109,269,356.74 61%

金额单位:人民币元

2011年8月27日

信息披露 Disclosure

(上接B85版) 本基金的业绩比较基准为: 债券指数涨跌幅 \times 85%+上证A股指数涨跌幅 \times 15%; 其中债券指数为: 中信国债指数涨跌幅 \times

本基金的业绩比较基准等; 他旁籍致疏於鴨冰80%+上 ILLABX] IEPAURAS (IMPAURAS) INSPAIRAS (IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS) INSPAIRAS (IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS (IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS (IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS IMPAURAS (IMPAURAS IMPAURAS I

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明 本财务报表符合企业会计准则的要求,真实,完整地反映了本基金于2011年06月30日的财务状况以及2010年度的经营成

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金十24 果和单位变动情况。 本财务报表以本基金特效整省为基础列报。 6.4.4 要要公计政策的公计估计 本报告期所采用的公计政策。会计估计与最近一期年度报告相一致。 6.4.5.1 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 本基金本报告期先会计放策变更。 6.4.5.1 会计政策变更的说明 本基金本报告期先会计成许变更。 6.4.5 会计成计由计变更的说明 本基金本报告期先会计估计变更。 6.4.5 会计由计变更的说明 本基金本报告期先会计估计变更。 6.4.5 会计通过正的说明

奉金並平核官別元宗(1日日東天)。 64.53。著籍更正的说明 本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金額。 64.6 段项 1印花庭 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 優票)交易印花税税率,由原先的3%。调 整为1%e; 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 经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月10日起,测整由出让方按证券 般票 灾易印花税税率缴纳 印花税 受进户不再征收,稳率年本实; 根据财政部、国家税务总局财税学 2003 103号文 铁于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知 約规定,股权分置 改革过程中国非流通股股东间流通股股东交付对价而发生的股权时上,暂全舱收印花税。 2营业税。企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税学 2004 78号文 铁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 的团式证券投资基金 开放式证券投资基金 产型人运用基金买卖股票,颁参的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

业所得税; 耕取财政部、国家税务总局财税学 Doos 103号文 统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 改革中非流通股投东通过对价方式的流通股股东支付的股份、现金等收入。暂免证收流通股股东应缴却的企业所得税; 相规财政部、国家税务总国税 Doos 19文 统于企业所得税若干优重政策的通知规策度。对证券贷金从证券市 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、红和收入、债券的利息收入及其他收入、暂不征收企业所得

基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 同受基金管理人的第一大股东控制、基金代销机

0.4.6.1.1 政元	X.90			金额单位:人民币
关联方名称	本期 2011年1月1日至201	1年6月30日	上年度可比 2010年1月1日至2	
大联刀石桥	成交金額	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	134,346,749.46	47.05%	112,418,98	30.38 44.229
		6.4.8.1.2债券	交易	金额单位:人民币5
14 mi → 19 m	本期 2011年1月1日至201	11年6月30日	上年度可 2010年1月1日至2	
关联方名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額 占当其成交总额	
银河证券	18,664,527.63	24.23%	15,582,45	59.62 21.209
		6.4.8.1.3债券回	购交易	金额单位:人民币5
关联方名称	本期 2011年1月1日至201	11年6月30日	上年度可 2010年1月1日至2	
大联刀石桥	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金額	占当期债券回购 成交总额的比例

银河证券	77,500,000.00	35.63%		62.229
		6.4.8.1.4 权证	E交易	金额单位:人民币元
关联方名称	本期 2011年1月1日至201	1年6月30日	上年度可 2010年1月1日至2	比期间
大联刀右你	成交金額	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	0.00	0.00%		0.00 0.00%

			金	额单位:人民币元
关联方名称		2011年1月1日	本期 日至2011年6月30日	
大联刀石桥	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
银河证券	114,758.12	46.54%	39,108.54	31.889
关联方名称			度可比期间 日至2010年6月30日	
人机刀石砂	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
银河证券	98,149.21	44.46%	6,539.91	7.339
注:上述佣金 证管费等)。	按市场佣金率计算,扣除证券公司 管理人因此从关联方获取的其他		包括但不限于买(卖)烃手费、证券结算 为本基金提供的证券投资研究成果和i	

本期 2011年1月1日至2011年6月30日 102.629.84

项目

		早证:人民用元
项目	本期	上年度可比期间
-9K CI	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	282,760.53	321,904.26
注:本基金应支付基金托管人托管	费,按前一日基金资产净值0.20%的年	费率逐日计提,累计至每月月底,按月支付。其论

银河收益证券投资基金

算公式为: 日基金托管费=前一日基金资产净值x0.20%;当年天数 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

		-i- thi			单位:人民币元
	2011年1月1		30⊟		
债券交易	易金額	基金边	逆回购	基金	正回购
基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
0.00	20,957,126.58	0.00	0.00	0.00	0.00
			30⊟		
债券交易	易金額	基金边	逆回购	基金	正回购
基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
20,062,677,53	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	基金买人 0.00 债券交易 基金买人	债券交易金额 基金买人 基金蛋出 0.00 20,957,126.58 上年 2010年1月1 债券交易金额	 債券交易金額 基金支人 基金支出 交易金額 0.00 20,957,126.58 0.00 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月 債券交易金額 基金支 基金支 基金変人 基金支 基金支 	2011年1月1日至2011年6月3回日 接金運即 接金運用 接金運用 大田 大田 大田 大田 大田 大田 大田 大	Temperature

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
坝日	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
基金合同生效日(2003年8月4日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	22,186,132.54	22,186,132.54
期间申购/买人总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	22,186,132.54	22,186,132.54
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.39%	11.16%
注, 木基金管理 人 法用因有资金投资 木基金系在	下党业名范围内按一船的商业名约	讲行 投资太其金的费率显从分的

注: 本基金管理人连用自有贷金按贷产基金条件上吊业务记回内按一股时间业 64.84.2 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: 本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

关联方 名称		本期 至2011年6月30日	上年度可比 2010年1月1日至20	
冶标	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
农业银行	24,066,554.14	86,799.99	43,020,152.62	123,513.5

28.38 32.70 100,000 3,071,668.00 2,838,000.0

8日 6.49.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.49.3.1 镇行向市场债券正回购 兹至到本报告期末201年6月30日上,本基金无从事证券银行间债券回购交易形成的卖出回购证券款。 6.49.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末2011年6月30日止,本基金无从事证券较易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。 6.410 有助于规解和分析会计报表需要说明的其他事项

§ 7 投资组合报告

7 1 BH	末基金资产组合情况	§ 7 投资组合报告	
7.1 293	A 至並页)組口間のL		金额单位:人民币元
序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	33,273,242.83	11.48
	其中:股票	33,273,242.83	11.48
2	固定收益投资	219,342,303.30	75.65
	其中:债券	219,342,303.30	75.65
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	9,000,000.00	3.10
	其中:买断式回购的买人返售金融资产		-
5	银行存款和结算备付金合计	24,316,668.0	8.39
6	其他各项资产	4,004,919.13	1.38
7	合计	289,937,133.33	100.00

7.2	州木妆仃业分尖的 权宗校贺组合		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	衣、林、牧、渔业	-	-
В	采掘业	-	-
C	制造业	18,417,133.32	6.64
C0	食品、饮料	9,289,940.32	3.35
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
С3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	3,256,958.68	1.17
C8	医药、生物制品	5,870,234.32	2.12
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,168,000.00	1.14
E	建筑业	_	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	5,114,449.50	1.84
Н	批发和零售贸易	_	-
I	金融、保险业	630,300.00	0.23
J	房地产业	_	-
K	社会服务业	3,105,360.00	1.12
L	传播与文化产业	2,838,000.00	1.02
M	综合类	-	-
1	4.11		·

7.3 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

					亚帆牛山:八八川
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	000596	古井贡酒	116,884	9,289,940.32	3
2	600011	华能国际	600,000	3,168,000.00	1
3	002334	英威腾	60,000	3,147,000.00	1
4	300187	永清环保	57,000	3,105,360.00	1
5	002038	双鹭药业	79,932	3,017,433.00	1
6	000538	云南白药	49,979	2,852,801.32	1
7	300058	蓝色光标	100,000	2,838,000.00	1
8	002308	威创股份	249,950	2,751,949.50	0.
9	600050	中国联通	450,000	2,362,500.00	0.
10	600016	民生银行	110,000	630,300.00	0.
		报告期末基金投资 资组合的重大变动		卖登载于银河基金管理有R	公司网站的半年度报告正

	《计头人金额超出	期初基金资产净值2%或	則20名的股票投資明细	金额单位:人民币:
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000635	英力特	8,658,364.00	2.84
2	600104	上海汽车	7,896,053.00	2.59
3	600011	华能国际	6,292,383.40	2.06
4	002110	三钢闽光	5,782,458.80	1.90
5	600295	鄂尔多斯	5,711,472.32	1.87
6	601318	中国平安	5,607,750.00	1.84
7	300002	神州泰岳	5,084,152.20	1.67
8	300131	英唐智控	4,122,904.80	1.35
9	601857	中国石油	3,448,100.00	1.13
10	002415	海康威视	3,397,397.40	1.11
11	000596	古井贡酒	3,086,857.00	1.01
12	300058	蓝色光标	3,071,668.00	1.01
13	002446	盛路通信	3,050,492.47	1.00
14	600292	九龙电力	2,988,242.60	0.98
15	000597	东北制药	2,977,104.00	0.98
16	002139	拓邦股份	2,969,653.48	0.97

2,888,760.90

2,873,160.19

占期初基金资产净值比例(%	本期累计卖出金额	股票名称	股票代码	序号
2.5	8,956,470.55	上海汽车	600104	1
2.1	8,619,534.29	英力特	000635	2
2.	6,527,174.38	华域汽车	600741	3
2.	6,485,676.93	中材国际	600970	4
2.0	6,327,960.32	三钢闽光	002110	5
2.0	6,230,786.92	英唐智控	300131	6
2.0	6,153,871.00	中国一重	601106	7
1.3	5,772,755.82	鄂尔多斯	600295	8
1.6	5,162,494.00	中国平安	601318	9
1.:	4,663,091.03	神州泰岳	300002	10
1.4	4,441,827.90	华星创业	300025	11
1.4	4,331,100.36	海通集团	600537	12
1.3	4,103,050.00	五 粮 液	000858	13
1.3	4,013,783.00	博瑞传播	600880	14
1.	3,587,095.43	海康威视	002415	15
1.	3,480,000.00	中国石油	601857	16
1.0	3,301,485.64	好想你	002582	17
1.0	3,266,453.69	华北制药	600812	18
1.0	3,230,105.10	益佰制药	600594	19
1.0	3,207,583.29	拓邦股份	002139	20

买人股票	成本(成交)总额		122,009,196.11				
卖出股票	收人(成交)总额	163,533,465.					
7.5 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	9,887,000.00	3.57				
2	央行票据	-	-				
3	金融债券	10,137,000.00	3.66				
	其中:政策性金融债	10,137,000.00	3.66				
4	企业债券	100,758,000.00	36.33				
5	企业短期融资券	49,972,000.00	18.02				
6	中期票据	-	_				
7	可转债	48,588,303.36	17.52				
8	其他	-	_				
)	合计	219.342.303.36	79.09				

a c 1811-	ヒャハム(人は) ヒサム	26c-5c32, fdc1J-781_	よりながかてなり	4:-VA-1/1.2%r0F1/m					
7.6 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	078065	07红豆债	200,000	20,796	,000.00	7.50			
2	1180066	11乐国资债01	200,000	20,308	,000.00	7.32			
3	113002	工行转债	170,290	20,174	,256.30	7.27			
4	122845	11横店债	200,000	20,100	,000.00	7.25			
5	098041	09永煤债	200,000		,000.00	7.15			
7.7 期2	卡按公允价值占基金	资产净值比例大	小排名的前十名	资产支持证券投资明约	H				

73.293.807.

58,584,300.67

51,938,882.47

7.7 期末夜公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券 注本基金本报告期末未持有资产支持证券 7.8 期末按公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

海螺水泥

盘江股份 江苏国泰

600395

4 002091

7.9 投资组合报告附注 7.9.1 银河收益基金投资的前十名证券中,没有发行主体被监管部门立案调查的情形,在报告编制日前一年内也没有受到

TIMI可,近日时间形态 7-9.2 银河收益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。 7-9.3 期末其他各项资产构成

		单位:人民币元
序号	名称	金額
1	存出保证金	735,942.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,214,656.15
5	应收申购款	54,320.84
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,004,919.13
7.9.4	期末持有的处于转股期的可转换债券明细	

1 300058 蓝色光标 §8 基金份额持有人信息 81 期末基金份额持有人户数及持有人结构 持有人户数 (户) 机构投资

69,852,460.10

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		3,833.40	0.0021%
·	§ 9 开放式基金份额变动	b .	V 0. 1
			单位:t
基金合同生效日(2003年8月4日)基金份额总额			1,802,248,568.23
本报告期期初基金份额总额			197,214,337.72
本报告期基金总申购份额			29,075,655.24
减:本报告期基金总赎回份额			47,168,176.12
本报告期基金拆分变动份额			_

本报告期期末基金份额总额 179,121,816.84 § 10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议 对古期内尤基金份额持有人大会决议 10.2 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

10.2 恋恋日年八、恋恋行日八切 v) 恋恋行日间,即本人八年受动

"报告期内基金管理人及生以下重大人事变动; (证券申报)上刊登了(银河基金管理有限公司关于董事变更的公为(银两基金管理有限公司关于董事变更的公为(银两基金管理有限公司关于董敬管理人员变更的公告), 经公司第十八次股东会议审议通过, 由徐旭女士 刘彦先生 腓科金先生 张国庄先生 波有拉先生, 正古疆先生, 斯人杰先生, 孙树又先生, 王福山先生, 秦荣生先生, 沈祥荣上载公司第二届董事会, 其中外似文先生, 王信加先生, 秦荣生先生, 沈祥荣上载公司第二届董事会, 其中外似文生, 王信加先生, 秦荣生先生, 沈祥荣上为她立董事。 平山董事务中李锡先生 成宗中长生, 李陈贵庄生, 秦勇先生, 秦勇先生, 不得任公司重查, 苏里仁等。 经公司第三届董申会和一个会议及表述通过, 选举给服司左任任公司重查, 李继是一位。 等 (大安区农民运用。) 《古学市局局》记记、公寓事代、于海里内心下中记记、公寓事代、特记九米市内局另市证内总任 任公司副总是理。 二、报告期内基金托管人发生如下重大变动; 1 2011年11月21日,中国证金会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格(证监许》 [2011]116等)、张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的证据告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的证据告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1 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 备注 占当期佣金 总量的比例 成交金額 佣金 134,346,749.46 114,758.1 海通证券 102.366.044.40 35.85% 92,103.0 48,829,867.6 17.10% 39,728.6 16.119 申银万国

(4)具备基金运作所需的高效、安全、逻辑的趣印研计、公司以理识 口口之生于超级强化。 这關於: (5)研究实力强,有固定的研究机构和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; (6)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。 (1)资格考察: (2)和步确定: (3)答订协议。

(3)签订协议。 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

794 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

2.85

	债券	交易	债券回	回购交易	权证交易		
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金額	占当期权证 成交总额的比例	
银河证券	18,664,527.63	24.23%	77,500,000.00	35.63%	-	-	
海通证券	57,279,326.74	74.37%	140,000, 000.00	64.37%	-	-	
光大证券	1,077,895.40	1.40%	-	-	-	-	
申银万国	-	-	-	-	-	-	
					钼:	可其全管理有限公	

§ 8 基金份额持有人信息

(上接B95颗)
64.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本琳·苏桂花谷企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2011年06月30日的财务状况以及2010年度的经营成果和种值多过情况。
64.4 重要会计成和会计估计
本报告期所采用的会计的证明
本报告期下采用的会计数策 会计估计与最近一期年度报告相一致。
64.5 会计改策和会计估计专见以及差错更正的说明
本据金本报告期无会计故策变更。
64.5 会计被策变的说明
本基金本报告期无会计协策变更。
64.5 会计尚汇查别的证明
本基金本报告期无会计估计变更。
64.5 会社局汇查的说明
本基金本报告期无会计估计变更。
64.5 经国务报报作用及会计差错的内容和更正金额。
64.6 现

16년 1条院批准,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

过程中担害高迪散股东南流迪散散东文付对价加发生的散处转让,暂免地取印化税。 2.常虚像,企业所得稳。 根据财富。国家债务总局财税字 2004 78号文 佚于证券投资盖金税收改策的通知1的规定,自2004年1月1日起,对证 资基金 射闭式止券投资基金,开放式止券投资基金 简理人运用基金头卖股票,债券的差价收入,继续免证常业税和企 业所得税; 根据财政部、国家税多总局财税字 2005 103号文 关于股权分置试点改革有关税收收货管问题的通知)的规定,股权分置 改革中非流通股权充通过对价方式向流通避股东支付的股份,现金等收入,暂免证收流通股股东废墟的企业所得税。 根据财政部、国家保务总局财税 2008 1号文 关于企业所得税若干优惠政劳通道如约据定、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,红和收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。 2.4 18/2636

目的收入,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,省个企收企业所符化。 化个人所得税 县银财政部、国家税务总局财税学 2002 1128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

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
6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易	

6.4.8.1.1 股票交	き易			4	:额单位:人民币元
关联方名称	本期 2011年1月1日至201	1年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
大联刀右桥	成交金額	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	58,230,217.21	1.46%	358,704,1	143.55	9.98%
6.4.8.1.2债券交	易			ú	:额单位:人民币元
关联方名称 -	本期 2011年1月1日至201	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
大联万石桥	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金額		占当期债券 成交总额的比例
银河证券	0.0	0.00%		0.00	0.009
6.4.8.1.3债券回	购交易			4	:额单位:人民币元
	本期 2011年1月1日至201	1年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		月30日
关联方名称	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		ち当期债券 回购 ご总额的比例
银河证券	20,000,000.00	1.15%	14,000,000.00		1.789

关联方名称 银河证券	当期 佣金 49 ,4			占期末应付佣: 总额的比例 .84 3.34	
关联方名称		2011年1月1日 占当期佣金总	至2011年6月30日		
半 軽 古夕 砂					
	本期 2011年1月1日至2011年6月30日				
6.4.8.1.5应支	付关联方的佣金			金额单位:人民币	
艮河证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	
	成交金額	占当期权证 成交总额的比例	成交金額	占当期权证 成交总额的比例	
关联方名称	本期 2011年1月1日至20		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		

2011年1月1日至2011年6月30日 日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数 6.4.8.2.2 基金托管费

		单位:人民币元
项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,919,528.81	1,808,253.68
·算公式为: 基金托管费=前一日基金资产净值×	0.25%÷当年天数	年费率逐日计提,累计至每月月底,按月支付。其
6.4.8.3 与关联方进行银行间同业	市场的债券 (含回购)交易	

农业银行	53,510,112.06	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00		
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出		
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购			
			度可比期间 日至2010年6月	30 ⊟				
农业银行	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00		
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出		
银行间市场交易的	债券交易	金額	基金逆回购		基金正回购			
本期 2011年1月1日至2011年6月30日								
	3 861311411411411414					单位:人民币元		

银河稳健证券投资基金

单位:人民币元

64.8.4 各关联方投资本基金的情况 64.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 注止和提告期更上库度可比明准金管理人均未运用固有资金投资本基金。 64.8.4.2 报告期末标基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 注止和提告期史上年度可比明陈基金管理人之外的其他关联方块投资本基金。 64.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方 名称	2011年1月1日	至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日			
合か	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入		
农业银行	104,560,040.50	531,000.80	175,383,008.36	575,937.72		
注:本基金无 6.4.9 期末(2 6.4.9.1 因认则 注:报告期末	9新发/增发证券而于	的情况存在。 金持有的流通受限证券 期末持有的流通受限证券 新发/增发而流通受限的证券	À			

									金額単位	:人氏巾兀
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
3000 58	蓝色 光标	-	临时 停牌	28.38	2011年 7月8日	32.70	1,188,416	36,007,040.75	33,727,246.08	-
3001 96	长海 股份	-	临时 停牌	18.00	2011年 7月1日	18.15	1,008,100	23,049,440.20	18,145,800.00	-
6003 15	上海家化	-	临时 停牌	35.60	-	-	500,000	16,597,742.75	17,800,000.00	-
6.4.	9.3 期元	に债券正 1行间市	回购交	易中作为抵	押的债券	À			*	

6.4.9.3.1 银行间印动侧旁近凹侧 截至到体柱后刺来2011年6月39日止,本基金无从事证券银行间债券回购交易形成的卖出回购证券款。 6.4.9.3.2 交易所市场债券近回购 截全基保管和未2011年6月9日止,本基金从事证券交易所债券近回购交易形成的卖出回购证券款余额分别为人民币 50.000.0000元;10.000.000.000.00元及55.000.000.00元,分别于2011年7月1日、7月5日及7月7日先后到期。该套交易要求本基 企但回购购付券有的证券交易所交易的债券和低定新使押实回题下转人质押率的债券,按证券交易所规定的比较消募为标

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 § 7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	851,809,278.62	59.11
	其中:股票	851,809,278.62	59.11
2	固定收益投资	430,019,475.10	29.84
	其中:债券	430,019,475.10	29.84
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	107,764,881.95	7.48
6	其他各项资产	51,346,584.22	3.56
7	合计	1,440,940,219.89	100.00
	用末按行业分类的股票投资组合		金额单位:人民币元

7	合计	1,440,940,21	9.89 100.00
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	<u> </u>	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	-	-
В	采掘业	40,250,386.59	3.00
С	制造业	556,964,159.05	41.56
C0	食品、饮料	106,574,359.38	7.95
C1	纺织、服装、皮毛	53,203,375.60	3.97
C2	木材、家具	-	1
С3	造纸、印刷	_	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	90,412,151.18	6.75
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	83,274,957.10	6.21
C7	机械、设备、仪表	107,682,664.67	8.04
C8	医药、生物制品	115,816,651.12	8.64
C99	其他制造业	_	
D	电力、煤气及水的生产和供应业	27,811,712.00	2.08
Е	建筑业	36,270,000.00	2.71
F	交通运输、仓储业	_	
G	信息技术业	37,161,899.04	2.77
Н	批发和零售贸易	90,320,711.64	6.74
I	金融、保险业	29,265,924.22	2.18
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	37,240.00	0.00
L	传播与文化产业	33,727,246.08	2.52
M	综合类	-	-
	4.11		

7.3 393	NARCY JUNE	口盔並以)中国		X7F1X (Q1915III	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	600079	人福医药	2,002,078	44,165,840.68	3.30
2	600585	海螺水泥	1,499,975	41,639,306.00	3.11
3	600815	厦工股份	2,699,909	39,796,658.66	2.97
4	600809	山西汾酒	550,000	38,527,500.00	2.87
5	002327	富安娜	898,790	37,713,228.40	2.81
6	601668	中国建筑	9,000,000	36,270,000.00	2.71
7	000858	五粮液	999,854	35,714,784.88	2.67
8	000651	格力电器	1,499,926	35,248,261.00	2.63
9	300058	蓝色光标	1,188,416	33,727,246.08	2.52
10	600395	盘江股份	899,861	29,866,386.59	2.23
注:投	资者欲了解本持	设告期末基金投资	管的所有股票明细,应阅	读登载于银河基金管理有限	弘司网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4. 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细

9 002155	7	00800	一汽轿车		46,688,925.	79	2.56
10 601668 中国建筑	8	600079	人福医药		46,000,002.	23	2.52
11	9	002155	辰州矿业		45,783,180.0	54	2.51
12	10	601668	中国建筑		43,954,832.0	00	2.41
12	11	000425	徐工机械		42,812,216.	18	2.35
14 002327 密安郷 35,151,245,90 1.92 15 002035 早帝後伊 35,019,388.64 1.93 16 000527 美妙也書 34,635,448.25 1.93 17 000858 五根液 34,586,499.04 1.90 18 000012 南政人 31,788,612.14 1.77 19 000635 天力特 31,442,053.01 1.77 20 661992 金陽投份 30,939,853.57 1.76 7-2 家計安出金網股份 30,939,853.57 1.76 7-2 家計安出金網股份 30,939,853.57 1.76 1 601318 中国学安 102,079,922.90 5.60 2 601699 商安环能 59,471,397.97 3.22 3 601166 兴业银行 51,759,968.18 2.23 4 600460 土兰微 50,509,008.49 2.27 5 601607 上海医药 49,112,497.71 2.76 6 000800 一代新年 46,697,756.56 2.25 7 601117 中国化学 44,201,885.85 2.5 8 600522 中天科技 42,696,925.56 2.3 10 000601 太产品 42,164,030.25 2.3 11 000425 徐正規様 42,060,100.28 2.3 12 600750 正世形业 40,102,885.81 2.2 13 600855 海螺末屋 40,130,266.18 2.2 14 002063 送光秋中 39,933,081.31 2.1 15 002155 長州企业 40,829,442.08 2.2 16 600139 西部南瀬 37,767,746.47 2.07 17 600875 东方电气 36,200,235.10 1.99 20 601601 中国公学 35,394,138.17 1.9 7-3 次投票所 39,933,081.31 2.1 19 002017 东佐和平 35,551,309.58 1.9 20 601601 中国公学 35,394,138.17 1.9 7-4 次投票所 47,066,508.20 3.5 3 全総産券 19,810,000.00 1.44 4 金産廃券 19,810,000.00 1.45 5 会を保券 19,810,000.00 1.46 5 会を保券 19,810,000.00 1.47 5 会を保券 19,810,000.00 1.47 5 会を保券 19,810,000.00 1.47 5 会を保券 19,810,000.00 1.46 5 会を保券 19,810,000.00 1.47 5 会を保券 19,810,000.00 1.46 5 会を保券 19,810,000.00 1.46 5 会を保券 19,810,000.00 1.46 5 会を保券 19,810,000.00 1.47 5 会を保券 19,810,000.00 1.46 5 会を保券 19,810,000.00 1.46 5 会を保券 19,810,000.00 1	12	000651	格力电器			_	2.34
14 002327 密安師 35.151.245.90 1.92 15 0020357 年命後行 35.019.388.64 1.93 16 000527 美肉也器 34.635.448.25 1.99 17 000688 五粮液 34.586.499.04 1.96 18 000012 南城本 31.788.61.214 1.77 19 000635 天力特 31.442.05301 1.73 20 601992 金県股份 39.939.853.57 1.76 7-4.2	13	600875	东方电气		40,504,983.	30	2.22
15 002035	14		宮安娜			_	1 93
16						_	
17						_	
18							
19						_	
20 601992 金属製粉 30,939,853.57 1.70 7.4.2 繁計労政治金額の						_	
P号						_	
### ### ### ### ### ### ### ### ### ##	20	601992					
			7.4.2 累计实出金额超过			父界投9	
1 601318 中国平安 102,079,929.29 5.66 2 601699 蓋安环能 59,471,397.97 3.26 3 601166 光业銀行 51,759,968.18 2.84 4 600460 土土版 50,509,008.49 2.77 5 601607 上海医药 49,112,497.71 2.76 6 000800 一代新车 46,607,756.56 2.56 7 601117 中国化学 46,601,888.88 2.5- 8 600522 中天科技 42,669,925.56 2.33 9 600669 三普亦业 42,164,003.25 2.33 10 000661 変产量 42,214,01,288.12 2.33 11 000425 徐工机械 42,060,100.28 2.23 12 600750 江中药业 40,829,442.08 2.2- 13 60885 海塚水泥 40,130.266.18 2.2. 14 002063 返光秋中 39,953.081.31 2.15 15 002155 限州企业 39,452,657.20 2.17 16 600139 西部遊園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園園	序号	股票代码	股票名称			占制	目初基金资产净值比例(%)
2 601699 高安环能 59,471,39797 3.24 3 601166 光业銀行 51,759,968.18 2.84 4 600460 土兰成 50,509,008.49 2.77 5 601607 上海医药 49,112,49771 2.77 6 000800 一汽轿车 46,697,756.56 2.56 7 601117 中国化学 46,201,858.58 2.5- 8 600522 中天科技 42,696,925.6 2.3- 9 600669 三普药业 42,101,288.12 2.3- 10 000061 发产量 42,164,030.25 2.3- 11 000425 给工机械 42,606,100.28 2.2- 13 600585 海螺水泥 40,130,266.18 2.20 13 600585 海螺水泥 40,130,266.18 2.20 15 002155 展州企业 39,953,081.31 2.15 16 600139 西西波蘭 37,767,746.47 2.0- 17 600875 东方电气 36,200,235.10 1.9- 18 60048 後利地产 35,76,188.46 1.9-						_	
3 601166 兴业银行 51.759,968.18 2.84						_	
4 600460 土当版 50.509.008.49 2.77 5 601607 上海医药 49,112,497.71 2.76 6 000800 一代轿车 46,697.756.56 2.56 7 601117 中国化学 46,607.756.56 2.56 8 600822 中天科技 42,696.925.56 2.3 9 600869 三普商业 42,401.288.12 2.3 11 000061 次产品 42,164.030.25 2.31 11 000425 徐工机械 42,060.100.28 2.31 12 600750 江中药业 40,829,442.08 2.2- 13 600852 海螺水港 40,130.266.18 2.2- 14 002063 透光秋井 39,955.081.31 2.15 15 002155 层州企业 39,955.081.31 2.15 16 60139 西部資票 37,767.74647 2.00 17 600875 东方电气 36,200.235.10 1.99 18 600048 條料地产 35,776.188.46 1.90 19 002017 东后和平 35,513.309.58 1.99 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>_</td> <td></td>						_	
5 601607 上海医药 49,112,497.71 2.70 6 000000 一汽轿车 46,697,756.56 2.56 7 601117 中国化学 46,201.858.58 2.56 8 600522 中天科技 42,601.858.58 2.56 9 600869 三普药业 42,401,288.12 2.33 10 000061 农产品 42,401,288.12 2.33 11 000425 冷工机械 42,060,100.28 2.31 12 600750 江中药业 40,829,442.08 2.22 13 600885 海螺水泥 40,130,266.18 2.24 14 002063 逐光软件 39,953.081.31 2.15 15 002155 展州市业 39,953.081.31 2.15 16 600139 西南南寨 37,767,746.47 2.00 17 600875 东方电气 36,200,2355.10 1.99 18 600048 解科产 35,761.88.46 1.99 19 002017 东后和平 35,394,138.17 1.96 次長្東大股票成本(成交)总额 2.50 2.15,46,705.56				1			
6 000800							
7 601117 中国化学 46,201,858,58 2,5 8 600522 中天科技 42,696,925,56 2,3 9 600869 三普药业 42,401,288,12 2,3 10 000061 农产品 42,164,030,25 2,3 11 000425 徐工机械 42,060,100,28 2,3 12 600750 江中药业 40,829,442,08 2,2 13 606885 海螺水配 40,130,26618 2,2 14 002063 远光软件 39,953,081,31 2,15 15 002155 展州企业 39,953,081,31 2,15 16 60139 四部資源 37,767,746,47 2,07 17 600875 东方电气 36,200,235,10 1.99 18 600048 保利地产 35,776,188,46 1.96 19 002017 东信和平 35,531,309,58 1.99 20 61661 中国大聚 207,277,66,90 2,115,486,715,56 次長聚成本(成交)总额 2,515,486,715,56 207,207,966,90 1.44 1 国家债券 207,207,966,90 1.44							
8 600522 中天科技 42,696,925.56 2.36 9 600869 三普カ业 42,401,288.12 2.33 10 000061 夜 产品 42,164,030.25 2.31 11 0000425 徐工机械 42,666,100.28 2.23 12 660750 江中药业 40,829,442.08 2.22 13 600585 高端水泥 40,130,266.18 2.22 14 002063 透光秋件 39,953,081.31 2.15 15 002155 限州矿业 39,452,657.20 2.17 16 600139 西部资源 37,767,746.47 2.07 17 60875 东方电气 36,200,235.10 1.99 18 60048 採利地产 35,776.188.46 1.99 20 601601 中国大康 35,351,399.58 1.99 20 601601 中国大康 35,394,138.17 1.99 次長្長野政本(成文)意願 2,115,486,715.56 2.115,486,715.56 水野東大優の会社 20,200,000 1.44 土屋野療等 20,207,966.90 1.54 1 国家衛舎 20,207,07,966.90						_	
9 600869 三普西並 42,401,288,12 2.33 10 000061 次 产品 42,164,030,25 2.31 11 000425 鈴工机械 42,060,100,28 2.31 12 600750 江中药业 40,829,44208 2.22 13 600585 海螺水泥 40,130,266,18 2.26 14 002063 透光软件 39,953,081,31 2.15 15 002155 展州企业 39,452,657,20 2.17 16 600139 西部資源 37,767,746,47 2.00 17 600875 东方电气 36,200,235,10 1.99 18 60048 採利地产 35,776,188,46 1.99 19 002017 东信和平 35,551,309,58 1.99 20 601601 中国太保 35,394,138,17 1.9 买人股票成本(成交)总额 1,877,406,300 2,115,486,715.56 多數學或數學或人(成交)总额 2,175,496,790 占基金资产净值比例(%) 1 国家债券品种 207,207,966,90 1.54 2 央行票報 15,935,000,00 1.14 4 企业债券 19,810,000,00 <td>7</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>46,201,858.5</td> <td>8</td> <td>2.54</td>	7				46,201,858.5	8	2.54
10 000061 夜产品		600522			42,696,925.5	6	2.34
11	9	600869	三普药业		42,401,288.1	2	2.33
12 600750 江中蔣业 40,829,442.08 2.24 13 600885 海螺水泥 40,130,266.18 2.26 14 002063 这光软件 39,953.081.31 2.15 15 002155 辰州矿业 39,953.081.31 2.15 16 600139 西海滨湖 37,767,746.47 2.07 17 600875 东方电气 36,200,235.10 1.99 18 600048 保利地产 35,776,184.6 1.96 19 002017 东信和平 35,571,399.88 1.95 20 601601 中国太保 35,394,138.17 1.92 7.4.3 文人股票的改本总额及实出股票的伙人总额 40,000,000 2,115,486,715.56 下号 信求 公允价值 古基金资产净值比例(%) 1.55,395,000.00 1.44 4 企业债券 -	10	000061	农产品		42,164,030.2	5	2.31
13 600885 海螺水肥 40,130,266.18 2,26 14 14 14 14 15 15 15 15	11	000425	徐工机械		42,060,100.2	8	2.31
14 002063 遠光軟件 39,953,081,31 2,15 15 002155 民州矿业 39,452,657,20 2,17 16 600139 西部資源 37,767,746,47 2,07 17 600875 东方电气 36,200,235,10 1,99 18 600048 保利地产 35,776,188,46 1,96 19 002017 东信和平 35,551,309,58 1,99 20 601601 中国大保 35,351,309,58 1,99 20 601601 中国大保 35,394,138,17 1,99	12	600750	江中药业		40,829,442.0	8	2.24
15 002155 展州矿业 39,452,657.20 2.17 16 600139 西部資源 37,767,746.47 2.07 17 600875 东方屯气 36,200.235.10 1.99 18 600048 保利地产 35,776.188.46 1.99 19 002017 东信和平 35,551,309.58 1.99 20 601601 中国大保 35,394,138.17 1.99 7.4.3 某人股票的成本总额及支出股票的收入总额	13	600585	海螺水泥		40,130,266.1	8	2.20
15 002155 展州矿业 39,452,657.20 2.17 16 600139 西部資源 37,767,746.47 2.07 17 600875 东方屯气 36,200.235.10 1.99 18 600048 保利地产 35,776.188.46 1.99 19 002017 东信和平 35,551,309.58 1.99 20 601601 中国大保 35,394,138.17 1.99 7.4.3 某人股票的成本总额及支出股票的收入总额	14	002063	远光软件		39,953,081.3	1	2.19
16 600139 西部資源 37,767,746.47 2.00 17 600875 东方电气 36,200,235.10 1.99 18 600048 保利地产 35,776.188.46 1.96 19 002017 东信和平 35,576.188.46 1.96 20 601601 中国大保 35,394.138.17 1.96		-				_	2.17
17 600875 东方电气 30,200,235,10 1.99 18 600048 採利地产 35,776,188,46 1.99 19 002017 东信和平 35,551,309,58 1.99 20 601601 中国大陸 35,394,138,17 1.99						_	
18 600048 保利地产 35,776,188.46 1.96 19 002017 东信和平 35,551,309.58 1.95 20 601601 中国大学 35,551,309.58 1.95 7.4.3 文人股票的成本总额及卖出股票的收入总额							
19 002017 东信和平 35,551,399.88 1.99 20 601601 中国大保 35,551,399.88 1.99 20 601601 中国大保 35,354,138.17 1.99 7.4.3 丈人股票的成本意観及支出股票的收入意報 東住か人民行元 下号 備券品种 公允仲国 占基金資产浄値比例(条) 1 国家债券 207,207,966.90 占基金資产浄値比例(条) 1 国家债券 207,207,966.90 15,46 2 央行票部 155,935,000.00 11.66 3 金融债券 19,810,000.00 1.44 4 企业债券 19,810,000.00 1.44 4 企业债券	.,					_	
20 601601 中国大保 33,394,138.17 1.9 天人股票成本(成文)总额 1,877,406,300. 序号 依據參品种 2,115,486,715.56 序号 依據參品种 公允的值 占基金资产净值比例(%) 1 国家债券 207,207,966.90 15.44 2 央行票報 155,935,000.00 11.66 3 金融债券 19,810,000.00 1.44 4 企业债券 19,810,000.00 1.44 4 企业债券 - - 5 企业庭期融资券 - - 7 可转债 47,066,508.20 3.51 8 其地 - - 9 合計 430,019,475.10 32.09 76 期来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时租 金额单位人人民币元 序号 债券名際 数量(条) 公允价值 占基金资产净值比例、人民币元 序号 债券名際 数量(条) 公允价值 5.66 会额产净值比例、人民币元 序号 债券名際 数量(条) 公允价值 占基金资产净值比例、人民币元 金额单户单位、人民币元 金额产产单位比例(。人民币元 5.96 40.00 3.87 3.92 5.96 40.00 3.87			71.11.07			_	
7.4.3						_	
	20	601601		一 一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一			1.94
英人股票成本(成交) 急額 1,877,406,300: 変出股票収入(成交) 急額 2,115,486,715.56 7.5 期末技備券品种分类的债券投资组合金額単位:人民币元 207,207,966.90 占基金资产净值比例(%) 1 国家债券 207,207,966.90 15.46 2 央行票据 155,935,000.00 11.66 3 金融债券 19,810,000.00 1.44 4 企业债券 19,810,000.00 1.44 4 企业债券 - - 5 企业短期融资券 - - 6 中期票据 - - 7 可转债 47,066,508.20 3.55 8 其地 - - 9 合計 430,019,475.10 32.09 7.6 期末核公允价值占基金资产净值比例大小非名的前五名债券投资时期 金額单比入(人民币) 序号 债券名等 数量(条) 公允价值 占基金资产净值比例(水) 1 010308 03国债(8) 537,430 52,926,106.40 占基金资产净值比例(水) 2 010110 21国债(9) 520,000 51,966,400.00 3.87 3 010112 21国债(9) 520,000 51,966,400.00 3.87 3 010112 21国债(9) 520,000 51,970,000.00 3.87			7.4.3 头人的	是 是位:人民	及头田胶采的收入芯 币元	est.	
F9号 (需要品件) 元素を修予品的债券投资组合 金額単位人民行元 F9号 債券品件 全允价值 占基金资产净值比例(%) 1 国家债券 155,935,000,00 15,44 2 央行票据 155,935,000,00 11,66 3 金融债券 19,810,000,00 1.44 4 企业债券 - - 5 企业原筹 - - 6 中期票据 - - 7 可转债 47,066,508,20 3.51 8 基地 - - 9 合計 430,019,475,10 32,09 7 明本核公允价值占基金资产净值比例大小球名的商五名债券投资押额 金额单位、人民币元 序号 债券化券 数量(家) 公允价值 占基金资产净值比例(金) 1 010308 03国债務) 537,430 52,926,106,40 占基金资产净值比例(金) 2 010110 21国债金 520,000 51,870,000,00 3.8% 3 010112 21国债金 520,000 51,870,000,00 3.8% 4 010203 02區債3	买人股票店	成本(成交)总额					1,877,406,300.7
世界では、人民币元	卖出股票	收入(成交)总额	i				2,115,486,715.56
序号 债券品种 公允价值 占基金資产净值比例(%) 1 国家债券 207,207,966.90 15.46 2 央行課報 155,935,000.00 11.66 3 金融债券 19,810,000.00 1.48 其中,政策性金融债 19,810,000.00 1.44 4 企业股票金 - - 6 中期票据 - - 7 可转债 47,066,508.20 3.51 8 其他 - - 9 合計 430,019,475.10 32.00 7.6 期末接公允价值占基金资产净值比例大小排名的商五名债券投资押卸 企额单位、人民币万序 债券公允价值 占基金资产净值比例大小排名的商五名债券投资押卸 企额单位、人民币万序 1 010308 03国债份 537,430 52,926,106.40 占基金资产净值比例(金) 2 010110 21国债份 520,000 51,870,000.00 3.8% 3 010112 21国债份 520,000 51,870,000.00 3.8% 4 010203 02国债(3) 500,000 49,435,000.00 3.6%			7.5 期末	卡按债券品种分	类的债券投资组合		
1 国家債券 207,207,966,90 15.44 2 央行課報 155,935,000,00 11.66 3 全職債券 19,810,000,00 1.44 其中,政策性金融債 19,810,000,00 1.44 4 企业債券 19,810,000,00 1.44 5 企业股別融資券 - - 7 可转債 47,066,508,20 3.55 8 其地 - - 9 合計 430,019,475,10 32,00 7.6 期末核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时捆 金额单位、人民市万 序号 债券化码 债券名券 数量(条) 公允价值 占基金资产净值比例(金) 1 010308 03国债(8) 537,430 52,926,106,40 占基金资产净值比例(金) 2 010110 21国债例の 520,000 51,966,400,00 3.87 3 010112 21国债例の 520,000 51,870,000,00 3.87 4 010203 02国債(3) 500,000 49,435,000,00 3.66	phe pre	/de	de FT 41			la la	dit A. Marsha W. Girt I. Pel
2			 	公允		- 6	
3 金融债券							
其中,政策性金融值 19,810,000.00 4 企业债券 5 企业信券 6 中期原程 7 可转值 47,066,508.20 3,51 8 其他 9 合計 76 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的商五名债券投资押细 企额单位人,民间元 序号 债券代码 债券化码 数量(家) 2 010110 21回债例 520,000 51,966,400.00 3,85 3 010112 21回债例 520,000 51,870,000.00 3 010112 21回债例 520,000 51,870,000.00 4 010203 02回债(3) 50,000 49,435,000.00 3,66							11.64
4 企业債券 - 5 企业収開総資券 - 6 中期展据 - 7 可转債 47,066,508.20 8 其他 - 9 合計 430,019,475.10 1.6 期末核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时期 金额单位,人民币元 序号 债券化码 债券名券 1 010308 03国债(8) 537,430 52,926,106.40 占基金资产净值比例(5) 2 010110 21国债00 520,000 51,966,400.00 3.87 3 010112 21国债00 520,000 51,870,000.00 3.87 4 010203 02国债(3) 500,000 49,435,000.00 3.66	3				19,810,000.00		1.48
5 企业短期融資券 - <td< td=""><td></td><td>其中:政策性金</td><td>融债</td><td></td><td>19,810,000.00</td><td></td><td>1.48</td></td<>		其中:政策性金	融债		19,810,000.00		1.48
6 中期原据 - 7 可转隙 47,066,508.20 3.5! 8 其他 - - 9 合計 430,019,475.10 32.00 7.6 期末核公允价值占基金资产净值比例大小非名的前五名债券投资明细 金额单位、人民币万序号 债券代码 债券名條 数量(条) 公允价值 1 010308 03国债(8) 537,430 52,926,106.40 占基金资产净值比例(条) 2 010110 21国债(8) 520,000 51,966,400.00 3.8% 3 010112 21国债(8) 520,000 51,870,000.00 3.8% 4 010203 02国债(3) 500,000 49,435,000.00 3.66	4	企业债券			-		-
7 同時億 47,066,508.20 3.5: 8 其億 - - - 9 合計 430,019,475.10 32.00 76. 期末接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时捆 金额单位,人民币元 序号 债券名等 数量(条) 公允价值 占基金资产净值比例(%) 1 010308 03国债(8) 537,430 52,926,106.40 占基金资产净值比例(%) 2 010110 21国债(9) 520,000 51,966,400.00 3.8% 3 010112 21国债(3) 520,000 51,870,000.00 3.8% 4 010203 02国债(3) 500,000 49,435,000.00 3.6%	5	企业短期融资类	F		-		-
7 可转億 47,066,508.20 3.5i 8 其億 - - 9 合計 430,019,475.10 32,09 76 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押棚 金額单位、人民市元 序号 债券名際 数量(条) 公允价值 占基金资产净值比例(金) 1 010308 03国债務(8) 537,430 52,926,106.40 占基金资产净值比例(金) 2 010110 21国债份 520,000 51,966,400.00 3.8% 3 010112 21国债份 520,000 51,870,000.00 3.8% 4 010203 02国债(3) 500,000 49,435,000.00 3.6	6	中期票据			-		-
8 其他 430,019,475,10 32.08 9 合计 430,019,475,10 32.08 7.6 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押捆 金额单位;人民币元序序号 债券名除 数量(条) 公允价值 1 010308 03国债(8) 537,430 52,926,10640 3.95 2 010110 21国债(0) 520,000 51,906,400,00 3.8% 3 010112 21国债(2) 520,000 51,870,000,00 3.8% 4 010203 02国债(3) 500,000 49,435,000,00 3.66	7	可转债			47,066,508.20		3.51
9 合计 430.019.475.10 32.00 7.6 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 债券名幣 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(条) 1 010308 03国债(8) 537,430 52,926,106.40 3.95 2 01010 21国债(9) 520,000 51,906,400.00 3.87 3 010112 21国债(2) 520,000 51,870,000.00 3.87 4 010203 02国债(3) 500,000 49,435,000.00 3.66	8	其他					_
7.6 期末接公允价值占基金資产净值比例大小排名的前五名债券投資明細 金額単位、人民币万 序号 企額単位、人民币万 房等 企業単位、人民币万 日 (日本金質产浄量比例(金) 1 010308 03国債(8) 537,430 52,926,1064-0 3.95 2 010110 21国債(3) 520,000 51,906,40-00 3.87 3 010112 21国債(3) 520,000 51,870,000.00 3.87 4 010203 02国債(3) 500,000 49,435,000.00 3.66					430,019,475 10		32.09
			基金资产净值比例大小	非名的前五名使			
1 010308 03国債傷 537,430 52,926,106.40 3.95 2 010110 21国債億 520,000 51,906,400.00 3.87 3 010112 21国債億 520,000 51,870,000.00 3.87 4 010203 02国債億 500,000 49,435,000.00 3.66							金额单位:人民币元
2 010110 21国債億0 520,000 51,906,400.00 3.8° 3 010112 21国債億2 520,000 51,870,000.00 3.8° 4 010203 02国債億3 500,000 49,435,000.00 3.66	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(%)
3 010112 21區積億2 520,000 51,870,000.00 3.87 4 010203 02區積(3) 500,000 49,435,000.00 3.66	1	010308	03国债(8)	537,430	52,926,	106.40	3.95
4 010203 02国债(3) 500,000 49,435,000.00 3.69	2	010110	21国债(10)	520,000	51,906,	400.00	3.87
	3	010112	21国债(12)	520,000	51,870,	00.00	3.87
	4	010203	02国债(3)	500,000	49,435,	00.00	3.69
	5	113001	中行转债	445,790	47,066.	508.20	3.51

17	600875	东方电气		36,200,235.10	1.99	
18	600048	保利地产		35,776,188.46	1.96	
19	002017	东信和平		35,551,309.58	1.95	
20	601601	中国太保		35,394,138.17	1.94	
		7.4.3 买入	股票的成本总额及3 单位:人民币5	定出股票的收入总额 c		
买人股易	原成本(成交)总额				1,877,406,300.	
卖出股票	厚收人(成交)总额				2,115,486,715.50	
		7.5 期	床按债券品种分类的 金额单位:人民产	的债券投资组合 5元		
序号	债多	学品种	公允价	值	占基金资产净值比例(%)	
1	国家债券			207, 207, 966.90	15.46	
2	央行票据		155,935,000.00			
3	金融债券			19,810,000.00	1.48	
	其中:政策性金融	独债		19,810,000.00	1.48	
4	企业债券			-	-	
5	企业短期融资券	:		-	-	
6	中期票据		-			
7	可转债			47,066,508.20	3.51	
8	其他			-	-	
9	合计			430,019,475.10	32.09	
7.6 期	末按公允价值占基	1.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	010308	03国债(8)	537,430	52,926,106.4	0 3.95	
2	010110	21国债(00)	520,000	51,906,400.0	0 3.87	
3	010112	21国债(12)	520,000	51,870,000.0	0 3.87	
	1					

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	010308	03国债(8)	537,430	52,926,106.40	3.9
2	010110	21国债(10)	520,000	51,906,400.00	3.8
3	010112	21国债(12)	520,000	51,870,000.00	3.8
4	010203	02国债(3)	500,000	49,435,000.00	3.6
5	113001	中行转债	445,790	47,066,508.20	3.5
注:本法 7.8 期 注:本法	未按公允价值占基金 基金本报告期末未持 未按公允价值占基金 基金本报告期末未持 资组合报告附注	有资产支持证券 资产净值比例大		资产支持证券投资明细 又证投资明细	

		単位:人民巾兀
序号	名称	金額
1	存出保证金	1,801,150.40
2	应收证券清算款	42,785,122.74
3	应收股利	-
4	应收利息	5,670,249.81
5	应收申购款	1,090,061.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,346,584.22

		持有	· 份額	占总份	额比例	持有	与份额	占	总份额比例
70,046	20,	503.26 36	3,202,089.26		25.29%	1,072	,969,226.76	74.7	71%
8.2 期末基金管	管理人的 从业	人员持有本开放式	甚金的情况						
	项目		持有依	}額总数	(份)		占基金总统	- 翻日	七例
基金管理公司所	有从业人员打	持有本开放式基金			61,411.97				0.0043
		§	9 开放式基金	份額变	动				a4 /).
* * * * * * * * * * * * * * * * * * * *		er vale A // der M der							单位:
		1日)基金份額总額							,651,618.
本报告期期初基							1	_	,969 ,339.
本报告期基金总									,979 ,368.
减:本报告期基金								399	,777,391.:
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	,436	,171,316.
# A // her	4+ L. L. A		§ 10 重大事	件揭示					
10.1 基金份额 报告期内无基金									
			minutani I. I. i	r-hL					
		人的专门基金托管部 发生以下重大人事事		1受到					
1、2011年1月 【2011】116号),引	基金托管人 21日,中国 全世中国农	发生如下重大变动; 证监会核准中国农业 业银行股份有限公司	们托管业务部总		健基金行业	上高级管	理人员任职	资格	(证监许
		财产、基金托管业务							
		基金财产、基金托管	业务的诉讼。						
10.4 基金投资 报告期内基金投		is .							
		+师事务所情况							
报告期内基金未									
		级管理人员受稽查	 於						
		人及其高级管理人员		音或处	罚的情况.				
		单元的有关情况							
10.7.1 基金租	用证券公司交	医易单元进行股票投	资及佣金支付	青况					
							金?	狐单	位:人民币
	交易单元	股票	交易		应支付	寸该券面	每的佣金		
券商名称	父め甲元 数量	成交金额	占当期股票 成交总额的b		佣金		占当期佣金 总量的比例		备注
光大证券	1	1,237,206,693.94	31	.01%	1,051,6	19.55	31.6	1%	-
申银万国	1	745,129,461.32	18	.68%	633,3	57.68	19.0	14%	_
	ı								

银河证券	1	58,230,217.21	1.46%	49,495.84	1.49%	-				
注:1、选择证券	公司专用席	位的标准:				<u> </u>				
(1)实力雄厚;										
2)信誉良好,	经营行为规范	Ξ;								
(3)具有健全的	 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; 									
(4)具备基金2	(4) 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;										
6)研究实力型	1,有固定的研	f究机构和专职的高	素质研究人员,能及	时提供高质量的研究	で支持和咨询服务	,包括宏观经				
报告、行业分析报告	5、市场分析报	2告、证券分析报告36	支其他报告等,并能相	限据基金投资的特定	要求,提供专题研究	究报告;				
6)本基金管理	1人要求的其	他条件。								
2、选择证券公	司专用席位的	程序:								
(1)资格考察;										
2)初步确定:										
6)签订协议。										
10.7.2 基金和	用证券公司公	・易单元进行其他证	券投资的情况							
10.7.2	111111111111111111111111111111111111111	500 1 20x2132410m	JA JACOCHO INCL							

11.38%

368,772.2

258,775.4

250,446.78

211,065.98

11.089

7.53%

457,409,034.80 453,869,228.0

318,489,158.44

308,237,282.73

248,315,251.28

162,429,438.54

国泰君安

					金額	単位:人民市π	
	债券	交易	债券回则	均交易	权证交易		
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比 例	
光大证券	14,925,000.00	100.00%	1,235,700,000.00	70.74%	-	-	
申银万国	-	-	365,000,000.00	20.90%	-	-	
安信证券	-	-	-	-	-	-	
中银投资证券	-	-	-	-	-	-	
华宝证券	-	-	-	-	-	-	
国泰君安	-	-	-	-	-	-	
中银国际	-	-	126,000,000.00	7.21%	-	-	
招商证券	-	-	-	-	-	-	
银河证券	_	-	20,000,000.00	1.15%	-	-	