2008年年度报告摘要

2008年12月31日

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2009年03月27日

§1 重要提示及目录

1.1 特别提示

本报告摘要是从本基金年度报告中摘录出来的,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

1.2 其他提示

本报告摘要分别采用中英文两种语言编制,在内容上有重大差异的情况下,以中文版本为准。

1.3 目录

本报告摘要的目录,请参阅年度报告全文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河
基金主代码	150103
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年03月30日
报告期末基金份额总额	4,186,966,976.46

2.2 基金产品说明

投资目标	1、在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。2、在有效控制风险的前提下,力争实现基金份额持有人的当期收益。
投资策略	1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、权证投资策略 5、股指期货投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、中小企业私募债投资策略 8、股票期权投资策略 9、融资融券投资策略 10、其他品种投资策略
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

名称	基金管理人	基金托管人
姓名	王佳芬	王丹
联系地址	北京市西城区金融街35号国际企业大厦A座9层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100033	100140
电话	010-66105799	010-66105799
传真	010-66105798	010-66105798
电子信箱	wangjuanfeng@galaxyasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-820-0860	95588
网址	http://www.galaxyasset.com	http://www.icbc.com.cn

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1.1 单位:人民币元	2008年	2007年	2006年
本期利润	-1,559,848,315.84	870,059,175.78	887,318,423.85
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-2,277,178,748.51	968,610,448.41	1,141,091,554.25
期末可供分配利润	-0.5191	0.5165	0.3110
期末可供分配利润占期末可供分配基金份额比例(%)	-65.82%	39.19%	70.25%
期末可供分配基金份额利润	-45.57%	118.78%	106.47%
3.1.2 当期发行的基金份额	2008年	2007年	2006年
期末可供分配基金份额利润	-1,628,597,868.35	130,343,835.56	361,751,665.89
期末可供分配基金份额利润占期末可供分配基金份额比例(%)	-0.3890	0.0273	0.6293
期末基金资产净值	2,558,369,108.11	5,363,711,974.15	1,062,208,221.24
期末基金份额净值	0.6110	1.1226	1.8478
3.1.3 本期利润	2008年	2007年	2006年
加权平均基金份额本期利润	125.60%	314.50%	89.46%

注:1、本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额=本期利润-本期公允价值变动损益;2、上述财务指标数值均按照相关法规计算。

3.2 期末数据和指标

3.2.1 单位:人民币元	期末	2008年末	2007年末	2006年末
可供分配利润		-4,186,966,976.46	2,158,369,108.11	1,062,208,221.24
可供分配基金份额利润		-0.5191	0.5165	0.3110
期末基金资产净值		2,558,369,108.11	5,363,711,974.15	1,062,208,221.24
期末基金份额净值		0.6110	1.1226	1.8478
3.2.2 累计期末指标	期末	2008年末	2007年末	2006年末
基金份额累计净值增长率		125.60%	314.50%	89.46%

注:1、本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额=本期利润-本期公允价值变动损益;2、上述财务指标数值均按照相关法规计算。

3.3 过去三个月的主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

单位:人民币元	2008年10月1日-2008年12月31日	2008年7月1日-2008年9月30日	2008年4月1日-2008年6月30日	2008年1月1日-2008年3月31日
本期利润	-1,559,848,315.84	-870,059,175.78	-887,318,423.85	-1,141,091,554.25
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-2,277,178,748.51	-968,610,448.41	-1,141,091,554.25	-1,062,208,221.24
期末可供分配利润	-0.5191	0.5165	0.3110	0.3110
期末可供分配利润占期末可供分配基金份额比例(%)	-65.82%	39.19%	70.25%	70.25%
期末可供分配基金份额利润	-45.57%	118.78%	106.47%	106.47%
期末基金资产净值	2,558,369,108.11	5,363,711,974.15	1,062,208,221.24	1,062,208,221.24
期末基金份额净值	0.6110	1.1226	1.8478	1.8478
3.3.3 期末可供分配基金份额利润	2008年	2007年	2006年	
期末可供分配基金份额利润	125.60%	314.50%	89.46%	

注:1、本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额=本期利润-本期公允价值变动损益;2、上述财务指标数值均按照相关法规计算。

§4 管理人报告

4.1 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.1.1 报告期内,本基金管理人的运作基本符合法律法规、基金合同的规定,未发生违规运作、损害基金份额持有人利益的行为。

4.1.2 报告期内,本基金管理人的主要工作

报告期内,本基金管理人主要从事了以下工作:

1、2008年,面对国内外经济形势的复杂变化,特别是金融危机的不断深化,我们坚持以科学发展观为指导,坚持稳中求进的工作方针,坚持以市场为导向,以客户为中心,以提高投资管理水平为核心,以内控合规为保障,以人才队伍建设为基础,以信息技术为手段,以品牌建设为目标,以提高公司核心竞争力为主线,以实现公司可持续发展为目标,全面开展各项工作,取得了阶段性成果。

2、报告期内,本基金管理人的主要工作:

(1)投资管理:

(2)内控合规:

(3)人力资源:

(4)信息技术:

(5)市场营销:

(6)基金业绩:

4.2 报告期内,本基金管理人的重大事项

4.2.1 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

4.2.2 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

4.2.3 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

4.3 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

4.4 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

4.5 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

4.6 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

4.7 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

§5 托管人报告

5.1 报告期内,本基金托管人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

5.2 报告期内,本基金托管人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

5.3 报告期内,本基金托管人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

§6 审计报告

6.1 报告期内,本基金管理人的重大事项

(1)

(2)

(3)

(4)

(5)

(6)

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

单位:人民币元	2008年12月31日	2007年12月31日
资产:		
银行存款	384,904,809.46	73,609,829.47
结算备付金	3,034,392.77	9,970,450.17
存出保证金	1,848,780.49	2,266,211.88
交易性金融资产	2,135,478,034.17	4,815,198,860.61
其中:股票投资	1,274,540,574.47	3,645,537,065.11
债券投资	-	-
权证投资	860,937,459.70	1,169,661,795.50
衍生金融资产	-	-
买入返售证券	-	156,224,325.98
应收证券清算款	-	-
应收利息	29,302,577.78	366,541,184.78
应收股利	16,334,641.68	25,787,253.42
其他应收款	-	-
待摊费用	57,250.78	3,636,680.38
其他流动资产	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	2,570,960,487.13	5,453,234,796.69
资产总计	5,174,308,284.24	10,455,268,592.37
负债:		
卖出回购证券款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,558,369,108.11	5,363,711,974.15
应付托管费	1,062,208,221.24	1,062,208,221.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,046,966,976.46	4,777,994,708.46
其他负债	2,158,088.86	2,719,772.95
应付利息	12,591,379.02	89,522,822.54
预提费用	-	-
其他负债	-	-
负债合计	4,186,966,976.46	4,777,994,708.46
实收基金	2,558,369,108.11	5,363,711,974.15
未分配利润	-2,558,369,108.11	-5,363,711,974.15
净资产:	2,558,369,108.11	5,363,711,974.15
注:本期末基金份额净值=0.6110元,本期末基金份额总额=4,186,966,976.46份。		

7.2 利润表

单位:人民币元	2008年1月1日-2008年12月31日	2007年1月1日-2007年12月31日
一、收入	-2,165,234,667.01	1,082,741,953.13
1.利息	36,560,622.50	18,146,257.47
2.投资收益	3,721,947.77	2,558,757.02
3.公允价值变动损益	32,605,345.59	15,587,500.45
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	233,329.14	-
6.资产处置损益	-	-
减:二、费用	-1,487,203,294.41	963,031,331.02
1.管理人报酬	-1,491,155,206.85	919,857,782.14
其中:固定管理费	-	-
浮动管理费	7,530,506.10	4,738,491.86
2.托管费	-	-
3.销售服务费	-18,114,014.98	34,303,082.47
4.交易费用	14,535,421.32	4,131,974.55
5.利息支出	-717,330,432.67	98,551,272.63
其中:卖出回购证券支出	-	-
6.其他费用	2,738,437.57	3,013,092.01
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-111,944,081.50	-114,131,504.72
减:所得税费用	-52,260,941.85	-36,580,467.03
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-8,710,157.06	-6,096,744.48
注:本期末基金份额净值=0.6110元,本期末基金份额总额=4,186,966,976.46份。		

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

单位:人民币元	2008年1月1日-2008年12月31日			2007年1月1日-2007年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净值合计	实收基金	未分配利润	净值合计
一、期初净值	5,363,711,974.15		5,363,711,974.15	1,062,208,221.24		1,062,208,221.24
二、本期经营活动产生的净值变动(本期利润)		-2,277,178,748.51	-2,277,178,748.51		968,610,448.41	968,610,448.41
三、本期基金份额交易产生的净值变动(净值减少以"-"号填列)	-2,805,342,866.04	2,805,342,866.04	-	4,301,502,886.91	-4,301,502,886.91	-
其中:1.申购款	1,046,966,976.46	-1,046,966,976.46	-	4,777,994,708.46	-4,777,994,708.46	-
2.赎回款	-3,852,309,842.50	3,852,309,842.50	-	-476,491,821.55	476,491,821.55	-
四、本期末基金份额净值	2,558,369,108.11	-2,558,369,108.11	0.6110	5,363,711,974.15	-5,363,711,974.15	1.1226

注:本期末基金份额总额=4,186,966,976.46份。

7.4 投资组合报告

7.4.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元	2008年12月31日	
资产类别	市值	占基金总资产比例(%)
股票	1,274,540,574.47	24.63%
其中:流通股	1,274,540,574.47	24.63%
债券	860,937,459.70	16.64%
其中:国债	860,937,459.70	16.64%
权证	-	-
其中:认购权证	-	-
其他资产	2,570,960,487.13	49.69%
合计	4,706,438,521.30	90.96%

7.4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元	2008年12月31日	
行业类别	市值	占基金资产净值比例(%)
1	403,613,636.23	7.52
2	288,412,114.38	5.38
3	259,665,619.49	4.84
4	250,285,962.70	4.67
5	200,867,159.96	3.74
6	184,819,417.18	3.45
7	176,264,811.00	3.29
8	161,046,126.82	3.00
9	154,871,278.00	2.89
10	152,451,476.30	2.84
11	148,085,884.99	2.76
12	122,416,074.97	2.28
13	121,387,466.76	2.26
14	113,770,587.58	2.12
15	110,005,950.39	2.05
16	107,861,696.80	2.01
17	107,461,784.21	2.00
18	100,558,445.09	1.87
19	95,034,364.43	1.77
20	93,876,345.89	1.75

8.4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元	2008年12月31日	
行业类别	市值	占基金资产净值比例(%)
1	367,747,643.08	6.86
2	337,198,976.64	6.29
3	243,400,184.67	4.54
4	232,052,236.21	4.33
5	215,312,555.88	4.01
6	189,486,268.24	3.53
7	187,136,784.51	3.49
8	177,633,101.94	3.31
9	160,844,887.46	3.00
10	147,905,829.82	2.76
11	140,542,697.41	2.62
12	136,087,518.87	2.54
13	129,202,894.40	2.41
14	122,154,136.82	2.28
15	118,241,144.21	2.20
16	114,735,359.66	2.14
17	106,953,891.27	1.99
18	106,274,300.93	1.98
19	99,075,006.73	1.85
20	94,097,434.35	1.75

8.4.3 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

单位:人民币元	市值
沪市	6,898,079,535.68
深市	7,297,042,158.20

8.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

单位:人民币元	债券品种	市值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	223,463,436.70	8.73
2	央行票据	444,769,000.00	17.38
3	金融债券	188,921,000.00	7.38
	其中:政策性金融债	188,921,000.00	7.38
4	企业债券	3,784,023.00	0.15
5	可转换债券	0.00	0.00
6	短期融资券	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	860,937,459.70	33.65

8.6 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债券投资明细

单位:人民币元	债券代码	债券名称	数量(张)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	080162	08央票62	2,700,000	289,359,000.00	11.31
2	080417	08进出口17	800,000	85,576,000.00	3.34
3	080123	08农发23	500,000	53,245,000.00	2.08
4	080117	08国开17	500,000	53,195,000.00	2.08
5	010110	21长江债01	500,000	52,759,500.00	2.06

8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

单位:人民币元	股票代码	股票名称	数量(股)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	403,613,636.23	7.52	
2	600016	民生银行	288,412,114.38	5.38	
3	600000	浦发银行	259,665,619.49	4.84	
4	601318	中国平安	250,285,962.70	4.67	
5	000002	万科A	200,867,159.96	3.74	
6	601088	中国神华	184,819,417.18	3.45	
7	600030	中信证券	176,264,811.00	3.29	
8	601186	中国铁建	161,045,126.82	3.00	
9	600015	华夏银行	154,871,278.00	2.89	
10	600005	武钢股份	152,451,476.30	2.84	
11	600048	保利地产	148,085,884.99	2.76	
12	000157	中联重科	122,416,074.97	2.28	
13	000858	五粮液	121,387,466.76	2.26	
14	600795	国电电力	113,770,587.58	2.12	
15	601919	中国远洋	110,005,950.39	2.05	
16	600282	南钢股份	107,861,696.80	2.01	
17	600550	保变电气	107,461,784.21	2.00	
18	601006	大秦铁路	100,558,445.09	1.87	
19	601390	中国中铁	95,034,364.43	1.77	
20	600011	华能国际	93,876,345.89	1.75	

8.4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元	股票代码	股票名称	数量(股)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	367,747,643.08	6.86	
2	600016	民生银行	337,198,976.64	6.29	
3	600030	中信证券	243,400,184.67	4.54	
4	601088	中国神华	232,052,236.21	4.33	
5	601318	中国平安	215,312,555.88	4.01	
6	601666	平煤股份	189,486,268.24	3.53	
7	600000	浦发银行	187,136,784.51	3.49	
8	000858	五粮液	177,633,101.94	3.31	
9	601919	中国远洋	160,844,887.46	3.00	
10	600015	华夏银行	147,905,829.82	2.76	
11	000157	中联重科	140,542,697.41	2.62	
12	000002	万科A	136,087,518.87	2.54	
13	600005	武钢股份	129,202,894.40	2.41	
14	000028	国药一致	122,154,136.82	2.28	
15	000488	晨鸣纸业	118,241,144.21	2.20	
16	600195	中牧股份	114,735,359.66	2.14	
17	600895	张江高科	106,953,891.27	1.99	
18	600048	保利地产	106,274,300.93	1.98	
19	600748	上实发展	99,075,006.73	1.85	
20	601939	建设银行	94,097,434.35	1.75	

8.4.3 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

单位:人民币元	市值
沪市	6,898,079,535.68
深市	7,297,042,158.20

8.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

单位:人民币元	债券品种	市值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	223,463,436.70	8.73
2	央行票据	444,769,000.00	17.38
3	金融债券	188,921,000.00	7.38
	其中:政策性金融债	188,921,000.00	7.38
4	企业债券	3,784,023.00	0.15
5	可转换债券	0.00	0.00
6	短期融资券	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	860,937,459.70	33.65

8.6 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债券投资明细

单位:人民币元	债券代码	债券名称	数量(张)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	080162	08央票62	2,700,000	289,359,000.00	11.31
2	080417	08进出口17	800,000	85,576,000.00	3.34
3	080123	08农发23	500,000	53,245,000.00	2.08
4	080117	08国开17	500,000	53,195,000.00	2.08
5	010110	21长江债01	500,000	52,759,500.00	2.06

8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

单位:人民币元	股票代码	股票名称	数量(股)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	367,747,643.08	6.86	
2	600016	民生银行	337,198,976.64	6.29	
3	600030	中信证券	243,400,184.67	4.54	
4	601088	中国神华	232,052,236.21	4.33	
5	601318	中国平安	215,312,555.88	4.01	
6	601666	平煤股份	189,486,268.24	3.53	
7	600000	浦发银行	187,136,784.51	3.49	
8	000858	五粮液	177,633,101.94	3.31	
9	601919	中国远洋	160,844,887.46	3.00	
10	600015	华夏银行	147,905,829.82	2.76	
11	000157	中联重科	140,542,697.41	2.62	
12	000002	万科A	136,087,518.87	2.54	
13	600005	武钢股份	129,202,894.40	2.41	
14	000028	国药一致	122,154,136.82	2.28	
15	000488	晨鸣纸业	118,241,144.21	2.20	
16	600195	中牧股份	114,735,359.66	2.14	
17	600895	张江高科	106,953,891.27	1.99	
18	600048	保利地产	106,274,300.93	1.98	
19	600748	上实发展	99,075,006.73	1.85	
20	601939	建设银行	94,097,434.35	1.75	

8.4.3 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

单位:人民币元	市值
沪市	6,898,079,535.68
深市	7,297,042,158.20

8.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

单位:人民币元	债券品种	市值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	223,463,436.70	8.73
2	央行票据	444,769,000.00	17.38
3	金融债券	188,921,000.00	7.38
	其中:政策性金融债	188,921,000.00	7.38
4	企业债券	3,784,023.00	0.15
5	可转换债券	0.00	0.00
6	短期融资券	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	860,937,459.70	33.65

8.6 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债券投资明细

单位:人民币元	债券代码	债券名称	数量(张)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	080162	08央票62	2,700,000	289,359,000.00	11.31
2	080417	08进出口17	800,000	85,576,000.00	3.34
3	080123	08农发23	500,000	53,245,000.00	2.08
4	080117	08国开17	500,000	53,195,000.00	2.08
5	010110	21长债01	500,000	52,759,500.00	2.06

8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

单位:人民币元	股票代码	股票名称	数量(股)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	367,747,643.08	6.86	
2	600016	民生银行	337,198,976.64	6.29	
3	600030	中信证券	243,400,184.67	4.54	
4	601088	中国神华	232,052,236.21	4.33	
5	601318	中国平安	215,312,555.88	4.01	
6	601666	平煤股份	189,486,268.24	3.53	
7	600000	浦发银行	187,136,784.51	3.49	
8	000858	五粮液	177,633,101.94	3.31	
9	601919	中国远洋	160,844,887.46	3.00	
10	600015	华夏银行	147,905,829.82	2.76	
11	000157	中联重科	140,542,697.41	2.62	
12	000002	万科A	136,087,518.87	2.54	
13	600005	武钢股份	129,202,894.40	2.41	
14	000028	国药一致	122,154,136.82	2.28	
15	000488	晨鸣纸业	118,241,144.21	2.20	
16	600195	中牧股份	114,735,359.66	2.14	
17	600895	张江高科	106,953,891.27	1.99	
18	600048	保利地产	106,274,300.93	1.98	
19	600748	上实发展	99,075,006.73	1.85	
20	601939	建设银行	94,097,434.35	1.75	

8.4.3 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

单位:人民币元	市值
沪市	6,898,079,535.68
深市	7,297,042,158.20

8.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

单位:人民币元	债券品种	市值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	223,463,436.70	8.73
2	央行票据	444,769,000.00	17.38
3	金融债券	188,921,000.00	7.38
	其中:政策性金融债	188,921,000.00	7.38
4	企业债券	3,784,023.00	0.15
5	可转换债券	0.00	0.00
6	短期融资券	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	860,937,459.70	33.65

8.6 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债券投资明细

单位:人民币元	债券代码	债券名称	数量(张)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	080162	08央票62	2,700,000	289,359,000.00	11.31
2	080417	08进出口17	800,000	85,576,000.00	3.34
3	080123	08农发23	500,000	53,245,000.00	2.08
4	080117	08国开17	500,000	53,195,000.00	2.08
5	010110	21长江债01	500,000	52,759,500.00	2.06

8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

单位:人民币元	股票代码	股票名称	数量(股)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	367,747,643.08	6.86	
2	600016	民生银行	337,198,976.64	6.29	
3	600030	中信证券	243,400,184.67	4.54	
4	601088	中国神华	232,052,236.21	4.33	
5	601318	中国平安	215,312,555.88	4.01	
6	601666	平煤股份	189,486,268.24	3.53	
7	600000	浦发银行	187,136,784.51	3.49	
8	000858	五粮液	177,633,101.94	3.31	
9	601919	中国远洋	160,844,887.46	3.00	
10	600015	华夏银行	147,905,829.82	2.76	
11	000157	中联重科	140,542,697.41	2.62	
12	000002	万科A	136,087,518.87	2.54	
13	600005	武钢股份	129,202,894.40	2.41	
14	000028	国药一致	122,154,136.82	2.28	
15	000488	晨鸣纸业	118,241,144.21	2.20	
16	600195	中牧股份	114,735,359.66	2.14	
17	600895	张江高科	106,953,891.27	1.99	
18	600048	保利地产	106,274,300.93	1.98	
19	600748	上实发展	99,075,006.73	1.85	
20	601939	建设银行	94,097,434.35	1.75	

8.4.3 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

单位:人民币元	市值
沪市	6,898,079,535.68
深市	7,297,042,158.20

8.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

单位:人民币元	债券品种	市值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	223,463,436.70	8.73
2	央行票据	444,769,000.00	17.38
3	金融债券	188,921,000.00	7.38
	其中:政策性金融债	188,921,000.00	7.38
4	企业债券	3,784,023.00	0.15
5	可转换债券	0.00	0.00
6	短期融资券	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	860,937,459.70	33.65

8.6 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债券投资明细

单位:人民币元	债券代码	债券名称	数量(张)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	080162	08央票62	2,700,000	289,359,000.00	11.31
2	080417	08进出口17	800,000	85,576,000.00	3.34
3	080123	08农发23	500,000	53,245,000.00	2.08
4	080117	08国开17	500,000	53,195,000.00	2.08
5	010110	21长江债01	500,000	52,759,500.00	2.06

8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

单位:人民币元	股票代码	股票名称	数量(股)	市值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	367,747,643.08	6.86	
2	600016	民生银行	337,198,976.64	6.29	
3	600030	中信证券	243,400,184.67	4.54	
4	601088	中国神华	232,052,236.21	4.33	
5	601318	中国平安	215,312,555.88	4.01	
6	601666	平煤股份	189,486,268.24	3.53	
7	600000	浦发银行	187,136,784.51	3.49	
8	000858	五粮液	177,633,101.94	3.31	
9	601919	中国远洋	160,844,887.46	3.00	
10	600015	华夏银行	147,905,829.82	2.76	
11	000157	中联重科	140,542,697.41	2.62	
12	000002	万科A	136,087,518.87	2.54	
13	600005	武钢股份	129,202,894.40	2.41	
14	000028	国药一致	122,154,136.82	2.28	
15	000488	晨鸣纸业	118,241,144.21	2.20	
16	600195	中牧股份	114,735,359.66	2.14	
17	600895	张江高科	106,953,891.27	1.99	
18	600048	保利地产	106,274,300.93	1.98	
19	600748	上实发展	99,075,006.73	1.85	
20	601939	建设银行	94,097,434.35	1.75	

8.4.3 报告期末按市场类别分类的股票投资组合

单位:人民币元	市值
沪市	6,898,079,535.68
深市	7,297,042,158.20

8.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

单位:人民币元	债券品种	市值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	223,463,436.70	8.73
2	央行票据	444,769,000.00	17.38
3	金融债券	188,921,000.00	7.38
	其中:政策性金融债	188,921,000.00	7.38
4	企业债券	3,784,023.00	0.15
5	可转换债券	0.00	0.00
6	短期融资券	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计