

## 南方宝元债券型基金投资组合公告

(2003年第4季度)

### 一、重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于2004年1月12日复核了本公告。

截止2003年12月31日,南方宝元债券型基金资产净值为2,280,146,901.07元,基金份额为2,185,284,097.06份,基金单位资产净值为1.0434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 186,760,000.01

B 采掘业 85,784,954.343.76

C 制造业 286,245,969.5512.55

C0 食品、饮料 25,545,632.141.12

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 30,309,864.541.33

C5 电子 2,257,286.400.10

C6 金属、非金属 99,587,504.794.36

C7 机械、设备、仪表 92,876,617.504.07

C8 医药、生物制品 22,074,634.800.97

C99 其他制造业 13,594,429.380.60

D 电力、煤气及水的生产和供应业 137,578,061.446.03

E 建筑业 168,080,000.01

F 交通运输、仓储业 154,960,149.436.80

G 信息技术业 62,982,590.942.76

H 批发和零售贸易

I 金融、保险业 37,146,536.151.63

J 房地产业 25,517,232.571.12

K 社会服务业

L 传播与文化产业

M 综合类

合计 790,570,334.4234.67

#### (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%

一年及以下 196,715,415.458.63

二年 149,420,000.006.55

三年 475,566,192.2620.86

五年 125,043,342.445.48

七年 207,473,394.009.10

十年 192,284,063.908.43

合计 1,346,502,408.0559.05

#### (三)货币资金

截止 2003 年 12 月 31 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 322,051,389.94 元,占基金资产净值的 14.12%。

### 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 73,990,189.533.25

2 长江电力 59,501,330.562.61

3 中集集团 44,510,563.441.95

4 中兴通讯 43,589,924.401.91

5 上海机场 38,959,694.461.71

6 中国石化 38,359,119.151.68

7 武钢股份 34,665,484.751.52

8 上港集箱 34,402,027.601.51

9 盐田港 A30,654,973.921.34

10 申能股份 30,373,716.541.33

### 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%

121 国债 0373.27178,058,394.007.81

202 国债 1622.30149,420,000.006.55

303 国开 1832.75130,000,000.005.70

403 国开 1932.76130,000,000.005.70

501 国债 0232.88120,120,000.005.27

### 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 12 月 31 日,基金未持有信用等级低于 A 级的企业债券。

(四)截止 2003 年 12 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 178,977,231.34 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

二零零四年一月二十九日