（上接D125版）

⑵ 赎券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

⑶ 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（包括实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

⑷ 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

⑸ 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

⑹ 期货工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

⑺ 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

⑻ 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

⑼ 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

⑴ 基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

⑵ 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

⑶ 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（包括实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

⑷ 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

⑴ 本基金的收益分配只针对持有本基金份额的持有人；

⑵ 每份基金份额享有同等分配权；

⑶ 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

⑷ 如果本基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

⑸ 基金收益分配后的基金份额净值不能低于面值；

⑹ 符合分红条件的基金每年至少分配收益一次，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；

⑺ 基金持有人可以选择现金分红方式或将所获红利再投资于相关基金的方式。选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红发放日的基金份额净值转成相应的基金份额；

⑻ 除非基金持有人办理了选择分红方式为红利再投资的手续，否则其持有基金份额的默认分红方式为现金分红方式；

⑼ 有关法律、法规、规章或中国证监会另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字［2005］103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字［2004］78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字［2005］103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税［2008］1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字［2002］128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字［2005］107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税［2005］102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字［2005］103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司	基金管理人的第一大股东
中国石油天然气集团公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海市城市建设投资开发总公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

注：本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
银河证券	1,618,368,594.15	19.65	1,848,647,881.47	22.98

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
银河证券	40,775,377.00	30.47	91,290,705.89	44.04

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
银河证券	943,400,000.00	34.78	416,100,000.00	18.69

7.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
银河证券	-	-	-	-

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总额的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
银河证券	1,375,599.21	20.05	886,138.08	31.60
	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总额的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
银河证券	1,571,331.45	23.30	372,941.94	24.73

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,692,211.64	20,595,888.06
其中：支付给销售机构的客户维护费	3,773,162.08	4,609,435.92

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times1.50\%$/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2010年未未支付管理费余额2,335,261.31；2009年未未支付管理费余额1,822,404.50

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,948,701.86	3,432,648.01

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times0.25\%$/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2010年未未支付托管费余额389,210.20；2009年未未支付托管费余额303,734.11

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
农业银行	53,510,112.06	-	-	-	-	-
	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
农业银行	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人2010年度及2009年度均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于2010年年末及2009年年末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	155,063,158.39	1,107,853.75	229,240,513.76	1,077,580.90

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于2010年度及2009年度均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 利润分配情况

7.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场外	场内					
1	-	2010年4月26日	2010年4月26日	0.0500	3,650,570.35	4,238,045.44	7,888,615.79	
合计	-	-	-	0.0500	3,650,570.35	4,238,045.44	7,888,615.79	

注：本基金于资产负债表日之后，年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的具体情况参见年报正文7.4.8.2资产负债表日后事项。

7.4.10 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300125	易世达	2010年9月27日	2011年1月13日	认购新发证券	55.00	83.49	32,649	1,795,695.00	2,725,865.01	-

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600518	康美药业	2010年12月6日	重大事项公告	19.71	2011年1月6日	17.29	1,700,000	32,301,995.35	33,507,000.00	-
600315	上海家化	2010年12月28日	重大事项公告	37.13	-	-	500,000	16,597,742.75	18,565,000.00	-

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金无银行间市场债券正回购。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额分别为人民币20,000,000.00元、25,000,000.00元、20,000,000.00元及20,000,000.00元，分别于2011年1月4日、1月5日、1月6日及1月7日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和成在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,257,209,766.65	65.33
	其中：股票	1,257,209,766.65	65.33
2	固定收益投资	492,671,807.60	25.60
	其中：债券	492,671,807.60	25.60
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	162,675,153.63	8.45
6	其他各项资产	11,764,724.29	0.61
7	合计	1,924,321,452.17	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	26,363,274.99	1.45
B	采掘业	131,510,298.63	7.22
C	制造业	626,502,818.23	34.38
C0	食品、饮料	101,875,841.21	5.59
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	10,712,000.00	0.59
C4	石油、化学、塑胶、塑料	41,004,370.00	2.25
C5	电子	111,004,994.14	6.09
C6	金属、非金属	4,287,145.32	0.24
C7	机械、设备、仪表	59,395,219.97	3.26
C8	医药、生物制品	252,492,020.79	13.86
C99	其他制造业	45,731,226.80	2.51
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,355,000.00	1.12
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	136,983,463.04	7.52
H	批发和零售贸易	78,642,751.53	4.32
I	金融、保险业	84,234,777.12	4.62
J	房地产业	33,018,958.60	1.81
K	社会服务业	77,647,339.71	4.26
L	传播与文化产业	41,951,084.80	2.30
M	综合类	-	-
	合计	1,257,209,766.65	69.00

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,499,907	84,234,777.12	4.62
2	601699	潞安环能	942,902	56,234,675.28	3.09
3	600460	士兰微	2,399,263	54,919,130.07	3.01
4	600869	三普药业	2,080,917	53,458,757.73	2.93
5	600809	山西汾酒	770,057	52,772,006.21	2.90
6	601607	上海医药	2,400,000	52,416,000.00	2.88
7	002063	远光软件	1,615,313	50,236,234.30	2.76
8	002017	东信和平	1,800,442	45,731,226.80	2.51
9	000061	农产品	2,499,969	44,024,454.09	2.42
10	300058	蓝色光标	1,188,416	41,951,084.80	2.30

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	106,432,485.71	7.42
2	000823	超声电子	70,343,807.28	4.90
3	600139	西部资源	63,118,877.07	4.40
4	600460	士兰微	58,801,983.60	4.10
5	601166	兴业银行	58,104,698.11	4.05
6	601607	上海医药	56,827,608.14	3.96
7	600741	华域汽车	54,798,453.42	3.82
8	600395	盘江股份	54,370,906.63	3.79
9	600718	东软集团	54,317,195.37	3.79
10	600884	杉杉股份	52,648,496.76	3.67
11	600518	康美药业	51,779,397.14	3.61
12	601699	潞安环能	51,557,752.86	3.59
13	600809	山西汾酒	49,711,551.30	3.47
14	002063	远光软件	49,199,996.98	3.43
15	002056	横店东磁	47,913,222.45	3.34
16	000987	广州友谊	45,630,980.49	3.18
17	002017	东信和平	45,374,439.84	3.16
18	000522	白云山A	44,721,808.53	3.12
19	300003	乐普医疗	44,189,297.30	3.08
20	600529	山东药玻	43,577,688.74	3.04
21	002250	联化科技	42,677,606.94	2.97
22	000848	承德露露	42,248,772.80	2.94
23	000061	农产品	40,631,701.91	2.83
24	002165	红宝丽	40,149,996.32	2.80
25	600869	三普药业	40,135,121.16	2.80
26	600588	用友软件	39,835,659.07	2.78
27	000060	中金岭南	39,814,018.37	2.78
28	600479	千金药业	39,690,155.42	2.77
29	600096	云天化	39,000,724.59	2.72
30	600887	伊利股份	38,144,355.70	2.66
31	600827	友谊股份	37,085,917.98	2.59
32	300058	蓝色光标	37,017,169.14	2.58
33	601117	中国化学	36,721,943.65	2.56
34	600859	王府井	36,576,152.67	2.55
35	600048	保利地产	36,336,083.96	2.53
36	002215	诺普信	33,865,174.65	2.36
37	601169	北京银行	33,722,861.44	2.35
38	000800	一汽轿车	33,474,075.44	2.33
39	000776	广发证券	33,155,093.09	2.31
40	000963	华东医药	33,031,248.67	2.30
41	600307	酒钢宏兴	33,011,934.92	2.30
42	000665	武汉塑料	32,345,125.55	2.25
43	600271	航天信息	31,876,263.74	2.22
44	600815	厦工股份	31,274,151.36	2.18
45	600323	南海发展	31,160,093.67	2.17
46	002148	北纬通信	30,901,198.23	2.15
47	000826	桑德环境	30,880,697.04	2.15
48	600166	福田汽车	30,798,374.77	2.15
49	601168	西部矿业	30,655,833.39	2.14
50	002324	普利特	30,610,268.44	2.13
51	600571	信雅达	30,253,934.54	2.11
52	002410	广联达	30,249,287.24	2.11
53	600055	万东医疗	29,837,989.19	2.08
54	000661	长春高新	29,808,600.15	2.08
55	601628	中国人寿	29,760,214.85	2.07
56	000581	威孚高科	29,732,611.87	2.07
57	000598	兴蓉投资	29,282,308.26	2.04
58	002041	登海种业	28,974,060.90	2.02

注：本项以及8.4.2、8.4.3的“买入金额”=“买入股票成本”+“买出金额”-“买出股票收入”，即按实买成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。8.4.2 累计买出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	95,354,938.11	6.65
2	600395	盘江股份	82,499,897.21	5.75
3	000823	超声电子	74,057,321.93	5.16
4	000060	中金岭南	63,095,355.96	4.40
5	002056	横店东磁	62,286,088.76	4.34
6	000063	中兴通讯	61,921,161.81	4.32
7	600570	恒生电子	58,389,573.47	4.07
8	600529	山东药玻	55,087,749.98	3.84
9	000568	泸州老窖	51,676,762.15	3.60
10	600409	三友化工	49,915,390.12	3.48
11	600718	东软集团	49,649,211.87	3.46
12	000848	承德露露	49,212,929.04	3.43
13	600884	杉杉股份	49,071,366.93	3.42
14	600741	华域汽车	45,745,696.29	3.19
15	002410	广联达	45,560,194.03	3.18
16	600837	海通证券	44,891,759.05	3.13
17	300003	乐普医疗	44,782,319.59	3.12
18	000157	中联重科	44,454,815.91	3.10
19	601318	中国平安	44,215,266.76	3.08
20	600827	友谊股份	44,020,845.39	3.07
21	600537	海通集团	43,936,352.89	3.06
22	002250	联化科技	43,701,989.74	3.05
23	000987	广州友谊	43,524,514.01	3.03
24	000800	一汽轿车	41,554,281.47	2.90
25	600511	国药股份	40,652,830.92	2.83
26	600036	招商银行	39,869,716.46	2.78
27	000550	江铃汽车	39,821,817.03	2.78
28	600096	云天化	39,649,083.99	2.76
29	600479	千金药业	38,321,625.00	2.67
30	002024	苏宁电器	37,648,318.37	2.62
31	600139	西部资源	37,597,791.91	2.62
32	300088	长信科技	37,388,980.17	2.61
33	000776	广发证券	37,016,491.24	2.58
34	600859	王府井	35,265,064.31	2.46
35	000400	许继电气	35,172,063.97	2.45
36	002165	红宝丽	35,115,937.20	2.45
37	002256	彩虹精化	34,984,712.60	2.44
38	600307	酒钢宏兴	33,549,659.20	2.34
39	600887	伊利股份	32,977,437.62	2.30
40	601169	北京银行	32,867,764.92	2.29
41	600271	航天信息	32,626,032.22	2.27
42	600815	厦工股份	32,457,731.65	2.26
43	000963	华东医药	32,312,426.27	2.25
44	600323	南海发展	32,147,280.71	2.24
45	002230	科大讯飞	32,002,290.22	2.23
46	000665	武汉塑料	31,590,090.77	2.20
47	601168	西部矿业	31,126,886.16	2.17
48	000581	威孚高科	31,084,204.78	2.17
49	600123	兰花科创	30,867,161.30	2.15
50	600166	福田汽车	29,855,180.58	2.08
51	600976	武汉健民	29,823,316.70	2.08
52	002047	成霖股份	29,687,304.51	2.07
53	002324	普利特	29,596,886.47	2.06
54	002117	东港股份	29,504,485.96	2.06
55	600125	铁龙物流	29,328,999.53	2.04
56	000826	桑德环境	29,117,863.98	2.03
57	002294	信立泰	29,113,313.42	2.03

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交总额）	4,197,037,279.75
卖出股票收入（成交总额）	4,087,021,564.86

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	194,472,318.20	10.67
2	央行票据	249,225,000.00	13.68
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	48,974,489.40	2.69
N-1	其他	-	-
N	合计	492,671,807.60	27.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010112	21国债(2)	520,000	52,374,400.00	2.87
2	010110	21国债(0)	520,000	52,332,800.00	2.87
3	0801053	08央行票据53	500,000	50,215,000.00	2.76
4	010203	02国债(3)	500,000	50,000,000.00	2.74
5	113001	中行转债	445,790	48,974,489.40	2.69

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的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。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,739,635.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,358,501.06
5	应收申购款	666,587.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,764,724.29

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	48,974,489.40	2.69

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
69,860	24,405.52	570,337,183.60	33.45%	1,134,632,155.72	66.55%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	51,975.45	0.0030%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年8月4日）基金份额总额	1,186,651,618.30
本报告期期初基金份额总额	1,426,550,679.03
本报告期基金总申购份额	975,134,584.89
减：本报告期基金总赎回份额	696,715,924.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,704,969,339.32

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.2010年5月8日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登了《银河基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，原总经理裴勇同志因工作调动原因，经第二届董事会第十三次会议审议通过，免去其所担任的总经理职务，聘任原副总经理柳科金同志担任公司总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为统一公司和基金审计机构，提高审计效率，经公司董事会审议通过，本基金审计机构改聘为安永华明会计师事务所。本基金管理人已履行了必要的更换程序，并于2010年2月3日发布关于旗下基金改聘会计师事务所的公告。 本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所的报酬为50000元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供2年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	1,823,857,035.44	22.14%	1,516,777.99	22.11%	-
银河证券	1	1,618,368,594.15	19.65%	1,375,599.21	20.05%	-
光大证券	1	1,154,866,433.59	14.02%	981,634.43	14.31%	-
中银国际	2	753,153,481.89	9.14%	612,944.81	8.93%	-
中银万国	1	719,017,706.09	8.73%	611,162.06	8.91%	-
华宝证券	1	509,275,752.11	6.18%	413,791.02	6.03%	-
中银投资证券	1	1,185,548,976.42	14.39%	963,266.69	14.04%	
国泰君安	2	472,092,806.36	5.73%	385,069.47	5.61%	-

注：1.选择证券公司专用席位的标准：

⑴ 实力雄厚；

⑵ 信誉良好，经营行为规范；

⑶ 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；

⑷ 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；

⑸ 研究实力强，有固定的研究机构专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；

⑹ 本基金管理人要求的其他条件。

2.选择证券公司专用席位的程序：

⑴