出现的两极分化的趋势，对证券投资提出了更高的要求。

随着机构投资者的增加，越来越多的投资者采取长期投资的策略，加上新的新股申购办法将一级市场投资与二级市场投资连接起来，客观上增加了二级市场的资金存量；同时，在低利率环境下，市场的资金供给仍将十分充裕，虽然市场将长期面临扩容压力，但总体的供需平衡仍会维持。故此，我们预计 2000 年我国证券市场仍将保持活跃态势，市场的主要机会仍然在高科技和网络股中间。但是，由于证券市场的两极分化，部分价值型股票的价值可能被低估，这也将为我们提供一定的投资机会。

在新的年度，我们将继续坚持“精选、重点、长期、稳健”的投资原则，始终保持积极、开放的心态，密切关注市场的变化，通过深入细致的研究，努力发掘在经济结构变革中质地优良、具有长期投资潜力的品种，争取以良好

的业绩回报广大投资者。

（二）内部监察报告

● 基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《安顺证券投资基金基金契约》和其他有关法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，遵循“用智慧赢得回报”和“信誉比什么都重要”的公司理念，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法规及基金契约的约定。

● 内部监察工作报告

安顺基金是首批同一基金管理公司管理多家基金的试点基金，从其成立运作开始，本基金管理人即高度重视对其运作合规性的内部监察工作。从防范运作风险、保障基金持有人利益出发，公司建立了多基金运作管理办法，规定了公司投资决策委员会、各基金经理小组、集中交易室、

研究员在投资运作中的工作程序。独立工作的内部监察人员对基金投资流程各环节的执行情况进行定期检查，并通过基金交易监控系统检查各基金投资运作合规情况；定期制作监察报告，发现违规隐患及时向管理层和监管部门报告并督促整改。

在本报告期内，我们将内部控制的重点置于确保本基金运作程序的合规性、独立性，防范不当关联交易、内幕交易以及本基金与本公司管理的其他基金间可能出现的违规交叉交易。此外，安顺基金在建立调整投资组合时是否体现安顺基金平衡性特点也是内部监察的关注点。

在安顺基金运作初期，我们在监察过程中曾经发现，有时在行情波动较大时，该基金投资操作中偶有忽视既定投资程序的情况，在公司管理层的高度重视下，我们向有关人员提出并作出处理，同时细化完善了原投资程序，重申坚持程序化运作的严肃性，在以后的投资运作中未发现类似违反工作程序的行为。

回顾安顺基金半年来的运作情况，我们认为安顺基金投资组合符合安顺证券投资基金基金契约的约定，较为合理地分配了成长类股票和收益类股票的投资比例。基金运作中无不当内幕交易和关联交易，也未发生过两基金间违规交叉交易行为，整体运作合规合法，基金持有人利益得到充分保障。

在 1999 年内部监察工作的实践中，我们发现建立科学严密的基金投资程序是防止个人冲动型投资的有效手段，而忽视基金投资既定程序的执行往往是走向投资失误的前奏。安顺基金运作的时间较短，在 1999 年的运作中有值得总结的经验和教训。作为基金管理人，我们将继续高度重视防范投资风险，不断引入先进的内控技术，提高内部监察工作的科学性和效率性，切实保障基金安全运作，以优异的业绩回报投资者。

三、托管人报告

1999 年度，安顺证券投资基金（以下简称“安顺基金”）的托管人—交通银行，严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则的规定，依据《安顺证券投资基金基金契约》和《安顺证券投资基金托管协议》中的条款，认真履行基金托管人的各项职责，安全保管安顺基金的所有资产，做好安顺基金的投资监管和清算核算工作，切实维护广大基金持有人的合法权益，未发生任何损害基金持有人利益的事件和行为。

1999 年度，基金托管人根据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、基金契约、托管协议和其它有关法规的规定，对基金管理人的投资运作实施了交易监督，未

发现基金管理人在投资运作中有违规及损害基金持有人利益的行为。

1999 年度，基金托管人根据安顺基金招募说明书和上市公告书对基金管理人编制的每日基金资产净值、每周基金资产净值公告、每季度基金投资组合公告等财务数据进行了严格的复核，确认基金管理人在 1999 年度所编制和披露的安顺基金信息是合法、真实和完整的。

四. 基金年度财务报告

(一) 审计报告

审 计 报 告

华业字(2000)第 199 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 1999 年 12 月 31 日的资产负债表及 1999 年度收益及收益分配表。这些会计报表由 贵基金的管理人负责，我们的责任是对这些会计报表发表审计意见。我们的审计是依据中国注册会计师独立审计准则进行的。在审计过程中，我们结合 贵基金的实际情况，实施了包括抽查会计记录等我们认为必要的审计程序。

我们认为，上述会计报表符合基金及其财务会的相

关制度、法规及公允会计原则；在所有重大方面公允地反映了 贵基金 1999 年 12 月 31 日的财务状况以及 1999 年度经营成果；会计处理方法的选用遵循了一贯性原则。

大华会计师事务所有限公司

中国注册会计师：吕秋萍

中国注册会计师：曹培青

中国·上海·昆山路 146 号

2000 年 2 月 22 日

（二）基金会计报告书

资产负债报告书

资产负债主要项目期初数、期末数如下：

项 目	期初数	期末数
股票投资—成本：	—	2,378,337,621.20
股票投资—估值增值：	—	4,060,906.33
债券投资—成本：	—	628,848,894.13
债券投资—估值增值：	—	-2,661,025.13
银行存款：	—	109,703,601.24
应收利息：	—	141,185.71
应收帐款：	—	16,081,388.18
其他应收款项：	—	429,026.52

<u>基金资产总额:</u>	—	<u>3,134,941,598.18</u>
应付基金管理费:	—	3,935,621.35
应付基金托管费:	—	655,936.90
应付帐款:	—	17,419,751.75
应付佣金:	—	418,602.62
其他应付款项:	—	253,000.00
<u>负债总额:</u>	—	<u>22,682,912.62</u>
基金单位总额:	—	3,000,000,000.00
未分配净收益:	—	110,858,804.36
未实现估值增值:	—	1,399,881.20
<u>基金资产净值:</u>	—	<u>3,112,258,685.56</u>
基金单位发行总份额:	—	3,000,000,000
每份基金单位资产净值:	—	1.0374

收益及分配报告书

收益及分配主要项目本期数、上期数如下:

项 目	本期数	上期数
在除息日确认的股息收入:	5,172,028.22	—
债券利息收入:	1,562,075.60	—
股票买卖价差收入:	109,518,211.89	—
债券买卖价差收入:	1,089,656.25	—
其他收入:	24,005,462.72	—

基金管理费:	26,097,400.21	—
基金托管费:	4,349,566.71	—
应由基金承担的其他费用:	41,663.40	—
基金净收益:	110,858,804.36	—
期末未分配净收益:	110,858,804.36	—

(三) 会计报告书附注

1、主要会计政策

(1) 会计期间: 公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。

(2) 记帐原则: 权责发生制。

(3) 记帐本位币: 人民币。

(4) 基金资产的估值方法:

①上市证券(包括已上市但流通受限的证券)以计算日市场平均价为准; 该日无交易的, 以最近一日平均价计算。

②未上市的股票以发行价计算。

③未上市国债及银行存款以本金加计至估值日为止的应计利息额计算。

④如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定基金资产价值时, 基金管理人依据主管机关的有关规定办理。

(5) 收入的确认政策

股息收入: 在被投资股票股权除息日确认。

债券利息收入：在被投资国债除息日确认。

其他收入：在实际收到时确认。

(6) 证券交易的成本计价方法

证券交易在取得时按实际成本计价，出售时按移动加权平均法计价。

(7) 税项

根据财政部、国家税务总局的财税字[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》，对基金税收有如下规定：

- ①以发行基金方式募集资金不征收营业税。
- ②对基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税。
- ③对基金买卖股票按照4‰的税率征收印花税。
- ④对基金从证券市场中取得的收入，暂免征所得税。
- ⑤基金向投资者分配的基金收益，暂免征所得税。

(8) 基金的收益分配政策：

- ①基金收益分配比例不低于基金净收益的90%
- ②基金收益分配采取现金方式，每年分配一次，分配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。

2、关联交易

(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	基金契约
交通银行	基金托管人	提取托管费	基金契约
上海国际信托投资公司	管理公司发起人 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
山东证券有限责任公司	管理公司发起人 基金发起人	租用交易席位	席位使用协议
申银万国证券股份有限公司	管理公司发起人	租用交易席位	席位使用协议
浙江证券有限责任公司	基金发起人	租用交易席位	席位使用协议

(2) 通过关联人席位交易情况:

①股票交易情况:

关联人	年成交量	占年成交量比例	年佣金	占年佣金量比例	平均佣金比率
上海国际信托投资公司	14,141,881.34	0.31%	12,020.78	0.32%	0.85‰
申银万国证券股份有限公司	3,103,822,604.73	68.31%	2,592,678.71	68.32%	0.84‰
浙江证券有限责任公司	460,166,232.83	10.13%	386,981.45	10.20%	0.84‰

②国债及回购交易情况:

关联人	国债年成交量	比例	回购年成交量	比例
申银万国证券股份有限公司	534,333,618.10	34.76%	292,900,000.00	100%
浙江证券有限责任公司	157,191,743.70	10.23%		

(3) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额

①基金管理人的报酬

本基金应给付基金管理人管理费，按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%，超出部分不计

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人报酬

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算，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。

1999 年管理人收取的基金管理费金额为 26,097,400.21 元。

②基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\text{‰} \div \text{当年天数}$$

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算，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。

1999 年托管人收取的基金托管费金额为 4,349,566.71 元。

3、主要报表项目说明

(1) 本基金发行费使用情况如下

项 目	金 额
发行费收入	30,000,000.00
上网发行费	7,514,100.00
发行协调费	4,532,098.90
上市推荐人费	700,000.00
律师费	50,000.00
会计师费	75,000.00
<u>上市初费</u>	<u>30,000.00</u>
基金发行费结余	17,098,801.10

发行时申购资金冻结利息额：1,486,757.84 元。

(2) 应收帐款 1999 年 12 月 31 日余额为人民币 16,081,388.18 元，是应收股票清算款。由以下两项组成：上海应收交易资金，14,896,718.23 元；深圳应收交易资金，1,184,669.95 元。

(3) 其他应收款项 1999 年 12 月 31 日余额为人民币 429,026.52 元，是深圳证券交易所调整交易保证金款项。

(4) 应付帐款 1999 年 12 月 31 日余额为人民币 17,419,751.75 元，是应付交易资金和应付配股款。由以下三项组成：上海应付交易资金，12,361,165.51 元；深圳应付交易资金，5,058,586.24 元。

(四) 本基金流通受限、不能自由转让的资产全部为

认购的配售新股。在估值时如果该新股还未上市，则按成本计价；如已上市，则按当日平均价计价。1999年12月31日估值时，已上市但流通受限的新股估值增值额为123,343,742.50元。

序号	股票名称	上市日期	交易日期	数量	成本	市价
1	浦发银行	99.11.10	00.1.12	6,858,000	68,580,000.00	170,146,980.00
2	秦岭水泥	99.12.16	00.2.18	600,000	3,540,000.00	4,416,000.00
3	南山实业	99.12.23	00.2.23	642,000	6,034,800.00	7,350,900.00
4	海南航空	99.11.25	00.1.25	3,542,000	16,293,200.00	18,028,780.00
5	真空电子	99.12.22	00.2.22	6,859,400	69,828,692.00	70,514,632.00
6	金陵药业	99.11.18	00.1.18	685,700	5,759,880.00	10,806,632.00
7	小鸭电器	99.11.25	00.1.25	771,400	2,900,464.00	4,790,394.00
8	广济药业	99.11.12	00.1.12	468,750	2,357,812.50	5,325,000.00
9	河池化工	99.12.2	00.2.14	428,600	1,778,690.00	3,415,942.00
10	欣龙无纺	99.12.9	00.2.17	472,000	2,737,600.00	5,276,960.00
11	中原油气	99.11.10	00.1.10	2,203,000	10,772,670.00	13,834,840.00
12	首钢股份	99.12.16	00.3.16	1,024,550	5,276,432.50	5,296,923.50
13	万杰实业	00.1.13	00.3.14	1,414,000	9,615,200.00	9,615,200.00
14	海南椰岛	00.1.20	00.3.20	428,600	1,757,260.00	1,757,260.00
15	东方铝业	00.1.20	00.3.20	438,200	4,119,080.00	4,119,080.00
16	锡业股份	00.2.21		1,671,426	10,028,556.00	10,028,556.00
17	大连金牛	00.3.1	00.3.1	2,460,500	10,038,840.00	10,038,840.00
18	赤天化	00.2.21	00.2.21	943,800	6,795,360.00	6,795,360.00
19	中化国际	00.3.1	00.3.1	2,192,700	17,541,600.00	17,541,600.00
20	华东医药	00.1.27	00.1.27	674,200	3,883,392.00	3,883,392.00
合 计				34,778,826	259,639,529.00	382,983,271.50

注：大连金牛、赤天化、中化国际、华东医药四只新股在上市日已流通 50%，其余 50%在新股认购日六个月后再上市流通。

（五）基金投资组合

1、按行业分类的投资组合

分 类	市值（元）	占净值比例
-----	-------	-------

交通运输	99,626,105.44	3.20%
能源电力	—	—
建材建筑	4,416,000.00	0.14%
冶金	122,303,737.60	3.93%
机械制造	159,697,776.01	5.13%
电子通讯	842,520,802.56	27.07%
化工	46,163,188.98	1.48%
医药	132,915,669.32	4.27%
汽车及配件制造	51,198,788.08	1.65%
纺织服装	123,680,023.47	3.97%
家电	116,499,699.50	3.74%
酿酒食品	17,553,826.59	0.56%
商贸旅游	240,344,471.58	7.72%
金融地产	170,146,980.00	5.47%
农林牧渔	—	—
综合	255,331,458.40	8.20%
合 计	2,382,398,527.53	76.53%

2、国债、货币资金合计

截止 1999 年 12 月 31 日，基金持有的国债及货币资金合计为 734,553,106.67 元，占基金资产净值的 23.60%。

3、基金投资前十名股票明细

序号	名称	数量	市值	占净值比例(%)
1	综艺股份	8,248,859	221,894,307.10	7.13%
2	东方电子	11,239,381	187,360,481.27	6.02%
3	浦发银行	6,858,000	170,146,980.00	5.47%
4	大唐电信	6,246,757	166,413,606.48	5.35%
5	环保股份	4,687,343	159,697,776.01	5.13%
6	真空电子	12,619,894	129,732,510.32	4.17%
7	许继电气	5,486,580	127,014,327.00	4.08%
8	清华同方	3,471,149	126,245,689.13	4.06%

9	中大股份	9,335,361	116,225,244.45	3.73%
10	上海医药	8,578,503	108,775,418.04	3.50%

4、基金投资组合报告附注

(1) 报告项目的计价方法。

本基金持有的上市证券采用公告内容截止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) 本基金不存在购入成本已超过基金资产净值 10% 的股票。

(3) 截止 1999 年 12 月 31 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 4,692,948.64 元。股票市值 2,382,398,527.53 元，国债及货币资金合计 734,553,106.67 元与其相抵减后等于基金净值。其他应收应付款项包括：应收利息、其他应收款、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、其他应付款。

(六) 主要财务指标

1、基金可分配净收益为 110,858,804.36 元；单位基金净收益为 0.0370 元。

2、期末基金资产总值为 3,134,941,598.18 元。

3、期末基金资产净值为 3,112,258,685.56 元；单位基金资产净值为 1.0374 元。

4、基金资产净值收益率为 6.62%。

五. 基金持有人结构及前十名持有人

截止 1999 年 12 月 31 日, 本基金发起人持有的基金份额为 0.3 亿基金单位, 占基金发行总份额的 1%, 其中:

发 起 人	持有份额(单位)	占总份额比例
上海国际信托投资公司	7,500,000	0.25%
山东证券有限责任公司	7,500,000	0.25%
浙江证券有限责任公司	7,500,000	0.25%
华安基金管理有限公司	7,500,000	0.25%

社会公众持有的基金份额为 29.7 亿基金单位, 占基金发行总份额的 99%。

本基金前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例如下:

序号	名 称	持有份额(单位)	占总份额比例
1	久事大厦	15,000,000	0.50%
2	久事浦东	13,500,000	0.45%
3	交通投资	8,000,000	0.27%
4	浙江证券	7,500,000	0.25%
5	山证总部	7,500,000	0.25%
6	投资信托	7,500,000	0.25%

7	华安基金	7,500,000	0.25%
8	孙 英	6,600,000	0.22%
9	富岛基金	5,550,000	0.19%
10	姜柏珍	5,400,000	0.18%

六. 重要事项揭示

(一) 本基金管理人、托管人在本期内未发生任何诉讼事项。

(二) 本基金管理人于一九九九年十一月二十五日召开了第一届董事会第三次会议。会议通过以下决议：同意徐建军同志因工作调动辞去董事长职务，选举杜建国同志担任董事长。以上人事变动，已报中国证监会核准，并于二〇〇〇年二月二十六日在《中国证券报》、《上海证券报》刊登决议公告。

(三) 根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字(1998)29号)中有关规定的要求，经我公司认真研究，本基金管理人向上海国际信托投资公司、申银万国证券股份有限公司、山东证券有限责任公司、浙江证券有限责任公司、国通证券有限公司、华夏证券有限公司等六家券商租用交易席位。选择标准详见《安顺证券投资基金招募说明书》。本年度内租用席位无任

何变更。

我们从 1999 年 6 月 15 日启用多席位交易系统。

各券商年成交量及年佣金情况如下：

①股票交易情况：

券商名称	年成交量	占年成交量比例	年佣金	占年佣金量比例
上海国际信托投资公司	14,141,881.34	0.31%	12,020.78	0.32%
申银万国证券股份有限公司	3,103,822,604.73	68.31%	2,592,678.71	68.32%
浙江证券有限责任公司	460,166,232.83	10.13%	386,981.45	10.20%
华夏证券有限公司	965,838,095.90	21.25%	803,315.39	21.16%
合 计	4,543,968,814.80	100.00%	3,794,996.33	100.00%

②国债及回购交易情况：

券商名称	国债年成交量	比例	回购年成交量	比例
申银万国证券股份有限公司	534,333,618.10	34.76%	292,900,000.00	100%
浙江证券有限责任公司	157,191,743.70	10.23%		
华夏证券有限公司	845,717,760.80	55.01%		
合 计	1,537,243,122.60	100.00%		

说明：

1999 年 6 月 15 日至 12 月 31 日，多席位交易系统开始试运行。因为多席位交易系统启用未满一年，因此，上述交易量分配未符合每一券商年交易量不得超过 30%的比例限制的规定。

七. 备查文件目录

1. 中国证监会批准安顺证券投资基金设立的文件。

2. 《安顺证券投资基金基金契约》。
3. 《安顺证券投资基金托管协议》。
4. 华安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
5. 安顺证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注。
6. 安顺证券投资基金 1999 年度收益分配公告。
7. 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、投资组合公告及其他临时公告。

华安基金管理有限公司

二〇〇〇年三月二十九日