**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:2013年3月29日**

# 银丰证券投资基金

## 【2012】年度报告摘要

### §1 重要提示

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2013年3月27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2012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 | 2002-09-10 |

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 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-38568699 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | lilisheng@galaxyasset.com | tianqing1.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<br>2.北京西城区闹市口大街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 | 2012年 | 2011年 | 2010年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -531,122,835.56 | -131,833,578.89 | -4,024,141.23 |
| 本期利润 | -206,036,603.64 | -915,064,974.16 | 102,009,433.62 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0687 | -0.3050 | 0.0340 |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.55% | -25.24% | 3.05% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2012年末 | 2011年末 | 2010年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2123 | -0.0985 | 0.0157 |
| 期末基金资产净值 | 2,498,356,579.46 | 2,704,393,183.10 | 3,640,458,159.40 |
| 期末基金份额净值 | 0.833 | 0.901 | 1.213 |

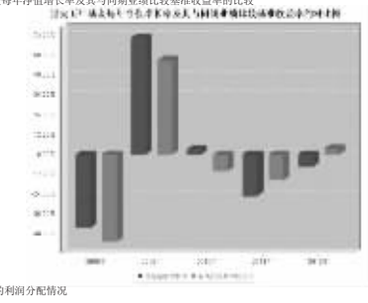
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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 | -1.77% | 2.40% | 6.73% | 1.94% | -8.50% | 0.46% |
| 过去六个月 | -6.19% | 2.41% | 1.92% | 1.82% | -8.11% | 0.59% |
| 过去一年 | -7.55% | 2.37% | 3.44% | 1.69% | -10.99% | 0.68% |
| 过去三年 | -28.78% | 2.47% | -21.40% | 1.87% | -7.38% | 0.60% |
| 过去五年 | -32.65% | 3.04% | -41.95% | 2.81% | 9.30% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 204.09% | 2.79% | 47.62% | 2.62% | 156.47% | 0.17% |

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2012 | - | - | - | - | |
| 2011 | 0.07 | 21,000,000.00 | - | 21,000,000.00 | |
| 2010 | 0.60 | 180,000,000.00 | - | 180,000,000.00 | |
| 合计 | 0.67 | 201,000,000.00 | - | 201,000,000.00 | |

### §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
银河证券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为管理13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。
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期期内的稳定增值。
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。
12.银河通利分级债券型证券投资基金
基金运作方式:契约型
基金合同生效日:2012年4月25日
基金投资目标:在合理控制风险的前提下,力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
13.银河主题策略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:2012年9月21日
基金投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,采用主题投资策略和精选个股策略的方法进行投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。

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 | - | 18 | 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的基金经理等职务,2010年7月起兼任银河蓝筹精选股票型证券投资基金的基金经理。 |
| 钱睿南 | 银丰证券投资基金的基金经理、银河稳健证券投资基金的基金经理、银河收益证券投资基金的基金经理、股票投资部总监 | 2012年12月21日 | - | 12 | 硕士研究生学历,曾先后在中国华融信托投资公司、中国银河证券有限责任公司公司工作。2002年6月加入银河基金管理有限公司,历任交易主管、基金经理助理等职务,2008年2月起担任银河稳健证券投资基金的基金经理,现任股票投资部总监。 |
| 神玉飞 | 银丰证券投资基金的基金经理 | 2012年12月21日 | - | 5 | 中共党员,博士研究生学历。2007年9月加入银河基金管理有限公司,曾担任宏观策略研究员、行业研究员、银丰证券投资基金的基金经理助理等职,期间主要从事宏观策略行业研究和股票投资策略研究工作。 |

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。
3.上表中徐小勇同志于2013年2月起不再担任银丰证券投资基金的基金经理,该事项于2013年2月8日在《证券时报》上对外公告。

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 公平交易制度和控制方法
本基金管理人通过制定严格的公平交易管理制度、投资管理制度、投资风险管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等一系列制度,从投权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控和分析评估等各个环节予以落实,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。
在投资决策环节,公司实行统一研究平台和统一的授权管理,所有投资组合经理在获取研究成果及投资建议等方面享有均等机会。公司分不同投资组合类别分别建立了投资备选库,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。
在交易执行方面,本基金管理人旗下管理的所有投资组合指令均执行集中交易制度,遵循"时间优先、价格优先"的原则,在满足系统公平交易的条件时自动进入公平交易程序,最大程度上确保公平对待各投资组合。若同日反向交易方面,除法规规定的特殊情况外,公司原则上禁止不同投资组合(完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合除外)之间的同日反向交易。

4.3.2 公平交易制度的执行情况
本报告期内,公司旗下管理的所有投资组合严格执行相关法律法规及公司制度,在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实,确保公平对待不同投资组合。同时,公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析。
针对同向交易部分,本报告期内,公司对旗下管理的所有投资组合(完全复制的指数基金除外),连续四个季度期间内、不同时间窗下(1日内、5日内、5日内)公开竞价交易的证券进行了价差分析,并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。
针对反向交易部分,公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易(包括股票和债券)的交易时间、交易价格进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。本报告期内,不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况(完全复制的指数基金除外)。
对于以公司名义进行的一级市场申购等交易,由各投资组合经理均严格按照制度规定,事前确定好申购价格和数量,按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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
2012年国股市经历了年初的大幅反弹后,此后震荡下跌,直至年底才大幅反弹,最后全年上涨3.17%。回顾2012年,房地产、非银行金融、建筑和银行涨幅居前,而通信、电力设备、计算机、纺织服装跌幅居前。
2012年初,中国经济面临着滞胀风险,经济面临下滑风险,通胀压力高位释放。宏观调控为应对滞胀风险,2012年上半年货币政策放松,央行持续降准降息以刺激经济。2012年下半年,伴随着通胀的回落,企业盈利也跌至了阶段性底部后,中国经济依靠自身力量出现了改善的迹象,这种改善趋势在2012年四季度得到了强化。
2012年宏观经济背景和货币政策组合决定大类资产方面债券优于股票。事实上,2012上半年股票市场经历了春季行情后一路下跌,市场对IPO政策不确和解禁冲击的担心是一步给股票市场带来了负面影响,直至2012年12月初市场创出新底后,才大幅反弹。
本基金管理人在2012年初对去年股市运行的特征认识不足,没有深刻认识到2012年行业分化的特征,对早周期行业的上涨和后周期行业的下跌认识不足。同期2012年投资操作存在以下不足:(1)对市场运行特征认识不足,没能很好地控制股票仓位,在股票市场上涨和下跌时没能及时大幅减仓和加仓;(2)没有很好地把握住房地产、非银行金融、建筑和银行的上涨,同时未能及时减持后周期特征明显的食品饮料;(3)未能及时减持基本面恶化的个股,2012年初随着经济基本面的恶化,组合中个股的基本面也出现了恶化。在去年年末的市场反弹过程中,本基金管理人大幅减持一批基本面恶化流动性欠缺的股票,同时增持了一批低估值的周期股,为本基金2013年的运作适度提前布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本基金2012年净值增长率为-7.55%,同期业绩比较基准增长率为3.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
全球经济和中国经济有望复苏。2013年伊始,欧美经济先行指标都显示发达经济正逐步好转,考虑到欧美经济经历了较长时间的调整,本基金管理人判断欧美复苏趋势虽然存在波折,但是仍然相对确定。中国经济也延续了去年四季度以来的回升趋势,目前虽然还无法判断中国经济2013年复苏的力度,但是经济运行环境和状态总体将优于2012年,企业盈利特别是周期行业盈利的改善也相对确定。国内货币政策也很难再现2012年上半年大幅放松的格局。
本基金管理人判断2013年股票市场投资机会将会优于2012年。首先,经济运行周期和货币政策特征决定了权益投资的吸引力提升;其次,监管层积极引入长线资金疏解A股的流动性困境;再次,股票市场的财富效应也将吸引新增资金。但是,本基金管理人同时也认识到A股面临新的挑战,RQFII长线资金进入和大非解禁一定会对当前A股现存各行业的估值体系产生影响,从而对A股投资者先前的投资理念和未来的投资行为产生一定的影响。
本基金管理人预计2013年A股市场可能处于震荡上行过程中,全年大概率上涨。本基金管理人预计A股2013年年初大幅上涨后,存在震荡整理的可能,但是新的经济增长动力得到确认后,市场的运行主线将更加明确。
基于对2013年股票市场相对乐观的判断,本基金管理人将采取积极的操作。本基金管理人将择机优化配置结构,继续增加周期股和价值股的配置,纠正组合偏离基准的风险。在此基础上,本基金管理人也将密切跟踪研究周期股和消费股,成长股和价值股估值溢价率的变化,力争把握上述行业运行的机会与风险。本基金管理人重点研究本轮制度改革和经济复苏方向,力争把握最终受益于制度改革和经济复苏的成长性行业和标的。

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负责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"。截至2012年12月31日止,本基金未实施利润分配。

### §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,不存在按法律法规应该由托管人履行的义务,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,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,本基金未实施利润分配。

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:2012年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 22,977,617.60 | 53,256,593.78 |
| 结算备付金 | | 2,414,969.59 | 3,751,221.35 |
| 存出保证金 | | 2,262,841.85 | 2,591,669.93 |
| 交易性金融资产 | | 2,400,478,218.56 | 2,732,369,512.87 |
| 其中:股票投资 | | 1,690,412,605.75 | 1,898,765,225.47 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 710,065,612.81 | 833,604,287.40 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 119,400,579.10 | - |
| 应收证券清算款 | | 11,608,380.26 | 9,989,717.48 |
| 应收利息 | | 10,366,388.90 | 11,407,459.76 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 2,569,508,995.86 | 2,813,366,175.17 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011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 | | 60,000,000.00 | 100,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 2,432,474.20 | 885,759.91 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 3,021,136.25 | 3,633,169.72 |
| 应付托管费 | | 503,522.70 | 605,528.29 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 980,637.61 | 661,469.95 |
| 应交税费 | | 2,024,158.46 | 1,748,558.46 |
| 应付利息 | | 34,487.18 | 38,505.74 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 2,156,000.00 | 1,400,000.00 |
| 负债合计 | | 71,152,416.40 | 108,972,992.07 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 未分配利润 | | -501,643,420.54 | -295,606,816.90 |
| 所有者权益合计 | | 2,498,356,579.46 | 2,704,393,183.10 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,569,508,995.86 | 2,813,366,175.17 |

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.833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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -146,755,046.00 | -847,604,371.31 |
| 1.利息收入 | | 25,629,334.04 | 27,907,459.50 |
| 其中:存款利息收入 | | 610,313.77 | 569,716.07 |
| 债券利息收入 | | 24,870,617.30 | 27,337,743.43 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 148,402.97 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | -497,471,875.60 | -92,310,435.94 |
| 其中:股票投资收益 | | -515,248,901.68 | -90,726,565.70 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | -2,845,814.03 | -14,421,637.57 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 20,622,840.11 | 12,837,767.33 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | 325,086,231.92 | -783,231,395.27 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | | 1,263.64 | 30,000.40 |
| 减:二、费用 | | 59,281,557.64 | 67,460,602.85 |
| 1.管理人报酬 | | 39,135,703.39 | 47,989,627.23 |
| 2.托管费 | | 6,522,617.23 | 7,998,271.18 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | | 9,051,229.47 | 6,106,946.29 |
| 5.利息支出 | | 4,072,648.23 | 4,810,853.25 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 4,072,648.23 | 4,810,853.25 |
| 6.其他费用 | | 499,359.32 | 554,904.90 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | -206,036,603.64 | -915,064,974.16 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | -206,036,603.64 | -915,064,974.16 |

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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012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 | -295,606,816.90 | 2,704,393,183.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | -206,036,603.64 | -206,036,603.64 |
| 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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 3,000,000,000.00 | -501,643,420.54 | 2,498,356,579.46 |
| | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 | | |
| 项目 | 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(本期净利润) | - | -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 |

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:
董伯儒 陈勇
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号文核准,由中国银河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")上证值字[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、法规及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,对于在其体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引(试行)》、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<金融工具确认和计量>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2012年12月31日的财务状况以及2012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
7.4.6.1 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,调整出出让方按证券(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[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。
7.4.6.2 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。
7.4.6.3 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、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴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[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;
根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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 |
| 银河证券投资有限公司 | 受基金管理人第一大股东控制 |
| 湖南电广传媒股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

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 2012年1月1日至2012年12月31日 | | 上年度可比期间 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 | 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 | 623,691,927.74 | 10.47% | 371,962,255.54 | 9.35% |

债券交易
金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011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 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 20,887,375.35 | 24.11% | - | - |

债券回购交易
金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | | 上年度可比期间 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 | 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 | 225,000,000.00 | 4.48% | 425,000,000.00 | 6.17% |

7.4.8.1.2 权证交易
本基金本报告期及上