

# 安久证券投资基金 2005 年年度报告摘要

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           | 11 |
|     | (四) 净值变动表           | 12 |
|     | (五) 会计报表附注          | 12 |
| 八、  | 投资组合报告              | 16 |
|     | (一) 基金资产组合          | 16 |
|     | (二) 股票投资组合          | 16 |
|     | (三) 股票明细            | 16 |
|     | (四) 报告期内股票投资组合的重大变动 | 17 |
|     | (五) 债券投资组合          | 19 |
|     | (六) 前五名债券明细         | 19 |
|     | (七) 权证投资组合          | 19 |
|     | (八) 投资组合报告附注        | 20 |
| 九、  | 基金份额持有人户数和持有人结构     | 20 |
| 十、  | 重大事件                | 21 |
| 十一、 | 备查文件目录              | 24 |

## 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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)<br>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。<br>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）  
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

### （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.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

### （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<br>增长率 | 净值增长率<br>标准差 | 业绩比较<br>基准收益<br>率 | 业绩比较基<br>准收益率标<br>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<br>生效起至今 | -19.43%   | 2.28%        | -                 | -                    | - | - |

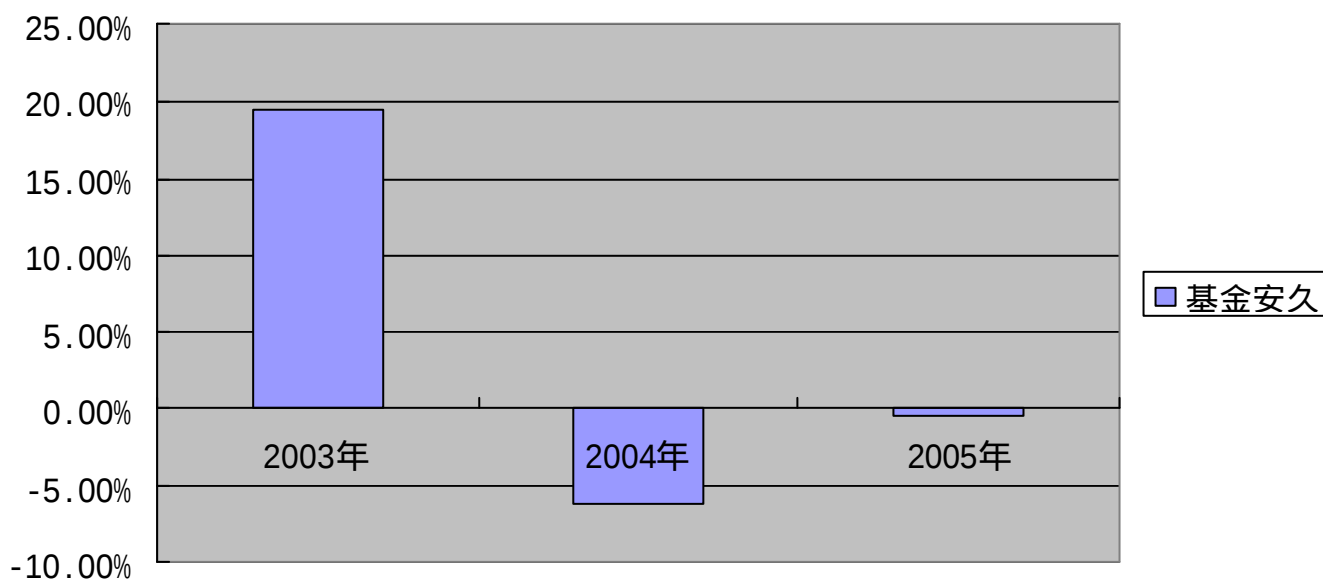
##### B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

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

基金安久过往三年的净值增长率



### (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

上海立信长江会计师事务所有限公司对安久证券投资基金本年度财务报表出具了无保留意见的审计报告。

## 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           |
|---------------|----|-----------------------|-----------------------|
| <b>资产：</b>    |    |                       |                       |
| 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          |    | 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          |    | <u>435,158,726.58</u> | <u>437,307,679.20</u> |
| <b>负债：</b>    |    |                       |                       |
| 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          |    | 349,282.92            | 244,117.03            |
| 其他应付款         |    | 750,000.00            | 500,000.00            |
| 预提费用          |    | 130,000.00            | 130,000.00            |
| 卖出回购证券款       |    | 0.00                  | 0.00                  |
| 负债合计          |    | <u>1,837,352.32</u>   | <u>2,084,711.05</u>   |
| <b>所有者权益：</b> |    |                       |                       |
| 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       |    | -47,667,488.33 | 29,710,389.29  |
| 债券差价收入       |    | 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         |    | 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         |    | 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. 主要会计政策、会计估计及其变更

本年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

##### 2. 重大会计差错的内容和更正金额

无。

##### 3. 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<br>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<br>银行间交易 | 基金合同<br>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            | 租用交易席位 | 席位使用协议 |
|                | (2005 年 4 月 14 日之前) |        |        |
| 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            | 租用交易席位 | 席位使用协议 |
|                | (2005 年 4 月 14 日之前) |        |        |
| 方正证券有限责任公司     | 基金管理人原股东            | 租用交易席位 | 席位使用协议 |
|                | (2005 年 4 月 14 日之前) |        |        |

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<br>量比例<br>(%) | 佣金         | 占总佣金<br>比例(%) | 平均佣金<br>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<br>量比例<br>(%) | 佣金         | 占总佣金<br>比例(%) | 平均佣金<br>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、回购及权证成交量：

| 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、回购及权证成交量：

| 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：

本报告期末和 2004 年末均无。

### 4. 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<br>单价 | 复牌日        | 复牌日<br>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% |

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于  
<http://www.huaan.com.cn> 网站的年度报告正文。

#### (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<br>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<br>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<br>宝集合资产管理计划                | 36,327,365 | 7.27%   |
| 4  | 国泰君安-花旗-DEUTSCHE<br>BANK AKTIEGESELLSCHAFT | 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              | 占总成交量比例 | 佣金           | 占总佣金比例  |
|--------------|--------|------------------|---------|--------------|---------|
| 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<br>总量比例 | 回购成交量          | 占总成交<br>总量比例 | 权证成交量      | 占总成交<br>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，并能为本基金提供全面的信息服；

(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、《安久证券投资基金招募说明书》；
- 3、《安久证券投资基金托管协议》；
- 4、《安久证券投资基金 2005 年度报告》；
- 5、中国证监会批准安久证券投资基金设立的文件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、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