

(上接A27版)

(4) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	150,159,000.00	24.96
其中：政策性金融债	150,159,000.00	24.96	
4	企业债券	-	-
5	短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	150,159,000.00	24.96

(5) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140429 29	14农发债	300,000	30,051,000.00	5.00
2	14国开 07	14国开债	300,000	30,045,000.00	4.99
3	140357 57	14进出债	300,000	30,042,000.00	4.99
4	140410 10	14农发债	300,000	30,015,000.00	4.99
5	140204 04	14国开债	300,000	30,006,000.00	4.99

(6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投

资明细

本基金本期未持有资产支持证券。

(7) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本期未持有贵金属投资。

(8) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本期未持有权证。

(9) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(10) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本期未投资股指期货。

(11) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

(12) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

(13) 本期国债期货投资情况说明

本基金未投资国债期货。

(14) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期未持有处于转股期的可转换债券。

(15) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分 占基金资产的公允价值比例(%) 流通受限情况说明

1 300183 东软载波 12,591,949.92 2.09 重大事项停牌

2 300168 万达信息 9,954,344.40 1.65 重大事项停牌

3. 宝康投资基金

(1) 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 - -

其中：股票 - -

2 固定收益投资 289,340,764.10 94.71

其中：债券 289,340,764.10 94.71

3 贵金属投资 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他投资 - -

6 银行存款和结算备付金 8,604,013.59 2.82

7 其他资产 7,561,766.41 2.48

8 合计 305,506,544.10 100.00

(2) 报告期末行业分类的股票投资组合

本基金本期未报告行业分类的股票投资。

(3) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本期未报告有股票投资。

(4) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2004年1月15日，本系列基金下设的各基金均已达到合同规定的资产配置比例。

(二) 宝康灵活配置证券投资基金

1. 净值增长率与同期比较基准收益率比较：

阶段 阶段

序号 1 2 3 4

净值增长 率差值 ① ② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④

业绩比 级基准 收益率差 基准收 益率差

净值增 长率差 值② ③ ④