

(上接B021版)
单位:元
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)
1 100102 10万元 300,000 30.460,000.00 16.00
2 010102 21万元 66,000 6,611,800.00 3.79
3 113001 中行转债 5,670 515,913.30 0.30

注:上述债券明细为本基金本报告期内持有的全部债券。

六、报告附注

1. 宜宾五粮液股份有限公司于2011年5月28日发布《宜宾五粮液股份有限公司关于收到中国证监会¹《行政处罚决定书》的公告》。根据公告的《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年报告数据录错,2007年某单笔被证监会罚没金额信息披露在重大遗漏上,上市公司和个人受到警告和罚款96万元处罚,其中公司罚没6万元。

鉴于以上被处罚事件主体发生时间至今超过两年,公司已完全整改并公告,且罚没金额较小,对当前的公司财务、经营未见重大直接影响,经公司法研会讨论认为,对于上市公司不构成重大市场风险、流动性风险、估值风险、信息披露的问题对公司的业务影响小,基金经理仍然看好该股票的估值,决定继续持有。

报告期内本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库。2. 基金投资前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产(单位:元)

序号 项目 名称 金额(元)
1 存出保证金 853,913.63
2 反应收券商清算款 5,102,677.76
3 反应收券商 0
4 反应收券商 553,798.68
5 反应收券商 21,786.24
6 其他应收款 0
7 待摊费用 0
8 其他 0
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 113001 中行转债 515,913.30 0.30

5. 本报告期末前十名股票中未存在道义受限的情况。

6. 报告期末基金未持有债券。

7. 报告期末基金未持有股票或权证。

8. 由于四舍五入的原因,分母数和与合计数之间可能存在尾差。

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金经理过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资人应在做出投资决策前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,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)截止2011年9月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益比率:

注:上述数据未包含本基金本报告期内持有的全部债券。

六、报告附注

1. 宜宾五粮液股份有限公司于2011年5月28日发布《宜宾五粮液股份有限公司关于收到中国证监会¹《行政处罚决定书》的公告》。根据公告的《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年报告数据录错,2007年某单笔被证监会罚没金额信息披露在重大遗漏上,上市公司和个人受到警告和罚款96万元处罚,其中公司罚没6万元。

鉴于以上被处罚事件主体发生时间至今超过两年,公司已完全整改并公告,且罚没金额较小,对当前的公司财务、经营未见重大直接影响,经公司法研会讨论认为,对于上市公司不构成重大市场风险、流动性风险、估值风险、信息披露的问题对公司的业务影响小,基金经理仍然看好该股票的估值,决定继续持有。

报告期内本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库。

2. 基金投资前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产(单位:元)

序号 项目 名称 金额(元)
1 存出保证金 853,913.63
2 反应收券商清算款 5,102,677.76
3 反应收券商 0
4 反应收券商 553,798.68
5 反应收券商 21,786.24
6 其他应收款 0
7 待摊费用 0
8 其他 0
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 113001 中行转债 515,913.30 0.30

5. 本报告期末前十名股票中未存在道义受限的情况。

6. 报告期末基金未持有债券。

7. 报告期末基金未持有股票或权证。

8. 由于四舍五入的原因,分母数和与合计数之间可能存在尾差。

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金经理过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资人应在做出投资决策前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,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)截止2011年9月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益比率:

注:上述数据未包含本基金本报告期内持有的全部债券。

六、报告附注

1. 宜宾五粮液股份有限公司于2011年5月28日发布《宜宾五粮液股份有限公司关于收到中国证监会¹《行政处罚决定书》的公告》。根据公告的《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年报告数据录错,2007年某单笔被证监会罚没金额信息披露在重大遗漏上,上市公司和个人受到警告和罚款96万元处罚,其中公司罚没6万元。

鉴于以上被处罚事件主体发生时间至今超过两年,公司已完全整改并公告,且罚没金额较小,对当前的公司财务、经营未见重大直接影响,经公司法研会讨论认为,对于上市公司不构成重大市场风险、流动性风险、估值风险、信息披露的问题对公司的业务影响小,基金经理仍然看好该股票的估值,决定继续持有。

报告期内本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库。

2. 基金投资前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产(单位:元)

序号 项目 名称 金额(元)
1 存出保证金 853,913.63
2 反应收券商清算款 5,102,677.76
3 反应收券商 0
4 反应收券商 553,798.68
5 反应收券商 21,786.24
6 其他应收款 0
7 待摊费用 0
8 其他 0
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 113001 中行转债 515,913.30 0.30

5. 本报告期末前十名股票中未存在道义受限的情况。

6. 报告期末基金未持有债券。

7. 报告期末基金未持有股票或权证。

8. 由于四舍五入的原因,分母数和与合计数之间可能存在尾差。

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金经理过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资人应在做出投资决策前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,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)截止2011年9月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益比率:

注:上述数据未包含本基金本报告期内持有的全部债券。

六、报告附注

1. 宜宾五粮液股份有限公司于2011年5月28日发布《宜宾五粮液股份有限公司关于收到中国证监会¹《行政处罚决定书》的公告》。根据公告的《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年报告数据录错,2007年某单笔被证监会罚没金额信息披露在重大遗漏上,上市公司和个人受到警告和罚款96万元处罚,其中公司罚没6万元。

鉴于以上被处罚事件主体发生时间至今超过两年,公司已完全整改并公告,且罚没金额较小,对当前的公司财务、经营未见重大直接影响,经公司法研会讨论认为,对于上市公司不构成重大市场风险、流动性风险、估值风险、信息披露的问题对公司的业务影响小,基金经理仍然看好该股票的估值,决定继续持有。

报告期内本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库。

2. 基金投资前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产(单位:元)

序号 项目 名称 金额(元)
1 存出保证金 853,913.63
2 反应收券商清算款 5,102,677.76
3 反应收券商 0
4 反应收券商 553,798.68
5 反应收券商 21,786.24
6 其他应收款 0
7 待摊费用 0
8 其他 0
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 113001 中行转债 515,913.30 0.30

5. 本报告期末前十名股票中未存在道义受限的情况。

6. 报告期末基金未持有债券。

7. 报告期末基金未持有股票或权证。

8. 由于四舍五入的原因,分母数和与合计数之间可能存在尾差。

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金经理过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资人应在做出投资决策前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,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)截止2011年9月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益比率:

注:上述数据未包含本基金本报告期内持有的全部债券。

六、报告附注

1. 宜宾五粮液股份有限公司于2011年5月28日发布《宜宾五粮液股份有限公司关于收到中国证监会¹《行政处罚决定书》的公告》。根据公告的《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年报告数据录错,2007年某单笔被证监会罚没金额信息披露在重大遗漏上,上市公司和个人受到警告和罚款96万元处罚,其中公司罚没6万元。

鉴于以上被处罚事件主体发生时间至今超过两年,公司已完全整改并公告,且罚没金额较小,对当前的公司财务、经营未见重大直接影响,经公司法研会讨论认为,对于上市公司不构成重大市场风险、流动性风险、估值风险、信息披露的问题对公司的业务影响小,基金经理仍然看好该股票的估值,决定继续持有。

报告期内本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库。

2. 基金投资前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产(单位:元)

序号 项目 名称 金额(元)
1 存出保证金 853,913.63
2 反应收券商清算款 5,102,677.76
3 反应收券商 0
4 反应收券商 553,798.68
5 反应收券商 21,786.24
6 其他应收款 0
7 待摊费用 0
8 其他 0
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 113001 中行转债 515,913.30 0.30

5. 本报告期末前十名股票中未存在道义受限的情况。

6. 报告期末基金未持有债券。

7. 报告期末基金未持有股票或权证。

8. 由于四舍五入的原因,分母数和与合计数之间可能存在尾差。

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金经理过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资人应在做出投资决策前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,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)截止2011年9月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益比率:

注:上述数据未包含本基金本报告期内持有的全部债券。

六、报告附注

1. 宜宾五粮液股份有限公司于2011年5月28日发布《宜宾五粮液股份有限公司关于收到中国证监会¹《行政处罚决定书》的公告》。根据公告的《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年报告数据录错,2007年某单笔被证监会罚没金额信息披露在重大遗漏上,上市公司和个人受到警告和罚款96万元处罚,其中公司罚没6万元。

鉴于以上被处罚事件主体发生时间至今超过两年,公司已完全整改并公告,且罚没金额较小,对当前的公司财务、经营未见重大直接影响,经公司法研会讨论认为,对于上市公司不构成重大市场风险、流动性风险、估值风险、信息披露的问题对公司的业务影响小,基金经理仍然看好该股票的估值,决定继续持有。

报告期内本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库。

2. 基金投资前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产(单位:元)

序号 项目 名称 金额(元)
1 存出保证金 853,913.63
2 反应收券商清算款 5,102,677.76
3 反应收券商 0
4 反应收券商 553,798.68
5 反应收券商 21,786.24
6 其他应收款 0
7 待摊费用 0
8 其他 0
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 113001 中行转债 515,913.30 0.30

5. 本报告期末前十名股票中未存在道义受限的情况。

6. 报告期末基金未持有债券。

7. 报告期末基金未持有股票或权证。

8. 由于四舍五入的原因,分母数和与合计数之间可能存在尾差。

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金经理过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资人应在做出投资决策前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,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

(一)截止2011年9月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益比率:

注:上述数据未包含