

(上接B021版)

| 序号 | 股票代码 | 基金名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 001032 | 10年国债 | 300,000 | 29,463,000.00 | 16.90 |
| 2 | 001012 | 21年国债 | 66,000 | 6,011,880.00 | 3.79 |
| 3 | 110001 | 中债国债 | 5,670 | 515,913.30 | 0.30 |

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

6. 报告附注
1. 宣纸五粒液股份有限公司于2011年5月28日发布《宣纸五粒液股份有限公司关于收到中国证监会《行政处罚决定书》的公告》。根据公司的《行政处罚决定书》，上市公司对于2007年之前的两笔证券投资信息，2007年年报虚假记载，2007年某董事被司法罚款等4宗信息披露存在重大遗漏，上市公司和相关个人受到警告和累计98万元罚款，其中公司罚款60万元。

鉴于以上被处罚事件主体发生时间距现在超过两年，公司已完成整改并公告，且罚款金额小，对当前的公司财务、经营无重大不良影响，经公司投研会议讨论，认为对上市公司不构成重大市场风险、流动性风险、估值风险、信息披露的问题对该公司的业绩影响小，基金经理仍然看好五粒液的投资价值，决定继续持有。

报告期内本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2. 基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

3. 其他资产 单位：元

| 序号 | 资产名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 应收利息 | 853,913.63 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,102,677.76 |
| 3 | 应收股利 | |
| 4 | 应收利息 | 553,798.68 |
| 5 | 应收利息 | 21,786.24 |
| 6 | 其他应收款 | |
| 7 | 预付款项 | |
| 8 | 其他 | |
| 9 | 合计 | 6,532,176.31 |

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1 | 110001 | 中债国债 | 515,913.30 | 0.30 |

5. 本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
6. 报告期末基金未持有权证。
7. 报告期末基金未持有资产支持证券。
8. 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金合同生效日为2003年4月25日，基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

截止2011年9月30日，本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|---------|----------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2003/4/25至2004/12/31 | -1.41% | 0.56% | -7.34% | 0.76% | 5.93% | -0.22% |
| 2005/1/1至2005/12/31 | 17.09% | 0.95% | -8.51% | 1.02% | 25.60% | -0.07% |
| 2006/1/1至2006/12/31 | 11.42% | 0.97% | -7.15% | 0.98% | 18.55% | -0.07% |
| 2007/1/1至2007/12/31 | 81.74% | 1.26% | 54.37% | 1.06% | 27.37% | 0.20% |
| 2008/1/1至2008/12/31 | 110.40% | 1.64% | 81.63% | 1.54% | 28.77% | 0.10% |
| 2009/1/1至2009/12/31 | -31.61% | 1.87% | -34.32% | 1.87% | 2.71% | -0.09% |
| 2010/1/1至2010/12/31 | 52.12% | 1.39% | 51.26% | 1.21% | 0.86% | 0.09% |
| 2011/1/1至2011/9/30 | 22.32% | 1.33% | 9.25% | 1.12% | 13.06% | 0.21% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 202.30% | 1.06% | 127.90% | 0.87% | 74.40% | 0.19% |
| 2003/4/25至2011/9/30 | 396.55% | 1.36% | 97.19% | 1.25% | 302.34% | 0.05% |

注：本基金合同生效以来，本基金的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

股权激励计划(草案)自公告之日起至公告日10个交易日外,不得再行公告。

1.定期报告公告前30日至公告后2个交易日内,因特
定公告前30日起至最近公告日后2个交易日内;

2.业绩预告、业绩快报公告前10日至公告后2个交易
日;

3.重大交易或重大事项决定过程中至该事项公告后
2个交易日;

4.其他可能影响股价的重大事项发生之日起至公告
后2个交易日;

5.重大资产重组、重大重组”以及“可能影响股价的
股票上市交易的相关规定应披露的交易或其他重大事项。
市价明显波动必须在有效期内完成,计划有效期
满未实施完毕的,应当在有效期内公告并说明原因,计划有效期