

南方宝元债券型基金投资组合公告(2003年第3季度)

一、重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于2003年10月20日复核了本公告。

截止2003年9月30日,南方宝元债券型基金资产净值为2,524,599,426.03元,基金份额为2,568,736,588.41份,基金单位资产净值为0.9828元。

二、基金投资组合

(一)按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值(元)	占基金资产净值比例%
A 农、林、牧、渔业		
B 采掘业	44,120,303.83	1.75
C 制造业	296,437,824.24	11.74
C0 食品、饮料	54,207,077.54	2.15
C1 纺织、服装、皮毛	4,314,651.40	0.17
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	44,732,609.00	1.77
C5 电子		
C6 金属、非金属	88,011,565.41	3.49
C7 机械、设备、仪表	83,486,734.39	3.30
C8 医药、生物制品	21,685,186.50	0.86
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业	38,357,816.19	1.52
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业	116,177,286.52	4.60
G 信息技术业	51,480,771.66	2.04
H 批发和零售贸易		
I 金融、保险业	2,677,192.70	0.11
J 房地产业	34,167,389.78	1.35
K 社会服务业		
L 传播与文化产业		
M 综合类		
合计	583,418,584.92	23.11

(二)按偿还期限分类的债券投资组合

偿还期限(年)	市值(元)	占基金资产净值比例%
一年及一年以下	9,932,000.00	0.39
三年	293,202,960.60	11.61
五年	131,467,269.30	5.21
七年	529,886,528.00	20.99
十年	619,033,508.90	24.52
合计	1,583,522,266.80	62.72

(三)货币资金

截止2003年9月30日,南方宝元债券型基金持有货币资金(含当日证券清算往来款)计

109,898,468.14 元,占基金资产净值的 4.35%。

三、基金投资前十名股票明细

序号	股票名称	市值(元)	占基金资产 净值比例%
1	上海汽车	56,968,748.41	2.26
2	宝钢股份	52,251,963.75	2.07
3	中兴通讯	50,124,879.86	1.99
4	中集集团	33,937,669.78	1.34
5	万 科 A	33,724,727.78	1.34
6	盐田港 A	28,327,072.57	1.12
7	上港集箱	27,238,296.00	1.08
8	烟台万华	27,236,943.36	1.08
9	三一重工	25,989,088.98	1.03
10	申能股份	22,806,109.40	0.90

四、基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	偿还期限(年)	票面利率%	市值(元)	占基金资产 净值比例%
1	20 国债 10	7	2.36	231,515,399.80	9.17
2	20 国债 04	10	2.60	196,580,356.80	7.79
3	21 国债 03	7	3.27	176,465,147.80	6.99
4	03 国开 18	3	2.75	130,000,000.00	5.15
5	03 国开 19	3	2.76	130,000,000.00	5.15

五、报告附注

(一)报告项目的计价方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日的市场收市价计算 ;已发行未上市证券采用成本价计算。

(二)基金持有每只股票的价值(按成本价计算)均不超过基金资产净值的 10%。

(三)截止 2003 年 9 月 30 日,基金未持有信用等级低于 A 级的企业债券。

(四)截止 2003 年 9 月 30 日,基金应收利息、交易保证金、应收申购款、买入返售证券、待摊费用、应付赎回款、应付赎回费、应付管理费、应付托管费、应付佣金、其他应付款、卖出回购证券款、预提费用合计为借方余额 247,760,106.17 元 ;与基金股票、债券市值、货币资金相加后等于基金资产净值。

南方基金管理有限公司
二零零三年十月二十五日