

富国天利增长债券投资基金投资组合公告

(2004 年第 1 号)

一、重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2004 年 4 月 16 日复核了本公告。截至 2004 年 3 月 31 日，富国天利增长债券投资基金资产净值为 720,145,479.42 元，基金份额为 699,992,033.07 份，单位基金净值为 1.0288 元。

二、基金投资组合

(一) 按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例(%)
1	国家债券	243,220,807.20	33.77
2	金融债券(含央行票据)	70,000,000.00	9.72
3	企业债券	0.00	0.00
4	可转换债券	348,521,127.95	48.40
	合计	661,741,935.15	91.89

(二) 股票合计

股票投资市值合计 11,084,245.26 元，占基金资产净值的 1.54%。

(三) 货币资金合计

截至 2004 年 3 月 31 日，本基金货币资金合计为 50,412,586.84 元(货币资金含当日证券清算款)，占基金资产净值的 7.00%。

三、基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例(%)
----	------	-------	----------

(一) 00 国债 12	100,090,000.00	13.90
(二) 邯钢转债 05	74,369,484.00	10.33
(三) 04 国开 02	50,000,000.00	6.94
(四) 03 国债 04	48,730,000.00	6.77
(五) 侨城转债	43,210,182.80	6.00

四、股票投资明细

序号	股票名称	市值(元)	占净值比例(%)	备注
1、	小商品城	11,084,245.26	1.54	增发申购

五、报告附注

(一) 根据基金契约,本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、金融债、企业(公司)债、可转债,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以通过参与新股首发等低风险的投资方式来提高基金收益水平。

(二) 各项目的计算方法:在证券交易所市场流通的债券,按如下估值方式处理:
A. 实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值。
B. 未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。未上市债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

(三) 截至 2004 年 3 月 31 日,本基金的其他资产项目(含买入返售证券)与负债项目(含卖出回购证券)轧差后为贷方余额 3,093,287.83 元。与证券投资市值、货币资金之和相抵减后基金资产净值为 720,145,479.42 元。

富国基金管理有限公司

二 00 四年四月十九日