

南方宝元债券型基金基金投资组合公告

南方宝元债券型基金投资组合公告

(2004 年第 1 季度)

一、重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2004 年 4 月 13 日复核了本公告。

截止 2004 年 3 月 31 日,南方宝元债券型基金资产净值为 1,948,146,115.09 元, 基金份额为 1,770,028,090.34 份, 基金单位资产净值为 1.1006 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	231,000.00	0.01%
B 采掘业	109,836,700.82	5.64%
C 制造业	239,933,425.89	12.32%
C0 食品、饮料	10,670,021.70	0.55%
C1 纺织、服装、皮毛	—	—
C2 木材、家具	—	—
C3 造纸、印刷	—	—
C4 石油、化学、塑胶、塑料	7,655,953.35	0.39%
C5 电子	12,052,031.86	0.62%
C6 金属、非金属	86,196,259.08	4.43%
C7 机械、设备、仪表	86,975,234.51	4.46%
C8 医药、生物制品	26,644,872.09	1.37%
C99 其他制造业	9,739,053.30	0.50%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	126,101,461.68	6.47%
E 建筑业	—	—
F 交通运输、仓储业	115,391,764.72	5.92%
G 信息技术业	24,216,277.26	1.24%
H 批发和零售贸易	9,124,500.00	0.47%
I 金融、保险业	—	—
J 房地产业	42,949,573.00	2.21%
K 社会服务业	—	—
L 传播与文化产业	—	—
M 综合类	—	—
合计	667,784,703.37	34.28%

(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	161,592,614.39	8.29%
二年	149,420,000.00	7.67%
三年	484,964,233.16	24.89%
五年	129,909,146.80	6.67%
七年	211,961,376.60	10.88%
十年	200,384,000.00	10.29%
合计	1,338,231,370.95	68.69%

(三) 货币资金

截止 2004 年 3 月 31 日,南方宝元债券型基金持有货币资金(含当日证券清

南方宝元债券型基金基金投资组合公告

算往来款)计 16,989,188.06 元,占基金资产净值的 0.87%。

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	中国石化	86,487,098.50	4.44%
2	长江电力	83,848,104.00	4.30%
3	上海汽车	80,115,738.99	4.11%
4	盐田港 A	41,666,432.50	2.14%
5	宝钢股份	39,014,546.89	2.00%
6	中集集团	37,855,847.19	1.94%
7	万科 A	33,856,091.96	1.74%
8	上海机场	31,861,038.99	1.64%
9	中兴通讯	24,049,257.26	1.23%
10	上港集箱	23,272,078.80	1.19%

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	03 国开 18	3	2.75	260,000,000.00	13.35%
2	01 国债 03	7	3.27	182,546,376.60	9.37%
3	02 国债 16	2	2.30	149,420,000.00	7.67%
4	01 国债 02	3	2.88	120,120,000.00	6.17%
5	03 国开 03	10	2.45	90,000,000.00	4.62%

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 2004 年 3 月 31 日,基金未持有信用等级低于 A 级的企业债券。

(四) 截止 2004 年 3 月 31 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、预提费用合计为贷方余额 74,859,147.29 元;与基金股票、债券市值、货币资金相抵后等于基金资产净值。

南方基金管理有限公司

二零零四年四月十六日