

本报告自2012年1月1日起至12月31日止		§ 2 基金简介		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投资类别、股票、债券、货币利率差异进行了分析。	本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。
2.1 基金基本情况		<p>基金名称 银河沪深300指数增强型证券投资基金</p> <p>基金代码 150005</p> <p>基金管理人 银河基金管理有限公司</p>		<p>本基金为完全复制的被动型指数基金投资部分,对公司管理的所有投资组合完全复制的指数基金除外,该四个季度期间内,不同时间窗口(内、3日内,3日内)公开竞价交易的所有进行了价差分析,并发现该</p>	<p>本基金从二级市场买入并持有至到期,按照约定固定价格赎回并计提利息。</p> <p>1)银行存款</p>
				<p>本基金从二级市场买入并持有至到期,按照约定固定价格赎回并计提利息。</p> <p>1)银行存款</p>	<p>本基金从二级市场买入并持有至到期,按照约定固定价格赎回并计提利息。</p> <p>1)银行存款</p>

[illegible][illegible]

金的基本投资策略。投资决策委员会通过对宏观经济形势、货币政策与货币市场、金类监管政策、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,并依此调整组合的短期品种配置比例。根据银货比,我国货币供应量在年初和年中,年中货币供应量较年初时按季节性规律有所增加,中期和长期货币市场利率在年初和年中,年中货币市场利率较年初有所提高。因此,中期和长期货币市场利率到年底时较年初有所提高,货币市场利率较年初有所提高,中期和长期货币市场利率到年底时较年初有所提高。	2012年度银河期货黄金业绩比较基准收益率为3.0869%,银河期货黄金净值收益率为4.0644%,银河期货黄金净值收益率为4.3137%。	4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望2013年,中国经济仍将保持高速增长态势,且随着复苏态势,同时经济结构的调整将带来重要意义,央行仍将实施稳健的货币政策,保持流动性合理充裕,并提高直接融资比重,同时保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。	<p>序号</p> <p>项目</p> <p>金额</p> <p>占基金资产净值的比例</p>
--	--	---	---

[illegible][illegible]

客户服务电话	400-820-0860	95559	400-820-0860	95559
传真	021-38568568	021-62701262	021-38568568	021-62701262

7.2 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>

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.3 年度财务报表

7.3.1 财务报表的编制基础

本财务报表按照财政部于2006年2月颁布的企业会计准则编制。

7.3.2 重要会计政策和会计估计

1. 会计期间: 自公历一月一日起至十二月三十一日止。

2. 记账本位币: 人民币。

3. 现金等价物的确定标准: 现金流量表中的现金等价物是指企业持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额的现金、价值变动风险很小的金融资产。

4. 金融资产分类和计量: 金融资产在初始确认时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、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

5. 金融资产的减值准备: 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 在资产负债表日不存在减值迹象的情况下, 不计提减值准备; 对于持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产, 在资产负债表日存在减值迹象的情况下, 进行减值测试, 计提减值准备。

6. 存货的计价方法: 存货按照成本进行初始计量, 发出存货时采用先进先出法。

7. 长期股权投资: 长期股权投资按照成本进行初始计量, 后续计量采用成本法。

8. 固定资产的计价和折旧方法: 固定资产按照成本进行初始计量, 折旧方法采用直线法。

9. 无形资产的计价和摊销方法: 无形资产按照成本进行初始计量, 摊销方法采用直线法。

10. 收入确认原则: 收入按照权责发生制确认。

11. 递延所得税资产: 递延所得税资产按照资产负债表债务法确认。

12. 金融负债的计量: 金融负债按照公允价值进行初始计量, 后续计量采用公允价值。

13. 公允价值: 公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中, 出售一项资产所能收到的或者转移一项负债所需支付的价格。

14. 关联方: 关联方是指一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响, 以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制或重大影响。

15. 所得税: 所得税按照资产负债表债务法确认。

16. 其他: 其他会计政策和会计估计按照企业会计准则的规定执行。

7.3.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本报告期无会计政策和会计估计变更以及差错更正。

7.3.4 合并财务报表的合并范围

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定。

7.3.5 财务报表的编制程序

财务报表的编制程序按照企业会计准则的规定执行。

7.3.6 财务报表的审计

财务报表已经会计师事务所审计, 并出具了标准无保留意见审计报告。

7.3.7 财务报表的批准

财务报表已经基金管理人批准。

7.3.8 财务报表的披露

财务报表按照中国证监会的规定进行披露。

7.3.9 财务报表的保管

财务报表按照中国证监会的规定进行保管。

7.3.10 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.11 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.12 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.13 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.14 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.15 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.16 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.17 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.18 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.19 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.20 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.21 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.22 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.23 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.24 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.25 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.26 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.27 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.28 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.29 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.30 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.31 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.32 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.33 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.34 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.35 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.36 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.37 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.38 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.39 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.40 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.41 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.42 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.43 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.44 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.45 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.46 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.47 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.48 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.49 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.50 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.51 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.52 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.53 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.54 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.55 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.56 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.57 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.58 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.59 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.60 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.61 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.62 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.63 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.64 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.65 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.66 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.67 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.68 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.69 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.70 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.71 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.72 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.73 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.74 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.75 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.76 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.77 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.78 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.79 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.80 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.81 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.82 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.83 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.84 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.85 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.86 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.87 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.88 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.89 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.90 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.91 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.92 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.93 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.94 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.95 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.96 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.97 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.98 财务报表的保存地点

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.99 财务报表的保存方式

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

7.3.100 财务报表的保存期限

财务报表按照中国证监会的规定进行保存。

2012年		2011年		2010年		2009年	
S.1.1 期间数据和指标		S.1.1 期间数据和指标		S.1.1 期间数据和指标		S.1.1 期间数据和指标	
本期已实现收益	9,973,624.90	89,933,606.59	6,736,333.15	41,262,843.81	526,623,813.17	17,118,194.54	526,623,813.17
本期净利润	9,973,624.90	89,933,606.59	6,736,333.15	41,262,843.81	526,623,813.17	17,118,194.54	526,623,813.17
本期公允价值变动损益							
本期计提资产减值准备							
其他综合收益							
资产							
流动资产							
货币资金							
应收账款							
预付款项							
其他应收款							
存货							
非流动资产							
长期股权投资							
固定资产							
无形资产							
其他非流动资产							
负债							
流动负债							
短期借款							
应付账款							
预收款项							
其他应付款							
长期负债							
应付债券							
其他非流动负债							
所有者权益							
实收资本							
资本公积							
盈余公积							
未分配利润							
其他所有者权益							

[illegible][illegible]

阶段	期初/净增长率 率(%)	期初/净增长率 率(%)	期末/同比增长 率(%)	期末/同比增长 率(%)	①-③	②-④	交易性金融负债	中国银河证券股份有限公司	同安基金管理人第一大股东控制、基金代销机构	金额单位:人民币元
							7,473			
过去三个月	1.0368%	0.0059%	0.7156%	0.0000%	0.3212%	0.0059%				占金融资产净值
过去六个月	1.9274%	0.0045%	1.4346%	0.0000%	0.4928%	0.0044%				比例(%)
								7.8.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。		
								7.8.1 重大关联交易交易金额占交易总额比例		

项目	本期	上期
应付交易费用	7,47.7	37,686.93
应付税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	708,508.60	330,803.88

[illegible]

<p>5.2.2 过去五年每年平均净值增长率与同期沪深300指数加权平均收益率的比较</p>		<p>本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日</p>		<p>单位:人民币元</p>	
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	项目	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费			7,997,400.68	项目	2011年1月1日至2011年12月31日
				报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	52
				报告期内偏离度的最高值	0.4100%

3.3 其他指标	债券利息收入	35,522,930.69	21,049,329.16	E为前一日基金资产净值	8.8. 投资组合报告附注
	资产支持证券利息收入	--	--	F为前一日基金资产净值	8.8.1. 基金组合
	资产支持证券利息收入	--	--	基金管理人每日计算,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、公休等,支付日期顺延。	本基金采用摊余成本法进行估值,各估值对象的溢价折价,利息收入按利率期限结构平均计入基金净值。
	买入返售金融资产收入	17,516,418.90	13,536,074.39	2011年末未支付管理费余额: 537,220.46; 2012年末未支付管理费余额: 876,096.32元。	本基金采用“影子定价法”计算的基金净值,即为为了避免采用摊余成本法计算的基金净值和交易市价
	其他利息收入	--	--		的偏离度,调整

年度	已赎回基金份额 按成本列示	直接赎回支付 期间转出金额	总申购 金额	基金份额 净值合计	备注
2012年	9,531,107.53	-	42,517.43	9,573,624.96	资产支持证券投资收益
2013年	6,726,064.35	-	10,248.80	6,736,313.15	衍生工具收益
2014年	7,323,098.78	-	5,548.03	7,328,646.81	股利收益
2015年	-	-	-	-	公允价值变动收益(损失以“-”号填列)

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提，计算方法如下：  
 $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$   
H为每日应计提的基金托管费  
E为前一日的基金资产净值  
8.8.4期末未结各项资产构成

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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况

单位：人民币元

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

基金合同生效日：2010年7月16日	-8,368,989,409.28	-8,368,989,409.28
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带来的成果。	-47,999,156.96	-47,999,156.96
9、按照国际成熟股票型证券投资基金投资策略：		
四、本期基金份额持有人有八分权益产生正的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-47,999,156.96	-47,999,156.96

基金合同生效日:2011年5月31日	基金管理人:银华基金管理有限公司	基金托管人:中国工商银行股份有限公司	基金销售机构: 1、银华基金管理股份有限公司直销中心 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)持有的基金份额 前20名持有人名称及持有份额	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策略保险增值,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,追求基金资产在本报告期内稳定增值。	基金管理人:银华基金管理有限公司 7.1.1 基金基本情况 银华沪深两市基本面股票证券投资基金(以下简称“银华基金”),系经中国证券监督管理委员会以下称“中国证监会”)证监基金字[2011]68号文核准注册,由银华基金管理股份有限公司(以下简称“银华基金”)发起设立。基金类型为:契约型开放式。	基金托管人:中国工商银行股份有限公司 7.1.2 基金投资组合 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。 本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的比例不高于90%;债券、货币市场工具、权证、股指期货及其他金融工具占基金资产净值的比例不超过10%。	基金销售机构: 1、银华基金管理股份有限公司直销中心 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)持有的基金份额 前20名持有人名称及持有份额	基金合同生效日:2011年5月31日

基金合同生效日:2024年01月25日	认购金额达到或超过500万元时B级基金。	期末持有的基金份额	-	22,048,091.64	22,048,091.64	报告期内涉及基金管理人、基金财产、基金投资运作等评价。
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。	在基金存续期内的任何一个工作日,若A级基金份额持有人在一个基金账户保留的基金份额达到或超过500万份时,本基金的投资运作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一个基金账户保留的基金份额低于500万份时,本基金的注册投资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	期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.45%	-	11.4基金投资策略的改变 报告期内基金管理人、基金财产、基金投资运作等评价。
基金运作方式:契约型开放式	基金合同生效日:2024年09月21日	基金合同生效日:2024年09月21日	-	-	-	11.5基金投资运作的会计师事务所情况 本基金投资运作符合会计师事务所相关规定。特殊普通合伙(以下简称“普华永道”)由50,000名人民币。目前该会计师事务所已在本

[illegible][illegible]

<p>努力,努力实现基金份额持有人的利益,不损害基金份额持有人的利益,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。</p> <p>4.4.2 信息披露</p> <p>本基金在本市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。</p> <p>4.4.3 金融资产和金融负债的分类</p> <p>本基金的金融资产分类为交易类金融资产及应收款项,在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券资产按公允价值分类。</p>	<p>关联方名称</p> <p>持有的基金份额</p> <p>持有的基金份额占基金总份额的比例</p> <p>持有的基金份额</p> <p>持有的基金份额占基金总份额的比例</p>	<p>选定的证券公司专用席位的程序:</p> <p>1) 资格考察;</p> <p>2) 初步确定;</p> <p>3) 签订协议。</p>
--	--	--

[illegible]