银丰证券投资基金

2011 年度报告摘要

2011年12月31日

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2012年3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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称:中国建设银行)根据本基金合同规定,于2012年3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经会计师事务所审计。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河银丰封闭
基金主代码	500058
交易代码	500058
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002年8月15日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2002年9月10日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型基金,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。
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的精选个股相结合的投资策略。在正常的市场情况下,股票投资比例变动范围是:基金资产的25%-75%;债券投资比例变动范围是:基金资产的25%-55%;现金资产比例的变动范围是:基金资产的0%-20%。
业绩比较基准	上证A股指数涨跌幅*75%+同期国债收益率*25%。
风险收益特征	本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属风险相对较低品种,其风险与收益特征从长期平均及预期来看介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间,或介于单纯的成长型组合与单纯的价值型组合之间,力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李立生	尹东
	联系电话	021-38568699	010-67595003
	电子邮箱	lilisheng@galaxyasset.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67595096
传真		021-38568568	010-66275865

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	1、上海市世纪大道1568号中建大厦15楼 2、北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-131,833,578.89	-4,024,141.23	628,002,548.93
本期利润	-915,064,974.16	102,009,433.62	1,697,580,099.17
加权平均基金份额本期利润	-0.3050	0.0340	0.5659
本期加权平均净值利润率	-28.63%	3.03%	50.69%
本期基金份额净值增长率	-25.24%	3.05%	70.66%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配利润	-295,606,816.90	47,056,647.74	231,080,788.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0985	0.0157	0.0770
期末基金资产净值	2,704,393,183.10	3,640,458,159.40	3,718,448,725.78
期末基金份额净值	0.901	1.213	1.239
3.1.3 累计期末指标	2011年末	2010年末	2009年末
基金份额累计净值增长率	228.92%	339.99%	326.97%

注:1.本期已实现收益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.上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. 对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

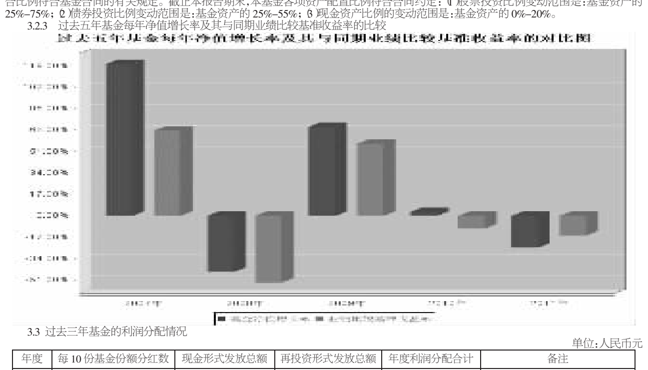
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.54%	2.85%	-4.66%	2.27%	-1.88%	0.58%
过去六个月	-12.69%	2.46%	-14.95%	1.84%	2.26%	0.62%
过去一年	-25.24%	2.45%	-15.55%	1.71%	-9.69%	0.74%
过去三年	31.47%	2.68%	19.29%	2.36%	12.18%	0.32%
过去五年	60.47%	3.29%	-6.02%	3.07%	66.49%	0.22%
自基金合同生效起至今	228.92%	2.83%	42.71%	2.70%	186.21%	0.13%

注:本基金的业绩比较基准为:上证A股指数涨跌幅*75%+同期国债收益率*25%。

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

注:2002年8月15日本基金成立,根据《银丰证券投资基金基金合同》规定,本基金应自基金合同生效日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截止本报告期末,本基金各项资产配置比例符合合同约定:(1)股票投资比例变动范围是:基金资产的25%-75%;(2)债券投资比例变动范围是:基金资产的25%-55%;(3)现金资产比例的变动范围是:基金资产的0%-20%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2011	0.070	21,000,002.14	-	21,000,002.14	根据2010年度未分配利润分配
2010	0.600	180,000,000.00	-	180,000,000.00	
2009	1.310	393,000,006.56	-	393,000,006.56	
合计	1.980	594,000,008.70	-	594,000,008.70	

§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11只开放式证券投资基金,基本情况如下:

1、银河银联系列证券投资基金

本系列基金为契约型开放式基金,由两只基金构成,包括银河稳健证券投资基金和银河收益证券投资基金,每只基金彼此独立运作,并通过基金间相互转换构成一个统一的基金体系。

基金合同生效日:2003年8月4日

(1)银河稳健证券投资基金

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。

(2)银河收益证券投资基金

投资目标:以债券投资为主,兼顾股票投资,在充分控制风险和保持较高流动性的前提下,实现基金资产的安全及长期稳定增值。

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。

11、银河消费驱动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:2011年7月29日

基金投资目标:本基金通过深入研究,重点投资与居民消费密切相关的行业中具有竞争优势的上市公司,分享由于中国巨大的人口基数、收入增长和消费结构变革所带来的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求基金资产长期稳定增值。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐小勇	银丰证券投资基金的基金经理、银河蓝筹精选股票型证券投资基金的基金经理	2010年4月29日	-	17	硕士研究生学历,曾先后在中国信达信托投资公司、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,历任行业研究员、高级行业研究员、基金经理助理、银河银泰理财分红证券投资基金基金经理等职务,2010年7月起兼任银河蓝筹精选股票型证券投资基金基金经理。
神玉飞	银丰证券投资基金的基金经理助理	2011年11月24日	-	4	博士研究生学历。2007年9月加入银河基金管理有限公司,担任研究员,2011年11月起担任银丰证券投资基金的基金经理助理。

注:1.上表中任职日期均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、勤勉律己、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,本报告期,发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例,但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、勤勉律己、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,为基金份额持有人谋求长期稳健的风险回报。

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

银丰证券投资基金(以下简称"银河银丰封闭")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

与银河银丰封闭风格相似的投资组合为银河稳健证券投资基金(以下简称"银河稳健混合")、银河银泰理财分红证券投资基金(以下简称"银河银泰混合")。报告期内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如下:

阶段	基金	净值增长率
2011年度	银河银泰混合	[illegible]
	银河稳健混合	[illegible]
	银河银丰封闭	[illegible]

注:[illegible]

4.3.3 异常交易行为的专项说明

银河银丰封闭在本报告期内未发现异常交易行为。

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国内A股市场在一季度上涨后,出现持续单边下跌行情,上证指数全年跌幅21.68%,连续两年下跌。行业板块全面下挫,差异比较大,食品饮料和金融板块跌幅小于10%,跌幅超过30%的板块有:电子、有色、机械、信息设备、交通运输、商业等,多数为周期性行业和上年度表现好的品种。

中国经济经过2008年的世界金融危机,2009年4万亿投资刺激实现快速恢复,2010年结构调整努力,在本年度出现滞胀的新情况。2011年通货膨胀高企,CPI连续走高,政府将治理通货膨胀作为首要目标,连续提高存款准备金、控制贷款投放、提高利率,造成社会资金持续偏紧,民间高利贷盛行,提高了社会资金成本,中小企业资金紧张。经济增长也遇到困难。前期大规模投资难以为继,政府融资平台风险显现,项目投资下降。房地产价格在金融危机后连续两年大幅上涨,成为经济和社会问题,政府在2011年加大治理力度,推出限购和限贷等强硬措施,房地产销售急剧萎缩,并出现降价势头,房地产投资锐减。在进出口方面,美国虽然复苏,但欧债危机出现,并愈演愈烈,不亚于2008年的金融危机,日本大地震中断日本经济,中国出口减少,顺差缩小,并有资本外逃现象。消费平稳,但增长也趋下降。中国潜在经济增长率可能已经下降,中速增长将成为常态。

A股市场的宏观基本面受到打击,没有新的增长点支持市场,多的是各个行业连续的利空消息。资金面紧张,而持续的IPO和再融资与大股东减持导致市场供需失衡,出现单边缩量下跌。

我们在2011年没有能够及时意识到A股市场熊市特征,对经济转型的艰巨性认识不足,缺少对国内外黑天鹅事件的警惕,全年股票仓位一直保持在高位。在配置结构方面也很不利,一是组合品种弹性大,金融等防御型股票比例低;二是有部分重仓股基本面变弱,下跌幅度巨大。资产配置和个股选择两个方面的失误造成基金净值下跌幅度比较大。在2011年基金的股票组合集中在食品饮料、医药和服务、信息技术、环保、农业等方面,虽然部分持仓有过较大上涨,但由于没有把握交易机会,丧失了应有的利益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2011年净值增长率为-25.24%,同期业绩比较基准增长率为-15.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国经济可能已经结束高增长态势,原有的发展模式已经不能适应新的国内外经济形势,要素价格长期性上涨,经济结构调整是必然选择。2012年经济转型还处在开始阶段,明确的增长动力可能尚需酝酿,原有的主导产业进入调整,经济形势比较复杂。在财政和货币政策方面,结构性特征也会非常明显,可能不会出现全面宽松状态。

国内资本市场供需结构可能有些变化,新股发行面临改革,长期资金可能入市,但供大于需可能仍是常态。

A股市场经过连续两年的下跌,基本反映了2008年以来复杂的宏观经济变化和货币政策转变。资本市场的整体估值下降幅度比较大,风险得到释放。如果在2012年出现新的风险因素导致的下跌,将迎来长线建仓机会。

我们预计2012年A股市场可能处于震荡过程中,全年上涨的可能性比较大。预计国内股票市场在年初受结构性货币政策宽松和资本市场发行政策调整等利好影响下可能出现反弹;之后,在固定资产投资下降,房地产行业资金链紧张和地产价格下跌的影响下再次探底,可能在年中形成年度低点。在目前环境下,难以判断新的增长方式和增长行业,A股市场见底回升的先导行业不清晰,因此市场回升力度也不易判断。

基于对2012年A股市场的复杂判断,我们将做更为积极的投资操作,在保持股票仓位适中的前提下,加大股票持仓位比例的调整,努力进行时机选择工作。在投资组合的结构方面将做比较大的调整,增强组合的均衡性,阶段性地偏重成长股或价值股。考虑到市场已经和可能出现的杀跌机会,积极买入价值股,尤其是跌幅大,估值低的品种。成长股是本基金长期持有的品种,将继续积极寻找和筛选,在持有的同时积极操作,争取更高的利润机会。我们将个股风险放在重要位置,将通过业务分析、财务判断、估值比较和积极操作尽量回避个股风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、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

根据本基金《基金合同》,"基金收益分配比例不得低于基金净收益的90%","基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额","基金收益分配采取现金方式,每年至少分配一次"。管理人于2011年3月30日公告银丰证券投资基金2010年度的分红,权益登记日2011年4月6日,除息日2011年4月7日。每10份基金份额派发0.07元。2011年度已实现收益为负,按照基金合同约定的分红比例计算无分配金额,不需分配利润。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建设银行股份有限公司确认,利润分配符合上述约定。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为21,000,002.14元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本报告期内本基金由安永华明会计师事务所出具标准无保留意见审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:银丰证券投资基金

报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	53,256,593.78	76,016,121.57
结算备付金		3,751,221.35	4,432,666.73
存出保证金		2,591,669.93	2,060,093.52
交易性金融资产	7.4.7.2	2,732,369,512.87	3,701,686,456.00
其中:股票投资		1,898,765,225.47	2,725,557,633.70
基金投资		-	-
债券投资		833,604,287.40	976,128,822.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,989,717.48	44,960,333.34
应收利息	7.4.7.5	11,407,459.76	18,449,969.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,813,366,175.17	3,847,605,640.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		100,000,000.00	175,000,000.00
应付证券清算款		885,759.91	22,322,646.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,633,169.72	4,679,939.00
应付托管费		605,528.29	779,989.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	661,469.95	1,406,082.28
应交税费		1,748,558.46	1,465,158.46
应付利息		38,505.74	103,664.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,400,000.00	1,390,000.00
负债合计		108,972,992.07	207,147,481.05
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-295,606,816.90	640,458,159.40
所有者权益合计		2,704,393,183.10	3,640,458,159.40
负债和所有者权益总计		2,813,366,175.17	3,847,605,640.45

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.901元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体:银丰证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入		-847,604,371.31	178,991,115.94
1.利息收入		27,907,459.50	32,550,533.27
其中:存款利息收入	7.4.7.11	569,716.07	698,885.67
债券利息收入		27,337,743.43	31,824,122.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	27,525.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-92,310,435.94	40,396,396.23
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-90,726,565.70	20,456,187.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-14,421,637.57	701,638.08
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	12,837,767.33	19,238,570.74
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-783,231,395.27	106,033,574.85
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	30,000.40	10,611.59
减:二、费用		67,460,602.85	76,981,682.32
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	47,989,627.23	50,579,880.97
2.托管费	7.4.10.2.2	7,998,271.18	8,429,980.13
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	6,106,946.29	13,205,274.67
5.利息支出		4,810,853.25	3,723,115.31
其中:卖出回购金融资产支出		4,810,853.25	3,723,115.31
6.其他费用	7.4.7.19	554,904.90	1,043,431.24
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-915,064,974.16	102,009,433.62
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-915,064,974.16	102,009,433.62

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银丰证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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)	3,000,000,000.00	640,458,159.40	3,640,458,159.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-915,064,974.16	-915,064,974.16
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-21,000,002.14	-21,000,002.14
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	-295,606,816.90	2,704,393,183.10

项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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)	3,000,000,000.00	718,448,725.78	3,718,448,725.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	102,009,433.62	102,009,433.62
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-180,000,000.00	-180,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	640,458,159.40	3,640,458,159.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

尤象都 陈勇 董伯儒

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银丰证券投资基金(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[2002]39号文《关于同意设立银丰证券投资基金的批复》的核准,由中国银河证券有限责任公司(现名:中国银河投资管理有限公司)、首都机场集团公司、上海市城市建设投资开发总公司、湖南广播电视产业中心、银河基金管理有限公司于2002年8月15日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式,存续期为15年,发行规模为30亿份基金份额。本基金经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证债字[2002]12号文审核同意,于2002年9月10日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金只投资于在国内依法公开发行上市、具有良好流动性的金融工具,主要包括在上海证券交易所和深圳证券交易所挂牌的股票和债券,法律、法规和中国证监会允许的其他金融工具也将纳入本基金投资范围。本基金的投资组合遵循下列比例规定:(1)本基金投资于股票、债券的比例,不得低于基金资产总值的80%;(2)本基金投资于债券的比例不低于基金资产总值的25%,不高于基金资产总值的55%;(3)本基金持有的一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(4)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的一家公司发行的证券总和,不得超过该证券的10%;(5)本基金投资于国家债券的比例,不得低于基金资产净值的20%;(6)遵守法律、法规、中国证监会及本基金契约所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×75%+同期国债收益率×25%。

7.4.2 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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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的说明

本年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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、储蓄存款利息收入,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、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
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、基金发起人
上海市城市建设投资开发总公司	基金管理人的股东、基金发起人
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	同受基金管理人第一大股东控制、基金发起人

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

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 2011年1月1日至2011年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	371,962,255.54	9.35%	2,078,306,824.19	24.34%

债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

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12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
中国银河证券股份有限公司	425,000,000.00	6.17%	246,000,000.00	4.09%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2011年1月1日至2011年12月31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
中国银河证券股份有限公司	310,987.90	9.39%	2,202.06	0.33%

关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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
中国银河证券股份有限公司	1,707,617.45	23.98%	415,011.67	29.54%

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	47,989,627.23	50,579,880.97
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:2011年末未支付管理费余额3,633,169.72元,2010年末未支付管理费余额4,679,939.00元。

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×1.50%/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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,998,271.18	8,429,980.13

注:2011年末未支付托管费余额605,528.29元,2010年末未支付托管费余额779,989.83元。

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×0.25%/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

基金托管人的托管费每日计算,逐日累计至每月月末,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两个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

本期 2011年1月1日至2011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 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	450,000,000.00	316,938.01

上年度可比期间 2010年1月1日至2010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 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国银河证券股份有限公司	70,678,660.96	-	-	-	840,000,000.00	278,501.36

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

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金合同生效日(2002年8月15日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	3,000,000.00	3,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
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	3,000,000.00	3,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.10%	0.10%

注:期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2010年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
首都机场集团公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
上海市城市建设投资开发总公司	1,500,000.00	0.05%	1,500,000.00	0.05%

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金系在正常业务范围内按一般商业条款进行,投资本基金的费率是公允的。

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 2011年1月1日至2011年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	53,256,593.78	496,388.05	76,016,121.57	621,123.02

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2011年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	1,898,765,225.47	67.49
	其中:股票	1,898,765,225.47	67.49
2	固定收益投资	833,604,287.40	29.63
	其中:债券	833,604,287.40	29.63
	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	57,007,815.13	2.03
6	其他各项资产	23,988,847.17	0.85
7	合计	2,813,366,175.17	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	213,019,494.91	7.88
B	采掘业	18,972,915.00	0.70
C	制造业	836,725,045.99	30.94
C0	食品、饮料	249,789,892.57	9.24
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	42,721,000.00	1.58
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,864,307.20	0.40
C5	电子	199,847,532.05	7.39
C6	金属、非金属	48,021,714.72	1.78
C7	机械、设备、仪表	55,699,516.80	2.06
C8	医药、生物制品	229,781,082.65	8.50
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	78,396,877.31	2.90
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	87,495,356.69	3.24
G	信息技术业	121,899,559.70	4.51
H	批发和零售贸易	270,442,606.17	10.00
I	金融、保险业	14,847,740.16	0.55
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	221,920,585.34	8.21
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	35,045,044.20	1.30
	合计	1,898,765,225.47	70.21

8.3 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	000423	东阿阿胶	5,349,967	229,781,082.65	8.50
2	000568	泸州老窖	5,553,113	207,131,114.90	7.66
3	002041	登海种业	5,619,219	160,822,047.78	5.95
4	002106	莱宝高科	7,170,570	120,178,753.20	4.44
5	000826	桑德环境	3,969,792	100,038,758.40	3.70
6	002320	海峡股份	5,767,657	87,495,356.69	3.24
7	600763	通策医疗	3,872,101	81,623,889.08	3.02
8	000501	鄂武商A	5,025,001	76,631,265.25	2.83
9	000939	凯迪电力	7,073,615	74,980,319.00	2.77
10	002475	立讯精密	1,933,890	67,492,761.00	2.50
11	601258	庞大集团	9,700,000	59,655,000.00	2.21
12	600416	湘电股份	8,095,860	55,699,516.80	2.06
13	000998	隆平高科	2,022,373	52,197,447.13	1.93
14	000969	安泰科技	2,899,862	48,021,714.72	1.78
15	000063	中兴通讯	2,633,599	44,507,823.10	1.65
16	002262	恩华药业	2,303,872	43,681,413.12	1.62
17	002292	奥飞动漫	1,700,000	42,721,000.00	1.58
18	600559	老白干酒	2,047,949	42,658,777.67	1.58
19	000963	华东医药	1,599,877	42,588,725.74	1.57
20	300187	永清环保	847,714	40,257,937.86	1.49
21	600770	综艺股份	2,199,940	35,045,044.20	1.30
22	002439	启明星辰	1,687,240	30,623,406.00	1.13
23	000061	农产品	2,346,152	26,159,594.80	0.97
24	002253	川大智胜	938,948	22,018,330.60	0.81
25	600858	银座股份	999,823	19,616,527.26	0.73
26	002340	格林美	972,970	18,972,915.00	0.70
27	002230	科大讯飞	450,000	15,750,000.00	0.58
28	601009	南京银行	1,599,972	14,847,740.16	0.55
29	300115	长盈精密	306,335	11,196,544.25	0.41
30	601208	东材科技	575,440	10,864,307.20	0.40
31	600588	用友软件	500,000	9,000,000.00	0.33
32	601139	深圳燃气	307,521	3,416,558.31	0.13
33	000705	浙江震元	219,800	2,110,080.00	0.08
34	002179	中航光电	59,724	979,473.60	0.04

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	601258	庞大集团	238,187,935.68	6.54
2	002041	登海种业	143,417,748.29	3.94
3	000939	凯迪电力	104,458,626.64	2.87
4	002320	海峡股份	95,453,643.93	2.62
5	000568	泸州老窖	77,917,571.42	2.14
6	600195	中牧股份	70,836,194.28	1.95
7	000063	中兴通讯	68,054,277.50	1.87
8	000423	东阿阿胶	67,642,684.51	1.86
9	000998	隆平高科	65,237,210.39	1.79
10	601166	兴业银行	57,742,450.43	1.59
11	600900	长江电力	56,955,263.87	1.56
12	600292	九龙电力	50,650,437.92	1.39
13	002541	鸿路钢构	49,031,392.51	1.35
14	600770	综艺股份	48,771,081.55	1.34
15	002001	新和成	45,985,731.04	1.26
16	002202	金风科技	45,570,638.60	1.25
17	300187	永清环保	43,995,461.75	1.21
18	600284	浦东建设	41,931,417.10	1.15
19	600763	通策医疗	41,428,223.32	1.14
20	000826	桑德环境	38,268,737.82	1.05

注:本项及下项8.4.2、8.4.3的"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖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	600588	用友软件	130,068,741.67	3.57
2	600600	青岛啤酒	119,719,723.18	3.29
3	601018	宁波港	90,053,986.79	2.47
4	600100	同方股份	85,988,099.10	2.36
5	002214	大立科技	78,087,513.00	2.14
6	600329	中新药业	69,900,569.32	1.92
7	600198	大唐电信	69,087,889.11	1.90
8	600582	天地科技	63,553,535.03	1.75
9	600195	中牧股份	62,636,428.87	1.72
10	601166	兴业银行	60,134,625.75	1.65
11	600570	恒生电子	58,610,525.25	1.61
12	600900	长江电力	57,065,302.29	1.57
13	002001	新和成	53,218,772.91	1.46
14	000061	农产品	52,615,930.39	1.45
15	600880	博瑞传播	49,694,394.53	1.37
16	600292	九龙电力	48,274,423.08	1.33
17	002541	鸿路钢构	44,842,165.15	1.23
18	002161	远望谷	41,496,598.39	1.14
19	002185	华天科技	40,805,460.03	1.12
20	600704	物产中大	39,192,200.63	1.08

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	2,109,364,924.98
卖出股票收入(成交)总额	2,049,960,182.49

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	259,165,195.10	9.58
2	央行票据	374,621,000.00	13.85
3	金融债券	80,362,000.00	2.97
	其中:政策性金融债	80,362,000.00	2.97
4	企业债券	77,510,092.30	2.87
5	企业短期融资券	10,008,000.00	0.37
6	中期票据	-	-
7	可转债	31,938,000.00	1.18
8	其他	-	-
9	合计	833,604,287.40	30.82

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	010203	02国债(3)	885,050	88,637,757.50	3.28
2	010308	03国债(8)	622,230	62,353,668.30	2.31
3	1001032	10央票32	600,000	59,436,000.00	2.20
4	019120	11国债20	500,000	50,575,000.00	1.87
5	019113	11国债13	500,000	50,500,000.00	1.87

8.7 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

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

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 报告期内本基金投资的前十名证券中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。

8.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	2,591,669.93
2	应收证券清算款	9,989,717.48
3	应收股利	-
4	应收利息	11,407,459.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,988,847.17

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	113002	工行转债	31,938,000.00	1.18

8.9.5 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。

§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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
66,673	44,995.73	1,378,462,906.00	45.95%	1,621,537,094.00	54.05%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险(集团)公司	292,280,482.00	9.74%
2	中国人寿保险股份有限公司	195,225,064.00	6.51%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	160,509,024.00	5.35%
4	中国太平洋财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品-013C-CT001沪	107,999,932.00	3.60%
5	中国人寿保险股份有限公司	67,633,536.00	2.25%
6	UBS AG	55,452,833.00	1.85%
7	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	53,245,079.00	1.77%
8	幸福人寿保险股份有限公司-分红	51,708,751.00	1.72%
9	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	39,609,273.00	1.32%
10	中国财产再保险股份有限公司	38,869,337.00	1.30%

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

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《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》,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。

2.2011年2月26日在《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高级管理人员变更的公告》,公司第二届董事会任期届满,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。

3.2011年7月21日在《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离职及副总经理代行总经理职务的公告》,鉴于总经理熊科金同志因个人原因辞职,经银河基金管理有限公司第三届董事会审议,决定免去熊科金同志总经理职务,由副总经理尤象都同志代行总经理职务。

4.2011年12月17日在《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任职及督察长变更的公告》,根据《中华人民共和国公司法》及《公司章程》的有关规定,经第三届董事会第五次会议表决通过,决定聘任尤象都同志担任公司总经理,聘任李立生同志担任公司督察长。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动:

本基金托管人2011年2月9日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2011]115号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人2011年1月31日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。本基金托管人2011年10月24日发布任免通知,聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

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

报告期内无涉基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

本基金本期报告内应支付给安永华明会计师事务所的报酬为100,000.00元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供3年的审计服务。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
申银万国	1	1,599,133,560.28	40.19%	1,299,306.64	39.23%	-
中信证券	1	498,654,266.48	12.53%	423,855.66	12.80%	-
中金公司	1	419,949,356.00	10.56%	356,957.06	10.78%	-
银河证券	6	371,962,255.54	9.35%	310,987.90	9.39%	-
平安证券	1	345,565,786.83	8.69%	293,730.39	8.87%	-
兴业证券	2	238,155,158.30	5.99%	202,430.53	6.11%	-
国信证券	1	225,933,818.31	5.68%	192,039.86	5.80%	-
国泰君安	2	146,016,946.99	3.67%	124,114.47	3.75%	-
广发证券	1	74,701,967.09	1.88%	60,695.69	1.83%	-
东兴证券	1	29,504,331.60	0.74%	23,972.55	0.72%	-
民生证券	1	23,811,402.20	0.60%	19,346.86	0.58%	-
浙商证券	1	5,189,624.75	0.13%	4,411.18	0.13%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

注:本期新增东兴证券1个交易单元,民生证券1个交易单元,东吴证券1个交易单元。

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。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	118,394,211.00	33.15%	1,872,000,000.00	27.18%	-	-
中金公司	138,567,815.20	38.80%	1,705,100,000.00	24.76%	-	-
银河证券	-	-	425,000,000.00	6.17%	-	-
平安证券	-	-	865,000,000.00	12.56%	-	-
兴业证券	84,011,606.40	23.53%	850,000,000.00	12.34%	-	-
国信证券	14,430,497.90	4.04%	535,000,000.00	7.77%	-	-
国泰君安	1,701,297.40	0.48%	550,000,000.00	7.99%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	85,000,000.00	1.23%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

1.2011年10月28日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告,根据国家金融工作的需要,郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司(本行)董事会(董事会)提出辞呈,请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定,郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

2.2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

银河基金管理有限公司

2012年3月27日