

3	600519	贵州茅台	504,941	107,365,604.83	3.88
4	600048	保利地产	8,764,899	96,326,240.01	3.48
5	000422	湖北宜化	4,481,200	93,791,516.00	3.39
6	000651	格力电器	3,555,855	83,562,592.50	3.02
7	000063	中兴通讯	2,894,556	81,858,043.68	2.96

6	600753	东方电气	2,227,139	81,022,262.74	2.92
9	600188	兖州煤业	2,274,079	80,277,106.70	2.90
10	002001	新和成	2,676,164	78,813,029.80	2.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末未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
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 2011年4月29日,中国证券监督管理委员会发布《中国证监会行政处罚决定书》(2011[7]号),对宜黄五粮液股份有限公司(下称:五粮液,股票代码:000888),唐桥等8名责任人员的《澄清公告》存在重大遗漏,信息披露不及时,不完整等行为,作出警告、罚款等行政处罚决定。

对于五粮液股票投资决策程序的说明：该股票经过研究推荐、审批后进入公司股票备选库，由研究员跟踪分析。本基金管理人进行了研究判断后，按照相关投资决策流程投资了该股票。该行政处罚事件发生后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析，认为此事项对该上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此没有改变本基金管理人对该上市公司投资。

其余九名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.2.8 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,970,441.94
2	应收证券清算款	56,413,088.61
3	应收股利	2,532,226.73
4	应收利息	53,205.57

5	应付账款	626,574.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,797,477.79

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,165,887,470.21
本报告期基金总申购份额	131,542,906.84

本报告期基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额	2,998,458,609.03	

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。

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准本基金募集的文件；

3、《依银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金托管协议》；
4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
6、本报告期内公开披露的公告。
7.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人的办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。
7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人办公地址及网站免费查阅申请文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
二〇一一年七月二十日

股票型证券投资基金

二 季 度 报 告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,823,094,287.97	91.16
	其中:股票	3,823,094,287.97	91.16

2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	349,009,393.15	8.32
6	其他各项资产	21,862,425.02	0.52
7	合计	4,193,966,106.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比
----	------	---------	----------

A	农、林、牧、渔业	100,693,191.76	2.46
B	采掘业	469,262,507.24	11.46
C	制造业	2,272,081,213.12	55.47
C0	食品、饮料	178,833,631.84	4.37
C1	纺织、服装、皮毛	127,803,395.27	3.12

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	168,848,237.09	4.12
C5	电子	350,417,058.08	8.56
C6	金属、非金属	295,582,539.76	7.22
C7	机械、设备、仪表	743,821,597.06	18.16

C8	医药、生物制品	338,234,754.02	8.26
C99	其他制造业	68,540,000.00	1.67
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	217,618,998.85	5.31
F	交通运输、仓储业	-	-

G	信息技术业	31,270,308.17	0.70
H	批发和零售贸易	282,356,711.61	6.89
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	406,564,871.06	9.93
K	社会服务业	13,247,533.16	0.32
L	传播与文化产业	-	-

M	综合类	29,998,753.00	0.73
	合计	3,823,094,287.97	93.34

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601699	潞安环能	4,800,000	157,488,000.00	3.84

2	000417	合肥百货	8,500,000	154,700,000.00	3.78
3	600376	普开股份	10,009,511	132,225,640.31	3.23
4	600104	上海汽车	6,530,654	122,384,455.96	2.99
5	600502	安徽水利	7,624,175	121,300,624.25	2.96
6	000527	美的电器	6,552,678	120,503,748.42	2.94
7	600048	保利地产	9,999,965	109,899,615.35	2.68

8	600518	康美药业	8,071,982	106,227,283.12	2.59
9	600742	一汽富维	3,608,531	105,657,787.68	2.58
10	600251	冠农股份	3,036,586	100,693,191.76	2.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告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
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,203,456.62
2	应收证券清算款	1,719,166.90
3	应收股利	2,067,056.88
4	应收利息	70,611.67
5	应收申购款	0.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,862,425.02

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本报告期基金总申购份额	612,801,335.73
减:本报告期基金总赎回份额	660,607,145.84
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	3,441,591,144.23

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。

7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理行业成长股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理行业成长股票型证券投资基金托管协议》；

6、本报告期内公开披露的临时公告。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。

投资者可到基金管理人的办公地址及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
二〇一一年七月二十日