

华安宝利配置证券投资基金 2005 年半年度报告摘要

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

签发日期：二〇〇五年八月二十六日

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。本半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根据本基金合同规定,于 2005 年 8 月 12 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

二、基金产品概况

1、基金概况

基金名称：华安宝利配置证券投资基金

基金简称：华安宝利

交易代码：040004

深交所行情代码：160404

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 8 月 24 日

期末基金份额总额：625,906,908.63 份

基金存续期：不定期

2、基金的投资

投资目标：本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。

投资策略：基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。

业绩比较基准： $35\% \times \text{天相转债指数收益率} + 30\% \times \text{天相 280 指数收益率} + 30\% \times \text{天相国债全价指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$

风险收益特征：本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等),但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为:利率风险,政策风险,经济周期风险,信用风险,再投资风险,上市公司经营风险,新产品创新带来的风险,购买力风险,流动性风险,现金管理风险,技术风险,管理风险,巨额赎回风险等。

3、基金管理人

基金管理人：华安基金管理有限公司

注册及办公地址：上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼(邮政编码：200120)

信息披露负责人：冯颖

联系电话：021-58881111

传真：021-68863414

电子邮箱：fengying@huaan.com.cn

客户服务热线：021-68604666

4、基金托管人

基金托管人：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)

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

5、信息披露

管理人互联网地址：<http://www.huaan.com.cn>

报告置备地点：上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

财务指标	2005 年 1-6 月
基金本期净收益：	1,785,663.74
基金加权份额本期净收益：	0.0034
期末可供分配基金收益	-3,412,227.32
期末可供分配基金份额收益	-0.0055
期末基金资产净值：	635,853,239.22
期末基金份额净值：	1.016
基金加权平均净值收益率	0.33%
本期基金份额净值增长率	3.29%
基金份额累计净值增长率	3.49%

提示：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、净值表现

A、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
过去一个月	4.21%	1.58%	1.42%	0.88%
过去三个月	-0.68%	1.20%	-0.55%	0.65%
过去六个月	3.29%	0.96%	-0.41%	0.58%
自基金合同生效起至今	3.49%	0.75%	-1.91%	0.55%

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

注: 1、华安宝利配置证券投资基金成立于 2004 年 8 月 24 日,截至本报告期末,不满一年。
2、根据《华安宝利配置证券投资基金基金合同》,自本基金成立 90 个工作日内,本基金投资可转换债券及其对应的基础股票的比例应达到 10%-70%(可转换债券所对应的基础股票的投资比例不超过基金净资产的 20%)、其它债券(除可转换债券外)的比例应达到 10%-65%、其它股票(除可转换债券所对应的基础股票外)的比例应达到 10%-65%。截止本报告期末,本基金已符合上述投资比例限制。

四、 管理人报告

1. 基金经理

袁蓓女士:经济学学士,五年证券从业经历。曾在中国平安保险(集团)股份有限公司投资管理中心工作。2003 年 1 月加入华安基金管理有限公司,在基金投资部从事证券投资和研究工作。现任华安宝利配置基金的基金经理。

汤礼辉先生,经济学硕士,7 年证券、基金从业经历。曾在大鹏证券上海总部、申银万国证券研究所工作。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,从事医药、金融行业及投资策略研究。现任研究发展部副总监。

2. 基金运作合规性声明

本报告期间,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套管理办法、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,遵循"忠诚理财、智慧回报"的公司理念,在严格控制风险的基础上,为持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为存在。基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

3. 基金经理工作报告

(1)本基金业绩表现

截止 2005 年 6 月 30 日,本基金单位净值为 1.016 元,累计单位净值 1.036 元,2005 年上半年累计单位净值上升 3.29%,同期衡量业绩的比较基准下跌 0.41%。

(2)2005 年上半年宏观经济和证券市场回顾

2005 年宏观经济仍维持较高的增长水平,但随着国家对房地产等过热领域的调控力度的加大,部分经济指标出现了见顶迹象,物价涨幅出现回落。此外,商业银行出于股改和资本充足率的考量和限制,大多采取了谨慎放贷的政策,从而导致货币政策中出现了信贷趋紧的现象。人民币汇率机制的变动也成为上半年宏观经济的讨论热点。

在宏观经济预期和市场改革的双重影响下,05 年上半年债券市场和股票市场演绎出截然相反的两重走势。在宏观经济见顶、通胀压力趋缓和资金供给过剩等因素和预期的影响下债券市场创出有史以来最大涨幅,收益率曲线稳步下降;而股票市场则围绕着宏观经济和股权分置改革两大主旋律出现了巨幅的波动,连续创出新高,估值水平接近甚至局部低于国际水平。

(3)基金运作情况回顾

宝利配置基金在 2005 年上半年投资运作中以立足长远为出发,从相对估值比较的角度,逐步加大了对股票和转债的投资力度,提高了股票和转债的仓位并逐步对普通债券进行了局部的减持,积极参与了短期融资券等新品种的投资。上半年在目标市场波动较大和业绩比较基准下跌的情况下,基金基本实现了平稳运作,基金累计净值上涨 3.29%,并于 4 月 20 日对持有人

按每十份派发了现金红利 0.20 元,符合本基金稳健运作的定位。

(4)市场展望和投资策略

宝利配置基金看好股权分置改革给股票市场带来的挑战和中长期机遇,同时也冷静面对宏观经济数据面临短期回调的可能性和经济长期高速发展的趋势,将立足于各目标市场间和市场内的相对估值比较,结合国际市场估值水平和国内外宏观经济,动态的调整资产配置比例和优化组合结构,并重点关注品种创新给股票市场和债券市场带来的投资机会,同时进一步深化风险管理在基金投资中的贡献。

此外,宝利基金将继续密切关注货币政策对证券市场的影响,在汇率机制改革有所突破后,重点关注信贷政策的动向。加强对税制改革等财政政策的研究,特别是所得税并轨和增值税改革等进程的跟踪和分析。

五、 托管人报告

2005 年上半年,托管人在华安宝利配置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 年上半年,华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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 年上半年,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华安宝利配置证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

六、 财务会计报告(未经审计)

(一)、资产负债表

项 目 附注	2005 年 6 月 30 日	2004 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	26,246,095.33	6,021,781.47
清算备付金	8,363,066.67	1,843,785.91
交易保证金	500,000.00	500,000.00
应收证券清算款	61,649.06	665,849.47
应收股利	208,000.00	-
应收利息	3,175,571.69	3,366,989.84
应收申购款	216,619.52	49,760.00
其他应收款	-	-
股票投资市值	340,254,854.42	171,628,171.98
其中：股票投资成本	343,978,293.46	171,351,541.96
债券投资市值	259,177,761.13	325,802,722.60
其中：债券投资成本	258,791,139.92	326,059,223.74
配股权证	-	-
买入返售证券	-	89,600,000.00

待摊费用	-	-
其他资产	-	-
资产合计:	638,203,617.82	599,479,061.27
	-	-
负债:		
应付证券清算款	318,617.96	911,345.07
应付赎回款	218,162.99	149,526.57
应付赎回费	822.23	563.54
应付管理人报酬	603,376.32	420,685.73
应付托管费	125,703.40	87,642.87
应付佣金	379,968.78	172,095.16
应付利息	-	-
其他应付款	500,000.00	500,000.00
卖出回购证券款	-	-
预提费用	203,726.92	100,000.00
负债合计:	2,350,378.60	2,341,858.94
	-	-
所有者权益:		
实收基金	625,906,908.63	595,725,509.60
未实现利得	13,358,557.91	-3,990,339.27
未分配收益	-3,412,227.32	5,402,032.00
持有人权益合计:	635,853,239.22	597,137,202.33
负债和所有者权益合计	638,203,617.82	599,479,061.27
基金份额净值	1.016	1.002

(二)、经营业绩表

项 目 附注	2005 年度
收入:	
股票差价收入	-6,607,317.51
债券差价收入	3,574,869.66
债券利息收入	3,051,553.28
存款利息收入	277,765.18
股利收入	5,095,856.09
买入返售证券收入	83,699.74
其他收入	452,577.94
收入合计	5,929,004.38
费用:	
基金管理人报酬 3(3)	3,189,764.97
基金托管费 3(3)	664,534.37
卖出回购证券支出	113,715.26
其他费用	175,326.04
其中:信息披露费	128,931.73
审计费用	24,795.19

费用合计	4,143,340.64
基金净收益	1,785,663.74
加：未实现估值增值变动数	-3,356,946.71
基金经营业绩	-1,571,282.97

(三)、收益分配表

项 目 附注	2005 年 1-6 月
本期基金净收益	1,785,663.74
加：期初未分配收益	5,402,032.00
加：本期申购基金单位的损益平准金	2,577,083.63
减：本期赎回基金单位的损益平准金	2,184,389.88
可供分配基金净收益	7,580,389.49
减：本期已分配基金净收益	10,992,616.81
期末基金未分配净收益	-3,412,227.32

(四)、净值变动表

项 目 附注	2005 年 1-6 月
一、期初基金净值	597,137,202.33
二、本期经营活动：	
基金净收益	1,785,663.74
未实现估值增值变动数	-3,356,946.71
经营活动产生的基金净值变动数	-1,571,282.97
三、本期基金单位交易：	
基金申购款	407,190,024.61
基金赎回款	-355,910,087.94
基金单位交易产生的基金净值变动数	51,279,936.67
四、本期向持有人分配收益	10,992,616.81
五、期末基金净值	635,853,239.22

(五)、会计报表附注

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制,会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会于 2005 年 7 月 1 日起颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号《半年度报告的内容与格式》、证券投资基金信息披露编报规则第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第 4 号《基金投资组合报告的编制及披露》进行编制及披露。

1. 会计政策

本半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。

根据财政部、国家税务总局的财税字财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》中有关规定:自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局的财税[2005]102 号文《财政部 国家税务总局关于股息红利个人所得税有关政策的通知》:自 2005 年 6 月 13 日,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。

根据财政部、国家税务总局的财税[2005]11 号文《财政部 国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》: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。

2. 本报告期重大会计差错

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

关联人	关系	交易性质	法律依据
-----	----	------	------

华安基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构	提取管理费	基金合同
------------	----------------------------	-------	------

交通银行	基金托管人、基金代销机构	提取托管费	基金合同
------	--------------	-------	------

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

上海广电(集团)有限公司	基金管理人股东		
--------------	---------	--	--

上海沸点投资发展有限公司	基金管理人股东		
--------------	---------	--	--

上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人股东		
----------------	---------	--	--

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：无

本报告期通过关联人席位的债券和回购成交量：无。

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：无。

(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 1.2%的年费率计提,计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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 3,189,764.97 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 664,534.37 元。

(4). 关联方持有的基金份额

2005 年 6 月 30 日

基金份额 净值

华安基金管理有限公司 50,000,000.00 50,800,000.00

4. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

本基金流通受限、不能自由转让的资产为获配的新股和配股。在估值时如果该股票还未上市,则按成本计价;如已上市,则按当日收盘价计价。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票情况如下:

股票名称	数量	估值方法	转让受限原因	受限期限	总成本	总市值
中材国际	16,970	按市价估值	未流通	2005-7-12	127,784.10	273,556.40
登海种业	29,165	按市价估值	未流通	2005-7-20	487,055.50	627,922.45
江苏三友	110,159	按市价估值	未流通	2005-8-18	391,064.45	571,725.21
广州国光	63,467	按市价估值	未流通	2005-8-23	685,443.60	726,697.15
轴研科技	31,879	按市价估值	未流通	2005-8-26	203,706.81	376,172.20
成霖股份	104,300	按市价估值	未流通	2005-8-31	896,980.00	948,087.00
三花股份	67,962	按市价估值	未流通	2005-9-7	502,239.18	688,455.06

3,294,273.64 4,212,615.47

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

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	340,254,854.42	53.31%
2	债券	259,177,761.13	40.61%
3	银行存款和清算备付金	34,609,162.00	5.42%
4	其他资产	4,161,840.27	0.65%
	合计	638,203,617.82	100.00%

(二)、股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	4,466,013.30	0.70%

B	采掘业	32,182,265.86	5.06%
C	制造业	208,983,268.10	32.87%
C0	食品、饮料	15,487,790.80	2.44%
C1	纺织、服装、皮毛	571,725.21	0.09%
C2	木材、家具	3,502,301.40	0.55%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	61,277,788.05	9.64%
C5	电子	14,046,697.15	2.21%
C6	金属、非金属	51,496,177.44	8.10%
C7	机械、设备、仪表	34,175,754.69	5.37%
C8	医药、生物制品	28,425,033.36	4.47%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,478,982.00	0.39%
E	建筑业	273,556.40	0.04%
F	交通运输、仓储业	42,068,868.48	6.62%
G	信息技术业	3,455,032.32	0.54%
I	金融、保险业	13,553,723.28	2.13%
J	房地产业	10,660,000.00	1.68%
K	社会服务业	22,133,144.68	3.48%
	合计	340,254,854.42	53.51%

(三)、 投资前十名股票明细

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	2,929,411.00	33,658,932.39	5.29%
2	600019	宝钢股份	6,500,000.00	32,370,000.00	5.09%
3	000069	华侨城 A	2,437,571.00	22,133,144.68	3.48%
4	600196	复星医药	4,425,310.00	21,861,031.40	3.44%
5	600269	赣粤高速	2,200,022.00	21,274,212.74	3.35%
6	000792	盐湖钾肥	1,500,383.00	14,928,810.85	2.35%
7	600583	海油工程	600,634.00	13,988,765.86	2.20%
8	600887	伊利股份	1,050,432.00	13,813,180.80	2.17%
9	600036	招商银行	2,236,588.00	13,553,723.28	2.13%
10	002025	航天电器	750,000.00	13,320,000.00	2.09%

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> 网站的半年度报告正文。

(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动

1、 累计买入、 累计卖出价值前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例
1	000069	华侨城 A	43,565,842.20	7.30%
2	600309	烟台万华	34,381,729.32	5.76%
3	600019	宝钢股份	33,919,888.22	5.68%
4	600196	复星医药	27,343,566.25	4.58%
5	600887	伊利股份	20,230,857.44	3.39%
6	600269	赣粤高速	19,047,925.56	3.19%

7	600002	齐鲁石化	17,679,408.10	2.96%
8	000933	神火股份	17,092,067.95	2.86%
9	000402	金融街	16,403,424.41	2.75%
10	002031	巨轮股份	15,623,331.55	2.62%
11	600320	振华港机	14,959,776.70	2.51%
12	600028	中国石化	13,723,857.09	2.30%
13	000866	扬子石化	13,612,613.55	2.28%
14	600583	海油工程	13,488,453.29	2.26%
15	600123	兰花科创	13,141,931.72	2.20%
16	600066	宇通客车	13,040,041.12	2.18%
17	600036	招商银行	12,923,789.97	2.16%
18	002025	航天电器	12,789,227.53	2.14%
19	600900	长江电力	12,010,841.84	2.01%
20	600426	华鲁恒升	11,666,436.79	1.95%

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	000069	华侨城 A	25,687,830.21	4.30%
2	600028	中国石化	20,377,662.48	3.41%
3	600320	振华港机	15,500,664.47	2.60%
4	600002	齐鲁石化	14,795,652.28	2.48%
5	600900	长江电力	14,601,885.97	2.45%
6	000538	云南白药	13,204,492.26	2.21%
7	000866	扬子石化	12,324,595.16	2.06%
8	000402	金融街	12,284,837.55	2.06%
9	600875	东方电机	11,580,219.93	1.94%
10	600019	宝钢股份	11,526,674.37	1.93%
11	600309	烟台万华	10,699,605.26	1.79%
12	600348	国阳新能	10,623,657.30	1.78%
13	000423	东阿阿胶	10,236,949.78	1.71%
14	002031	巨轮股份	9,569,194.97	1.60%
15	600033	福建高速	9,476,401.90	1.59%
16	600795	国电电力	9,351,407.99	1.57%
17	600029	南方航空	9,172,558.31	1.54%
18	600636	三爱富	8,960,879.19	1.50%
19	600426	华鲁恒升	8,651,849.98	1.45%
20	600271	航天信息	8,365,176.73	1.40%

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： 573,365,178.99

卖出股票的收入总额： 394,461,423.71

(五)、 债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	20,102,527.00	3.16%

2	金融债券	101,476,000.00	15.96%
3	企业债券	21,159,991.77	3.33%
4	央行票据	0.00	0.00%
5	可转换债券	116,439,242.36	18.31%
	合计	259,177,761.13	40.76%

(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	040217	04 国开 17	600,000.00	60,780,000.00	9.56%
2	040212	04 国开 12	400,000.00	40,696,000.00	6.40%
3	110874	创业转债	304,980.00	30,860,926.20	4.85%
4	100726	华电转债	228,730.00	23,792,494.60	3.74%
5	0581004	05 国开投 CP01	200,000.00	19,902,230.77	3.13%

(七)、投资组合报告附注

1、本基金的估值方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日(或最近交易日)的市场收盘价计算,已发行未上市股票采用成本价计算。在银行间债券市场挂牌交易的债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑市场成交价、报价、收益率曲线、成本价等因素确定的反映公允价值的价格估值。

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	深圳结算保证金	500,000.00
2	应收利息	3,175,571.69
3	买入返售证券	-
4	应收证券清算款	61,649.06
5	应收申购款	216,619.52
6	应收股利	208,000.00
	合计	4,161,840.27

4、处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	100096	云化转债	73,120	10,274,822.40	1.62%
2	100726	华电转债	228,730	23,792,494.60	3.74%
3	100795	国电转债	38,420	4,182,017.00	0.66%
4	110001	邯钢转债	40,000	4,117,600.00	0.65%
5	110036	招行转债	28,000	2,896,880.00	0.46%

6	110037	歌华转债	63,490	6,556,612.30	1.03%
7	110219	南山转债	31,020	3,053,919.00	0.48%
8	125488	晨鸣转债	38,180	4,026,462.80	0.63%
9	125630	铜都转债	10,909	1,180,681.07	0.19%
10	125729	燕京转债	6,100	670,390.00	0.11%
11	125822	海化转债	19,900	2,085,122.00	0.33%
12	125932	华菱转债	16,083	1,613,607.39	0.25%
13	125936	华西转债	123,570	12,164,230.80	1.91%
14	125959	首钢转债	59,460	5,793,187.80	0.91%
15	126002	万科转 2	30,300	3,170,289.00	0.50%

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 2,607 户 -

平均每户持有基金份额 240,087.04 -

机构投资者持有的基金份额 575,592,077.68 91.96%

个人投资者持有的基金份额 50,314,830.95 8.04%

十、 开放式基金份额变动

项目 份额(份)

基金合同生效日的基金份额总额 1,130,480,770.08

期初基金份额总额 595,725,509.60

加：本期申购基金份额总额 386,036,918.80

减：本期赎回基金份额总额 355,855,519.77

期末基金份额总额 625,906,908.63

十一、 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. 本基金管理人重大人事变动如下：

本基金管理人于 2005 年 5 月 25 日发布基金经理调整公告：除袁蓓女士继续担任"华安宝利配置证券投资基金"基金经理外,增聘汤礼辉先生为"华安宝利配置证券投资基金"基金经理。

(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：

权益登记日、除息日 红利划出日、红利再投资日 每 10 份基金份额收益分配金额
本报告期第 1 次分红 2005 年 4 月 19 日 2005 年 4 月 20 日 0.20 元

(六)、 基金改聘为其审计的会计师事务所情况 :本报告期内本基金未改聘为其审计的会计

师事务所。

(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,包括稽查或处罚的次数、原因及结论,如监管部门提出整改意见的,应简单说明整改情况: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:无。

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	佣金	占总佣金
	量比例	总量比例			
渤海证券有限责任公司	1	121,533,535.84	13.39%	98,730.94	13.54%
海通证券股份有限公司	1	87,021,469.43	9.58%	68,094.89	9.34%
华夏证券股份有限公司	1	225,289,112.08	24.81%	176,290.78	24.17%
申银万国证券股份有限公司	1	232,681,853.12	25.63%	189,711.94	26.00%
兴业证券股份有限公司	1	241,367,203.35	26.59%	196,588.24	26.95%
合计		907,893,173.82	100.00%	729,416.79	100.00%

(2). 债券及回购交易情况:

券商名称	债券成交量	占总成交	回购成交量	占总成交
	总量比例	总量比例		
渤海证券有限责任公司	95,157,740.00	30.72%	31,000,000.00	16.16%
海通证券股份有限公司	11,252,230.50	3.63%	-	0.00%
华夏证券股份有限公司	48,893,207.84	15.78%	-	0.00%
申银万国证券股份有限公司	19,464,720.80	6.28%	99,500,000.00	51.88%
兴业证券股份有限公司	135,026,262.70	43.59%	61,300,000.00	31.96%
合计	309,794,161.84	100.00%	191,800,000.00	100.00%

(九)、其他事项:

1. 变更基金份额发售机构

其他重要事项 披露日期

- 1 华安基金管理有限公司关于新增湘财证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告 2005-04-28
- 2 华安基金管理有限公司关于在广发证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司等代销机构开通基金转换业务的公告 2005-04-26
- 3 华安基金管理有限公司关于开通机构电子直销业务的公告 2005-04-04
- 4 华安基金管理有限公司关于在华夏证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、招商证券股份有限公司等代销机构开通基金转换业务的公告 2005-01-27

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,交通银行在全球公开发售H股,并在香港联交所挂牌上市。

华安基金管理有限公司

2005年8月26日