

# 华安创新证券投资基金 更新的招募说明书摘要

2004 年第 2 号

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

基金类型：契约型开放式

2004 年 11 月

## 目录

一、基金合同的生效日期.....	1
二、重要提示.....	1
三、基金管理人.....	1
四、基金托管人.....	5
五、相关服务机构.....	6
六、基金的名称.....	11
七、基金的类型.....	11
八、基金的投资目标.....	11
九、基金的投资方向.....	11
十、基金的投资决策.....	12
十一、基金的业绩比较基准.....	14
十二、基金的风险收益特征.....	14
十三、基金的投资组合报告（未经审计）.....	14
十四、基金的业绩.....	17
十五、费用概览.....	18
十六、对招募说明书更新部分的说明.....	21

## 一、基金合同的生效日期

华安创新证券投资基金经中国证监会 2001 年 8 月 15 日证监基金字[2001]33 号文件《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》批准发起设立,基金合同于 2001 年 9 月 21 日正式生效。

## 二、重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为 2004 年 9 月 30 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2004 年 9 月 30 日。

## 三、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

1. 名称: 华安基金管理有限公司
2. 注册地址: 上海浦东新区浦东南路 360 号, 新上海国际大厦 38 楼
3. 设立日期: 1998 年 6 月 4 日

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

4. 法定代表人：杜建国
5. 办公地址：上海浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼
6. 联系电话：(021) 58881111
7. 联系人：冯颖
8. 注册资本：1.5 亿元人民币
9. 股权结构：

发起人名称	出资额（万元）	出资比例
上海国际信托投资有限公司	4500	30%
申银万国证券股份有限公司	3000	20%
天同证券有限责任公司	3000	20%
东方证券有限责任公司	3000	20%
方正证券有限责任公司	1500	10%
合计	15000	100%

### （二）主要人员情况

#### 1. 董事、监事及高级管理人员

##### （1）董事会：

杜建国先生，大学学历，高级经济师。历任上海康健联合开发公司总经理，上投实业公司副总经理，上海国际信托投资公司证券投资信托部经理、证券总部总经理，现任华安基金管理有限公司董事长。

韩方河先生，研究生学历，高级经济师。历任上海市物价研究所所长，上海市物价局政策研究处处长，上海国际信托投资公司证券总部副总经理、证券投资信托部总经理，现任华安基金管理有限公司董事、总经理。

柳亚男先生，研究生学历，高级经济师。历任山东省人民银行金管处副处长，山东省融资中心总经理，山东证券有限责任公司总经理，现任天同证券有限责任公司副董事长。

缪恒生先生，研究生学历，高级经济师。历任中国人民银行南市区办会计出纳科副科长，中国工商银行上海市分行南市区办副主任，上海申银证券公司董事、副总裁，现任申银万国证券股份有限公司副总裁。

陶晋先生，大学学历，高级经济师。历任上海市计划委员会教科文处主任科员、综合处副处级，现任东方证券有限责任公司研究发展总部总经理。

李华强先生，研究生学历，工程师。历任中国有色金属工业总公司株洲冶炼厂工程师、

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

分厂副厂长及深圳合资企业总经理，深圳科技工业园总公司参股企业俄罗斯深圳（莫斯科）股份有限公司业务部经理，国信证券有限责任公司投资银行总部副总经理，浙江证券有限责任公司总裁助理，现任方正证券有限责任公司董事长兼总裁。

### 独立董事：

萧灼基先生，研究生学历，教授。现任全国政协委员，政协经济委员会委员，北京大学经济学院教授，博士生导师，北京市、云南省、吉林省、成都市，武汉市等省市专家顾问，北京市场经济研究所所长，《经济界》杂志社社长、主编。

朱勇先生，研究生学历。曾任上海医药公司助理工程师，北京理工大学助理研究员，中国计划委员会部门负责人，美国康涅狄格州 Perspective Investment Advisory Inc. 基金经理，美国 Alliance Capital Management Corporation 亚洲区执行董事，现任中国国际金融有限公司资产管理部负责人。

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，具有证券律师资格。1998 年曾荣获上海市十佳律师称号。现任金茂律师事务所专职律师，上海市律师协会副会长。

### （2）监事会：

张杰波先生，大学学历，会计师。历任山东省人民银行主任科员、山东证券有限责任公司部门经理、总经理助理、现任天同证券有限责任公司总经理助理兼上海业务总部总经理。

张令先生，大专学历，会计师。历任中国纺织机械厂财务科科长、处长、副总会计师、浦东发展银行信托证券部科长、副总经理、东方证券有限责任公司资金财务管理总部负责人，现任东方证券有限责任公司资金财务管理总部总经理。

陈勇先生，大学学历，经济师。曾在上海市投资咨询公司、上海上咨前进会计师事务所、上海方正延中科技集团股份有限公司证券部、投资部工作，历任上海方正延中科技集团股份有限公司投资部总经理、助理总裁，浙江证券有限责任公司总裁助理，现任浙江证券有限责任公司副总裁。

王礼华先生，大专学历，会计师。历任上海九华袜厂财务科副科长，上海万国证券公司交易部经理助理、资金及投资管理部经理、国债部经理，资产管理总部副总经理兼国债部经理、国债总部副总经理，申银万国证券股份有限公司国债总部总经理、客户资产管理总部总经理。

孙志方先生，研究生学历，曾在上海国际信托投资公司综合研究室、法律顾问室、证券投资信托部工作，历任华安基金管理有限公司监察稽核部总经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理、研究发展部总监。

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

### (3) 高级管理人员：

韩方河先生，研究生学历，高级经济师。历任上海市物价研究所所长，上海市物价局政策研究处处长，上海国际信托投资公司证券总部副总经理、证券投资信托部总经理，现任华安基金管理有限公司董事、总经理。

邵杰军先生，副总经理，管理学硕士。曾任申银万国证券股份有限公司基金管理总部总经理助理。

姚毓林先生，副总经理，MBA，10年证券和投资专业经验。曾是美国避险基金投资公司 Berens Capital 合伙人，并曾在美国道琼斯公司(Dow Jones)房屋抵押贷款债券部，美国高盛公司(Goldman Sachs)风险管理部和美国避险基金公司 Alpha Asset Management 工作。

李炳旺先生，副总经理，MBA，18年基金业工作经验。曾任国际证券投资信托公司资讯暨注册登记部主管、怡富证券投资信托公司注册登记与IT资讯部主管、综合规划部副总经理。

章国富先生，督察长，经济学博士。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师，上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹(集团)有限公司财务部副部长(主持工作)、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监。

### 2. 基金经理介绍

刘新勇先生：硕士，6年证券从业经历，曾在淄博基金管理有限公司从事研究、投资工作。1999年5月加入华安基金管理有限公司后，曾任研究发展部高级研究员、华安180基金的基金经理。

### 3. 本公司采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

韩方河先生，董事、总经理

姚毓林先生，副总经理

王国卫先生，总经理助理、基金投资部总监

孙志方先生，总经理助理、研究发展部总监

尚志民先生，基金投资部副总监、基金经理

汤礼辉先生，基金投资部总监助理

刘新勇先生，基金经理

陈苏桥先生，基金经理

项廷峰先生，基金经理

林彤彤先生，基金经理

吴娜女士，基金经理助理

刘光华先生，基金经理助理

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

1. 名称：交通银行
2. 注册地址：上海市仙霞路 18 号
3. 设立日期：1987 年 4 月 1 日
4. 注册资本：170 亿元人民币
5. 法定代表人：方诚国
6. 办公地址：上海市银城中路 188 号
7. 联系电话：(021) 58781234
8. 联系人：江永珍

### (二) 主要人员情况

张建国先生，交通银行行长，经济学硕士，高级经济师。1997 年 6 月任中国工商银行天津市分行副行长、党委常委；1998 年 9 月任中国工商银行国际业务部总经理；2001 年 9 月任交通银行副行长、党委委员；2004 年 5 月至今任交通银行行长、党委副书记、副董事长。

李军先生，交通银行副行长，主管交通银行基金业务，经济学硕士，高级经济师。曾任交通银行武汉分行副总经理、武汉分行行长、党委书记；交通银行总稽核、党委委员、董事；2001 年 4 月至今任交通银行副行长、党委委员、常务董事（2004 年 6 月董事会不设常务董事职务后，改任董事）。

谢红兵先生，交通银行证券投资基金托管部总经理，大学学历。曾任交通银行上海分行杨浦办事处副主任；上海分行营业处处长，静安支行行长、杨浦支行行长；1998 年 6 月任交通银行证券投资基金托管部副总经理；1999 年 12 月任交通银行证券投资基金托管部总经理。

### (三) 基金托管业务经营情况

截至 2003 年 12 月 31 日, 交通银行共托管证券投资基金十九只, 分别是: 普惠基金、安顺基金、汉兴基金、裕华基金、兴科基金、安久基金、科汇基金、科讯基金、久富基金、华安创新基金、科瑞基金、国泰金鹰增长基金、华夏债券基金、湘财合丰系列基金(成长、周期、稳定)、鹏华普天系列基金、海富通精选基金、博时现金收益基金。同时, 交通银行也是全国社会保障基金两家托管行之一。基金资产托管规模逾 500 亿元。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1. 直销机构:

(1) 华安基金管理有限公司上海投资理财中心

地址: 上海市浦东新区浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼

电话: (021) 68863400

传真: (021) 68863223

联系人: 乐嘉庆

(2) 华安基金管理有限公司北京投资理财中心

地址: 北京市西城区金融街 23 号平安大厦 106 室

电话: (010) 66219999

传真: (010) 66214060

联系人: 刘彦珠

(3) 华安基金管理有限公司电子交易平台

咨询及交易电话: (021) 68604666

交易网址: [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)

联系人: 赵敏

#### 2. 代销机构:

(1) 交通银行

注册地址: 上海市仙霞路 18 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

---

法定代表人：方诚国

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408842

联系人：王玮

客户服务中心电话：95559

(2) 中国工商银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：(010) 66107911

传真：(010) 66107914

联系人：田耕

客户服务中心电话：95588

(3) 中国银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

电话：(010) 66594909

传真：(010) 66594853

联系人：王娟

客户服务统一咨询电话：95566

(4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

电话：(021) 62580818-177

传真：(021) 62583439

联系人：芮敏琪

客户服务热线：4008888666

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(5) 华夏证券股份有限公司

注册地址：北京市新中街 68 号

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

---

法定代表人：周济谱

电话：400-8888-108（免长途费）；（010）65186758

传真：（010）65182261

联系人：魏明

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（6）渤海证券有限责任公司

注册地址：天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军

电话：（022）28451883

传真：（022）28451616

联系人：徐焕强

公司网站：[www.ewww.com](http://www.ewww.com)

（7）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：（021）53594566-4125

传真：（021）53858549

联系人：金芸

客服电话：021-962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

（8）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：王明权

电话：021-962505、021-54033888

传真：021-64736644

联系人：王序微

公司网址：[www.sywg.com.cn](http://www.sywg.com.cn)

（9）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

---

法定代表人：兰荣

电话：021-68419125

传真：021-68419867

联系人：缪白

客户服务热线：021-68419125

公司网站：[www.xyqzq.com.cn](http://www.xyqzq.com.cn)

(10) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943511

传真：0755-82943237

联系人：黄健

客户服务热线：4008888111、0755-26951111

公司网站：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(11) 中国银河证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：朱利

电话：010 - 66568888

联系人：郭京华

公司网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

客户服务热线：010-68016655

(12) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87557985

联系人：肖中梅

公司网站：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(13) 国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 21 层

法定代表人：胡继之

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：林建闽

公司网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

客户服务热线：800-810-8868

## (二) 基金注册与过户登记人

华安基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 38 楼

法定代表人：杜建国

电话：(021) 58881111

传真：(021) 68862332

联系人：朱永红

客户服务中心电话：(021) 68604666

## (三) 律师事务所和经办律师

律师事务所：通力律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 21 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 68818100

传真：(021) 68816880

经办律师：韩炯、秦悦民

## (四) 会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区东昌路 568 号 (200120)

办公地址：上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼 (200021)

法定代表人：杨绍信

电话：(021)63863388

传真：(021)63863300

联系人：陈兆欣

经办注册会计师：肖峰、陈玲

## 六、基金的名称

本基金名称：华安创新证券投资基金。

## 七、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

## 八、基金的投资目标

基金管理人将以分散投资风险，提高基金资产的安全性，并积极追求投资收益的稳定增长为目标，以诚信原则及专业经营方式，将本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。

本基金的投资原则：

1. 本基金遵循诚信稳健原则，高度重视基金资产的安全性，力求更好地降低投资风险。
2. 本基金主要投资于在中国境内上市的创新类上市公司的股票和债券，以获取资本利得为主要投资目标。
3. 本基金将根据市场变化，灵活选择一定比例的短期投资，在防范风险的前提下，力求增加基金的收益。
4. 在严格遵守《基金法》、《试点办法》、《基金合同》等有关规定的情况下，基金管理人可根据具体情况，不断调整投资组合，提高投资组合的回报率，但基金的股票资产中至少有 80% 属于华安创新证券投资基金名称所显示的投资内容。

## 九、基金的投资方向

本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益，通过建立科学合理的投资组

合，为投资者降低和分散投资风险，提高基金资产的安全性。

这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。

高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域，包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。

传统产业类型的上市公司中，如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。

本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素：公司创新能力强，主营业务市场空间大，财务状况良好，具有相当竞争优势等。

本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产，如国债和现金，从而保持基金资产良好的流动性。

## 十、基金的投资决策

### （一）决策依据

1. 国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定；
2. 国内国际宏观经济环境；
3. 国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期；
4. 国家产业政策；
5. 各地区、各行业发展状况；
6. 上市公司研究；
7. 证券市场走势。

### （二）投资流程

1. 投资决策委员会会议形成由参加会议成员签字的书面决议，确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，由公司总经理或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理提议，可临时召开投资决策委员会会议。

2. 基金经理设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；《基金合同》的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；风险分析小组的建议等。

3. 基金经理向集中交易室下达投资指令。交易员收到基金投资指令后，按时间优先、价格优先、综合平衡、比例分配原则完成指令。

4. 风险分析小组对开放式基金投资组合进行评估，向基金经理提出调整建议。

5. 监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

### （三）基金投资限制

基金管理人应依据有关法令及《基金合同》规定，运作管理本基金：

1. 本基金投资组合应遵循下列规定：

本基金投资于股票、债券的比例，不低于本基金资产总值的 80%；

本基金持有 1 家上市公司的股票，不超过本基金资产净值的 10%；

本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有 1 家公司发行的证券的总和，不超过该证券的 10%；

本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；

本基金股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容；

中国证监会的其它比例限制。

2. 禁止用本基金资产从事以下行为：

投资于其他证券投资基金；

以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；

动用银行信贷资金从事基金投资；

将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；

从事证券信用交易；

以基金资产进行房地产投资；

从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；

当时有效的法律、法规、规章、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

## 十一、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：无。

## 十二、基金的风险收益特征

本基金的风险收益特征：无。

## 十三、基金的投资组合报告（未经审计）

### （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。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于 2004 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2004 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### （二）基金投资组合报告

#### 1、基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例(%)
1	股票	1,660,606,320.23	65.29%
2	债券	589,040,286.80	23.16%
3	银行存款和清算备付金合计	194,924,642.51	7.66%
4	其他资产	98,899,058.98	3.89%
	合计	2,543,470,308.52	100.00%

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

### 2、股票投资组合

#### (1) 按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例(%)
B	采掘业	221,416,192.40	9.04%
C	制造业	848,961,444.21	34.66%
C0	其中：食品、饮料	80,450,436.78	3.28%
C1	纺织、服装、皮毛	35,053,970.33	1.43%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	120,386,985.22	4.92%
C5	电子	73,855,563.07	3.02%
C6	金属、非金属	377,753,885.33	15.42%
C7	机械、设备、仪表	149,402,727.00	6.10%
C8	医药、生物制品	12,057,876.48	0.49%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	179,353,088.72	7.32%
F	交通运输、仓储业	280,313,791.95	11.45%
G	信息技术业	29,022,643.36	1.19%
H	批发和零售贸易	17,220,000.00	0.70%
I	金融、保险业	68,059,159.59	2.78%
J	房地产业	16,260,000.00	0.66%
	合 计	1,660,606,320.23	67.80%

#### (2) 基金投资前十名股票明细

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	600009	上海机场	13,000,000	183,820,000.00	7.51%
2	600005	武钢股份	20,900,105	167,618,842.10	6.84%
3	600795	国电电力	20,782,168	161,893,088.72	6.61%
4	600019	宝钢股份	17,436,200	115,078,920.00	4.70%
5	600028	中国石化	22,000,000	103,620,000.00	4.23%
6	600309	烟台万华	7,692,652	97,927,459.96	4.00%
7	000983	西山煤电	6,926,242	91,772,706.50	3.75%
8	000898	鞍钢新轧	12,570,403	69,514,328.59	2.84%
9	600000	浦发银行	8,016,391	68,059,159.59	2.78%
10	600104	上海汽车	6,000,000	46,920,000.00	1.92%

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

### (3) 债券投资组合

#### 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	371,360,838.60	15.16%
2	金融债券	139,943,000.00	5.71%
3	企业债券	12,341,613.60	0.51%
4	可转换债券	65,394,834.60	2.67%
	合计	589,040,286.80	24.05%

#### 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	030010	03 国债 10	1,500,000	149,880,000.00	6.12%
2	040212	04 国开 12	1,200,000	119,930,000.00	4.90%
3	010004	20 国债	1,252,660	118,714,588.20	4.85%
4	010405	04 国债 05	577,210	54,107,665.40	2.21%
5	010401	04 国债 01	498,500	48,658,585.00	1.99%

### (4) 投资组合报告附注

#### 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)的市场收盘价计算,已发行未上市股票采用成本价计算。

#### 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。

#### 其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
----	------	-------

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

1	深圳结算保证金	750,000.00
2	应收利息	7,945,770.98
3	买入返售证券	40,000,000.00
4	应收基金申购款	50,203,288.00
	合计	98,899,058.98

### 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	100236	桂冠转债	148,900	15,421,573.00	0.63%
2	110001	邯钢转债	256,140	26,751,261.60	1.09%
3	125959	首钢转债	200,000	20,102,000.00	0.82%

### (5) 开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	期初基金份额总额	2,451,938,055.39
2	加：本期申购基金份额总额	170,601,149.94
3	减：本期赎回基金份额总额	139,510,458.96
4	期末基金份额总额	2,483,028,746.37

## 十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

### (一) 经营业绩

自合同生效当年开始所有完整会计年度的主要经营业绩数据：

项 目	单位：人民币元			
	2004年1月1日 -2004年9月30日	2003年	2002年	2001年9月21日 -2001年12月31日
<b>总净值</b>				
最低	2,174,833,115.62	2,931,260,337.81	4,292,754,580.21	4,998,891,604.21

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

最高	3,093,226,341.61	4,682,159,680.71	5,075,676,786.89	5,071,101,605.13
期末	2,449,216,038.39	2,931,260,337.81	4,292,754,580.21	5,064,713,018.51
<b>单位净值</b>				
最低	0.898	0.892	0.916	1.000
最高	1.157	1.072	1.051	1.012
期末	0.986	1.060	0.916	1.012
每单位收益分配金额	0.090	0.018	0.022	--

### (二) 基金净值表现

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

(截至时间 2004 年 6 月 30 日)

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	-	-
过去一个月	-5.96%	0.84%	-	-	-	-
过去三个月	-13.51%	0.95%	-	-	-	-
过去六个月	-4.34%	1.04%	-	-	-	-
过去一年	3.78%	0.87%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	5.50%	0.69%	-	-	-	-

备注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

## 十五、费用概览

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1. 基金费用的种类

基金管理人的管理费；

基金托管人的托管费；

证券交易费用；

基金信息披露费用；

基金持有人大会费用；

与基金相关的会计师费和律师费；

基金分红手续费；

按照国家有关规定可以列入的其他费用。

## 2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，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。

### 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述 1 中 至 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

## 3. 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4. 基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金持有人大会决议通过。

## (二) 与基金销售有关的费用

1. 本基金申购费率（直销机构电子交易平台除外）分为 1.0%、1.2% 和 1.5% 三档。投资者在一天之内有多笔申购，适用费率按单笔分别计算：

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

一次申购金额高于 1,000 万元（含 1,000 万元）的，申购费率为申购金额的 1.0%；

一次申购金额低于 1,000 万元但高于 100 万元（含 100 万元），申购费率为申购金额的 1.2%；

一次申购金额低于 100 万元的，申购费率为申购金额的 1.5%。

投资者通过直销机构电子交易平台申购本基金的费率为 0.6%。

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金资产。

2. 本基金的赎回费率统一按 0.5%收取。

本基金的赎回费用由赎回人承担，在扣除 0.1%的基金注册与过户登记服务费后，列入基金资产。

### 3. 转换费率

本基金管理人已开通了本基金与华安上证 180 指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金之间的转换业务。目前，基金转换业务仅限于开通电子直销业务（包括华安“银基通”和“银联通”）的个人投资者通过本公司网站（www.huaan.com.cn）或客户服务及交易热线（021-68604666）办理。办理转换费用包括转出基金的赎回费和转换申购补差费两部分。基金转换费用由基金份额持有人承担。

1) 目前华安旗下各开放式基金的赎回费率如下，转出基金的赎回费根据持有人对该基金的持有期限适用相对应的费率确定。

	持有期	费率
华安创新	全部	0.5%
华安 180	全部	0
华安富利	全部	0

2) 转换申购补差费为两只转换基金之间的申购费率补差，具体收取费用视每笔转换申请的转入基金与转出基金之间的申购费率的差异而定。

其他代理销售机构办理基金转换业务适用的基金转换费用将在开通时另行公告。

4. 基金管理人可视市场情况对上述费率进行调整，但申购费率最高不超过 3%，赎回费率最高不超过 1%。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调低申购费率、赎回费率或转换费率，调低后的申购费率、赎回费率和转换费率应在最新的更新的招募说明书中列示。如在招募说明书或任何一份更新的招募说明书有效期间上述费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购费率、基金赎回费率或基金转换费率。

## 十六、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求, 结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动, 对本基金的原招募说明书进行了更新, 主要更新的内容如下:

1. 根据国家有关规定对原招募说明书进行了结构调整: 增加了“基金的业绩”、“基金合同的内容摘要”和“基金托管协议的内容摘要”三个部分; 删除了“基金持有人”、“基金专用交易席位的选用”、“基金管理人的更换”、“基金托管人的更换”等相关部分。

2. 根据国家有关规定重新规范了一些提法, 如将“基金契约”改为“基金合同”、“基金单位”改为“基金份额”、将“基金持有人”、“基金单位持有人”改为“基金份额持有人”、将“基金清算”改为“基金财产清算”、将“基金终止”改为“基金合同终止”等。

3. 在“一、绪言”、“二、释义”部分, 根据国家有关规定进行了调整, 补充了国家最近颁布的法律法规。

4. 在“三、基金管理人”部分, 根据《基金法》的规定及公司的实际情况重新规范了基金管理人的职责、承诺和内部控制制度的表述。

5. 在“四、基金托管人”部分, 更新了基金托管人的有关资料, 并增加了基金托管人主要人员情况的说明以及托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序的说明。

6. 在“五、相关服务机构”部分, 增加了7个代销机构: 海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国信证券有限责任公司。

7. 在“六、基金的申购、赎回和转换”部分, 更新了基金转换等内容。

8. 在“八、基金的投资”部分, 补充了本基金最近一期投资组合报告的内容。

9. 在“九、基金的业绩”这一章节, 补充说明了基金合同生效以来的投资业绩。

## 华安创新证券投资基金更新的招募说明书摘要

---

10. 在“十一、基金的收益分配”部分，根据有关法规明确了如果投资者没有明示选择收益分配方式，则视为选择现金方式。

11. 在“十三、基金的费用和税收”部分，将基金费用分为“与基金运作有关的费用”和“与基金销售有关的费用”两类进行说明。

12. 在“十五、基金的信息披露”部分，根据《基金法》和《证券投资基金信息披露管理办法》的规定进行了内容更新和规范。

13. 在“十八、基金合同的内容摘要”部分，根据有关法规和证监会的要求修改了基金合同中份额持有人大会的有关内容。

14. 在“二十、对基金份额持有人的服务”部分，根据证监会的规定及公司的实际情况增加了“手机短信服务”和“资讯服务”的内容。

华安基金管理有限公司

二 四年十一月十三日