

银河稳健证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称中国农业银行)根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 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.....	38
7.9 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	40
§9 开放式基金份额变动	40

§10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	42
§11 备查文件目录	45
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河稳健证券投资基金
基金简称	银河稳健混合
基金主代码	151001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 8 月 4 日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,436,171,316.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以稳健的投资风格，构造资本增值与收益水平适度匹配的投资组合，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值
投资策略	采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，动态配置资产，精选个股进行投资。在正常情况下本基金的资产配置比例变化范围是：股票投资的比例范围为基金资产净值的 35% 至 75%；债券投资的比例范围为基金资产净值的 20% 至 45%；现金的比例范围为基金资产净值的 5% 至 20%。
业绩比较基准	上证 A 股指数涨跌幅 × 75% + 中信国债指数涨跌幅 × 25%
风险收益特征	银河稳健基金属证券投资基金中风险中度品种（在股票型基金中属风险中度偏低），力争使长期的平均单位风险收益超越业绩比较基准。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李昇	李芳菲
	联系电话	021-38568888	010-66060069
	电子邮箱	lisheng@galaxyasset.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-820-0860	95599
传真		021-38568501	010-63201816
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	200122	100031
法定代表人	徐旭	项俊波

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金半年度报告备置地点	1、上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼 2、北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	银河基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年1月1日 - 2011年6月30日)
本期已实现收益	-39,537,853.90
本期利润	-181,453,322.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1159
本期加权平均净值利润率	-11.76%
本期基金份额净值增长率	-10.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	295,894,109.52
期末可供分配基金份额利润	0.2060
期末基金资产净值	1,340,134,203.17
期末基金份额净值	0.9331
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	356.50%

注：1、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

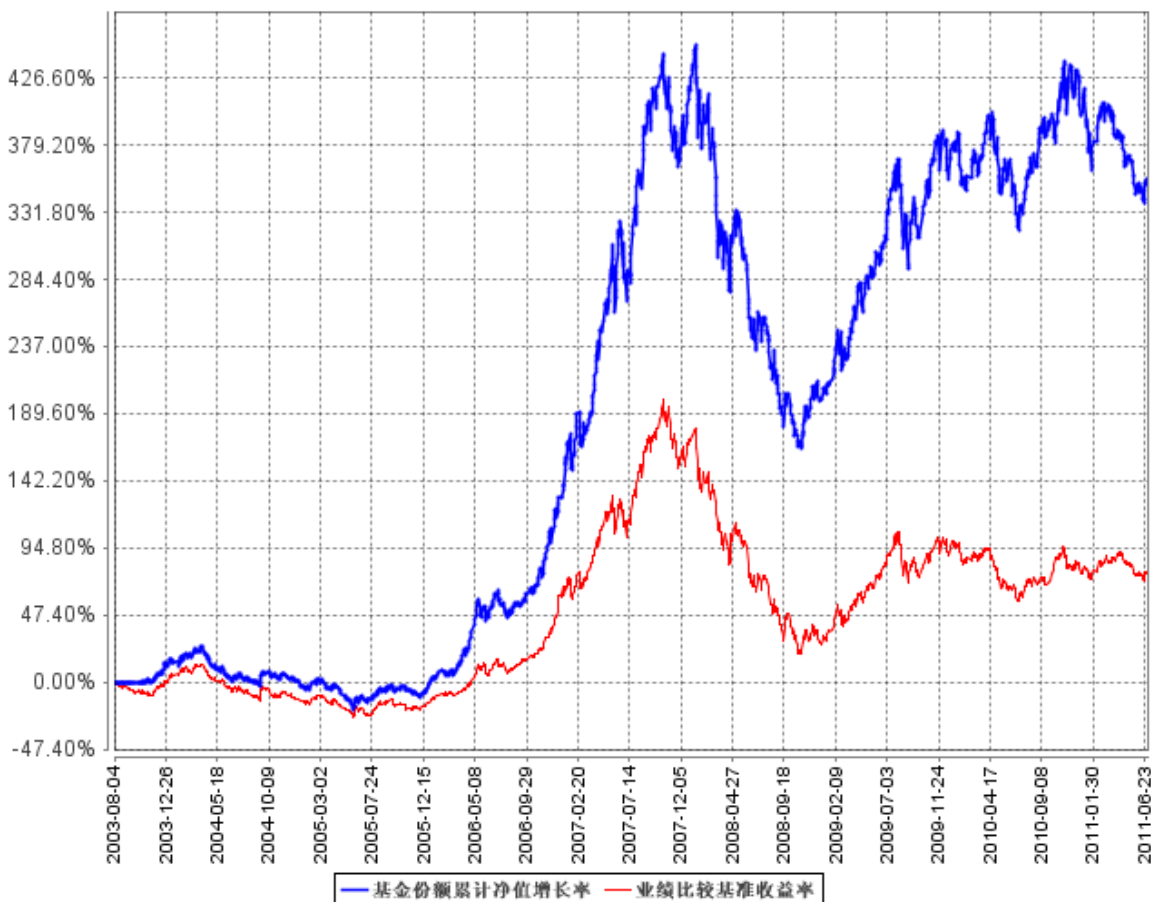
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.81%	0.75%	0.49%	0.79%	1.32%	-0.04%
过去三个月	-5.70%	0.72%	-4.08%	0.75%	-1.62%	-0.03%
过去六个月	-10.94%	0.92%	-0.70%	0.81%	-10.24%	0.11%
过去一年	5.96%	1.08%	11.92%	0.92%	-5.96%	0.16%
过去三年	34.17%	1.29%	6.15%	1.39%	28.02%	-0.10%
自基金合同生效起至今	356.50%	1.37%	78.03%	1.35%	278.47%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司设立于 2002 年 6 月 14 日，公司的股东分别为中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团公司、首都机场集团公司、上海市城市建设投资开发总公司、湖南电广传媒股份有限公司。

目前，除本基金外，银河基金管理有限公司另管理 1 只封闭式基金与 9 只开放式证券投资基金，基本情况如下：

1、银丰证券投资基金

类型：契约型封闭式

成立日：2002 年 8 月 15 日

投资目标：为平衡型基金，力求有机融合稳健型和进取型两种投资风格，在控制风险的前提下追求基金资产的长期稳定增值。

2、银河银泰理财分红证券投资基金

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

基金投资目标：追求资产的安全性和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报

3、银河银富货币市场基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 12 月 20 日

基金投资目标：在确保基金资产安全和高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的回报

4、银河银信添利债券型证券投资基金

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

基金投资目标：在满足本金稳妥与良好流动性的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

5、银河竞争优势成长股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2008 年 5 月 26 日

基金投资目标：在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中

长期资本增值。

6、银河行业优选股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009 年 4 月 24 日

基金投资目标：本基金将“自上而下”的资产配置以及动态行业配置策略与“自下而上”的个股优选策略相结合，优选景气行业或预期景气行业中的优势企业进行投资，在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中长期资本增值。

7、银河沪深 300 价值指数证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009 年 12 月 28 日

基金投资目标：通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段，追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。

8、银河蓝筹精选股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010 年 7 月 16 日

基金投资目标：本基金投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司，在有效控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果。

9、银河创新成长股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010 年 12 月 29 日

基金投资目标：本基金投资于具有良好成长性的创新类上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

10、银河保本混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011 年 5 月 31 日

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略，并引入保证人，在保证本金安全的基础上，通过保本资产与风险资产的动态配置和组合管理，谋求基金资产在保本周期内的稳定增值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱睿南	银河稳健证券投资基金的基金经理、银河创新成长股票型证券投资基金的基金经理、股票投资部总监	2008年2月27日	-	10	硕士研究生学历，曾先后在中国华融信托投资公司、中国银河证券有限责任公司工作。2002年6月加入银河基金管理有限公司，历任交易主管、银河银泰理财分红证券投资基金基金经理助理等职务，2009年8月起兼任股票投资部总监，2010年12月29日起兼任银河创新成长股票型证券投资基金的基金经理。

注：1、上表中任职日期为我公司做出决定之日；

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项管理办法、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚实信用、勤奋律己、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金持有人的利益，无损害基金持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤奋律己、创新图强”的理念，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定，进一步加强风险管理和完善内部控制体系，为基金持有人谋求长期稳定的回报。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

银河稳健证券投资基金（以下简称“银河稳健混合”）在本报告期内严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，公平对待所管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

与银河稳健混合投资风格相似的投资组合为银河银泰理财分红证券投资基金（以下简称“银河银泰混合”）、银丰证券投资基金（以下简称“银河银丰封闭”）。本报告期内银河稳健混合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较如下：

阶段	基金	净值增长率
2011 年上半年	银河银泰混合	-10.40%
	银河稳健混合	-10.94%
	银河银丰封闭	-14.37%

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期未发现本基金有可能导致不公平交易的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年，A 股先抑后扬，市场分化严重，低估值的权重板块表现抗跌，但高估的中小市值股票跌幅巨大。

本基金在年初展望中认为 A 股市场在 2011 年出现系统性牛市的概率不大，震荡仍是主基调，大的投资机会可能还是来自于下跌出来的空间。基于上述判断，上半年本基金在资产配置层面总体保持了较为中性的股票仓位，债券配置比例有所提高。行业配置层面，前期基于对投资增速较高的判断增加了周期品的配置，后期则加大了食品、医药、纺织服装等消费行业的配置比重，对银行和房地产配置比例始终很低。在组合风格方面，创业板配置比例偏重，大盘蓝筹股比例总体偏低，导致基金业绩与基准偏离较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上半年本基金净值增长率-10.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们倾向于认为下半年国内经济能够保持较为稳定的状态，保障房以及水利建设的加速能够缓解经济增速下滑的担忧，尽管通胀可能仍有反复，但投资者的担心会逐步缓解，这些对于市场都是正面因素。但同时我们也要警惕价格指数下行对于企业盈利的冲击是否会超预期。我们不认为货币政策会有明显的放松空间，政策的微调更多会表现在财政政策方面，因此市场投资机会更多的仍会围绕受益于财政政策、能够出现业绩提升的行业和公司。

供求关系是影响市场的另一重要因素，目前看不到新股停发或者融资放缓节奏的迹象，比价效应总体对二级市场产生压制作用，大小非减持的迹象也没有缓解，这对于市场产生了持续的压力。债券市场的加速扩容也值得关注，如果收益率上行，会进一步增加股市的机会成本。

综合来看，我们判断市场存在反弹的机会，但受制于基本面和股市政策，我们不认为会出现大力度的反弹，区间震荡仍然是市场最可能的运行态势。部分消费品行业存在获取超额收益的机会，但多数周期性行业仍然难以出现趋势性机会。伴随着中小市值股票估值风险的释放以及数量的快速增加，我们坚信其中存在挖掘成长股的良好投资机会，这也是本基金下半年的重点工作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，基金会计部按照管理层批准后的估值政策进行估值。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人以截至 2010 年 12 月 31 日的可分配收益为准，于 2011 年 1 月 17 向基金份额持有人实施了利润分配，发放总额为 32,528,582.48 元。

根据《证券投资基金法》有关规定及本基金《基金合同》的有关约定，经本基金管理人计算并经基金托管人中国农业银行股份有限公司确认，利润分配方案符合上述约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管银河稳健证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵

守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《银河银联系列证券投资基金基金合同》、《银河银联系列证券投资基金托管协议》的约定，对银河稳健证券投资基金管理人—银河基金管理有限公司 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，银河基金管理有限公司在银河稳健证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，银河基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的银河稳健证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银河稳健证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	104,560,040.50	155,063,158.39
结算备付金		3,204,841.45	7,611,995.24
存出保证金		1,801,150.40	1,739,635.51
交易性金融资产	6.4.7.2	1,281,828,753.72	1,749,881,574.25
其中：股票投资		851,809,278.62	1,257,209,766.65
基金投资		-	-
债券投资		430,019,475.10	492,671,807.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		42,785,122.74	-

应收利息	6.4.7.5	5,670,249.81	9,358,501.06
应收股利		-	-
应收申购款		1,090,061.27	666,587.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,440,940,219.89	1,924,321,452.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		95,000,000.00	85,000,000.00
应付证券清算款		-	8,293,113.10
应付赎回款		440,249.34	1,337,883.96
应付管理人报酬		1,621,429.93	2,335,261.31
应付托管费		270,238.34	389,210.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,481,549.93	2,804,973.87
应交税费		38,095.00	38,095.00
应付利息		74,324.46	26,583.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,880,129.72	1,963,004.02
负债合计		100,806,016.72	102,188,125.18
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,044,240,093.65	1,239,680,629.22
未分配利润	6.4.7.10	295,894,109.52	582,452,697.77
所有者权益合计		1,340,134,203.17	1,822,133,326.99
负债和所有者权益总计		1,440,940,219.89	1,924,321,452.17

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9331 元，基金份额总额 1,436,171,316.02 份。

6.2 利润表

会计主体：银河稳健证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	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
一、收入		-160,701,285.77	-154,347,087.68
1. 利息收入		7,508,775.89	6,962,148.07

其中：存款利息收入	6.4.7.11	570,642.24	601,132.39
债券利息收入		6,938,133.65	6,361,015.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-27,043,944.07	59,060,412.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-26,114,691.58	54,167,279.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,408,975.00	730,764.84
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,479,722.51	4,162,368.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-141,915,469.09	-220,765,567.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	749,351.50	395,919.26
减：二、费用		20,752,037.22	18,862,971.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,517,172.86	10,849,522.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,919,528.81	1,808,253.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	6,177,244.36	5,483,845.35
5. 利息支出		998,045.81	602,171.29
其中：卖出回购金融资产支出		998,045.81	602,171.29
6. 其他费用	6.4.7.20	140,045.38	119,178.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-181,453,322.99	-173,210,058.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-181,453,322.99	-173,210,058.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河稳健证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,239,680,629.22	582,452,697.77	1,822,133,326.99
二、本期经营活动产生	-	-181,453,322.99	-181,453,322.99

的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-195,440,535.57	-72,576,682.78	-268,017,218.35
其中：1. 基金申购款	95,235,353.74	36,021,505.52	131,256,859.26
2. 基金赎回款	-290,675,889.31	-108,598,188.30	-399,274,077.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-32,528,582.48	-32,528,582.48
五、期末所有者权益（基金净值）	1,044,240,093.65	295,894,109.52	1,340,134,203.17
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,037,235,900.87	397,421,937.51	1,434,657,838.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-173,210,058.71	-173,210,058.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	165,016,710.21	66,584,776.06	231,601,486.27
其中：1. 基金申购款	352,736,738.91	134,256,605.16	486,993,344.07
2. 基金赎回款	-187,720,028.70	-67,671,829.10	-255,391,857.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-7,888,615.79	-7,888,615.79
五、期末所有者权益（基金净值）	1,202,252,611.08	282,908,039.07	1,485,160,650.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

尤象都
基金管理公司负责人

尤象都
主管会计工作负责人

董伯儒
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银河银联系列证券投资基金—银河稳健证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]65号文《关于同意银河银联系列证券投资基金设立的批复》的核准,由银河基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2003年8月4日正式生效,首次设立募集规模为1,186,651,618.30份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,注册登记机构为银河基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。2008年2月28日,本基金管理人银河基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前,本基金的基金份额净值为人民币1.3753元,根据基金份额拆分公式,计算精确到小数点后第9位(第9位以后舍去)为人民币1.375340290元。本基金管理人于拆分日,按照1:1.375340290的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后,基金份额净值为人民币1.0000元,基金份额面值为人民币0.7271元。

本基金投资于在国内依法公开发行、具有良好流动性的金融工具,以及法律、法规及中国证监会允许的其他金融工具。本基金的投资组合遵循以下规定:(1)投资于股票和债券的比例不低于本基金资产总值的80%;(2)投资于股票的比例在正常情况下不低于基金资产净值的35%,不高于基金资产净值的75%;(3)投资组合中现金比例不低于5%;(4)投资于国家债券的比例,不低于本基金资产总值的20%;(5)持有一家上市公司的股票,不超过本基金资产净值的10%;(6)与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;(7)中国证监会规定的其他比例限制。

本基金的业绩比较基准为:上证A股指数涨跌幅 \times 75%+中信国债指数涨跌幅 \times 25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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 年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	104,560,040.50
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	104,560,040.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	861,103,919.28	851,809,278.62	-9,294,640.66	
债券	交易所市场	256,284,733.21	254,274,475.10	-2,010,258.11
	银行间市场	177,644,240.00	175,745,000.00	-1,899,240.00

	合计	433,928,973.21	430,019,475.10	-3,909,498.11
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	1,295,032,892.49	1,281,828,753.72	-13,204,138.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：该科目本报告期末余额均为零

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	17,964.09
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,297.98
应收债券利息	5,650,922.94
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	64.80
合计	5,670,249.81

6.4.7.6 其他资产

注：该科目本报告期末余额均为零

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,480,949.93
银行间市场应付交易费用	600.00
合计	1,481,549.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00
应付赎回费	1,197.99
预提费用	128,931.73
合计	1,880,129.72

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,704,969,339.32	1,239,680,629.22
本期申购	130,979,368.25	95,235,353.74
本期赎回(以“-”号填列)	-399,777,391.55	-290,675,889.31
本期末	1,436,171,316.02	1,044,240,093.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	542,753,284.09	39,699,413.68	582,452,697.77
本期利润	-39,537,853.90	-141,915,469.09	-181,453,322.99
本期基金份额交易产生的变动数	-80,492,198.00	7,915,515.22	-72,576,682.78
其中：基金申购款	38,998,041.51	-2,976,535.99	36,021,505.52
基金赎回款	-119,490,239.51	10,892,051.21	-108,598,188.30
本期已分配利润	-32,528,582.48	-	-32,528,582.48
本期末	390,194,649.71	-94,300,540.19	295,894,109.52

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	531,000.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	38,450.22
其他	1,191.22
合计	570,642.24

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	2,115,486,715.56
减：卖出股票成本总额	2,141,601,407.14
买卖股票差价收入	-26,114,691.58

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	188,208,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	184,408,975.00
减：应收利息总额	8,208,000.00
债券投资收益	-4,408,975.00

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：该科目本报告期末余额均为零

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,479,722.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,479,722.51

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-141,915,469.09
——股票投资	-141,205,381.59
——债券投资	-710,087.50
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-141,915,469.09

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	747,879.66
转换费收入	1,471.84
合计	749,351.50

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	6,176,219.36
银行间市场交易费用	1,025.00
合计	6,177,244.36

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	79,343.16
银行费用	2,113.65
债券帐户维护费	9,000.00
合计	140,045.38

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	58,230,217.21	1.46%	358,704,143.55	9.98%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	0.00	0.00%	0.00	0.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	20,000,000.00	1.15%	14,000,000.00	1.78%

6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	0.00	0.00%	0.00	0.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	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	49,495.84	1.49%	49,495.84	3.34%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	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	304,893.68	10.18%	0.00	0.00%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

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管理费	11,517,172.86
其中：支付销售机构的客户维护费	865,768.77	949,713.65

注：本基金应支付基金管理人管理费，按前一日基金资产净值的 1.5%年费率逐日计提，累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 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

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的 0.25%的年费率逐日计提，累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.3 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

本期 2011年1月1日至2011年6月30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	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	53,510,112.06	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	104,560,040.50	531,000.80	175,383,008.36	575,937.72

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金无参与关联方承销证券的情况存在。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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
		场内	场外					

1	-	2011年1月17日	2011年1月17日	0.2000	16,398,239.63	16,130,342.85	32,528,582.48	
合计	-	-	-	0.2000	16,398,239.63	16,130,342.85	32,528,582.48	

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限的证券

6.4.12.2 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
300058	蓝色光标	-	临时停牌	28.38	2011年7月8日	32.70	1,188,416.00	36,007,040.75	33,727,246.08	-
300196	长海股份	-	临时停牌	18.00	2011年7月1日	18.15	1,008,100.00	23,049,440.20	18,145,800.00	-
600315	上海家化	-	临时停牌	35.60	-	-	500,000.00	16,597,742.75	17,800,000.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至到本报告期末 2011 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 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 50,000,000.00 元、10,000,000.00 元及 35,000,000.00 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/或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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制

环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）总经理领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督；（4）董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。

公司设立独立的风险控制专员岗，专门负责对投资管理全过程进行监督，出具监督意见和风险建议；对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督；对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；同时，公司建立了内部评级体系和交易对手库，在进行银行间同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金管理人每日对本基金的流动性需求进行测算，并同时通过独立的风控专员定期对基金流动性进行检查，并对潜在的流动性风险进行提示。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格变动，同时也将影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险。从直接的利息收入变动对基金资产的影响来看，利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30 日	1个月以 内	1-3个月	6个月以 内	3个月-1 年	6个月-1 年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	104,560,040.50	-	-	-	-	-	-	-	-	104,560,040.50
结算备付金	3,204,841.45	-	-	-	-	-	-	-	-	3,204,841.45
存出保证金	160,000.00	-	-	-	-	-	-	-	1,641,150.40	1,801,150.40
交易性金融资 产	-	51,906,400.00	-	139,933,000.00	-	-	237,109,614.60	1,070,460.50	851,809,278.62	1,281,828,753.72
应收证券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	-	42,785,122.74	42,785,122.74
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	5,670,249.81	5,670,249.81
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,090,061.27	1,090,061.27
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	107,924,881.95	51,906,400.00	-	139,933,000.00	-	-	237,109,614.60	1,070,460.50	902,995,862.84	1,440,940,219.89
负债										
卖出回购金融	95,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	95,000.00

资产款	0.00										,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	440,249.34	440,249.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,621,429.93	1,621,429.93
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	270,238.34	270,238.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,481,549.93	1,481,549.93
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	74,324.46	74,324.46
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	38,095.00	38,095.00
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,880,129.72	1,880,129.72
负债总计	95,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	5,806,016.72	5,806,016.72
利率敏感度缺口	12,924,881.95	51,906,400.00	-	139,933,000.00	-	-	237,109,614.60	1,070,460.50	897,189,846.12	1,340,134,203.17	
上年度末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计	
资产											
银行存款	155,063,158.39	-	-	-	-	-	-	-	-	-	155,063,158.39
结算备付金	7,611,995.24	-	-	-	-	-	-	-	-	-	7,611,995.24
存出保证金	160,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	1,579,635.51	1,739,635.51
交易性金融资产	-	80,174,000.00	-	254,081,689.40	-	-	157,351,382.70	1,064,735.50	1,257,209,766.65	1,749,881,574.25	
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	9,358,501.06	9,358,501.06	
应收申购款	5,461.30	-	-	-	-	-	-	-	661,126.42	666,587.72	
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
资产总计	162,840,614.93	80,174,000.00	-	254,081,689.40	-	-	157,351,382.70	1,064,735.50	1,268,809,029.64	1,924,321,452.17	

负债										
卖出回购金融资产款	85,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	85,000,000.00
应付证券清算款		-	-	-	-	-	-	-	8,293,113.10	8,293,113.10
应付赎回款		-	-	-	-	-	-	-	1,337,883.96	1,337,883.96
应付管理人报酬		-	-	-	-	-	-	-	2,335,261.31	2,335,261.31
应付托管费		-	-	-	-	-	-	-	389,210.20	389,210.20
应付交易费用		-	-	-	-	-	-	-	2,804,973.87	2,804,973.87
应付利息		-	-	-	-	-	-	-	26,583.72	26,583.72
应交税费		-	-	-	-	-	-	-	38,095.00	38,095.00
其他负债		-	-	-	-	-	-	-	1,963,004.02	1,963,004.02
负债总计	85,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	17,188,125.18	102,188,125.18
利率敏感度缺口	77,840,614.93	80,174,000.00	-	254,081,689.40	-	157,351,382.70	1,064,735.50	1,251,620,904.46	1,822,133,326.99	1,822,133,326.99

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011 年 6 月 30 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,163,475.59	1,115,568.67
市场利率上升 25 个基点	-1,163,475.59	-1,115,568.67	

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产价格的变动，本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	851,809,278.62	63.56	1,257,209,766.65	69.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	851,809,278.62	63.56	1,257,209,766.65	69.00

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	估测组合市场价格风险的数据为上证 A 股指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定上证 A 股指数变化 5，其他市场变量均不发生变化。		
测算时期为 3 个月，对于交易少于 3 个月的资产，默认其波动与指数同步。			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011年6月30日）	上年度末（2010年12月31日）
	上证 A 股指数上升 5	41,351,382.98	58,615,566.45
上证 A 股指数下降 5	-41,351,382.98	-58,615,566.45	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	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	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

7.2 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	-	-
B	采掘业	40,250,386.59	3.00
C	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	-	-
C3	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
E	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
H	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	-	-
	合计	851,809,278.62	63.56

7.3 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

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
11	601601	中国太保	1,307,098	29,265,924.22	2.18
12	600292	九龙电力	1,794,304	27,811,712.00	2.08
13	002277	友阿股份	1,198,702	26,275,547.84	1.96
14	000063	中兴通讯	894,268	25,289,899.04	1.89
15	600276	恒瑞医药	825,000	24,725,250.00	1.84
16	600559	老白干酒	868,782	24,525,715.86	1.83
17	002091	江苏国泰	1,206,533	22,755,212.38	1.70
18	600778	友好集团	1,800,567	22,074,951.42	1.65
19	600882	大成股份	1,499,906	21,298,665.20	1.59
20	300171	东富龙	511,700	20,928,530.00	1.56
21	600869	三普药业	750,000	20,227,500.00	1.51
22	002024	苏宁电器	1,500,000	19,215,000.00	1.43
23	300174	元力股份	772,856	18,772,672.24	1.40
24	300196	长海股份	1,008,100	18,145,800.00	1.35
25	600315	上海家化	500,000	17,800,000.00	1.33
26	002541	鸿路钢构	398,861	16,074,098.30	1.20
27	002293	罗莱家纺	199,744	15,490,147.20	1.16

28	300039	上海凯宝	565,797	14,122,293.12	1.05
29	600096	云天化	699,950	13,922,005.50	1.04
30	300037	新宙邦	360,000	13,892,400.00	1.04
31	002099	海翔药业	572,667	12,575,767.32	0.94
32	600570	恒生电子	800,000	11,872,000.00	0.89
33	600475	华光股份	616,599	11,709,215.01	0.87
34	002353	杰瑞股份	160,000	10,384,000.00	0.77
35	600537	海通集团	213,172	7,806,358.64	0.58
36	002035	华帝股份	599,980	7,415,752.80	0.55
37	300230	永利带业	299,899	4,726,408.24	0.35
38	300187	永清环保	500	27,240.00	0.00
39	300178	腾邦国际	500	10,000.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	600585	海螺水泥	73,293,807.63	4.02
2	601601	中国太保	62,425,748.51	3.43
3	600395	盘江股份	58,584,300.67	3.22
4	002091	江苏国泰	51,938,882.47	2.85
5	601166	兴业银行	50,724,268.96	2.78
6	600815	厦工股份	47,237,121.16	2.59
7	000800	一汽轿车	46,688,925.79	2.56
8	600079	人福医药	46,000,002.23	2.52
9	002155	辰州矿业	45,783,180.64	2.51
10	601668	中国建筑	43,954,832.00	2.41
11	000425	徐工机械	42,812,216.18	2.35
12	000651	格力电器	42,648,306.81	2.34
13	600875	东方电气	40,504,983.30	2.22
14	002327	富安娜	35,151,245.90	1.93
15	002035	华帝股份	35,019,388.64	1.92
16	000527	美的电器	34,635,448.25	1.90
17	000858	五粮液	34,586,499.04	1.90
18	000012	南玻A	31,788,612.14	1.74

19	000635	英力特	31,442,053.01	1.73
20	601992	金隅股份	30,939,853.57	1.70

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	601318	中国平安	102,079,929.29	5.60
2	601699	潞安环能	59,471,397.97	3.26
3	601166	兴业银行	51,759,968.18	2.84
4	600460	士兰微	50,509,008.49	2.77
5	601607	上海医药	49,112,497.71	2.70
6	000800	一汽轿车	46,697,756.56	2.56
7	601117	中国化学	46,201,858.58	2.54
8	600522	中天科技	42,696,925.56	2.34
9	600869	三普药业	42,401,288.12	2.33
10	000061	农产品	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	2.24
13	600585	海螺水泥	40,130,266.18	2.20
14	002063	远光软件	39,953,081.31	2.19
15	002155	辰州矿业	39,452,657.20	2.17
16	600139	西部资源	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	1.95
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	1,877,406,300.7
卖出股票收入（成交）总额	2,115,486,715.56

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	207,207,966.90	15.46
2	央行票据	155,935,000.00	11.64
3	金融债券	19,810,000.00	1.48
	其中：政策性金融债	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	52,926,106.40	3.95
2	010110	21 国债(10)	520,000	51,906,400.00	3.87
3	010112	21 国债(12)	520,000	51,870,000.00	3.87
4	010203	02 国债(3)	500,000	49,435,000.00	3.69
5	113001	中行转债	445,790	47,066,508.20	3.51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

7.8 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

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 五粮液于 2011 年 5 月 28 日公告了《关于收到中国证监会行政处罚决定书的公告》。五粮液对此作出了说明，公司接受证监会的行政处罚，将不申请行政复议和提起行政诉讼；公司对有关事项进行了认真整改，整改取得明显实效；公司没有受到任何经济损失；公司按照整改方案中“切实解决关联交易”的承诺，已采取积极措施，使关联交易大幅减少。该公司的主营业务未受该事件影响，本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名股票的发行主体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。

7.9.2 银河稳健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	金额
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

7.9.4 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	47,066,508.20	3.51

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300058	蓝色光标	33,727,246.08	2.52	临时停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
70,046	20,503.26	363,202,089.26	25.29%	1,072,969,226.76	74.71%

8.2 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	61,411.97	0.0043%

§ 9 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	1,704,969,339.32
本报告期基金总申购份额	130,979,368.25
减：本报告期基金总赎回份额	399,777,391.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,436,171,316.02

§ 10 重大事件揭示**10.1 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

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

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2011年2月26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董事变更的公告》和《银河基金管理有限公司关于高级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、刘澎湃先生、熊科金先生、张国臣先生、凌有法先生、王志强先生、熊人杰先生、孙树义先生、王福山先生、秦荣生先生、沈祥荣先生组成公司第三届董事会，其中孙树义先生、王福山先生、秦荣生先生、沈祥荣先生为独立董事。第二届董事会中李锡奎先生、戴宪生先生、李洪先生、裴勇先生不再担任公司董事，傅丰祥先生不再担任公司独立董事。经公司第三届董事会第一次会议表决通过，选举徐旭同志担任公司董事长，李锡奎同志不再担任公司董事长，聘任尤象都和陈勇两位同志担任公司副总经理。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

1、2011年1月21日，中国证监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（证监许可【2011】116号），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。

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

报告期内基金未改聘会计师事务所。

10.6 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。

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

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	
光大证券	1	1,237,206,693.94	31.01%	1,051,619.55	31.61%	-
申银万国	1	745,129,461.32	18.68%	633,357.68	19.04%	-
安信证券	2	457,409,034.80	11.47%	371,646.47	11.17%	-
中银投资证券	1	453,869,228.00	11.38%	368,772.25	11.08%	-
华宝证券	1	318,489,158.44	7.98%	258,775.48	7.78%	-
国泰君安	2	308,237,282.73	7.73%	250,446.78	7.53%	-
中银国际	2	248,315,251.28	6.22%	211,065.98	6.34%	-
招商证券	1	162,429,438.54	4.07%	131,974.67	3.97%	-
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：

(1) 实力雄厚；

- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 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；
- (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) 初步确定；
- (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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	银河基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行有限责任公司个人网上基金前端申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 1 月 4 日
2	银河稳健证券投资基金分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 1 月 12 日
3	银河基金管理有限公司关于旗下基金调整在交通银行股份有限公司定投申购金额下限的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 1 月 14 日
4	银河基金管理有限公司关于旗下基金在天相投资顾问有限公司开通基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 1 月 20 日
5	银河银联系列证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 1 月 22 日
6	银河基金管理有限公司关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 2 月 22 日
7	银河基金管理有限公司关于董事变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 2 月 26 日
8	银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 2 月 26 日
9	银河银联系列证券投资基金招募说明书(更新摘要)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011 年 3 月 17 日
10	银河银联系列证券投资基金 2010	全文在公司网站, 摘	2011 年 3 月 30 日

	年年度报告及摘要	要在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》	
11	银河基金管理有限公司关于旗下 开放式基金新增中信证券股份有 限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2011 年 4 月 1 日
12	银河银联系列证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2011 年 4 月 20 日
13	银河基金管理有限公司关于旗下 基金新增华夏银行股份有限公司 为代销机构的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2011 年 4 月 29 日
14	银河基金管理有限公司关于旗下 基金在中信证券股份有限公司开 通基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2011 年 5 月 4 日
15	银河基金管理有限公司关于旗下 开放式基金新增东莞农村商业银 行股份有限公司为代销机构的公 告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2011 年 6 月 1 日
16	关于旗下基金持有的停牌股票恢 复市价估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2011 年 6 月 11 日
17	银河基金管理有限公司关于旗下 基金对长期停牌的股票变更估值 方法的提示性公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2011 年 6 月 18 日
18	银河基金管理有限公司关于旗下 基金参加交通银行股份有限公司 网上银行、手机银行基金申购费 率优惠的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2011 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河银联系列证券投资基金的文件
- 2、《银河银联系列证券投资基金基金合同》
- 3、《银河银联系列证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
- 5、银河银联系列证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

11.2 存放地点

上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼

11.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021) 38568888 / 400-820-0860

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司
2011 年 8 月 27 日