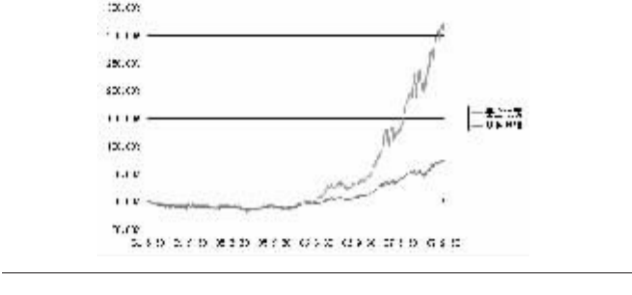


第一节 重要提示
本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10月10日复核了本报告中财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金净值不下降或其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本季度报告中财务资料未经审计。

第二节 基金产品概况
基金名称：银河银泰理财分红证券投资基金
基金简称：银泰理财分红基金
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2004年3月30日
招募说明书全文披露日期：4,636,363,433,88
投资目标：追求基金资产的增值和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略：
1.资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2.股票投资策略
本基金在投资风险管理控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经过严格论证认为具有可持续发展能力的优质股票和成长性股票,同时兼顾股票投资的流动性要求。
3.债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
通过久期调整,上调久期指数+40%+中债国债指数+5%+金融同业存款利率+5%。
风险控制：本基金属于风险较高的投资品种,风险-收益水平高于债券基金与股票基金之间基金管理人名称：银河基金管理有限公司
基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司
基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）
第二节 主要财务指标和基金净值表现
一、本报告期主要会计数据和财务指标
1.本期期间： 1-4,466,366,361.18元
2.本报告期间基金份额净值变动后的净值： 269,504,022.63元
3.本报告期间基金份额净值变动： 0.2494元/份
4.期末基金份额净值： 5,303.93,218.02元
5.期末基金份额净值增长率： 1,114.42元/份
6.本报告期间基金份额净值增长率与同期业绩比较基准的对比
基金名称：银河银泰理财分红证券投资基金
基金简称：银泰理财分红基金
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2004年3月30日
招募说明书全文披露日期：4,466,366,361.18元
投资目标：追求基金资产的增值和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略：
1.资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2.股票投资策略
本基金在投资风险管理控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经过严格论证认为具有可持续发展能力的优质股票和成长性股票,同时兼顾股票投资的流动性要求。
3.债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
通过久期调整,上调久期指数+40%+中债国债指数+5%+金融同业存款利率+5%。
风险控制：本基金属于风险较高的投资品种,风险-收益水平高于债券基金与股票基金之间
基金管理人名称：银河基金管理有限公司
基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司
基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）
第二节 主要财务指标和基金净值表现
一、本报告期主要会计数据和财务指标
1.本期期间： 1-4,466,366,361.18元
2.本报告期间基金份额净值变动后的净值： 269,504,022.63元
3.本报告期间基金份额净值变动： 0.2494元/份
4.期末基金份额净值： 5,303.93,218.02元
5.期末基金份额净值增长率： 1,114.42元/份
6.本报告期间基金份额净值增长率与同期业绩比较基准的对比
基金名称：银河银泰理财分红证券投资基金
基金简称：银泰理财分红基金
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2004年3月30日
招募说明书全文披露日期：4,466,366,361.18元
投资目标：追求基金资产的增值和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略：
1.资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2.股票投资策略
本基金在投资风险管理控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经过严格论证认为具有可持续发展能力的优质股票和成长性股票,同时兼顾股票投资的流动性要求。
3.债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
通过久期调整,上调久期指数+40%+中债国债指数+5%+金融同业存款利率+5%。
风险控制：本基金属于风险较高的投资品种,风险-收益水平高于债券基金与股票基金之间

| 阶段 | 净值增长率 | | 业绩比较基准增长率 | 业绩比较基准收益率 | 对比1 | 对比2 |
|-----------|-------|------|-----------|-----------|-------|------|
| | 1 | 2 | | | | |
| 2007年第三季度 | 36.20 | 1.56 | 16.56 | 0.79 | 196.5 | 0.77 |



第一节 重要提示
本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10月23日复核了本报告中财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金净值不下降或其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本季度报告中财务资料未经审计。

第二节 基金产品概况
基金名称：银河银信添利债券型证券投资基金
基金简称：银信添利基金
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2007年3月14日
招募说明书全文披露日期：4,443,437,759.94份
投资目标：满足本基金稳健与良好流动性的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略：
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2. 债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
3. 资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2. 债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
3. 资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。

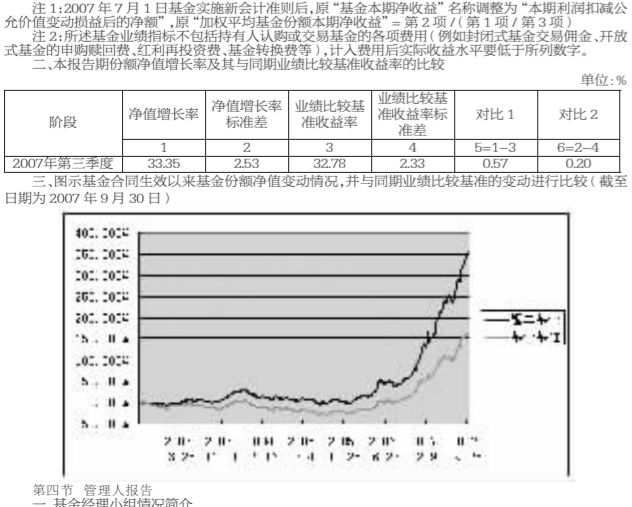
二、基金净值表现
1. 本基金银河银信添利基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比表：
阶段 净值增长率 业绩比较基准增长率 对比1 对比2
2007年第三季度 70.04% 0.18% 0.61% 0.06% 6.43% 0.12%

三、资产配置策略
本基金根据对宏观经济、企业债券等品种与同期国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期,主动地增加或减少债券类资产的配置,降低或提高可转债资产在债券类资产中的配置比例,获取不同债券品种之间利率变化所带来的投资收益。
2. 债券品种选择
在以上债券资产中,中期和长期债券品种的流动性好,本金安全,属低风险、收益稳定的品种,适合作为投资组合中的核心资产,并作为基金资产的主要构成部分。
3. 动态调整策略
在以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的动态变化,采取多种灵活的策略,获取超额收益。
4. 债券投资策略
本基金根据对宏观经济、企业债券等品种与同期国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期,主动地增加或减少债券类资产的配置,降低或提高可转债资产在债券类资产中的配置比例,获取不同债券品种之间利率变化所带来的投资收益。

第一节 重要提示
本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10月15日复核了本报告中财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金净值不下降或其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本季度报告中财务资料未经审计。

第二节 基金产品概况
基金名称：银河证券投资基金
基金简称：银河基金
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2002年9月15日
招募说明书全文披露日期：202,012,915.55份
投资目标：本基金为平衡型基金,力求为基金份额持有人创造长期稳定的投资回报,在正常的市场环境下,股票投资资产的比例不低于基金资产的70%。
投资策略：
1.资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2. 股票投资策略
本基金在投资风险管理控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经过严格论证认为具有可持续发展能力的优质股票和成长性股票,同时兼顾股票投资的流动性要求。
3. 债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
通过久期调整,上调久期指数+40%+中债国债指数+5%+金融同业存款利率+5%。
风险控制：本基金属于风险较高的投资品种,风险-收益水平高于债券基金与股票基金之间
基金管理人名称：银河基金管理有限公司
基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）
第二节 主要财务指标和基金净值表现
一、本报告期主要会计数据和财务指标
1.本期期间： 2,068,011,062.04元
2.本报告期间基金份额净值变动后的净值： 1,996,500.00元
3.本报告期间基金份额净值变动： 0.6893元
4.期末基金份额净值： 7,294,521,813.96元
5.期末基金份额净值增长率： 1,114.42元/份
6.本报告期间基金份额净值增长率与同期业绩比较基准的对比
基金名称：银河证券投资基金
基金简称：银河基金
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2002年9月15日
招募说明书全文披露日期：202,012,915.55份
投资目标：本基金为平衡型基金,力求为基金份额持有人创造长期稳定的投资回报,在正常的市场环境下,股票投资资产的比例不低于基金资产的70%。
投资策略：
1.资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2. 股票投资策略
本基金在投资风险管理控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经过严格论证认为具有可持续发展能力的优质股票和成长性股票,同时兼顾股票投资的流动性要求。
3. 债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
通过久期调整,上调久期指数+40%+中债国债指数+5%+金融同业存款利率+5%。
风险控制：本基金属于风险较高的投资品种,风险-收益水平高于债券基金与股票基金之间

| 阶段 | 净值增长率 | | 业绩比较基准增长率 | 业绩比较基准收益率 | 对比1 | 对比2 |
|-----------|-------|------|-----------|-----------|------|------|
| | 1 | 2 | | | | |
| 2007年第三季度 | 33.35 | 2.53 | 32.78 | 2.33 | 0.57 | 0.20 |



第一节 重要提示
本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10月15日复核了本报告中财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金净值不下降或其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本季度报告中财务资料未经审计。

第二节 基金产品概况
基金名称：银河证券投资基金
基金简称：银河基金
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2002年9月15日
招募说明书全文披露日期：202,012,915.55份
投资目标：本基金为平衡型基金,力求为基金份额持有人创造长期稳定的投资回报,在正常的市场环境下,股票投资资产的比例不低于基金资产的70%。
投资策略：
1.资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2. 股票投资策略
本基金在投资风险管理控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经过严格论证认为具有可持续发展能力的优质股票和成长性股票,同时兼顾股票投资的流动性要求。
3. 债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
通过久期调整,上调久期指数+40%+中债国债指数+5%+金融同业存款利率+5%。
风险控制：本基金属于风险较高的投资品种,风险-收益水平高于债券基金与股票基金之间

银河银泰理财分红证券投资基金 2007年第三季度报告

二、行业分类类的股票投资组合
序号 行业 市值(元) 占净值比例(%)
1 A、农、林、牧、渔业 70,622,227.20 1.33
2 B、采矿业 274,502,663.94 5.18
3 C制造业 1,170,060,099.38 22.06
4 C01 食品、饮料 313,189,063.64 5.83
5 C2 纺织服装、皮毛 429,826.40 0.01
6 C3 造纸、印刷 81,702,429.60 1.54
7 C4 石油、化学、塑胶、塑料 150,126,983.93 2.83
8 C5 电子、电器、通讯 589,042.92 0.01
9 C6 金属、非金属 212,854,803.70 4.01
10 C7 机械、设备、仪表 317,180,061.68 5.98
11 C8 医药、生物制品 38,024,176.00 0.72
12 C9 其他制造业 96,383,820.25 1.86
13 D电力、煤气及水的生产和供应业 77,280,000.00 1.46
14 E 建筑业 300,322.20 0.01
15 F 交通运输、仓储业 608,376,096.63 11.52
16 G 信息技术业 53,079,587.25 1.02
17 H 批发和零售贸易 377,351,120.20 7.19
18 I 金融、保险业 480,063,400.93 9.06
19 J房地产业 336,677,330.34 6.33
20 K 社会服务业 92,804,084.28 1.76
21 L 传播与文化业 47,380,320.27 0.90
22 M 综合类 108,289,276.60 2.06
合计： 3,587,206,518.12 67.83

二、资产配置策略
本基金在投资风险管理控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经过严格论证认为具有可持续发展能力的优质股票和成长性股票,同时兼顾股票投资的流动性要求。
3. 债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
通过久期调整,上调久期指数+40%+中债国债指数+5%+金融同业存款利率+5%。
风险控制：本基金属于风险较高的投资品种,风险-收益水平高于债券基金与股票基金之间
基金管理人名称：银河基金管理有限公司
基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）
第二节 主要财务指标和基金净值表现
一、本报告期主要会计数据和财务指标
1.本期期间： 1-4,466,366,361.18元
2.本报告期间基金份额净值变动后的净值： 269,504,022.63元
3.本报告期间基金份额净值变动： 0.2494元/份
4.期末基金份额净值： 5,303.93,218.02元
5.期末基金份额净值增长率： 1,114.42元/份
6.本报告期间基金份额净值增长率与同期业绩比较基准的对比
基金名称：银河银泰理财分红证券投资基金
基金简称：银泰理财分红基金
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2004年3月30日
招募说明书全文披露日期：4,466,366,361.18元
投资目标：追求基金资产的增值和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略：
1.资产配置策略
本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产的仓位比例,确定基金资产的行业资产的投资比例。
2. 股票投资策略
本基金在投资风险管理控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经过严格论证认为具有可持续发展能力的优质股票和成长性股票,同时兼顾股票投资的流动性要求。
3. 债券投资策略
根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合研判,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的投资回报。
通过久期调整,上调久期指数+40%+中债国债指数+5%+金融同业存款利率+5%。
风险控制：本基金属于风险较高的投资品种,风险-收益水平高于债券基金与股票基金之间

| 二、行业分类类的股票投资组合 | | 三、基金投资组合前十名股票明细 | | | |
|----------------|--------|-----------------|------------|----------------|----------|
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 | 市值(元) | 占净值比例(%) |
| 1 | 601006 | 大秦铁路 | 6,884,005 | 175,335,607.35 | 3.31 |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 8,601,415 | 161,016,800.10 | 3.04 |
| 3 | 000889 | 五矿有色 | 3,712,636 | 157,601,398.20 | 2.97 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 1,043,428 | 140,810,608.60 | 2.66 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 3,033,399 | 116,108,945.53 | 2.19 |
| 6 | 601333 | 广核核电 | 11,199,466 | 111,210,697.38 | 2.10 |
| 7 | 600195 | 中钢股份 | 3,721,266 | 109,963,410.20 | 2.07 |
| 8 | 600895 | 郑煤高新 | 4,826,132 | 108,829,276.60 | 2.06 |
| 9 | 000157 | 中联重工 | 2,471,968 | 107,921,625.90 | 2.03 |
| 10 | 600016 | 民生银行 | 6,799,062 | 107,493,012.12 | 2.03 |
| 总计 | | | 52,193,204 | 1,296,291,282 | 24.44 |

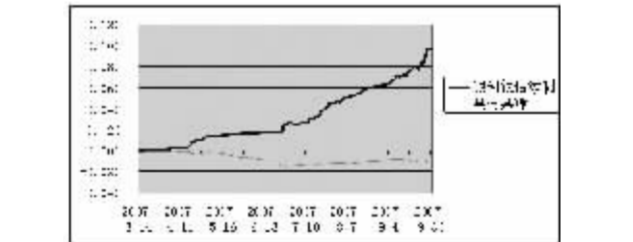
四、按券种分类的债券投资组合
债券市值(元) 占基金净值比例(%)
国债 104,707,398.60 1.97
央行票据 1,074,158,000.00 20.25
金融债 139,070,000.00 2.63
企业债 0.00 0.00
可转债 15,478,910.12 0.29
合计 1,334,014,278.72 25.15

银河银信添利债券型证券投资基金 2007年第三季度报告

二、基金净值表现
1. 本基金银河银信添利基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比表：
阶段 净值增长率 业绩比较基准增长率 对比1 对比2
2007年第三季度 70.04% 0.18% 0.61% 0.06% 6.43% 0.12%

三、资产配置策略
本基金根据对宏观经济、企业债券等品种与同期国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期,主动地增加或减少债券类资产的配置,降低或提高可转债资产在债券类资产中的配置比例,获取不同债券品种之间利率变化所带来的投资收益。
2. 债券品种选择
在以上债券资产中,中期和长期债券品种的流动性好,本金安全,属低风险、收益稳定的品种,适合作为投资组合中的核心资产,并作为基金资产的主要构成部分。
3. 动态调整策略
在以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的动态变化,采取多种灵活的策略,获取超额收益。
4. 债券投资策略
本基金根据对宏观经济、企业债券等品种与同期国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期,主动地增加或减少债券类资产的配置,降低或提高可转债资产在债券类资产中的配置比例,获取不同债券品种之间利率变化所带来的投资收益。

二、基金净值表现
1. 本基金银河银信添利基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比表：
阶段 净值增长率 业绩比较基准增长率 对比1 对比2
2007年第三季度 70.04% 0.18% 0.61% 0.06% 6.43% 0.12%



二、基金净值表现
1. 本基金银河银信添利基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比表：
阶段 净值增长率 业绩比较基准增长率 对比1 对比2
2007年第三季度 70.04% 0.18% 0.61% 0.06% 6.43% 0.12%

银丰证券投资基金 2007年第三季度报告

| 二、行业分类类的股票投资组合 | | 三、基金投资组合前十名股票明细 | | | |
|----------------|-----------------|-----------------|----|----------------|----------|
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 | 市值(元) | 占净值比例(%) |
| 1 | A、农、林、牧、渔业 | | | 0.00 | 0.00% |
| 2 | B、采矿业 | | | 63,781,500.06 | 1.70% |
| 3 | C制造业 | | | 23,198,620.79 | 0.62% |
| 4 | C01 食品、饮料 | | | 1,490,410.07 | 0.04% |
| 5 | C2 纺织服装、皮毛 | | | 1,193,843.28 | 0.03% |
| 6 | C3 造纸、印刷 | | | 0.00 | 0.00% |
| 7 | C4 石油、化学、塑胶、塑料 | | | 5,222,506.12 | 0.14% |
| 8 | C5 电子、电器、通讯 | | | 2,619,574.08 | 0.07% |
| 9 | C6 金属、非金属 | | | 6,014,546.91 | 0.13% |
| 10 | C7 机械、设备、仪表 | | | 7,402,341.73 | 0.20% |
| 11 | C8 医药、生物制品 | | | 254,380.60 | 0.01% |
| 12 | C9 其他制造业 | | | 0.00 | 0.00% |
| 13 | D电力、煤气及水的生产和供应业 | | | 408,427.11 | 0.01% |
| 14 | E 建筑业 | | | 1,029,968.38 | 2.70% |
| 15 | F 交通运输、仓储业 | | | 265,170.43 | 0.07% |
| 16 | G 信息技术业 | | | 0.00 | 0.00% |
| 17 | H 批发和零售贸易 | | | 158,895,687.20 | 4.16% |
| 18 | I 金融、保险业 | | | 1,831,900.00 | 0.05% |
| 19 | J房地产业 | | | 3,267,042.36 | 0.08% |
| 20 | K 社会服务业 | | | 0.00 | 0.00% |
| 21 | L 传播与文化业 | | | 0.00 | 0.00% |
| 22 | M 综合类 | | | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | | | | 351,368,216.29 | 94.00% |

| 二、资产配置策略 | | 三、基金投资组合前十名股票明细 | | | |
|----------|--------|-----------------|------------|------------------|------------|
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 | 市值(元) | 占基金净值比例(%) |
| 1 | 601318 | 中国平安 | 2,917,956 | 389,629,028.56 | 5.21 |
| 2 | 000700 | 大冶特钢 | 17,976,174 | 359,569,022.08 | 4.66 |
| 3 | 601699 | 招商环保 | 3,527,606 | 317,544,540.00 | 4.25 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 8,067,760 | 307,447,015.20 | 4.03 |
| 5 | 000117 | 西药特钢 | 14,468,874 | 289,454,538.30 | 3.96 |
| 6 | 600616 | 华冠转债 | 1,466,874 | 241,696,617.76 | 3.21 |
| 7 | 601020 | 中人钢 | 7,297,873 | 235,778,607.89 | 3.22 |
| 8 | 600639 | 浦钛高新 | 10,321,309 | 215,496,970.57 | 3.17 |
| 9 | 600015 | 华夏银行 | 11,414,057 | 225,894,188.03 | 3.10 |
| 10 | 600600 | 福耀玻璃 | 5,028,302 | 199,786,810.40 | 2.74 |
| 总计 | | | 85,579,580 | 2,769,891,299.25 | 37.98 |

四、按券种分类的债券投资组合
债券市值(元) 占基金净值比例(%)
国债 243,308,877.30 3.34
金融债 441,060,200.00 6.06
央行票据 1,097,661,200.00 15.06
企业债 0.00 0.00
可转债 79,657,120.00 1.09
合计 1,861,677,197.30 25.52

| 五、基金投资前五名债券明细 | | | |
|---------------|---------|----------------|----------|
| 序号 | 债券名称 | 市值(元) | 市值占净值(%) |
| 1 | 07央票06 | 165,291,000.00 | 3.12 |
| 2 | 07央票22 | 165,070,000.00 | 3.11 |
| 3 | 06央行票08 | 145,920,000.00 | 2.75 |
| 4 | 07央票04 | 145,860,000.00 | 2.75 |
| 5 | 04国债17 | 99,700,000.00 | 1.88 |
| 合计 | | 721,841,000.00 | 13.61 |

六、投资组合
(一) 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
(二) 报告期末本基金投资的前十名股票中,没有在本基金合同规定备选股票库之外的股票。
(三) 其他资产构成

| 名称 | | 金额(元) |
|---------|--|----------------|
| 交易所保证金 | | 1,848,780.49 |
| 应收证券清算款 | | 182,751,532.15 |
| 应收利息 | | 17,142,134.09 |
| 应收股利 | | 0 |
| 应收申购款 | | 87,132,546.23 |
| 总计 | | 288,774,993.96 |

(四) 本期末无处于转股期的可转换债券。
(五) 本基金本报告期末持有权证情况

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量(份) | 成本总额(元) |
|----|------|------|-------|---------|
| 1 | --- | --- | --- | --- |
| 合计 | | | | |

主动投资

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 市值(元) | 占基金净值比例(%) |
|----|--------|--------|-----------|----------------|------------|
| 1 | 000002 | 万科A | 1,694,000 | 56,751,817.70 | 0.75 |
| 2 | 031001 | 侨城HOC1 | 1,229,378 | 61,632,524.68 | 0.82 |
| 合计 | | | | 118,384,342.38 | 1.57 |

六、基金投资组合
(一) 报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
(二) 报告期末本基金投资的前十名股票中,没有在本基金合同规定备选股票库之外的股票。
(三) 其他资产构成

| 名称 | | 金额(元) |
|---------|--|---------------|
| 交易所保证金 | | 250,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 3,987,230.01 |
| 应收利息 | | 43,284,028.66 |
| 应收股利 | | 4,271,781.29 |
| 其他应收款 | | 204.25 |
| 总计 | | 51,933,244.21 |

(四) 本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(五) 本基金本报告期末未持有权证。
(六) 本基金本报告期末未持有资产支持证券。
第六节 开放式基金业务变动

| 项目 | | 份额(份) |
|----------|--|-------|
| 期初基金份额</ | | |