

银河银富货币市场基金 2011 年年度报告摘要

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司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及其更新。

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	银河银富货币	
基金主代码	150005	
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	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2, 578, 439, 341. 64 份	
下属分级基金的基金简称:	银河银富货币 A	银河银富货币 B
下属分级基金的交易代码:	150005	150015
报告期末下属分级基金的份额总额	120, 432, 187. 50 份	2, 458, 007, 154. 14 份

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金主要投资于短期金融工具，投资策略的重点是在投资组合的流动性和收益性这两个方面取得平衡。本基金将以价值研究为导向，利用基本分析和数量化分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，追求稳定的当期收益。 1. 战略资产配置策略 利率预期策略：因为利率变化是影响债券价格的最重要的因素，所以利率预期策略是本基金的基本投资策略。投资决策委员会通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化和短期资金供给等因素的分析，形成对未来短期利率走势的判断，并依此调整组合的期限和品种配置。比如，根据历史上我国短期资金市场利率的走势，在年初、年末资金利率较高时按哑铃策略配置基金资产，而在年中资金利率偏低时按梯形策略配置基金资产。 平均剩余期限控制策略：根据对短期利率走势的判断确定并控制投资组合的平均剩余期限。在预期短期利率上升时，缩短组合的平均期限，以规避资本损失和获得较高的再投资收益；在预期短期利率下降时，延长组合的平均期限，以锁定较高的收益水平。 现金流管理策略：根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持本基金充分流动性的基础上争取较高收益。 2. 战术资产配置策略 在战术资产配置阶段，配置策略主要体现在：利用金融工程技术，寻找价格低估的投资品种。把握银行间市场和交易所市场出现的套利机会。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为银行半年期定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金面临的风险与其他开放式基金相同(如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等)，但由于本基金主要投资短期流动性金融工具，上述风险在本基金中存在一定的特殊性，投资本金损失的可能性很小

	银河银富货币 A	银河银富货币 B
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李立生	张咏东
	联系电话	021-38568699	021-32169999
	电子邮箱	lilisheng@galaxyasset.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400-820-0860	95559
传真		021-38568568	021-62701216

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
基金年度报告报告备置地点	1、上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼 2、上海市银城中路 188 号

§ 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	
	银河银富货币 A	银河银富货币 B	银河银富货币 A	银河银富货币 B	银河银富货币 A	银河银富货币 B
本期 已实 现收 益	6,736,313.15	41,262,843.81	526,623.81	17,118,194.54	1,736,796.27	30,292,151.74
本期 利润	6,736,313.15	41,262,843.81	526,623.81	17,118,194.54	1,736,796.27	30,292,151.74
本期 净值 收益 率	3.8454%	4.0946%	1.5281%	1.7722%	0.9191%	1.1633%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
	银河银富货币 A	银河银富货币 B	银河银富货币 A	银河银富货币 B	银河银富货币 A	银河银富货币 B
期末 基金 资产 净值	120,432,187.50	2,458,007,154.14	47,131,669.07	778,189,132.15	42,314,930.35	1,722,406,367.12

注：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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金表现

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

银河银富货币 A

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	1.0814%	0.0039%	0.8433%	0.0000%	0.2381%	0.0039%
过去六个月	2.0644%	0.0033%	1.6825%	0.0001%	0.3819%	0.0032%
过去一年	3.8454%	0.0037%	3.1175%	0.0007%	0.7279%	0.0030%
过去三年	6.4013%	0.0053%	7.1821%	0.0015%	-0.7808%	0.0038%
过去五年	14.2477%	0.0086%	13.1419%	0.0019%	1.1058%	0.0067%
自基金合同 生效日起至 今	19.3339%	0.0075%	16.6091%	0.0020%	2.7248%	0.0055%

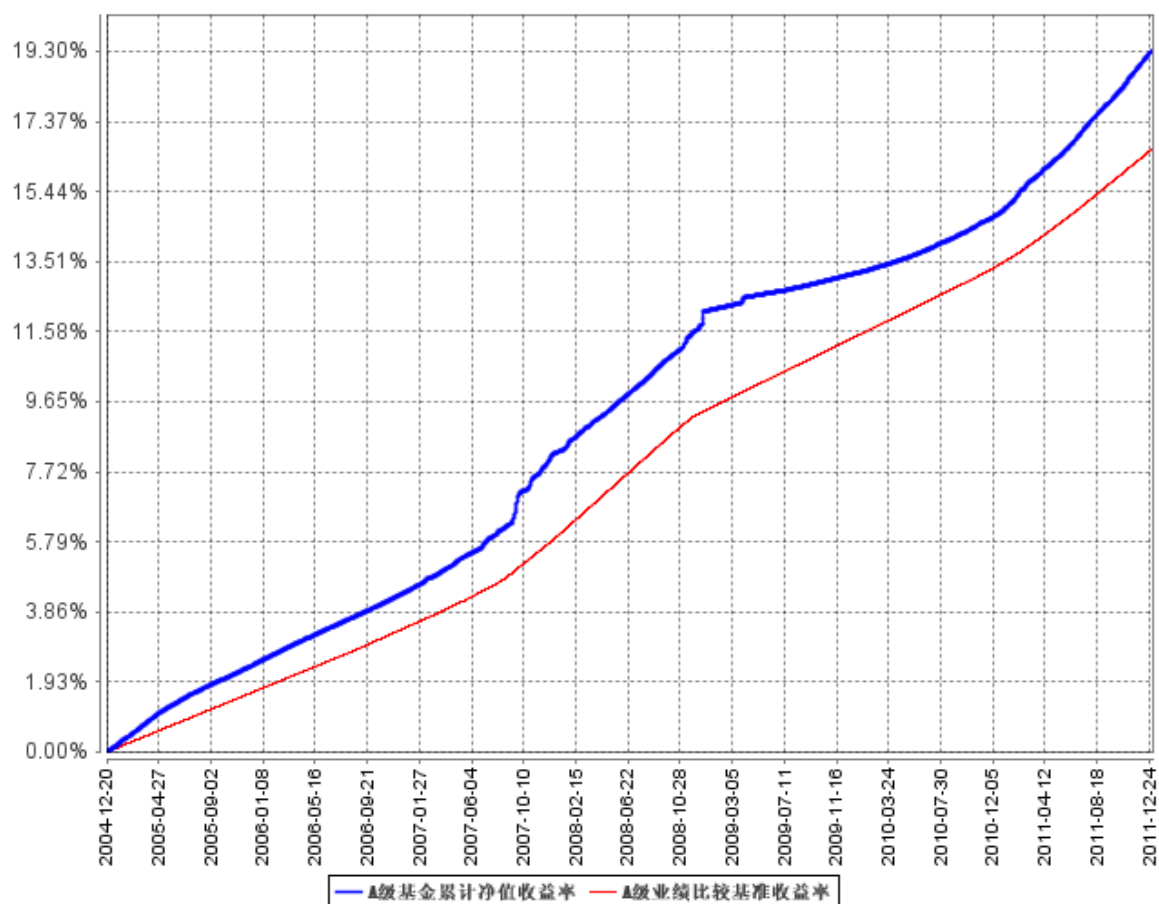
银河银富货币 B

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	1.1427%	0.0039%	0.8433%	0.0000%	0.2994%	0.0039%
过去六个月	2.1881%	0.0033%	1.6825%	0.0001%	0.5056%	0.0032%
过去一年	4.0946%	0.0037%	3.1175%	0.0007%	0.9771%	0.0030%
过去三年	7.1717%	0.0053%	7.1821%	0.0015%	-0.0104%	0.0038%
过去五年	15.6289%	0.0086%	13.1419%	0.0019%	2.4870%	0.0067%
自基金合同 生效日起至 今	20.8255%	0.0076%	16.6091%	0.0020%	4.2164%	0.0056%

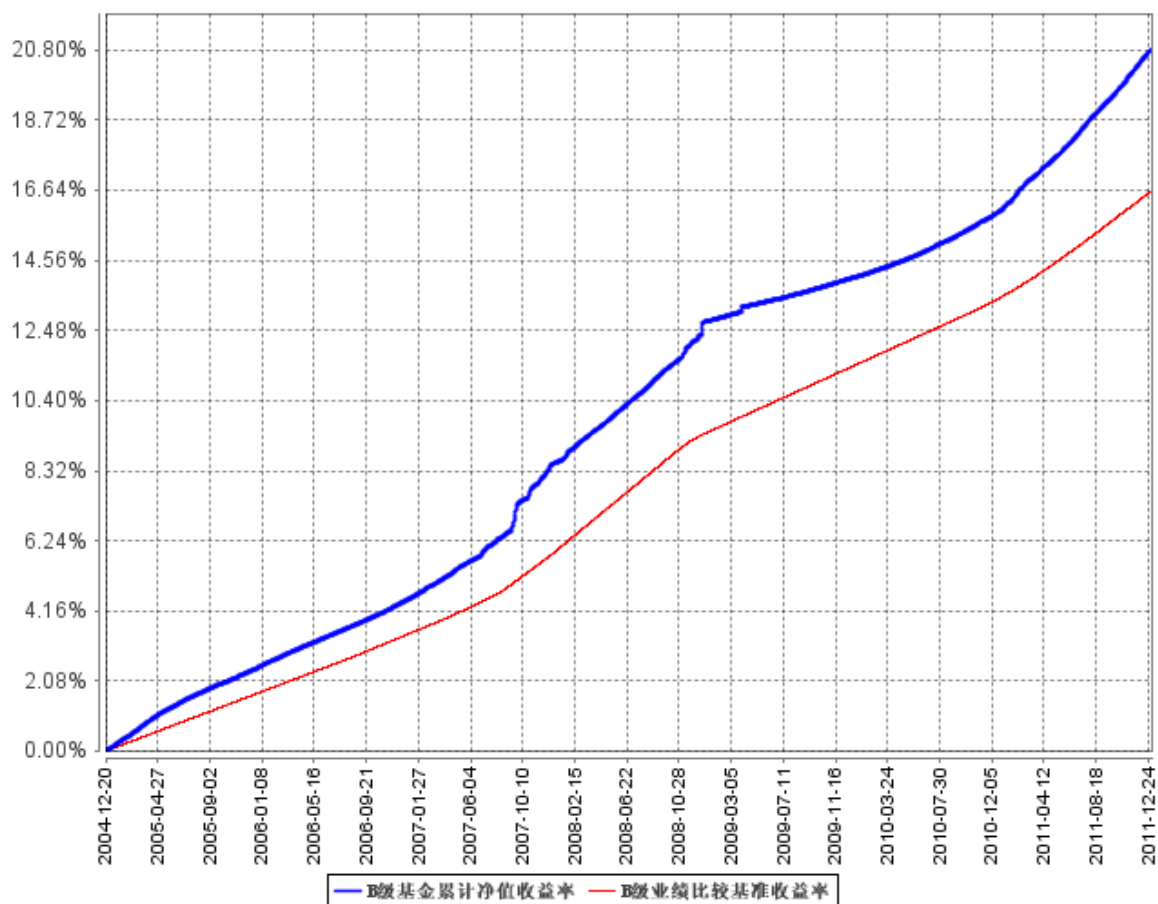
注：本基金的收益分配是按日结转份额

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



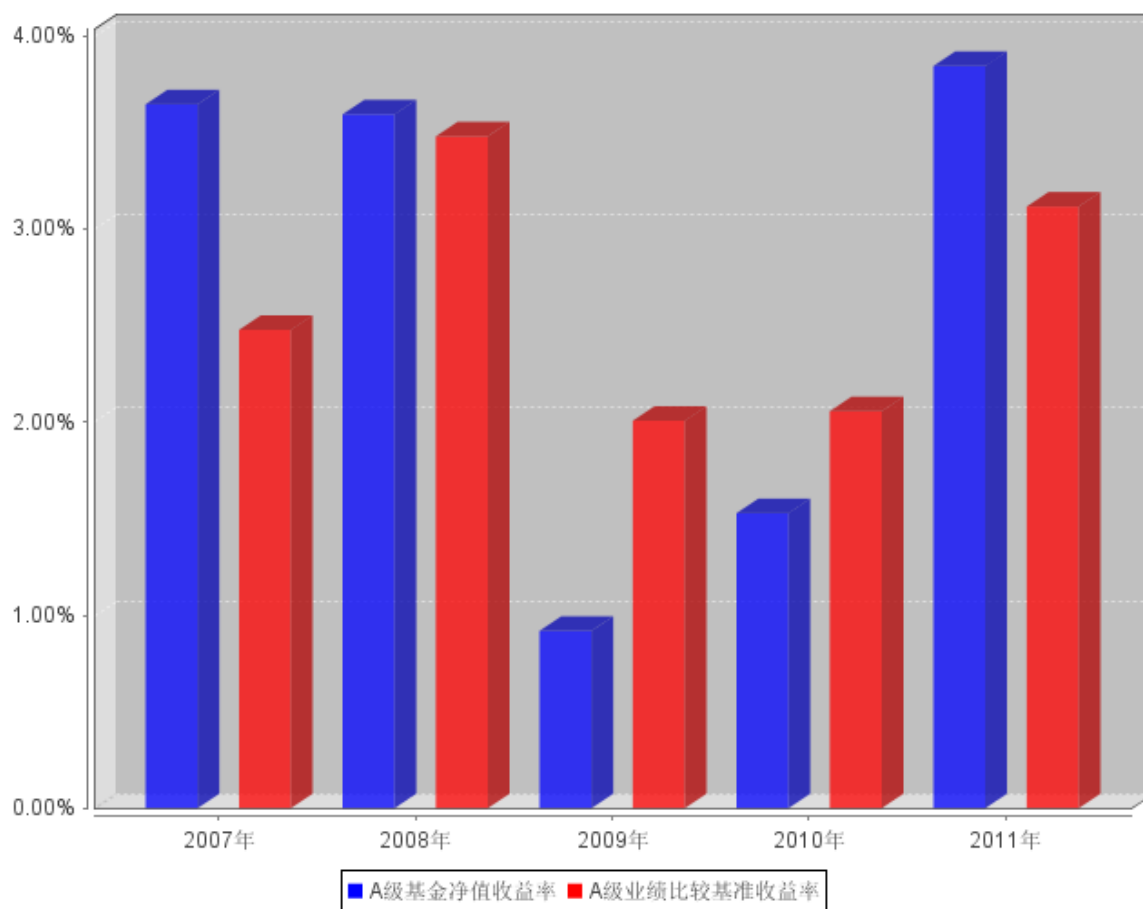
B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



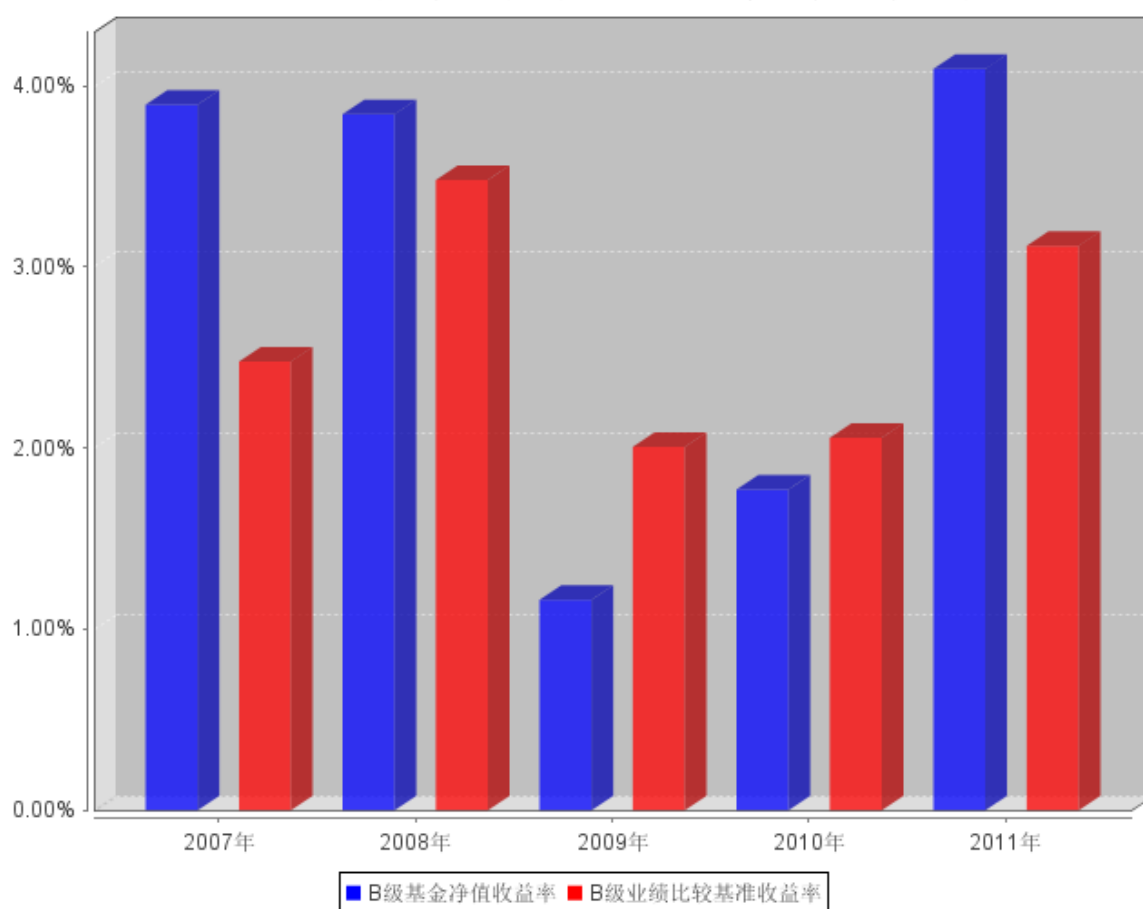
注：本基金自合同生效日起 6 个月为建仓期；至建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

A级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

银河银富货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2011年	6,726,064.35	-	10,248.80	6,736,313.15	
2010年	523,088.78	-	3,535.03	526,623.81	
2009年	1,744,687.64	-	-7,891.37	1,736,796.27	
合计	8,993,840.77	-	5,892.46	8,999,733.23	
银河银富货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2011年	41,024,067.41	-	238,776.40	41,262,843.81	
2010年	17,089,106.18	-	29,088.36	17,118,194.54	
2009年	30,422,011.11	-	-129,859.37	30,292,151.74	
合计	88,535,184.70	-	138,005.39	88,673,190.09	

§ 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 10 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

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张矛	银河银富货币市场基金的基金经理、银河收益证券投资基金的基金经理	2010 年 1 月 12 日	-	6	中共党员，硕士研究生学历。曾就职于浙商证券有限责任公司、浙商银行股份有限公司，主要从事策略分析、债券投资及交易等工作。2008 年 10 月加入银河基金管理有限公司，历任债券交易员，2011 年 8 月起兼任银河收益证券投资基金

					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。

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

银河银富货币市场基金（以下简称“银河银富货币”）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

注：本基金管理人旗下无与银河银富货币投资风格相似的投资组合。

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 年国内通胀压力前高后低，宏观经济由热转冷，银行间资金面持续紧张，货币市场利率处于高位。上半年，随着食品价格的上涨，通胀压力不断攀升，央行通过 6 次上调准备金率、3 次加息以抑制物价上涨。紧缩的货币政策刺激货币市场利率不断抬升，3 个月 shibor 和银行间 7 日回购利率均创出近年来新高，资金明显处于长期的供不应求状态。为缓和准备金缴款压力，在公开市场操作上，央行不断进行净投放，全年总计向市场投放了 1.9 万亿。下半年经济出现回落，通胀压力有所缓和，

货币政策转向微调。尽管年底下调了一次准备金，暂停了 3 年期和 1 年期的央票发行，但是由于外汇占款出现超预期下降，货币市场资金面改善程度较为有限。

本基金全年维持了较为稳健的操作策略，存款等类现金资产维持在较高水平以保证流动性，现券方面主要增配风险收益比较好的中高等级短期融资券，浮息债比例有所降低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年度银河银富货币业绩比较基准收益率为 3.1175%，银河银富货币 A 净值收益率为 3.8454%，银河银富货币 B 净值收益率为 4.0946%。

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 年经济增长和通胀将同时回落，通缩风险加大，货币政策继续趋于实际宽松，债市整体依然有走强的空间。尽管明年公开市场到期量有限，外汇占款增速不容乐观，但是我们认为央行将通过多次下调准备金率来进行货币注入，当前高位的法准率也提供了较大的操作空间。为了促使表外资金回流表内，降低实体企业融资成本，均需要央行设法降低货币市场利率，一年期央票发行利率也存在下调的必要和空间。

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

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人，分红方式为红利再投资。本报告期内本基金以红利再投资方式进行收益分配，其中 A 级分配收益 6,736,313.15 元，B 级分配收益 41,262,843.81 元，符合法律法规及《基金合同》的约定。

§ 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

2011 年度，托管人在银河银富货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2011 年度，银河基金管理有限公司在银河银富货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。 本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：6,736,313.15 元，向 B 级份额持有人分配利润：41,262,843.81 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

2011 年度，由银河基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关银河银富货币市场基金的年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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无保留意见审计报告。投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银河银富货币市场基金

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		1,100,177,612.87	100,060,091.23
结算备付金		34,167,885.64	10,480,892.85
存出保证金		-	-
交易性金融资产		529,218,848.60	400,183,159.35

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		529,218,848.60	400,183,159.35
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		900,995,751.50	299,999,770.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		15,109,354.09	4,402,608.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	10,773,174.44
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,579,669,452.70	825,899,696.86
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		537,220.46	259,818.76
应付托管费		162,794.06	78,732.95
应付销售服务费		46,187.08	15,461.34
应付交易费用		15,605.58	13,103.91
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		330,803.88	81,778.68
递延所得税负债		-	-
其他负债		137,500.00	130,000.00
负债合计		1,230,111.06	578,895.64
所有者权益：			
实收基金		2,578,439,341.64	825,320,801.22
未分配利润		-	-
所有者权益合计		2,578,439,341.64	825,320,801.22
负债和所有者权益总计		2,579,669,452.70	825,899,696.86

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 2,578,439,341.64 份，其中 A 级基金份额参考净值 1.00 元，份额总额 120,432,187.50 份；B 级基金份额参考净值 1.00 元，份额总额 2,458,007,154.14 份。

7.2 利润表

会计主体：银河银富货币市场基金

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		54,401,459.42	22,623,401.75
1.利息收入		53,090,657.67	21,911,194.25
其中：存款利息收入		18,505,254.12	3,175,367.98
债券利息收入		21,049,329.16	13,155,098.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,536,074.39	5,580,727.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,310,801.75	712,207.50
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,310,801.75	712,207.50
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、费用		6,402,302.46	4,978,583.40
1. 管理人报酬		4,073,692.72	3,431,294.70
2. 托管费		1,234,452.26	1,039,786.27
3. 销售服务费		569,856.31	188,290.51
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		340,915.33	147,279.97
其中：卖出回购金融资产支出		340,915.33	147,279.97
6. 其他费用		183,385.84	171,931.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		47,999,156.96	17,644,818.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		47,999,156.96	17,644,818.35

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河银富货币市场基金

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）	825,320,801.22	-	825,320,801.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,999,156.96	47,999,156.96
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）	1,753,118,540.42	-	1,753,118,540.42
其中：1. 基金申购款	10,122,107,949.70	-	10,122,107,949.70
2. 基金赎回款	-8,368,989,409.28	-	-8,368,989,409.28
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）	-	-47,999,156.96	-47,999,156.96
五、期末所有者权益（基金净值）	2,578,439,341.64	-	2,578,439,341.64
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）	1,764,721,297.47	-	1,764,721,297.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,644,818.35	17,644,818.35
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）	-939,400,496.25	-	-939,400,496.25
其中：1. 基金申购款	1,408,695,330.56	-	1,408,695,330.56
2. 基金赎回款	-2,348,095,826.81	-	-2,348,095,826.81
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）	-	-17,644,818.35	-17,644,818.35
五、期末所有者权益（基金净值）	825,320,801.22	-	825,320,801.22

金净值)			
------	--	--	--

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> 尤象都 </u>	<u> 陈勇 </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

银河银富货币市场基金（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]177 号文《关于同意银河银富货币市场基金募集的批复》的核准，由银河基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 12 月 20 日正式生效，首次设立募集规模为 1,937,975,917.90 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《银河基金管理有限公司关于银河银富货币市场基金份额分级及销售服务费率调整的公告》，本基金于 2006 年 11 月 1 日开始实施分级，分级后本基金设两级基金：A 级基金份额和 B 级基金份额。当申购金额低于 500 万元时为 A 级基金，当申购金额达到或超过 500 万元时为 B 级基金。

在基金存续期内的任何一个开放日，若 A 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 级基金份额升级为 B 级基金份额。若 B 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 级基金份额降级为 A 级基金份额。

本基金的投资范围为剩余期限不超过 397 天（含 397 天）的债券；剩余期限不超过一年（含一年）的中央银行票据、债券回购、银行定期存款、银行大额存单；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如在本基金存续期内市场出现新的金融产品且在开放式货币市场基金许可的投资范围内，本基金管理人保留调整投资对象的权利。

根据当前市场情况以及相关法律法规的规定，并综合考虑短期资金市场中各投资品种的收益性、流动性、及信用风险情况，本基金的资产配置比例范围确定为：短期债券和央行票据 0%-95%；债券回购 0%-95%；同业存款及现金比例 5%-100%。

本基金业绩比较基准为：银行半年期定期存款利率(税后)。

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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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。

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. 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》，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[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。

2. 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》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 20% 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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	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
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	同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：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股票交易。

债券交易

注：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		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		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	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例

银河证券	1, 090, 000, 000. 00	100. 00%	9, 350, 800, 000. 00	100. 00%
------	----------------------	----------	----------------------	----------

7.4.8.1.2 权证交易

注：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
银河证券	-	-	-	-
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
银河证券	-	-	-	-

注：根据与银河证券签订的《证券交易席位租赁协议》，债券回购交易不收佣金。

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	4, 073, 692. 72	3, 431, 294. 70
其中：支付销售机构的客户维护费	269, 915. 55	35, 980. 31

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0. 33%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

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。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

2010 年末未支付管理费余额：259, 818. 76 元，2011 年末未支付管理费余额：537, 220. 46 元。

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	1,234,452.26	1,039,786.27

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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两个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇节假日、公休日等，支付日期顺延。

2010 年末未支付托管费余额：78,732.95 元，2011 年末未支付托管费余额：162,794.06 元。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河银富货币 A	银河银富货币 B	合计
银河基金	34,279.94	80,407.90	114,687.84
交通银行	51,745.41	938.60	52,684.01
银河证券	29,849.10	2,648.74	32,497.84
合计	115,874.45	83,995.24	199,869.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河银富货币 A	银河银富货币 B	合计
银河基金	19,000.34	69,597.26	88,597.60
交通银行	28,770.07	255.90	29,025.97
银河证券	15,509.40	4,232.26	19,741.66
合计	63,279.81	74,085.42	137,365.23

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。A 类基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。B 类基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{销售服务费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付；基金管理人应于此月前两个工作日将上月基金销售服务费的计算结果书面通知基金托管人并做出划付指令；基金托管人应在收到计算结果后当日完成复核，并于当日从基金资产中一次性支付销售服务费给基金销售人，若遇节假日、公休假等，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
交通银行	40,333,208.64	50,292,341.45	-	-	-	-
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
交通银行	-	40,767,588.91	-	-	-	-

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

银河银富货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011 年 12 月 31 日		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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

银河银富货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011 年 12 月 31 日	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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例
银河金融控股 有限责任公司	803,122,410.56	31.15%	-	-

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2011 年年末和 2010 年年末均未投资 A 级基金。

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		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	期末余额	当期利息收入
交通银行	177,612.87	10,130.26	60,091.23	14,449.76

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2011 年 12 月 31 日的相关余额人民币 34,167,885.64 元(2010 年为人民币 10,480,892.85 元)，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示，备付金利息收入为人民币 407,197.30 元（2010 年人民币为 1,819,714.08 元）。

7.4.8.6 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

注：本基金本报告期末未持有流通受限债券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

§ 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	固定收益投资	529,218,848.60	20.51
	其中：债券	529,218,848.60	20.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	900,995,751.50	34.93
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,134,345,498.51	43.97
4	其他各项资产	15,109,354.09	0.59
5	合计	2,579,669,452.70	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.94	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资金净值的 20%

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	46
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	124
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：在本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余期限未超过 180 天

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	58.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	7.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.56	-
4	90 天(含)—180 天	15.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	3.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.46	-

8.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	69,162,168.95	2.68
3	金融债券	130,232,275.27	5.05
	其中：政策性金融债	80,241,169.71	3.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	329,824,404.38	12.79
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	529,218,848.60	20.52
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	40,221,408.65	1.56

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	071304	07 华夏 02 浮	500,000	49,991,105.56	1.94
2	100236	10 国开 36	400,000	40,221,408.65	1.56
3	070211	07 国开 11	300,000	30,021,538.29	1.16
4	1181113	11 浙国贸 CP01	300,000	30,004,922.99	1.16
5	041159016	11 丝绸 CP002	300,000	30,001,311.07	1.16
6	1181149	11 盘投 CP01	300,000	29,991,391.63	1.16
7	1101018	11 央票 18	300,000	29,765,251.86	1.15
8	1101028	11 央票 28	300,000	29,677,903.95	1.15
9	1181069	11 昆钢集 CP01	200,000	20,010,251.79	0.78
10	1181024	11 人福 CP01	200,000	20,002,122.31	0.78

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	9
报告期内偏离度的最高值	0.30%
报告期内偏离度的最低值	-0.21%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.13%

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本基金采用摊余成本法进行估值, 各估值对象的溢折价、利息收入按剩余期限摊销平均计入基金净值。

本基金采用“影子定价”的方法进行估值修正, 即为了避免采用摊余成本法计算的基金净值与按市场利率和交易市价计算的资产净值发生重大偏离, 当此偏离度达到或超过基金资产净值的 0.50% 时, 适用影子定价对估值对象进行调整, 调整差额于当日计入基金净值。

8.8.2 本报告期内本基金每日持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本余额均未超过当日基金资产净值的 20%。

8.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

8.8.4 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	应收证券清算款	-
3	应收利息	15,109,354.09
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	15,109,354.09

§ 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

份额 级别	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
银河 银富 货币 A	4,288	28,085.86	11,313,648.13	9.39%	109,118,539.37	90.61%
银河 银富 货币 B	38	64,684,398.79	2,432,614,287.68	98.97%	25,392,866.46	1.03%

合计	4,326	596,033.13	2,443,927,935.81	94.78%	134,511,405.83	5.22%
----	-------	------------	------------------	--------	----------------	-------

注：本基金对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

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	份额级别	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	银河银富货币 A	210,499.44	0.1748%
	银河银富货币 B	—	—
	合计	210,499.44	0.0082%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	银河银富货币 A	银河银富货币 B
基金合同生效日（2004 年 12 月 20 日）基金份额总额	1,937,975,917.90	—
本报告期期初基金份额总额	47,131,669.07	778,189,132.15
本报告期基金总申购份额	1,609,356,488.24	8,512,751,461.46
减：本报告期基金总赎回份额	1,536,055,969.81	6,832,933,439.47
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	120,432,187.50	2,458,007,154.14

注：基金合同生效日为 2004 年 12 月 20 日，红利再投资和基金转换转入和因分级导致的基金份额强增作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出和因分级导致的基金份额强减作为本期赎回资金的支付，统一计入本期总赎回份额，可不单独列示。

§ 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

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的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

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 50,000 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。

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、托管人的托管业务部门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	1	-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金无席位变更情况。

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。

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	-	-	-1,090,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内没有偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

银河基金管理有限公司
2012 年 3 月 27 日