

博时价值增长证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年 12 月 31 日

CR	医药、生物制品	107,322,153.30	0.69
C90	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	798,053,559.81	5.16
E	建筑业	30,956,409.00	0.20
F	交通运输、仓储业	58,168,558.77	0.38
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售业	876,918,765.98	5.67
I	金融、保险业	9,747,590.55	0.06
J	房地产业	1,360,250,000.00	8.79
K	社会服务业	177,787,519.52	1.15
L	传播与文化产业	42,207,588.00	0.27
M	综合类	-	-
	合计	6,180,726,958.36	39.96

A.3 前5名股东和公债持有人资产净值比例前4大股东的资产净值和股票投资情况					
序号	公债名称	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600031	三一重工	106,225,807	1,332,071,619.78	8.61
2	600048	保利地产	80,000,000	600,000,000.00	3.17
3	001913	永胜铝业	220,127,000	663,301,820.00	3.29
4	800052	万利A	75,000,000	560,200,000.00	2.82
5	002299	永安保险	21,161,784,282	312,188,075.88	0.16
6	600011	华联国际	57,306,242	368,588,794.70	1.98
7	000038	雅戈尔	2,272,285	229,077,292.50	1.08
8	000018	成发高科	5,468,168	196,252,449.52	1.27
9	002581	汇金股份	7,060,664	177,785,510.52	0.81
10	001985	金一文化	4,890,100	163,982,377.60	0.80

5.4 按资产类别将基金品种分类的资产投资组合			
序号	基金品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	605,100,000.00	3.90
2	央行票据	2,629,721,000.00	17.01
3	金融债券	3,934,404,000.00	25.44
	其中:政策性金融债	3,934,804,000.00	25.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	89,449,403.05	0.58
8	其他	-	-
9	合计	7,580,164,003.05	48.93

4.5 报告期内期末公允价值占净资产比例在10%以上的前5名金融资产投资情况					
序号	债券代码	债券名称	数量 (元)	公允价值 (元)	占基金净资产比例 (%)
1	1001070	10年国债70	12,000,000	1,183,480,000.00	7.65
2	110416	11农发16	7,000,000	717,920,000.00	4.68
3	1001074	10年国债74	7,000,000	690,690,000.00	4.47
4	110020	11年国债20	6,000,000	605,100,000.00	3.91
5	110229	11年国债29	5,000,000	501,250,000.00	3.24

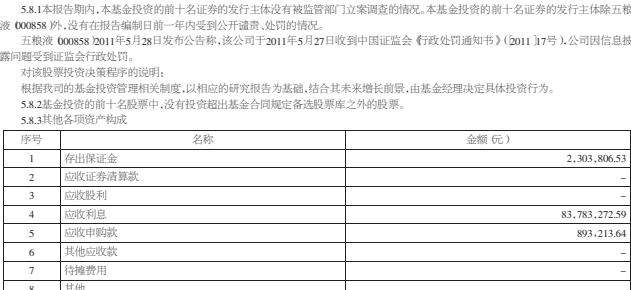
4.6 报告期内公允价值占净资产比例在10%以上的前5名资产投资情况

本基金本报告期末公允价值占净资产比例在10%以上的前5名资产投资情况

4.7 报告期内期末公允价值占净资产比例在10%以上的前5名权益投资情况

本基金本报告期末未持有权益。

4.8 报告期内衍生品投资



9	合计				86,800,292.76
5.8.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例 (%)	
1	113001	中行转债	89,449,035.00	0.58	
5.8.1报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值的比例 (%)	流通受限情况说明
1	002051	格力电器	177,787,519.52	1.15	资产重组
5.8.2 报告期末报告附注的其他文字描述部分					
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。					

九、开放式基金资产净值

56 召开股东大会会议变动		单位:元
本报告期前次募集资金总额		21,816,890,883.81
减:本报告期前次募集资金使用额		49,264,544.25
减:本报告期募集资金投资款总额		354,242,545.25
本报告期募集资金结存变动总额		
本报告期前次募集资金总额		21,511,932,683.51

[illegible]

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
	其中：政策性金融债	--	--
4	企业债券	--	--

5	企业年金基金			20,050,000.00	2.37
6	中期票据			--	--
7	可转债			--	--
8	其他			--	--
9	合计			20,050,000.00	2.37

5.3 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (元)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	1181172	11国开债CP01	200,000	20,050,000.00	2.37

5.6 报告期末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细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 报告期内本基金投资的前十名证券中的公允价值变动情况

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名证券中的公允价值变动情况

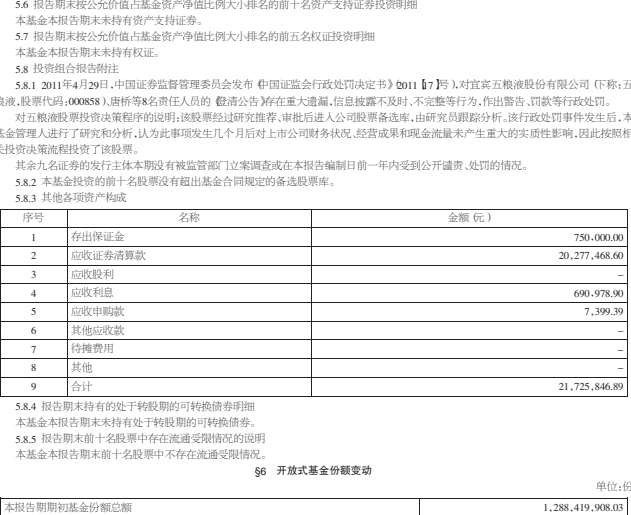
5.8.3 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票。

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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。



本报告期末基金申购份额	2,005,041.52
减：本报告期末基金赎回份额	381,264,628.88
本报告期末基金转分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	909,160,319.70

注：①. 本报告期末基金份额持有人结构：已赎回基金份额持有人比例0%。

57 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；
- 2、《银河沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《银河沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金管理人业务资格批复和证券投资基金托管协议；
- 6、托管协议；
- 7、基金管理人住所及基金管理人办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴基金广场6层。
- 8、基金管理人网址：www.gyfund.com.cn

投资者可到基金管理人办公地址免费查阅备查文件。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。

银河基金管理有限公司
二〇一七年十二月二十七日

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1181172	11道云港CP01	200,000	20,050,000.00	2.37

5.4 报告期内基金公司由基金管理人前十大排名的前十名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。

5.5 报告期内期末公允价值资产支持证券前十大排名的前十名公允价值投资明细

本基金本报告期末未持有公允价值。

5.6 投资组合情况

5.6.1 2014年1月1日至中国证券投资基金业协会公布《中国证监会行政处罚决定书》[2014]17号,对宜安五金粮油股份有限公司(下称“宜安”,股票代码:000858)等相关责任人(下称“被调查公司”)在重大违法、信息披露不及时、不合规等方面,作出警告、罚款等行政处罚。对宜安被调查责任人作出行政处罚,该事项经公司董事会、监事会、股东大会审议通过,并经中国证监会立案调查,中国证监会作出行政处罚决定,本基金管理人进行了充分研究分析,认为此事发生几个月后,上市公司财务状况、经营成果和现金流量未发生重大负面影响,因此按照投资协议继续持有该资产支持证券。

其余公允价值资产支持证券均就监管部门立案调查或在报告编制日的一年内受到公开谴责、处罚。

5.6.2 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。

5.6.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	20,677,468.60
3	应收股利	0.00
4	应收利息	0.00
5	应收申购款	7,390.39
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	21,725,846.80

5.6.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.6.5 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 封闭式基金参与融资融券

本报告期前十大基金份数持有	单位:份
本报告期前十大基金份数持有	1,288,419,908.03

本报告期末基金申购份额	2,005,041.52
减：本报告期末基金赎回份额	381,264,628.88
本报告期末基金转分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	909,160,319.70

注：①. 本报告期末基金份额持有人结构：已赎回基金份额持有人比例0%。

57 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；
- 2、《银河沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《银河沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金管理人业务资格批复和证券投资基金托管协议；
- 6、存查地点

基金合同、基金招募说明书及基金管理人办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴基金广场6层。

7.2 查阅方式

投资者可至基金管理人办公地址免费查阅备查文件。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。

银河基金管理有限公司
二〇一七年十二月二十七日

农银汇理基金管理有限公司
二〇一二年一月二十日