

银河银泰理财分红证券投资基金 2010 年年度报告

2010 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 3 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	51

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	52
8.9 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息.....	53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	53
§10 开放式基金份额变动.....	53
§11 重大事件揭示.....	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
11.2 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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	错误！未定义书签。
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	错误！未定义书签。
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	57
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河银泰理财分红证券投资基金
基金简称	银河银泰混合
基金主代码	150103
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
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,168,198,076.18 份

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>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、资金供求因素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间的投资比例，确定风格资产、行业资产的投资比例布局。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将在投资风险控制计划的指导下，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，主要投资于经评估或预期认为具有可持续发展能力的价值型股票和成长型股票，同时兼顾较高的流动性要求。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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判断，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回报。</p>
业绩比较基准	上证A股指数×40%+中信全债指数×55%+金融同业存款利率×5%。
风险收益特征	本基金属于风险较低的投资品种，风险-收益水平介于债券基金与股票基金之间

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李昇	蒋松云
	联系电话	021-38568808	010-66105799
	电子邮箱	lisheng@galaxyasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95588
传真		021-38568501	010-66105798
注册地址		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 55 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 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		李锡奎	姜建清

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、北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
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、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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	441,485,528.27	534,173,206.24	-1,559,848,315.84
本期利润	619,683,402.86	1,274,800,561.91	-2,277,178,748.51
加权平均基金份额本期利润	0.1727	0.3194	-0.5191
本期加权平均净值利润率	17.73%	40.46%	-65.82%
本期基金份额净值增长率	18.51%	51.60%	-45.57%

3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	-202,828,766.87	-712,994,982.71	-1,628,597,868.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0640	-0.1909	-0.3890
期末基金资产净值	3,477,942,012.25	3,459,907,821.91	2,558,369,108.11
期末基金份额净值	1.0978	0.9263	0.6110
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	305.34%	242.02%	125.60%

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、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。

3.2 基金净值表现

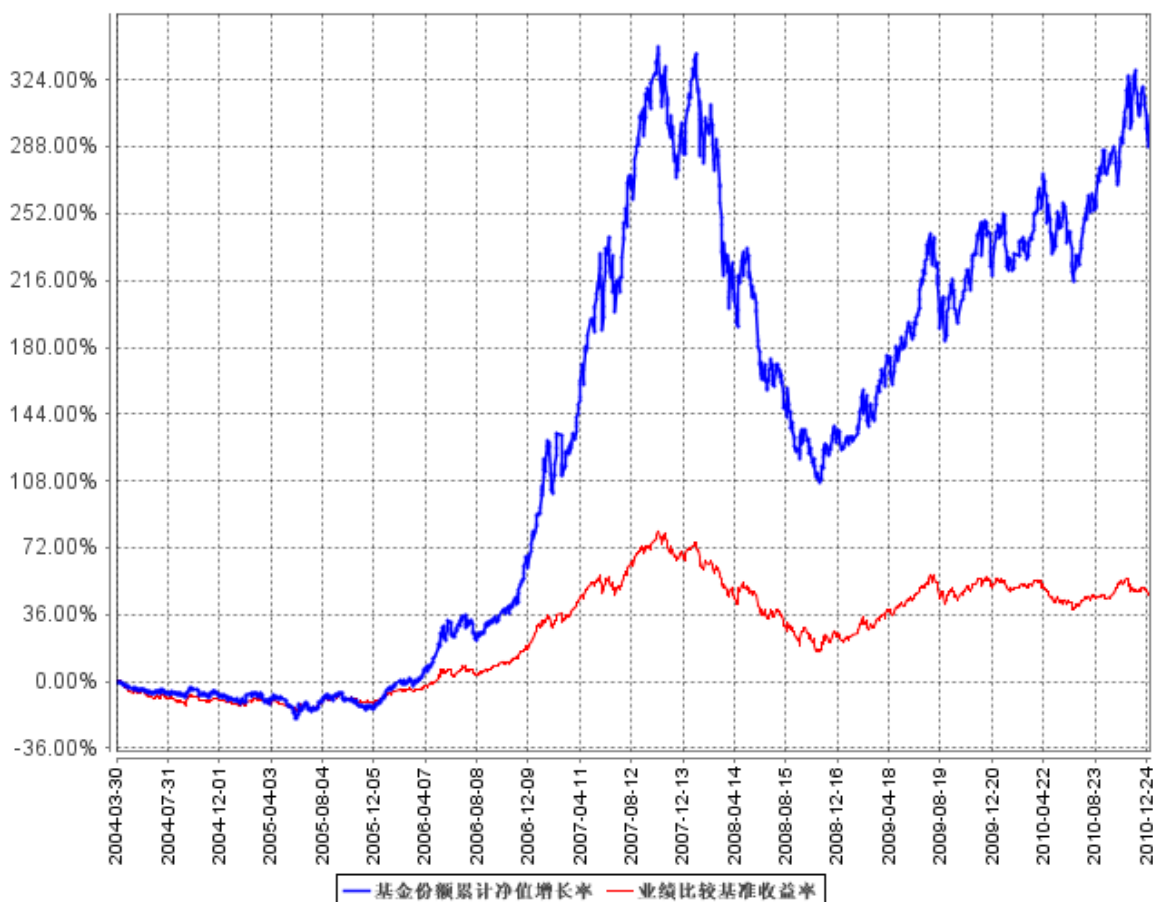
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.28%	1.49%	1.42%	0.64%	4.86%	0.85%
过去六个月	24.72%	1.27%	6.24%	0.56%	18.48%	0.71%
过去一年	18.51%	1.24%	-4.43%	0.57%	22.94%	0.67%
过去三年	-2.21%	1.54%	-13.60%	0.86%	11.39%	0.68%
过去五年	341.73%	1.56%	61.97%	0.82%	279.76%	0.74%
自基金合同生效日起至 今	305.34%	1.40%	48.50%	0.76%	256.84%	0.64%

注：本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数×40%+中信全债指数×55%+金融同业存款利率×5%，每日进行再平衡过程。

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

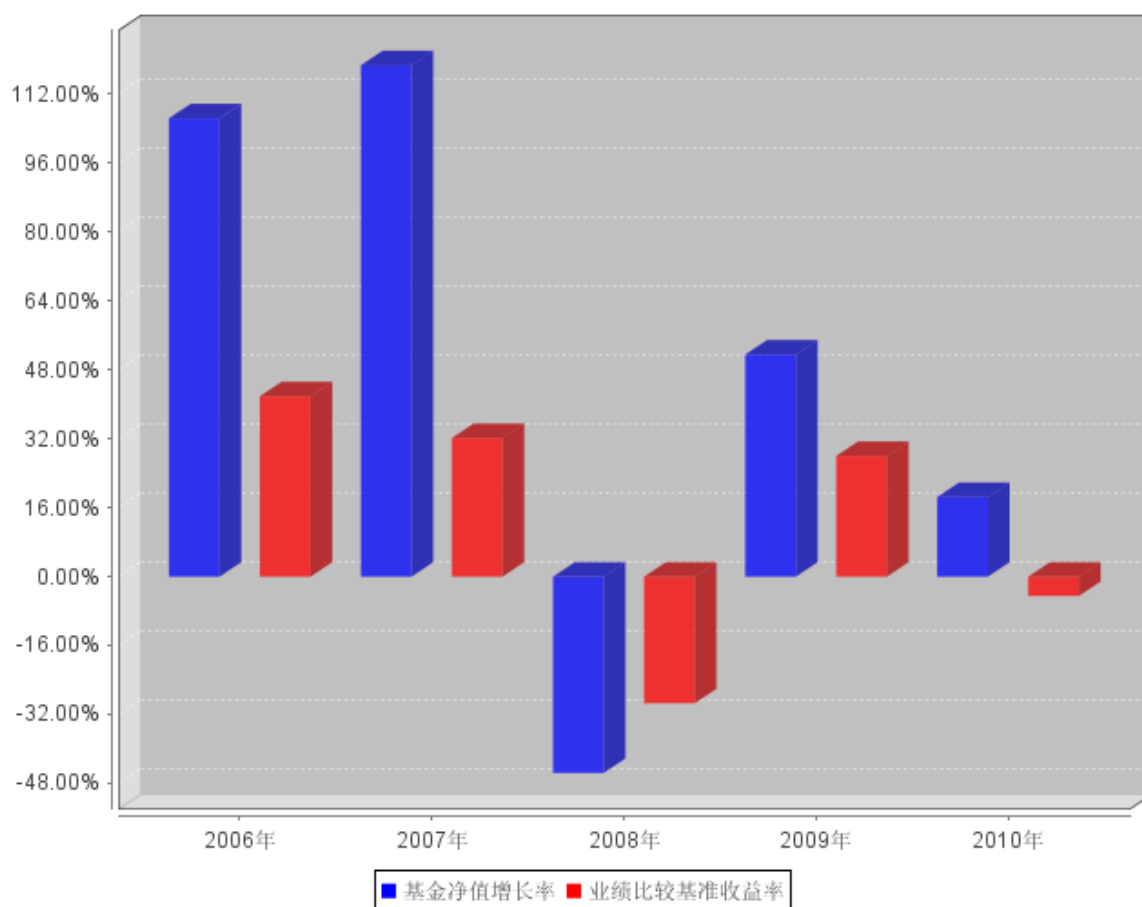
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：2004 年 3 月 30 日本基金成立，根据《银河银泰理财分红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。

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

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对比图



3.3 其他指标

无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

过往三年基金已实现净收益为负，无应分配利润。

§ 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、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 8 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。

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。

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		
刘风华	银河银泰理财分红证券投资基金的基金经理、研究部总监	2007 年 1 月 15 日	-	13	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、银丰证券投资基金基金经理助理等职务，目前兼任研究部总监。
徐小勇	银河银泰理财分红证券投资基金的基金经理	2008年8月14日	2010年4月29日	16	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、银河银泰理财分红证券投资基金基金经理助理、银河银泰理财分红证券投资基金基金经理等职务。

注：1、上表中任职，离任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合规守信情况的说明

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。本报告期内，由于系统故障原因，本基金参与“正泰电器”申购未能成功，基金管理人对上述行为而给基金资产造成的损失进行了补偿，对基金份额持有人利益未造成损害。

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，为基金份额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

银河银泰理财分红证券投资基金（以下简称“银河银泰混合”）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

与银河银泰混合基金投资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”）、银丰证券投资基金（以下简称“银河银丰封闭”）。银河银泰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
2010 年	银河银泰混合	18.51%
	银河稳健混合	6.77%
	银河银丰封闭	3.05%

注：银河银泰混合与银河银丰封闭、银河稳健混合本年度净值增长率差异分别为 15.55%和 11.44%，主要原因为银河银泰混合在本年度对地产、食品饮料、医药等行业有着较好的判断，在大消费行业和新兴产业进行了重点配置，取得了明显超额收益，对业绩贡献较大；另外，在风格资产配置及仓位的转换上，均进行了良好的把握，综上所述导致各基金收益率有所差异。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

异常交易行为的专项说明：银河银泰混合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

2010 年 A 股市场呈现先抑后扬又再度回落的走势，符合我们对 2010 年市场将呈现宽幅震荡的判断。2010 年上半年市场回落原因在于政策紧缩预期和房地产调控，下半年市场回暖一方面是美国启动二次定量宽松政策，海外股市及大宗商品市场上涨带动 A 股反弹，另一方面是经济出现环比回升势头，对经济二次探底的悲观情绪得到修正。但到了四季度，随着通胀的抬头，政策紧缩预期再现，A 股再度出现急剧回落。

整体来看，上证指数全年下跌约 14.3%，但在整体弱市中结构性机会众多，转型经济预期下 A 股呈现出明显的中小盘行情和追逐新兴产业股票的结构行情。分行业来看，消费及科技类股票

表现强劲，电子元器件、信息服务、医药生物、食品饮料、机械设备等行业涨幅居前，而黑色金属、采掘和金融地产等周期类及权重股跌幅最大。从市场风格来看，2010 年中小盘股明显强于大盘股，中小板指数全年上涨了 18.6%。

2010 年海外市场走势大幅强于 A 股市场，其中美国股市持续走强，道指全年上涨约 11%。全球经济复苏之路出现分化，欧美国家经济逐步复苏，其继续执行宽松货币政策刺激经济，大宗商品价格也从底部显著回升。同期，新兴市场国家因通胀压力不断增大，纷纷执行加息等“退出”政策，导致新兴市场股票在 2010 年下半年出现回落。

2010 年我们基于对中国经济进入转型期的认识，一定程度上回避了传统行业，同时加大了对消费和新兴产业行业的投资力度，并通过精选个股实现超额收益，较好的把握了 A 股结构性机会，基金业绩表现良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年银泰业绩比较基准收益率为-4.47%，银泰净值增长率为 18.51%，业绩高于基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年 A 股市场面临着“保增长”和“抑通胀”的复杂环境。中国经济将继续行进在转型的道路上，“十二五”期间，中国经济增长将从“出口-投资”拉动，转向靠“内需投资与消费”双轮驱动，我们对中国经济的长期发展前景依然充满信心。但短期从通胀的角度来看，2011 年政府政策基本取向是稳中偏紧，并有进一步调控房地产的可能性，流动性能否转向需要我们进一步的观察；此外，上市公司盈利增速将较 2010 年有一定幅度回落，股票市场的供给会继续加大。目前 A 股总体估值水平较为合理，但结构性差异较大。2011 年的 A 股市场可能将继续在政策与经济增强的博弈下呈现宽幅震荡行情，市场在通胀明显回落、经济增长回升势头明显的预期下才会出现显著的趋势性行情。

2011 年我们的投资策略将继续在波动的市场中保持灵活的股票仓位，我们将努力把握未来几年中国经济增长的主要驱动因素，一方面继续在医药、消费以及新兴产业领域里寻找能够长期高速增长的公司，并在合理的估值水平买入；另一方面我们会结合政策、经济、估值及流动性等因素尽力把握周期性行业的阶段性投资机会。此外，2011 年我们也会关注“十二五”规划、先进装备制造、西藏和新疆等区域经济、节能环保车、农业及 EMV 迁移等等一系列主题投资机会

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照现代企业制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，认真贯彻了独立董事制度，重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意，保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续严格遵守《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定的回报。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止 2010 年 12 月 31 日，基金已实现净收益为负，无应分配利润。

§ 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

2010 年，本托管人在对银河银泰理财分红证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

2010 年，银河银泰理财分红证券投资基金的管理人——银河基金管理有限公司在银河银泰理财分红证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作基本按照有关法律法规、基金合同的规定进行。本报告期内，银河银泰理财分红证券投资基金未进行利润分配。

2010 年，银河银泰理财分红证券投资基金出现过新股申购无效的情况，我行及时向银河基金管理有限公司发送提示函件，银河基金管理有限公司在规定时间内及时对投资组合进行披露或调整，相关损失已足额补偿。

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

本托管人依法对银河基金管理有限公司编制和披露的银河银泰理财分红证券投资基金 2010 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	60821717_B06

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河银泰理财分红证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的银河银泰理财分红证券投资基金财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表和 2010 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银河基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银河银泰理财分红证券投资基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	中国注册会计师徐 艳 中国注册会计师蒋燕华
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
审计报告日期	2011 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银河银泰理财分红证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	23,805,003.04	566,408,718.67
结算备付金		6,298,070.07	10,384,142.66
存出保证金		1,848,780.49	2,885,081.41
交易性金融资产	7.4.7.2	3,586,675,621.91	3,558,151,766.12
其中：股票投资		2,714,513,597.11	2,726,324,844.72
基金投资		-	-
债券投资		872,162,024.80	831,826,921.40
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		25,000,000.00	-
应收利息	7.4.7.5	19,189,590.53	18,025,907.59
应收股利		-	-
应收申购款		1,514,690.75	13,650.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,664,331,756.79	4,155,869,267.23
负债和所有者权益	附注号	本期期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		165,000,000.00	642,799,053.30
应付证券清算款		8,799,675.44	38,604,656.16
应付赎回款		1,913,824.77	3,744,374.81
应付管理人报酬		4,508,550.16	4,374,287.98
应付托管费		751,425.03	729,047.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,907,395.24	3,392,538.34
应交税费		266,654.40	257,406.40
应付利息		60,489.94	32,792.47

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,181,729.56	2,027,287.89
负债合计		186,389,744.54	695,961,445.32
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,168,198,076.18	3,735,208,949.44
未分配利润	7.4.7.10	309,743,936.07	-275,301,127.53
所有者权益合计		3,477,942,012.25	3,459,907,821.91
负债和所有者权益总计		3,664,331,756.79	4,155,869,267.23

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0978 元，基金份额总额 3,168,198,076.18 份。

7.2 利润表

会计主体：银河银泰理财分红证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		699,666,814.22	1,360,541,121.20
1. 利息收入		31,035,891.16	31,017,266.16
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	1,608,721.75	1,619,280.45
债券利息收入		29,244,481.38	29,397,985.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		182,688.03	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		489,808,315.84	588,305,761.95
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	474,164,815.96	568,829,997.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	663,131.48	2,920,532.74
资产支持证券投资收益	7.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 5	-	551,784.42
股利收益	7.4.7.1 6	14,980,368.40	16,003,447.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 7	178,197,874.59	740,627,355.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 8	624,732.63	590,737.42
减：二、费用		79,983,411.36	85,740,559.29
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	52,445,576.85	46,961,722.72
2. 托管费	7.4.10. 2.2	8,740,929.40	7,826,953.74
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.1 9	16,701,688.17	28,793,152.94
5. 利息支出		1,698,741.37	1,759,739.07
其中：卖出回购金融资产支出		1,698,741.37	1,759,739.07
6. 其他费用	7.4.7.2 0	396,475.57	398,990.82
三、利润总额		619,683,402.86	1,274,800,561.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		619,683,402.86	1,274,800,561.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河银泰理财分红证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	3,735,208,949.44	-275,301,127.53	3,459,907,821.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	619,683,402.86	619,683,402.86
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）	-567,010,873.26	-34,638,339.26	-601,649,212.52
其中：1. 基金申购款	262,128,665.61	1,027,055.97	263,155,721.58
2. 基金赎回款	-829,139,538.87	-35,665,395.23	-864,804,934.10
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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	3,168,198,076.18	309,743,936.07	3,477,942,012.25
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	4,186,966,976.46	-1,628,597,868.35	2,558,369,108.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,274,800,561.91	1,274,800,561.91
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)	-451,758,027.02	78,496,178.91	-373,261,848.11
其中：1.基金申购款	52,638,135.46	-10,692,055.21	41,946,080.25
2.基金赎回款	-504,396,162.48	89,188,234.12	-415,207,928.36
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,735,208,949.44	-275,301,127.53	3,459,907,821.91

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：

<u>熊科金</u>	<u>熊科金</u>	<u>董伯儒</u>
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

银河银泰理财分红证券投资基金(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 2004 12 号文《关于同意银河银泰理财分红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 2004 年 3 月 30 日正式生效,首次设立募集规模为 6,013,222,027.96 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及注册登记机构为银河基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法公开发行上市的具有良好流动性的债券、股票、央行票据、

回购等金融工具，以及未来法律法规和中国证监会许可的其他金融工具。其中，债券投资包括国债、金融债、信用评级在投资级以上的企业债（包含可转换公司债券）等。

本基金资产配置比例的基本范围是：股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；国债的比例不低于基金资产净值的 20%。

本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数×40%+中信全债指数×55%+金融同业存款利率×5%。

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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民

币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入

方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(3) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

(4) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(5) 在符合上述有关基金分红条件的前提下，如果已经实现收益，则本基金可进行多次分红；

(6) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红

利按红利发放日的单位基金资产净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认为的收益分配方式是现金红利；

(7) 收益分配比例不低于基金净收益的 90%；

(8) 基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益可不分配。

7.4.4.12 分部报告

-

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	23,805,003.04	566,408,718.67
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	23,805,003.04	566,408,718.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,137,526,837.56	2,714,513,597.11	576,986,759.55
债券	交易所市场	239,340,855.75	244,218,024.80
	银行间市场	642,372,841.85	627,944,000.00
	合计	881,713,697.60	872,162,024.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,019,240,535.16	3,586,675,621.91	567,435,086.75
项目	上年度末 2009年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,343,174,073.47	2,726,324,844.72	383,150,771.25
债券	交易所市场	253,166,318.64	260,303,921.40
	银行间市场	572,574,161.85	571,523,000.00
	-	-	-
合计	825,740,480.49	831,826,921.40	6,086,440.91
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,168,914,553.96	3,558,151,766.12	389,237,212.16

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金期末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 20,09年12月31日
应收活期存款利息	9,548.91	25,222.23
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	2,204.30	3,634.50

应收债券利息	19,177,802.72	17,997,016.26
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	34.60	34.60
合计	19,189,590.53	18,025,907.59

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,906,190.24	3,387,169.09
银行间市场应付交易费用	1,205.00	5,369.25
合计	2,907,395.24	3,392,538.34

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00	1,500,000.00
应付赎回费	350.72	2,019.54
应付后端申购费	1,378.84	11,268.35
预提审计费用	70,000.00	70,000.00
预提信息披露费	360,000.00	360,000.00
其他	-	84,000.00
合计	2,181,729.56	2,027,287.89

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,735,208,949.44	3,735,208,949.44
本期申购	262,128,665.61	262,128,665.61
本期赎回 (以“-”号填列)	-829,139,538.87	-829,139,538.87
_年_月_日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	3,168,198,076.18	3,168,198,076.18

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	-712,994,982.71	437,693,855.18	-275,301,127.53
本期利润	441,485,528.27	178,197,874.59	619,683,402.86
本期基金份额交易产生的变动数	68,680,687.57	-103,319,026.83	-34,638,339.26
其中：基金申购款	-36,464,404.69	37,491,460.66	1,027,055.97
基金赎回款	105,145,092.26	-140,810,487.49	-35,665,395.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-202,828,766.87	512,572,702.94	309,743,936.07

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,541,858.29	1,505,012.49
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	64,932.70	113,006.05
其他	1,930.76	1,261.91
合计	1,608,721.75	1,619,280.45

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010	2009 年 1 月 1 日至 2009

	年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,778,930,213.26	9,507,866,781.55
卖出股票成本总额	5,304,765,397.30	8,939,036,784.37
买卖股票差价收入	474,164,815.96	568,829,997.18

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年 12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	228,859,193.49	540,925,341.02
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	224,426,614.49	526,407,628.16
减：应收利息总额	3,769,447.52	11,597,180.12
债券投资收益	663,131.48	2,920,532.74

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
卖出权证成交总额	-	1,550,228.58
减：卖出权证成本总额	-	998,444.16
买卖权证差价收入	-	551,784.42

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
股票投资产生的股利收益	14,980,368.40	16,003,447.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	14,980,368.40	16,003,447.61

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010 年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年 12月31日
1. 交易性金融资产	178,197,874.59	740,627,355.67
——股票投资	193,835,988.30	768,256,076.92
——债券投资	-15,638,113.71	-27,628,721.25
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	178,197,874.59	740,627,355.67

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
基金赎回费收入	592,899.83	579,998.85
其他	11,510.40	-
印花税手续费返还	13,734.66	5,362.37
转换费收入	6,587.74	5,376.20
合计	624,732.63	590,737.42

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
交易所市场交易费用	16,700,438.17	28,788,102.94
银行间市场交易费用	1,250.00	5,050.00
合计	16,701,688.17	28,793,152.94

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
回购交易费用	0.00	-
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
资金汇划费	8,475.57	10,990.82
合计	396,475.57	398,990.82

7.4.7.21 分部报告

-

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司	基金管理人的股东
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
上海市城市建设投资开发总公司	基金管理人的股东
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	受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	1,387,009,250.37	12.89	4,733,006,652.10	25.04

7.4.10.1.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	-	-	31,155,158.55	30.50

7.4.10.1.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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 (%)	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
银河证券	65,000,000.00	3.24	1,032,900,000.00	29.34

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年可比期间未发生关联方权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
银河证券	1,130,027.79	12.63	130,582.07	4.49
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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 (%)
银河证券	3,989,869.61	25.19	550,396.29	16.25

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	52,445,576.85	46,961,722.72
其中：支付给销售机构的客户维护费	13,184,113.93	13,846,491.17

注：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：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

2010年末未支付管理费余额：4,508,550.16元，2009年末未支付管理费余额：4,374,287.98元

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,740,929.40	7,826,953.74

注：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：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

2010 年末未支付托管费余额：751,425.03 元，2009 年末未支付托管费余额：729,047.97 元

7.4.10.3 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 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
工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 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
工商银行	30,262,211.10	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

2010 年度及 2009 年度基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2010 年年末及 2009 年年末均未投资本基金。

7.4.10.5 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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	23,805,003.04	1,541,858.29	566,408,718.67	1,505,012.49

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于 2010 年度及 2009 年度均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金 2010 年度未进行利润分配。

7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300125	易世达	2010年9月27日	2011年1月13日	新股流通受限	55.00	83.49	37,672	2,071,960.00	3,145,235.28	
601118	海南橡胶	2010年12月30日	2011年4月7日	新股流通受限	5.99	5.99	492,618	2,950,781.82	2,950,781.82	
601933	永辉超市	2010年12月9日	2011年3月15日	新股流通受限	23.98	31.24	49,465	1,186,170.70	1,545,286.60	
601126	四方股份	2010年12月28日	2011年3月31日	新股流通受限	23.00	31.11	21,586	496,478.00	671,540.46	

该可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 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
600315	上海家化	2010年12月6日	重大事项公告	37.13	-	-	3,335,409	108,357,996.81	123,843,736.17	
300113	顺网科技	2010年12月13日	重大事项公告	69.40	2011年1月31日	75.98	28,644	1,231,119.12	1,987,893.60	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 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 40,000,000.00 元、50,000,000.00 元、50,000,000.00 元及

25,000,000.00 元，分别于 2011 年 1 月 4 日、1 月 6 日及 1 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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，因此除在附注十一中列示的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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	23,805,003 .04	-	-	-	-	-	-	-	-	23,805 ,003.0 4
结算备付金	6,298,070. 07	-	-	-	-	-	-	-	-	6,298, 070.07
存出保证金	98,780.49	-	-	-	-	-	-	-	1,750,000.0 0	1,848, 780.49
交易性金融资 产	-	158,881,00 0.00	-	525,772,7 39.20	-	-	183,915,9 00.00	3,592,385. 60	2,714,513,5 97.11	3,586, 675,62 1.91
应收证券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	-	25,000,000. 00	25,000 ,000.0 0
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	19,189,590. 00	19,189 ,590.00

										53,590.53
应收申购款	5,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	1,509,690.75
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,206,853.60	158,881,000.00	-	-525,772,739.20	-	-	-183,915,900.00	3,592,385.60	2,761,962,878.39	3,664,331,756.79
负债										
卖出回购金融资产款	165,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	165,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-8,799,675.44	8,799,675.44
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-1,913,824.77	1,913,824.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	-4,508,550.16	4,508,550.16
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	-751,425.03	751,425.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-2,907,395.24	2,907,395.24
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-60,489.94	60,489.94
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-266,654.40	266,654.40
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-2,181,729.56	2,181,729.56
负债总计	165,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-21,389,744.54	186,389,744.54
利率敏感度缺口	-134,793,146.40	158,881,000.00	-	-525,772,739.20	-	-	-183,915,900.00	3,592,385.60	2,740,573,133.85	3,477,942,012.25
上年度末 2009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	566,408,718.67	-	-	-	-	-	-	-	-	566,408,718.67
结算备付金	10,384,142.66	-	-	-	-	-	-	-	-	10,384,142.66

存出保证金	98,780.49	-	-	-	-	-	-	-	2,786,300.92	2,885,081.41
交易性金融资产	49,835,000.00	30,097,000.00	-96,004,274.20	-	-	-	651,815,195.20	4,075,448.00	2,726,324.84	3,558,151.76
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	18,025,907.59	18,025,907.59
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	13,650.78	13,650.78
资产总计	626,726,641.82	30,097,000.00	-96,004,278.20	-	-	-	651,815,195.20	4,075,448.00	2,747,150.74	4,155,869.26
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	642,799,053.30	-	-	-	-	-	-	-	-	642,799,053.30
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	38,604,656.16	38,604,656.16
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	3,744,374.81	3,744,374.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	4,374,287.98	4,374,287.98
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	729,047.97	729,047.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	3,392,538.34	3,392,538.34
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	32,792.47	32,792.47
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	257,406.40	257,406.40
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	2,027,287.89	2,027,287.89
负债总计	642,799,053.30	-	-	-	-	-	-	-	53,162,392.02	695,961,445.32
利率敏感度缺口	-16,072,411.48	30,097,000.00	-96,004,278.20	-	-	-	651,815,195.20	4,075,448.00	2,693,988.31	3,459,907.82

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、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。		
	2、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。		
	3、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（2010 年 12 月 31 日）	上年度末（2009 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,527,462.06	2,541,647.16
市场利率上升 25 个基点	-1,527,462.06	-2,541,647.16	

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 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—债券投资	872,162,024.80	25.08	831,826,921.40	24.04
合计	872,162,024.80	25.08	831,826,921.40	24.04

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、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。		
	2、假定上证 A 股指数变化 5，其他市场变量均不发生变化。		
	3、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（2010年12月31日）	上年度末（2009年12月31日）
	上证 A 股指数上升 5%	114,587,861.97	145,395,886.79
	上证 A 股指数下降 5%	-114,587,861.97	-145,395,886.79

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

-

§ 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	2,714,513,597.11	74.08
	其中：股票	2,714,513,597.11	74.08
2	固定收益投资	872,162,024.80	23.80
	其中：债券	872,162,024.80	23.80
	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	30,103,073.11	0.82
6	其他各项资产	47,553,061.77	1.30
7	合计	3,664,331,756.79	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	91,351,781.82	2.63
B	采掘业	140,863,933.13	4.05
C	制造业	1,811,224,678.84	52.08
C0	食品、饮料	463,732,789.80	13.33
C1	纺织、服装、皮毛	37,870,453.12	1.09
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	186,473,498.02	5.36

C5	电子	138,046,976.30	3.97
C6	金属、非金属	38,796,710.10	1.12
C7	机械、设备、仪表	262,785,643.13	7.56
C8	医药、生物制品	581,734,338.97	16.73
C99	其他制造业	101,784,269.40	2.93
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,838,200.00	0.71
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	401,502,722.92	11.54
H	批发和零售贸易	94,406,230.62	2.71
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	30,900,000.00	0.89
K	社会服务业	115,899,226.78	3.33
L	传播与文化产业	3,526,823.00	0.10
M	综合类	-	-
	合计	2,714,513,597.11	78.05

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	000596	古井贡酒	3,454,868	277,080,413.60	7.97
2	000423	东阿阿胶	2,709,876	138,474,663.60	3.98
3	600315	上海家化	3,335,409	123,843,736.17	3.56
4	000568	泸州老窖	2,799,923	114,516,850.70	3.29
5	002161	远望谷	3,023,264	105,542,146.24	3.03
6	000522	白云山A	5,948,601	101,840,049.12	2.93
7	300015	爱尔眼科	2,141,310	94,731,554.40	2.72
8	600460	士兰微	4,000,000	91,560,000.00	2.63
9	600198	大唐电信	4,589,114	90,084,307.82	2.59
10	600588	用友软件	3,499,948	81,408,790.48	2.34
11	002017	东信和平	3,006,861	76,374,269.40	2.20
12	002223	鱼跃医疗	1,490,050	75,083,619.50	2.16
13	002038	双鹭药业	1,250,000	73,750,000.00	2.12
14	600750	江中药业	1,999,980	72,059,279.40	2.07
15	600559	老白干酒	1,656,232	62,357,134.80	1.79
16	600718	东软集团	3,862,185	61,949,447.40	1.78
17	600276	恒瑞医药	1,002,000	59,679,120.00	1.72
18	002262	恩华药业	2,267,458	53,738,754.60	1.55

19	600587	新华医疗	1,770,924	49,638,999.72	1.43
20	000998	隆平高科	1,500,000	48,855,000.00	1.40
21	002215	诺普信	1,379,581	48,133,581.09	1.38
22	000661	长春高新	704,468	42,831,654.40	1.23
23	002041	登海种业	600,000	39,546,000.00	1.14
24	600267	海正药业	1,000,000	38,480,000.00	1.11
25	002236	大华股份	453,785	38,063,485.80	1.09
26	002340	格林美	591,121	37,518,449.87	1.08
27	002029	七匹狼	1,085,728	35,872,453.12	1.03
28	600031	三一重工	1,600,000	34,608,000.00	1.00
29	600693	东百集团	2,926,633	34,358,671.42	0.99
30	000960	锡业股份	999,981	32,699,378.70	0.94
31	600436	片仔癀	441,117	32,113,317.60	0.92
32	002230	科大讯飞	400,000	31,600,000.00	0.91
33	600383	金地集团	5,000,000	30,900,000.00	0.89
34	002353	杰瑞股份	209,000	29,861,920.00	0.86
35	601699	潞安环能	499,913	29,814,811.32	0.86
36	600089	特变电工	1,499,981	27,989,645.46	0.80
37	002104	恒宝股份	1,500,000	25,410,000.00	0.73
38	002310	东方园林	180,000	24,838,200.00	0.71
39	600123	兰花科创	500,000	23,540,000.00	0.68
40	600312	平高电气	1,499,892	20,443,527.96	0.59
41	600997	开滦股份	999,938	20,128,751.94	0.58
42	600479	千金药业	999,905	18,368,254.85	0.53
43	300045	华力创通	399,948	16,517,852.40	0.47
44	002013	中航精机	499,960	16,268,698.40	0.47
45	300144	宋城股份	199,990	11,257,437.10	0.32
46	002430	杭氧股份	284,690	9,907,212.00	0.28
47	600570	恒生电子	430,510	8,717,827.50	0.25
48	002123	荣信股份	182,178	8,653,455.00	0.25
49	600335	鼎盛天工	499,645	8,244,142.50	0.24
50	601766	中国南车	999,947	7,549,599.85	0.22
51	300055	万邦达	50,000	6,765,000.00	0.19
52	600305	恒顺醋业	349,920	6,571,497.60	0.19
53	002167	东方锆业	139,057	6,491,180.76	0.19
54	002493	荣盛石化	100,000	6,396,000.00	0.18
55	600261	浙江阳光	150,000	6,346,500.00	0.18
56	002428	云南锆业	84,020	6,097,331.40	0.18
57	300022	吉峰农机	147,434	4,717,888.00	0.14

58	600332	广州药业	200,000	4,138,000.00	0.12
59	002405	四维图新	67,838	3,694,457.48	0.11
60	300058	蓝色光标	99,910	3,526,823.00	0.10
61	000019	深深宝 A	299,990	3,206,893.10	0.09
62	300125	易世达	37,672	3,145,235.28	0.09
63	601118	海南橡胶	492,618	2,950,781.82	0.08
64	000157	中联重科	150,352	2,125,977.28	0.06
65	002484	江海股份	66,815	2,051,220.50	0.06
66	600763	通策医疗	100,000	1,998,000.00	0.06
67	300113	顺网科技	28,644	1,987,893.60	0.06
68	002256	彩虹精化	100,000	1,609,000.00	0.05
69	300099	尤洛卡	14,100	1,590,480.00	0.05
70	601933	永辉超市	49,465	1,545,286.60	0.04
71	601126	N 四方	21,586	671,540.46	0.02
72	002503	搜于特	500	45,630.00	0.00
73	002528	英飞拓	500	25,770.00	0.00
74	002529	海源机械	500	10,745.00	0.00

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	600309	烟台万华	136,541,932.83	3.95
2	600588	用友软件	113,713,732.55	3.29
3	000522	白云山 A	113,486,118.38	3.28
4	600030	中信证券	109,973,108.72	3.18
5	600315	上海家化	108,357,996.81	3.13
6	600997	开滦股份	103,938,990.07	3.00
7	601288	农业银行	93,800,000.00	2.71
8	600198	大唐电信	93,490,419.57	2.70
9	000423	东阿阿胶	92,153,334.65	2.66
10	600125	铁龙物流	84,367,386.51	2.44
11	300015	爱尔眼科	84,111,104.52	2.43
12	600460	士兰微	82,721,464.57	2.39
13	600123	兰花科创	78,856,032.03	2.28

14	002017	东信和平	75,627,472.02	2.19
15	002415	海康威视	73,101,270.14	2.11
16	600521	华海药业	71,464,752.75	2.07
17	002161	远望谷	69,074,462.22	2.00
18	600383	金地集团	69,062,220.27	2.00
19	002215	诺普信	68,995,491.99	1.99
20	002230	科大讯飞	66,802,611.93	1.93

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	600570	恒生电子	171,409,346.89	4.95
2	000157	中联重科	158,637,741.87	4.59
3	000060	中金岭南	146,483,890.18	4.23
4	000568	泸州老窖	137,364,449.23	3.97
5	601318	中国平安	127,819,470.49	3.69
6	002106	莱宝高科	120,524,181.87	3.48
7	600309	烟台万华	115,438,515.55	3.34
8	000612	焦作万方	114,460,555.52	3.31
9	600030	中信证券	103,681,550.93	3.00
10	000937	冀中能源	98,818,817.27	2.86
11	600997	开滦股份	98,686,394.21	2.85
12	600588	用友软件	94,399,842.22	2.73
13	601288	农业银行	94,230,000.00	2.72
14	002415	海康威视	90,857,767.74	2.63
15	600125	铁龙物流	89,756,833.57	2.59
16	002230	科大讯飞	85,149,443.22	2.46
17	600036	招商银行	84,927,194.89	2.45
18	000969	安泰科技	83,468,527.57	2.41
19	000983	西山煤电	82,007,555.80	2.37
20	000792	盐湖钾肥	80,950,542.34	2.34
21	600639	浦东金桥	79,207,491.11	2.29
22	600887	伊利股份	78,941,616.48	2.28
23	601717	郑煤机	72,705,181.83	2.10

24	600521	华海药业	69,426,382.25	2.01
25	000825	太钢不锈	69,371,107.82	2.00

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	5,099,118,161.39
卖出股票收入（成交）总额	5,778,930,213.26

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	217,687,152.20	6.26
2	央行票据	578,483,000.00	16.63
3	金融债券	29,571,000.00	0.85
	其中：政策性金融债	29,571,000.00	0.85
4	企业债券	23,482,385.60	0.68
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	22,938,487.00	0.66
N-1	其他	-	-
N	合计	872,162,024.80	25.08

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	0801062	08 央票 62	2,300,000	231,104,000.00	6.64
2	010203	02 国债(3)	552,340	55,234,000.00	1.59
3	010110	21 国债(00)	510,000	51,326,400.00	1.48
4	019804	08 国债 04	500,000	50,390,000.00	1.45
5	0801047	08 央票 47	500,000	50,195,000.00	1.44

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	1,848,780.49
2	应收证券清算款	25,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	19,189,590.53
5	应收申购款	1,514,690.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,553,061.77

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	113001	中行转债	20,780,019.00	0.60
2	110009	双良转债	2,158,468.00	0.06

8.9.5 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	600315	上海家化	123,843,736.17	3.56	临时停牌

注：本基金本报告期前十名股票中上海家化筹划国资改革事宜连续停牌。

§ 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		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
159,491	19,864.43	45,996,940.88	1.45%	3,122,201,135.30	98.55%

9.2 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	183,507.75	0.0058%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年3月30日）基金份额总额	6,013,222,027.96
本报告期期初基金份额总额	3,735,208,949.44
本报告期基金总申购份额	262,128,665.61
减：本报告期基金总赎回份额	829,139,538.87
本报告期末基金份额总额	3,168,198,076.18

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1、2010年4月30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调整基金经理的公告》，决定徐小勇先生不再担任银河银泰理财分红证券投资基金

基金经理，银河银泰混合基金由刘风华女士单独管理。

2、2010 年 5 月 8 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总经理变更的公告》，原总经理裴勇同志因工作调动原因，经第二届董事会第十三次会议审议通过，免去其所担任的总经理职务，聘任原副总经理熊科金同志担任公司总经理。

3、经证监会审批，晏秋生任资产托管部副总经理

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为统一公司和基金审计机构，提高审计效率，经公司董事会审议通过，本基金审计机构改聘为安永华明会计师事务所。本基金管理人已履行了必要的更换程序，并于 2010 年 2 月 3 日发布关于旗下基金改聘会计师事务所的公告。

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所的报酬为 70,000 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
银河证券	8	1,387,009,250.37	12.89%	1,130,027.79	12.63%	-
长城证券	3	1,113,379,321.03	10.35%	924,905.64	10.34%	-

华泰联合	3	1,062,747,855.34	9.88%	903,328.64	10.10%	-
光大证券	2	1,015,258,477.07	9.44%	862,966.25	9.65%	-
中金公司	2	882,359,256.45	8.20%	732,281.40	8.19%	-
东方证券	1	868,304,527.98	8.07%	705,502.29	7.89%	-
长江证券	1	829,534,925.66	7.71%	674,003.39	7.53%	-
安信证券	1	760,423,294.66	7.07%	646,356.93	7.23%	-
海通证券	1	728,878,279.62	6.77%	592,217.82	6.62%	-
国金证券	2	621,274,938.83	5.77%	528,080.03	5.90%	-
高华证券	1	619,724,825.13	5.76%	526,763.66	5.89%	-
招商证券	1	585,076,050.29	5.44%	475,378.42	5.31%	-
国泰君安	1	286,275,419.10	2.66%	243,331.27	2.72%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
汉唐证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

注：1、专用席位的选择标准和程序

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
- (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。

11.7.2 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
银河证券	-	-	65,000,000.00	3.24%	-	-
长城证券	-	-	185,000,000.00	9.22%	-	-
华泰联合	35,560,870.88	74.64%	275,000,000.00	13.71%	-	-
光大证券	-	-	380,000,000.00	18.94%	-	-
中金公司	1,575,626.70	3.31%	420,000,000.00	20.94%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	377,445.39	0.79%	366,000,000.00	18.25%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	140,000,000.00	6.98%	-	-
高华证券	10,127,649.00	21.26%	80,000,000.00	3.99%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	95,000,000.00	4.74%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
汉唐证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
信泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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开放式基金增加广发华福证券有限责任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	2010年1月7日
2	银河基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中国国际金融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	2010年1月15日
3	银河银泰理财分红证券投资基金 2009 年第 4 季度季报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2010年1月22日
4	银河基金管理有限公司关于变更基金审计机构公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2010年2月3日
5	银河基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金转换业务规则的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2010年3月4日
6	银河基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增东兴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	2010年3月15日
7	银河银泰理财分红证券投资基金、2009 年年度报告正文及摘要	全文在公司网站，摘要在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年3月26日
8	银河银泰理财分红证券投资基金 2010 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年4月21日

		报》、公司网站	
9	银河基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2010年4月30日
10	银河基金管理有限公司关于旗下基金新增华泰联合证券有限责任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	2010年5月7日
11	银河基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2010年5月8日
12	银河银泰理财分红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	2010年5月13日
13	银河基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增财通证券有限责任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	2010年6月10日
14	银河银泰理财分红证券投资基金、2010年2季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2010年7月19日
15	银河基金管理有限公司关于参加信达证券股份有限公司等定期定额申购及网上交易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	2010年8月27日
16	银河银泰理财分红证券投资基金2010年半年度报告及摘要	全文在公司网站，摘要在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年8月28日
17	银河基金管理有限公司关于旗下基金新增方正证券有限责任公司	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年9月2日

	为代销协议的公告	报》、公司网站	
18	银河银泰理财分红证券投资基金 2010 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时 报》、公司网站	2010 年 10 月 27 日
19	银河银泰理财分红证券投资基金 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	2010 年 11 月 13 日
20	银河基金管理有限公司关于开通 汇付天下“天天盈”基金网上直 销的公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时 报》、公司网站	2010 年 11 月 25 日
21	银河基金管理有限公司关于旗下 开放式基金新增民生证券有限责 任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	2010 年 12 月 3 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河银泰理财分红证券投资基金的文件
- 2、《银河银泰理财分红证券投资基金基金合同》
- 3、《银河银泰理财分红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、银河银泰理财分红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

12.2 存放地点

查阅地点：上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼

12.3 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3月30日