

安久证券投资基金 2005 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：交通银行股份有限公司
签发日期：二〇〇六年三月二十八日

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) 基金管理人以及基金经理简介	7
	(二) 基金运作合规性声明	7
	(三) 基金经理工作报告	7
	(四) 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	22
	(一) 基金资产组合	22
	(二) 股票投资组合	22
	(三) 股票明细	23
	(四) 报告期内股票投资组合的重大变动	24
	(五) 债券投资组合	26
	(六) 前五名债券明细	26
	(七) 权证投资组合	26
	(八) 投资组合报告附注	26
九、	基金份额持有人户数和持有人结构	27
十、	重大事件	28
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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2006 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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告的财务报表部分已经审计。

二、基金产品概况

(一) 基金概况

基金名称:	安久证券投资基金
基金简称:	基金安久
交易代码:	184709
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1992 年 8 月 31 日(原四川国信投资基金成立日期) 2000 年 7 月 4 日华安基金管理有限公司开始管理基金安久
期末基金份额总额:	5 亿份
基金存续期:	15 年(自 1992 年 8 月 31 日至 2007 年 8 月 30 日)
基金上市地点:	深圳证券交易所
基金上市日期:	2001 年 8 月 31 日

(二) 基金的投资

投资目标:	本基金为积极成长型基金,本基金投资于积极应用新技术的上市公司。
投资策略:	本基金将通过努力提高自身综合决策能力来减少风险。同时也通过分散投资来减少风险。 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,至少 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单一主业或多主业有良好成长性的公司股票，该类公司的特征是：(1) 预期利润总额增长速度超过行业平均水平或同期 GDP 增长速度；(2) 新技术应用对公司的主营业务贡献明显。

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
信息披露负责人：冯颖
联系电话：021-58881111
传真：021-68863414
电子邮箱：fengying@huanan.com.cn
客户服务热线：021-68604666

(四) 基金托管人

基金托管人：交通银行股份有限公司
(简称“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

(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.huanan.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：上海市南京东路 61 号四楼
登记注册机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
办公地点：深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

财务指标	2005 年度	2004 年度	2003 年度
基金本期净收益	-46,249,351.90	25,176,809.13	-14,055,289.59
加权平均基金份额本期净收益	-0.0925	0.0504	-0.0281
期末可供分配基金收益	-93,137,265.27	-64,777,031.85	-72,064,722.50
期末可供分配基金份额收益	-0.1863	-0.1296	-0.1441
期末基金资产净值	433,321,374.26	435,222,968.15	463,876,169.43
期末基金份额净值	0.8666	0.8704	0.9278
基金加权平均净值收益率	-10.99%	5.39%	-3.37%
本期基金份额净值增长率	-0.44%	-6.19%	19.52%
基金份额累计净值增长率	-19.43%	-19.07%	-13.73%

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、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

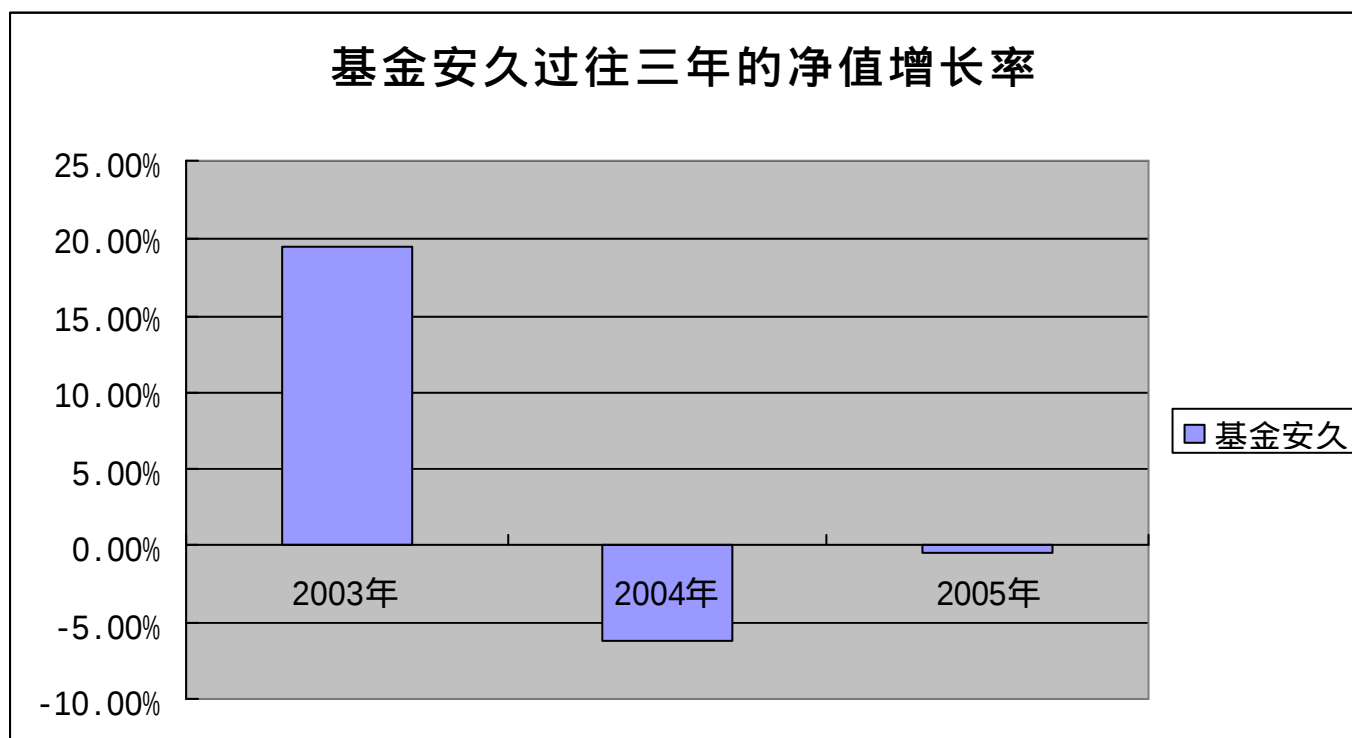
阶段	净值 增长率	净值增长率 标准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
三个月	1.73%	1.83%	-	-	-	-
六个月	7.40%	1.73%	-	-	-	-
一年	-0.44%	2.55%	-	-	-	-
三年	11.63%	2.34%	-	-	-	-
五年	-0.33%	2.11%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-19.43%	2.28%	-	-	-	-

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金安久份额累计净值增长率历史走势图
 2000/7/4 - 2005/12/31



C、图示基金过往三年每年的净值增长率



(三) 基金收益分配情况

本基金过往三年未分红。

四、 管理人报告

(一) 基金管理人以及基金经理简介

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本 1.5 亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气(集团)总公司、上海国际信托投资有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海广电(集团)有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

截至 2005 年 12 月 31 日,公司旗下共管理了基金安信、基金安顺、基金安久、基金安瑞 4 只封闭式证券投资基金,华安创新、华安 180、华安富利、华安宝利 4 只开放式基金,管理资产规模达到 448.50 亿元。

鲍泓先生,经济学学士,11 年证券、基金从业经历。1994 年加入天同证券公司,先后担任投资银行总部项目经理、资产管理总部研究员、经理助理等工作。2000 年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员,从事行业与策略研究等工作。

(二) 基金运作合规性声明

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《安久证券投资基金基金合同》、《安久证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

(三) 基金经理工作报告

(1) 行情回顾

2005 年宏观经济总体继续呈现减速运行的格局;同时,市场对于投资、出口等层面结构性失衡的风险也一度给予了特别的关注。此外,在国际化进程中,A 股内在的制度性缺陷因素加重了市场的困惑及脆弱的持股心态。在上述背景下,一季度 A 股反弹行情高度低于一般预期,局部牛市特征明显;二季度市场在周期性行业估值之惑、股权分置改革之惑、及全流通估值之惑等因素作用下,再创新低,击破千点大关,使饱受摧残的投资者再一次经受了磨难;三季度随着估值本身已具备吸引力且号召力强的蓝筹类公司积极投身“股改”,投资机会开始显现,市场出现全面的恢复性上涨;四季度宏观经济调整趋势逐步明朗、人民币资产对外围资金的吸引力也在不断增强,银行、地产等大市值行业表现出色,并带动市场进一步企稳;而中兴通讯、国阳新能等优质公司在股改进程中迸发的财富效应,也极大地坚定了投资者的持股信心,岁末的反弹行情得以继续向纵深发展。

(2) 操作回顾

安久基金 2005 年净值增长为-0.44%,好于综合指数表现,但在全部封闭式基金中处于相对落后位置。具体操作上看,上半年针对宏观经济减速趋势,增加了食品饮料、医药、金融、商业地产、交通运输等行业的投资比重,降低了金属、机械、造纸等周期类资产比重,但周期类资产减持时机偏晚,导致组合在 4 月底—6 月中旬市场剧烈下跌过程中出现较大损失,进而拖累了全年的净值表现;下半年重点增加了军工、农业、机械、地产、零售、水务等行业及中小企业的配置比例,提升了组合的进攻性,分季度业绩表现也有所回升。

纵观全年操作,存在的问题主要有:

1、投资风格不够灵活多变,导致在防御与进攻、成长与价值、周期与非周期等板块轮动过程中,投资节奏把握能力不强。

2、组合集中度有所偏低,从而不易得到个股的深入研究支持,组合表现也更易波动,降低了投资成功率。

(3) 展望

总体而言,我们对 2006 年的市场持相对乐观态度。宏观经济减速导致的上市公司业绩下滑风险已在指数调整中得到相当程度消化,同时 05 年末的 GDP 修正结果也促使投资者对经济可持续发展的信心进一步增强。此外,估值水平的横向比较,也说明 A 股市场总体已处于安全的投资区域。与 H 股相比,A 股许多个股包括上游的能源、原材料及下游的地产、银行、零售、食品饮料等行业优质公司,都存在较大的“向上”接轨需求,这也是市场多年调整后的必然结果;再有,“股权分置”问题的解决等制度变革因素必将为上市公司的价值提升带来良好的驱动力,为优秀公司提供广阔的发展空间。最后,随着“十一五规划”的出台,国家发展战略将有重大转变,经济结构的变化及增长模式的转变也将催生很多新的投资机会。

2006 年我们将继续跟踪经济增长、消费升级、本币升值以及经济增长方式转变背景下消费类、非贸易品(如服务业)以及资源类企业等领域的投资机会;关注价值类企业阶段性低估产生的机会;继续加大对有核心竞争力、长期发展潜力大的公司的投资比重;同时,也将关注新老划断、上市公司业绩下滑、发达国家资产价格波动的传导等因素导致的市场的风险与机遇。

(四) 内部监察报告

截止 2005 年末,公司管理资产规模达到 448.50 亿元,比 2004 年末的 271 亿元人民币增长了 65.50%。公司的投资客户数量也大幅度增加,从 2004 年末的 35.3 万户增加到 60 万户,增长幅度达到 69%。

在公司管理资产规模与客户数量迅速增长的同时，公司在投资、营销、后台运行等方面面临的风险也随之增大，为杜绝公司发展中的风险隐患、保证公司的持续健康发展，公司于 7、8、9 三个月开展了一次全公司范围内的查隐患、堵漏洞、防事故的风险控制专项行动。根据风险控制专项行动的工作安排，各部门在深入学习法律法规的同时，进行了业务流程的梳理、风险点以及内部控制的自我评估，同时按照自查、评估的结果对相关制度进行了修订和完善，有效降低了公司的管理风险与基金的运作风险。

2005 年度，按照根据年初制订的监察稽核计划各项检查工作已顺利完成。除坚持每日对投资、交易、核算、销售等相关业务活动进行日常合规性监察外，还有计划地对公司相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实。

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

2005 年全年，托管人在安久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。

2005 年全年，华安基金管理有限公司在安久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。

2005 年全年，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久证券投资基金的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真实、准确、完整。

六、 审计报告

信长会师报字(2006)第 10460 号

安久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 2005 年 12 月 31 日的资产负债表和 2005 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《安久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 2005 年 12 月 31 日的财务状况和 2005 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

吕秋萍

罗芳

中国·上海

二 00 六年二月十七日

七、财务会计报告

(一) 资产负债表

项 目	附注	2005年12月31日	2004年12月31日
资产：			
银行存款		2,070,694.15	4,475,601.01
清算备付金		4,631,266.98	13,695,805.81
交易保证金		1,131,465.52	750,000.00
应收证券清算款		5,088,361.21	534,649.09
应收股利		0.00	0.00
应收利息	7(1)	530,072.47	504,958.24
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		331,053,622.25	322,792,121.35
其中：股票投资成本		304,785,745.22	338,016,852.65
债券投资市值		90,653,244.00	94,554,543.70
其中：债券投资成本		90,462,481.50	97,218,930.88
权证投资		0.00	0.00
其中：权证投资成本		0.00	0.00

买入返售证券	0.00	0.00
待摊费用	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	435,158,726.58	437,307,679.20

负债：

应付证券清算款	0.00	553,982.40
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	521,202.32	562,809.94
应付托管费	86,867.08	93,801.68
应付佣金	7(3) 349,282.92	244,117.03
其他应付款	7(4) 750,000.00	500,000.00
预提费用	7(5) 130,000.00	130,000.00
卖出回购证券款	0.00	0.00
负债合计	1,837,352.32	2,084,711.05

所有者权益：

实收基金	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	26,458,639.53	-17,889,118.48
未分配收益	-93,137,265.27	-46,887,913.37
持有人权益合计	433,321,374.26	435,222,968.15
负债和所有者权益合计	435,158,726.58	437,307,679.20

(二) 经营业绩表

项 目	附注	2005年度	2004年度
收入：			
股票差价收入	7(6)	-47,667,488.33	29,710,389.29
债券差价收入	7(7)	758,573.42	-1,653,328.89
权证差价收入		553,546.21	0.00
债券利息收入		2,686,007.69	3,302,171.63
存款利息收入		266,881.22	288,314.74
股利收入		4,929,828.30	2,687,940.75
买入返售证券收入		899.00	0.00
其他收入	7(8)	43,616.30	76,527.03
收入合计		-38,428,136.19	34,412,014.55

费用：

基金管理人报酬	6,330,531.40	7,021,005.32
---------	--------------	--------------

基金托管费	1,055,088.71	1,170,167.63
卖出回购证券支出	63,321.31	662,842.72
其他费用	7(9) 372,274.29	381,189.75
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	50,000.00	50,000.00
费用合计	7,821,215.71	9,235,205.42
基金净收益	-46,249,351.90	25,176,809.13
加：未实现估值增值变动数	44,347,758.01	-53,830,010.41
基金经营业绩	-1,901,593.89	-28,653,201.28

(三) 收益分配表

项 目	附注	2005年度	2004年度
本期基金净收益		-46,249,351.90	25,176,809.13
加：期初未分配收益		-46,887,913.37	-72,064,722.50
可供分配基金净收益		-93,137,265.27	-46,887,913.37
减：本期已分配基金净收益		0.00	0.00
期末基金未分配净收益		-93,137,265.27	-46,887,913.37

(四) 净值变动表

项 目	附注	2005年度	2004年度
一、期初基金净值		435,222,968.15	463,876,169.43
二、本期经营活动：			
基金净收益		-46,249,351.90	25,176,809.13
未实现估值增值变动数		44,347,758.01	-53,830,010.41
经营活动产生的基金净值变动数		-1,901,593.89	-28,653,201.28
四、本期向持有人分配收益		0.00	0.00
五、期末基金净值		433,321,374.26	435,222,968.15

(五) 会计报表附注

1. 基金的基本情况

历史沿革：安久证券投资基金（以下简称“基金”）系根据中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]28号文《关于四川国信投资基金清理规范方案的批复》，经2000年6月四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议通过，由四川国信投资基金清理规范而成。经原四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议通过并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]56号文《关于



同意四川国信投资基金规范为安久证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》批准，基金于2002年5月21日完成扩募，基金总份额由200,000,020份基金份额扩募至500,000,000份基金份额，扩募后基金存续期延长5年，至2007年8月30日止。

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[2000]第28号

核准文件名称：关于四川国信投资基金清理规范方案的批复

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：2000年7月4日

基金合同生效日的基金份额：200,000,020

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

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

本基金的会计年度为公历1月1日至12月31日止。

3) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

4) 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、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

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：

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；

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。

从获赠确认日起至卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证

券交易所挂牌的该权证投资的市价（平均价）估值；未上市交易的权证投资按公允价值估值。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；如果市价低于配股价，按零估值。

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) 证券交易的成本计价方法：

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；收到股权分置改革进程中由非流通股股东支付的现金对价冲减股票投资成本。

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。

获赠权证在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

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账，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账。

8) 收入的确认和计量

证券买卖差价收入：

i) 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。

ii) 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。

iii) 权证差价收入：于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其相关费用的差额入账。

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扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

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扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认入账。

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。

存款利息收入：按本金与适用的利率逐日计提确认，计提对象为银行存款、清算备付金和权证交易保证金。

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。

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%。

基金收益分配采用现金方式。

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。

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

无。

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

无。

13) 重大会计差错的内容和更正金额

无。

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：

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。

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。

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。自 2005 年 6 月 13 日起，对个人投资者从上市公司取得的股息红利所得，暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定计征个人所得税，基金投资者参照前述规定。

基金买卖股票按照 0.2% 的税率征收印花税。从 2005 年 1 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据，由立据双方当事人分别按 1‰ 的税率缴纳证券（股票）交易印花税。

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

5. 资产负债表日后事项

无。

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

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变更为上海电气（集团）总公司、上海国际信托投资有限公司、上海广电（集团）有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和上海沸点投资发展有限公司，本次出资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于 2005 年 4 月 14 日办理完毕。

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	提取管理费	基金合同

基金发起人			
交通银行	基金托管人	提取托管费	基金合同
		银行间交易	成交确认书
上海国际信托投资有限公司	基金管理人股东		
上海电气(集团)总公司	基金管理人股东 (2005 年 4 月 14 日之后)		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人股东 (2005 年 4 月 14 日之后)		
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人股东 (2005 年 4 月 14 日之后)		
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人股东 (2005 年 4 月 14 日之后)		
申银万国证券股份有限公司	基金管理人原股东 (2005 年 4 月 14 日之前)	租用交易席位	席位使用协议
天同证券有限责任公司	基金管理人原股东 (2005 年 4 月 14 日之前)		
东方证券股份有限公司	基金管理人原股东 (2005 年 4 月 14 日之前)	租用交易席位	席位使用协议
方正证券有限责任公司	基金管理人原股东 (2005 年 4 月 14 日之前)	租用交易席位	席位使用协议

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(%)
申银万国证券股份公司	229,031,358.47	12.20	186,967.56	12.35	0.08
东方证券股份有限公司	191,916,798.93	10.22	153,227.60	10.12	0.08
方正证券有限责任公司	85,705,897.50	4.57	70,278.37	4.64	0.08
合 计	506,654,054.90	26.99	410,473.53	27.11	0.08

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(%)
申银万国证券股份公司	318,993,428.25	17.73	257,703.47	17.97	0.08
东方证券股份有限公司	318,573,437.52	17.70	254,622.67	17.75	0.08
方正证券有限责任公司	239,595,056.44	13.31	193,352.93	13.48	0.08
合 计	877,161,922.21	48.74	705,679.07	49.20	0.08

本报告期通过关联人席位的债券、回购和权证成交量：

关 联 人	债券交易量	比例(%)	回购交易量	比例(%)	权证交易量	比例(%)
申银万国证券股份公司	5,710,485.00	5.15	78,000,000.00	59.59	0.00	0.00



东方证券股份有限公司	7,972,899.50	7.19	0.00	0.00	0.00	0.00
方正证券有限责任公司	920,000.00	0.83	0.00	0.00	0.00	0.00
合 计	14,603,384.50	13.17	78,000,000.00	59.59	0.00	0.00

上年度通过关联人席位的债券、回购和权证成交量：

关 联 人	债券交易量	比例(%)	回购交易量	比例(%)	权证交易量	比例(%)
申银万国证券股份有限公司	57,294,450.50	28.46	335,000,000.00	30.88	0.00	0.00
东方证券股份有限公司	30,028,558.69	14.91	252,700,000.00	23.30	0.00	0.00
方正证券有限责任公司	33,111,702.50	16.45	284,000,000.00	26.18	0.00	0.00
合 计	120,434,711.69	59.82	871,700,000.00	80.36	0.00	0.00

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：

本基金在本年度与东方证券股份有限公司通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2005 年度	2004 年度
买入债券结算金额	19,990,000.00	0.00
卖出债券结算金额	0.00	0.00

本基金在 2004 年度与交通银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2005 年度	2004 年度
卖出回购证券	0.00	19,600,000.00
卖出回购证券利息支出	0.00	8,457.53

(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，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。

本基金在本报告期间需支付基金管理人管理费 6,330,531.40 元。（上年度：7,021,005.32 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 1,055,088.71 元。(上年度：1,170,167.63 元)

由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于 2005 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 2,070,694.15 元(2004 年：4,475,601.01)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 94,837.50 元。(2004 年：196,724.97 元)

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2005 年 12 月 31 日的相关余额 4,631,266.98 元计入“结算备付金”科目(2004 年：13,695,805.81 元)

(4). 基金管理公司投资本基金的情况：

2005 年度基金管理公司投资本基金的情况：

关联人	年初数		买入	卖出	年末数		适用费率
	持有份额	持有比例			持有份额	持有比例	
华安基金管理有限公司	5,000,000.00	1.00%	4,582,100.00	0.00	9,582,100.00	1.92%	-

2004 年度基金管理有限公司投资本基金的情况：

关联人	年初数		买入	卖出	年末数		适用费率
	持有份额	持有比例			持有份额	持有比例	
华安基金管理有限公司	5,000,000.00	1.00%	0.00	0.00	5,000,000.00	1.00%	-

(5). 基金管理公司主要股东及其控制的机构投资本基金的情况：

本报告期末与 2004 年末均无。

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	2005 年 12 月 31 日	2004 年 12 月 31 日
银行存款利息	569.48	3,414.83
清算备付金利息	3,798.03	1,772.58
权证保证金利息	59.10	0.00
债券利息	525,645.86	499,770.83
买入返售证券利息	0.00	0.00

合计	530,072.47	504,958.24
(2). 投资估值增值明细：	2005 年 12 月 31 日	2004 年 12 月 31 日
明细项目		
股票估值增值余额	26,267,877.03	-15,224,731.30
债券估值增值余额	190,762.50	-2,664,387.18
合计	26,458,639.53	-17,889,118.48
(3). 应付佣金明细：	2005 年 12 月 31 日	2004 年 12 月 31 日
明细项目		
东方证券股份有限公司	6,454.02	58,765.47
申银万国证券股份有限公司	21,807.27	8,743.29
上海证券有限责任公司	4,366.39	0.00
平安证券有限责任公司	128,725.87	0.00
光大证券股份有限公司	34,830.76	114,806.71
方正证券有限责任公司	3,639.44	61,801.56
国泰君安证券股份有限公司	121,043.44	0.00
联合证券有限责任公司	28,415.73	0.00
合计	349,282.92	244,117.03
(4). 其他应付款明细：	2005 年 12 月 31 日	2004 年 12 月 31 日
明细项目		
券商垫付交易保证金	750,000.00	500,000.00
合计	750,000.00	500,000.00
(5). 预提费用明细：	2005 年 12 月 31 日	2004 年 12 月 31 日
明细项目		
信息披露费	80,000.00	80,000.00
审计费用	50,000.00	50,000.00
合计	130,000.00	130,000.00
(6). 卖出股票：		
明细项目	2005 年	2004 年
卖出股票成交总额	938,705,345.49	907,090,688.77
减：佣金	787,141.69	758,630.96
成本总额	985,585,692.13	876,621,668.52
股票差价收入	-47,667,488.33	29,710,389.29
(7). 卖出债券：		



明细项目	2005 年	2004 年
卖出债券成交总额	91,497,149.05	171,210,645.28
减：成本总额	88,852,377.63	170,909,576.92
应收利息总额	1,886,198.00	1,954,397.25
债券差价收入	758,573.42	-1,653,328.89

(8). 其他收入：

明细项目	2005 年	2004 年
新股、配股申购手续费返还	43,616.30	76,527.03
合计	43,616.30	76,527.03

(9). 其他费用：

明细项目	2005 年	2004 年
审计费	50,000.00	50,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
交易所费用	655.36	9,257.96
其他	21,618.93	21,931.79
合计	372,274.29	381,189.75

(10). 因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价情况：

明细项目	2005 年	2004 年
股权分置现金对价对股票投资成本的累计影响金额	555,598.59	0.00

8. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票情况如下：

本基金截至 2005 年 12 月 31 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票 代码	股票名称	停牌日	年末估值 单价	复牌日	复牌日 开盘价格	数量	总成本	总市值
方案沟通协商阶段停牌：								
000970	中科三环	2005-12-23	6.85	2006-01-05	7.68	1,888,816	12,369,185.25	12,938,389.60

方案实施阶段停牌：

600851	海欣股份	2005-12-19	3.33	2006-02-09	2.86	<u>910,000</u>	<u>5,842,572.83</u>	<u>3,030,300.00</u>
	合 计					<u>2,798,816</u>	<u>18,211,758.08</u>	<u>15,968,689.60</u>

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限的债券。

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	331,053,622.25	76.08%
2	债券	90,653,244.00	20.83%
3	权证	0.00	0.00%
4	银行存款和清算备付金	6,701,961.13	1.54%
5	其他资产	6,749,899.20	1.55%
	合计	435,158,726.58	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	21,324,882.68	4.92%
B	采掘业	44,822,340.48	10.34%
C	制造业	190,184,084.75	43.89%
C0	食品、饮料	22,345,904.22	5.16%
C1	纺织、服装、皮毛	3,030,300.00	0.70%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	51,790,098.36	11.95%
C5	电子	47,154,088.69	10.88%
C6	金属、非金属	18,415,191.12	4.25%
C7	机械、设备、仪表	33,925,951.78	7.83%
C8	医药、生物制品	13,522,550.58	3.12%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,197,500.00	0.51%
G	信息技术业	3,028,523.63	0.70%
H	批发和零售贸易	8,983,471.25	2.07%
I	金融、保险业	13,389,599.46	3.09%
J	房地产业	23,682,680.90	5.47%
K	社会服务业	12,540,359.10	2.89%
M	综合类	10,900,180.00	2.52%
	合计	331,053,622.25	76.40%

(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	600309	烟台万华	2,263,053	32,316,396.84	7.46%
2	002025	航天电器	865,456	25,453,060.96	5.87%
3	600261	G 浙阳光	1,840,779	20,009,267.73	4.62%
4	000792	盐湖钾肥	1,658,748	19,473,701.52	4.49%
5	600583	海油工程	734,838	18,980,865.54	4.38%
6	000402	金 融 街	1,779,297	17,259,180.90	3.98%
7	600000	浦发银行	1,363,503	13,389,599.46	3.09%
8	002041	登海种业	668,082	12,994,194.90	3.00%
9	000970	中科三环	1,888,816	12,938,389.60	2.99%
10	600519	贵州茅台	281,165	12,849,240.50	2.97%
11	600008	首创股份	2,196,210	12,540,359.10	2.89%
12	600348	G 国 阳	1,263,613	11,650,511.86	2.69%
13	000538	云南白药	563,490	11,636,068.50	2.69%
14	600858	银座股份	1,423,000	10,900,180.00	2.52%
15	600550	G 天 威	716,521	8,892,025.61	2.05%
16	600438	通威股份	737,882	8,330,687.78	1.92%
17	600153	建发股份	1,879,405	7,987,471.25	1.84%
18	600761	G 合 力	1,403,673	7,776,348.42	1.79%
19	600489	中金黄金	1,015,308	7,624,963.08	1.76%
20	600028	中国石化	1,400,000	6,566,000.00	1.52%
21	000002	G 万科 A	1,450,000	6,423,500.00	1.48%
22	002021	中捷股份	1,107,458	6,268,212.28	1.45%
23	600600	青岛啤酒	620,470	5,162,310.40	1.19%
24	000869	张 裕 A	193,153	4,334,353.32	1.00%
25	600456	G 宝 钛	251,622	3,281,150.88	0.76%
26	600580	G 卧 龙	515,478	3,268,130.52	0.75%
27	600150	G 重 机	381,084	3,231,592.32	0.75%
28	600851	海欣股份	910,000	3,030,300.00	0.70%
29	600406	国电南瑞	199,639	3,028,523.63	0.70%
30	002031	巨轮股份	403,120	2,870,214.40	0.66%
31	600323	南海发展	250,000	2,197,500.00	0.51%
32	600660	福耀玻璃	416,632	2,195,650.64	0.51%
33	600196	复星医药	397,992	1,886,482.08	0.44%
34	002045	广州国光	199,500	1,691,760.00	0.39%
35	600312	平高电气	242,067	1,619,428.23	0.37%
36	002024	苏宁电器	50,000	996,000.00	0.23%

(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%或前二十名股票明细

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	600309	烟台万华	57,721,053.92	13.26%
2	002041	登海种业	37,555,754.49	8.63%
3	000792	盐湖钾肥	30,596,449.99	7.03%
4	600019	G 宝 钢	30,500,720.04	7.01%
5	600550	G 天 威	29,544,641.02	6.79%
6	600050	中国联通	24,653,241.37	5.66%
7	600150	G 重 机	24,447,480.90	5.62%
8	002025	航天电器	24,441,926.13	5.62%
9	000538	云南白药	23,854,325.64	5.48%
10	600519	贵州茅台	22,664,463.62	5.21%
11	000402	金 融 街	22,327,664.93	5.13%
12	600320	振华港机	22,063,194.04	5.07%
13	600123	兰花科创	21,988,231.57	5.05%
14	600289	亿阳信通	21,938,412.26	5.04%
15	600583	海油工程	19,737,436.80	4.54%
16	600085	G 同仁堂	18,706,462.07	4.30%
17	600261	G 浙阳光	18,640,011.38	4.28%
18	600009	上海机场	18,321,025.31	4.21%
19	600600	青岛啤酒	17,440,256.89	4.01%
20	600348	G 国 阳	17,107,917.88	3.93%
21	600036	招商银行	16,196,105.72	3.72%
22	000488	晨鸣纸业	16,031,587.09	3.68%
23	600580	G 卧 龙	15,908,343.05	3.66%
24	000825	太钢不锈	15,880,689.12	3.65%
25	600151	航天机电	15,856,561.61	3.64%
26	000869	张 裕 A	15,681,516.77	3.60%
27	002028	思源电气	15,300,847.24	3.52%
28	600183	生益科技	14,232,223.12	3.27%
29	600269	赣粤高速	13,871,411.23	3.19%
30	600858	银座股份	13,754,581.64	3.16%
31	600000	浦发银行	13,461,238.41	3.09%
32	000970	中科三环	12,770,905.32	2.93%
33	600008	首创股份	11,690,327.14	2.69%
34	600832	G 明 珠	10,096,952.79	2.32%
35	600438	通威股份	9,654,593.02	2.22%
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	600123	兰花科创	32,600,454.56	7.49%



2	600019	G 宝 钢	30,765,486.16	7.07%
3	002041	登海种业	26,705,893.14	6.14%
4	000825	太钢不锈	24,797,262.84	5.70%
5	002028	思源电气	24,005,349.89	5.52%
6	600026	G 中 海	23,855,833.34	5.48%
7	600150	G 重 机	22,692,209.21	5.21%
8	600050	中国联通	22,137,970.42	5.09%
9	600636	三 爱 富	21,165,943.43	4.86%
10	600550	G 天 威	21,114,440.45	4.85%
11	000488	晨鸣纸业	20,854,463.97	4.79%
12	600320	振华港机	20,773,853.96	4.77%
13	600005	G 武 钢	20,713,458.96	4.76%
14	600309	烟台万华	20,539,092.73	4.72%
15	000060	G 中 金	20,510,189.26	4.71%
16	600085	G 同仁堂	17,584,084.16	4.04%
17	600308	G 华 泰	17,123,365.80	3.93%
18	600036	招商银行	17,099,963.12	3.93%
19	600009	上海机场	16,695,666.47	3.84%
20	600289	亿阳信通	15,432,980.11	3.55%
21	000002	G 万科 A	14,712,234.37	3.38%
22	600660	福耀玻璃	14,615,937.79	3.36%
23	600795	国电电力	14,225,575.11	3.27%
24	000869	张 裕 A	13,763,111.69	3.16%
25	600151	航天机电	13,668,267.85	3.14%
26	600580	G 卧 龙	13,508,987.63	3.10%
27	600600	青岛啤酒	13,110,188.56	3.01%
28	000983	G 西 煤	13,030,915.55	2.99%
29	600269	赣粤高速	12,533,274.54	2.88%
30	600205	山东铝业	12,307,703.29	2.83%
31	600426	华鲁恒升	12,141,906.67	2.79%
32	600296	兰州铝业	12,072,567.51	2.77%
33	000538	云南白药	11,898,718.90	2.73%
34	600519	贵州茅台	11,761,198.27	2.70%
35	600033	福建高速	11,712,953.18	2.69%
36	600428	G 中 远	11,347,544.71	2.61%
37	000792	盐湖钾肥	11,123,081.46	2.56%
38	000778	G 铸 管	10,874,595.77	2.50%
39	600832	G 明 珠	10,364,147.08	2.38%
40	600183	生益科技	10,292,651.20	2.36%
41	000069	华侨城 A	10,247,865.09	2.35%
42	000969	G 安泰 A	9,962,737.19	2.29%
43	000527	美的电器	9,855,352.78	2.26%
44	600302	标准股份	9,358,987.85	2.15%
45	000911	南宁糖业	8,963,096.06	2.06%



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*	952,910,183.29
卖出股票的收入总额	938,705,345.49

*: 买入股票的成本总额中未扣除因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价 555,598.59 元。

(五) 债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国债投资	59,509,442.00	13.73%
2	金融债	30,110,000.00	6.95%
3	可转债	1,033,802.00	0.24%
	合计	90,653,244.00	20.92%

(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	010115	21 国债	290,000	29,548,100.00	6.82%
2	050415	05 农发 15	200,000	19,990,000.00	4.61%
3	010004	20 国债	193,800	19,546,668.00	4.51%
4	040217	04 国开 17	100,000	10,120,000.00	2.34%
5	010110	21 国债	55,800	5,587,254.00	1.29%

(七) 权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

本报告期末本基金所持有权证情况：无。

(八) 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，未上市交易的权证投资（包括配股权证）按公允价值估值。

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	深交所交易保证金	1,000,000.00
2	权证交易保证金	131,465.52
3	应收利息	530,072.47
4	待摊费用	0.00
5	应收证券清算款	5,088,361.21
	合计	6,749,899.20

4、处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	持有数量(张)	市值(元)	占净值比例
100196	复星转债	9,800	1,033,802.00	0.24%

5、整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	成本总额(元)	获得途径
1	580000	宝钢 JTB1	383,200	0.00	股权分置改革被动持有

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	9,181	-
平均每户持有基金份额	54,460	-
机构投资者持有的基金份额	350,630,844	70.13%
个人投资者持有的基金份额	149,369,156	29.87%

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(集团)公司	47,457,034	9.49%
2	湘财-汇丰-荷兰银行有限公司	44,860,076	8.97%
3	招商证券-招行-招商证券基金 宝集合资产管理计划	36,327,365	7.27%
4	国泰君安-花旗-DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	32,195,048	6.44%
5	中国人寿保险股份有限公司	30,750,796	6.15%
6	中国人寿资产管理有限公司	26,575,911	5.32%
7	新华人寿保险股份有限公司	22,598,625	4.52%
8	泰康人寿保险股份有限公司	19,933,037	3.99%
9	全国社保基金一零九组合	11,741,440	2.35%
10	全国社保基金六零三组合	10,018,704	2.00%

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：

1. 本基金管理人于 2005 年 5 月 25 日公告：研究决定对"安久证券投资基金"的基金经理作如下调整：

聘任鲍泓先生为"安久证券投资基金"基金经理,王国卫先生不再担任"安久证券投资基金"基金经理,吴娜女士不再担任"安久证券投资基金"基金经理助理。

2. 基金托管人交通银行于 2005 年 9 月 27 日公布了交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管任职资格的公告,交通银行资产托管部原总经理谢红兵同志已调离交通银行,不再担任资产托管部总经理职务。目前暂由资产托管部谷娜莎副总经理主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在 2005 年 9 月 27 日《证券时报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》。

3. 基金托管人交通银行于 2006 年 1 月 25 日公布了交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管任职资格的公告,阮红同志担任交通银行资产托管部总经理,主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在 2006 年 1 月 25 日《证券时报》、《金融时报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管任职资格的公告》。

(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：

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：50,000.00 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)本报告期间租用证券公司席位情况如下：

1. 报告期内租用证券公司席位的变更情况：

新增席位：

券商名称	上交所席位数	深交所席位数
国泰君安股份有限公司	1	-
联合证券有限责任公司	-	1

退租席位：

券商名称	上交所席位数	深交所席位数
上海证券有限责任公司	-	1

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
光大证券股份有限公司	1	440,090,179.79	23.45%	344,374.02	22.75%
申银万国证券股份有限公司	1	229,031,358.47	12.20%	186,967.56	12.35%
东方证券股份有限公司	2	191,916,798.93	10.22%	153,227.60	10.12%
平安证券有限责任公司	1	536,767,598.62	28.60%	438,993.76	29.00%
方正证券有限责任公司	1	85,705,897.50	4.57%	70,278.37	4.64%
上海证券有限责任公司	1	24,728,146.79	1.32%	19,350.05	1.28%
国泰君安股份有限公司	1	332,542,464.54	17.72%	272,351.81	17.99%
联合证券有限责任公司	1	36,313,876.90	1.93%	28,415.73	1.88%
合 计	9	1,877,096,321.54	100.00%	1,513,958.90	100.00%

(2). 债券、回购及权证交易情况：

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	权证成交量	占总成交总量比例
光大证券股份有限公司	2,086,748.80	1.88%	0.00	0.00	0.00	0.00
申银万国证券股份有限公司	5,710,485.00	5.15%	78,000,000.00	59.59%	0.00	0.00
东方证券股份有限公司	7,972,899.50	7.19%	0.00	0.00	0.00	0.00
平安证券有限责任公司	61,463,913.60	55.42%	52,900,000.00	40.41%	0.00	0.00
方正证券有限责任公司	920,000.00	0.83%	0.00	0.00	0.00	0.00
上海证券有限责任公司	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
国泰君安股份有限公司	32,757,816.50	29.53%	0.00	0.00	553,589.17	100.00%
联合证券有限责任公司	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
合 计	110,911,863.40	100.00%	130,900,000.00	100.00%	553,589.17	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；

(2) 财务状况良好，经营行为规范；

(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) 证券研究或市场研究实力较强，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、个股分析、基金市场分析等各方面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

由研究发展部或渠道业务部牵头并组织相关人员依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) 填写《新增席位申请审核表》

研究发展部或渠道业务部汇总对各候选席位券商的综合评估结果，择优选出拟新增席位，填写《新增席位申请审核表》，对拟新增席位的必要性进行阐述。

(3) 候选席位名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部或渠道业务部提交的《新增席位申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易席位使用协议》，并通知基金托管人。

(九) 其他重要事项：

1、权证投资方案：

2005 年 8 月 22 日，本基金管理人发布关于所管理的部分证券投资基金权证投资方案的公告，安久证券投资基金可主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

上述作为临时公告披露的重大事项均刊登于《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上。

(十) 2005 年 6 月 23 日，交通银行股份有限公司在香港联交所成功上市。

十一、备查文件目录

1、《安久证券投资基金基金合同》；



- 2、《安久证券投资基金扩募说明书》；
- 3、《安久证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准安久证券投资基金设立的文件；
- 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
2006 年 3 月 28 日