银河银信添利债券型证券投资基金 2008年年度报告摘要

2008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:中信银行股份有限公司 送出日期:2009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及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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年3月25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。

本报告财务资料已经审计,请投资者注意阅读。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

§2 基金简介

基金简称	银信添利基金	
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	
报告期末基金份额总额	1,326,513,318.35份	
下属两级基金的基金简称	银信添利A类	银信添利B类
下属两级基金的交易代码	519667	519666
报告期末下属两级基金的份额总额	895,325,104.63份	431,188,213.72份

2.1 基金基本情况

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	通过合理的债券资产配置,综合运用利率预期、收益率曲线和其他动态增强策略特别是新股申购等,获取稳定收益。
业绩比较基准	新华巴克莱资本中国全债指数涨跌幅*80%+税后一年期定期存款利率*20%。
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,以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为基金的投资目标。本基金还可以通过参与新股申购提高基金的收益水平。本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和收益水平高于货币市场基金和中短期债券基金,低于混合型基金和股票型基金。

注:根据新华雷曼中国综合债券指数的编制人新华富时指数有限公司的公告,其母公司新华财经与雷曼兄弟公司合作推出的新华雷曼中国全债指数已正式更名为新华巴克莱资本中国全债指数,指数的编制方法、计算和管理无任何改变。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王娟凤	朱义明
	联系电话	021-38568707	010-65556899
	电子邮箱	wangjuanfeng@galaxyasset.com	zhuyiming@citicbank.com
客户服务电话		400-820-0860	95558
传真		021-38568501	010-65550832

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 2、北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

§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

期间数据和指标		2008年度	2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日
本期已实现收益	A类	40,585,749.62	316,004,262.96
	B类	124,118,875.08	
本期利润	A类	77,327,365.01	492,849,671.63
	B类	-11,376,624.78	
加权平均基金份额本期利润	A类	0.0618	0.1542
	B类	-0.0074	
本期基金份额净值增长率	A类	6.27%	14.15%
	B类	6.04%	
期末数据和指标		2008年度	2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日
期末可供分配基金份额利润	A类	0.0439	0.0747
	B类	0.0416	
期末基金资产净值	A类	969,504,716.29	4,246,779,564.39
	B类	465,887,016.37	
期末基金份额净值	A类	1.0829	1.1204
	B类	1.0805	

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。

所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(基金于2008年5月23日进行分级)。

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

债券银信添利A类基金:

阶段	净值增长率①	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	6.69%	0.25%	3.77%	0.09%	2.92%	0.16%
过去六个月	8.03%	0.19%	5.66%	0.08%	2.37%	0.11%
过去一年	6.27%	0.20%	8.22%	0.06%	-1.95%	0.14%
自基金成立起至今	21.30%	0.21%	7.80%	0.07%	13.50%	0.14%

债券银信添利B类基金:

阶段	净值增长率①	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	6.59%	0.26%	3.77%	0.09%	2.82%	0.17%
过去六个月	7.81%	0.19%	5.66%	0.08%	2.15%	0.11%
过去一年	6.04%	0.20%	8.22%	0.06%	-2.18%	0.14%
自基金成立起至今	21.04%	0.21%	7.80%	0.07%	13.24%	0.14%

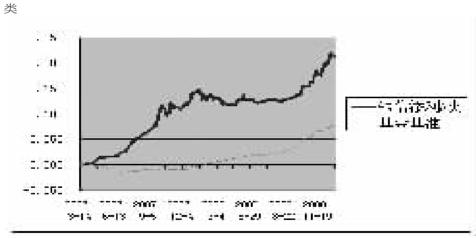
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

银河银信添利债券型证券投资基金

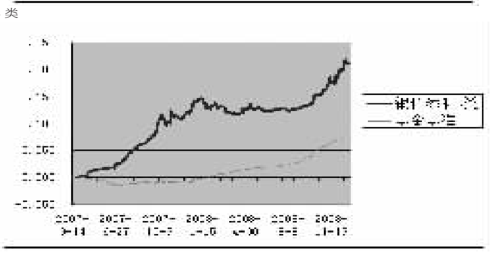
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2007年3月14日至2008年12月31日)

债券A类

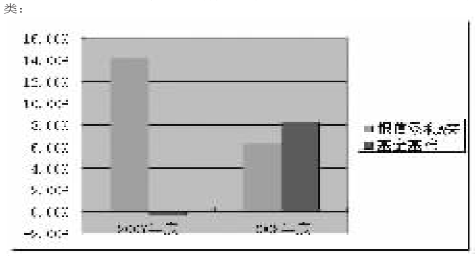


债券B类

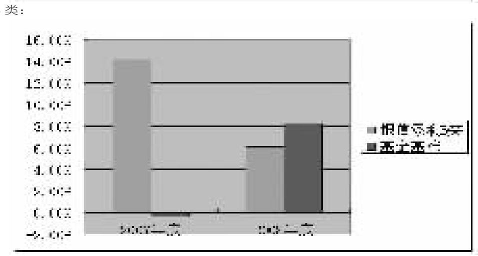


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

债券A类:



债券B类:



注:基金于2007年3月14日合同生效。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	基金类别	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
2008.5.23-2008.12.31	A类	0.630	57,530,020.73	32,734,306.50	90,264,327.23	-
	B类	0.630	22,917,070.54	9,580,833.84	32,497,904.38	-
2008.1.1-2008.5.22		0.380	51,745,242.72	69,239,496.31	120,984,739.03	-
2007.3.14-2007.12.31		0.200	55,310,432.12	19,420,892.59	74,731,324.71	-
合计		1.210	187,502,766.11	130,975,529.24	318,478,295.35	-

§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(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另管理1只封闭式基金与4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

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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆栋梁	本基金基金经理	2007-3-14	—	13	本科学历,曾先后就职于中国信达信托投资公司、宏源证券股份有限公司和上海永嘉投资管理有限责任公司,期间主要从事固定收益投资及相应的管理工作。2004年9月进入银河基金管理有限公司,担任银河基金管理公司研究员、基金经理助理等职务。

注:任职日期和离职日期均指公司做出决定之日,为便于理解,表中标注的任职日期为基金经理的正式任职日期。

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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。

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

银河银信添利债券型证券投资基金(以下简称"银信添利")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》,完善了公司公平交易制度,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

本基金管理人旗下无与本基金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

本基金在本报告期内无异常交易行为。

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

2008年市场概述:

2008年的债券市场是精彩纷呈的一年,受上下半年截然不同的国际国内宏观经济和物价走势的影响,债券市场跌宕起伏,表现出宏观经济背景息息相关的特征。具体全年市场走势可以分为三个阶段:

第一阶段为年初至4月中旬,期间美国次贷危机开始在金融系统显现,美联储年初大幅降息以缓解银行体系流动性危机。由此,尽管国内物价指数高企,但市场对加息的预期开始弱化,同时央行年初的信贷紧缩政策导致市场特别是国内银行体系流动性泛滥,债券市场在资金推动下,出现一波上涨行情,债券特别是国债收益率大幅下降,10年期国债收益率下降50个基点,牛市萌芽初现。

第二阶段为4月中旬至7月中旬,期间以油价为代表的国际大宗商品持续走高,国内物价居高不下,国内外加息预期增强,央行连续两个月提高准备金率导致资金极度紧张。市场出现较大幅度调整,债券收益率重回前期高位,考验投资者忍耐力。

第三阶段:7月下旬至年底,期间由次贷危机引发的全球金融经济危机蔓延至全球,国际国内经济下滑趋势渐趋明朗,央行空前力度的降息降准备金率,实体经济不振,银行惜贷,市场资金充裕,债券市场各期限各品种收益率大幅度降低,平均降幅超过200个基点。

2008年投资管理回顾:

银信添利债券投资基金运作进入第二个年头,在保证基金资产安全的前提下,追求稳定的回报仍是我们一贯坚持的投资理念。但是08年上半年,由于股票市场的调整幅度认识不足,导致的基金权益类投资的损失,严重拖累了净值增长。下半年特别是四季度,银信添利基金及时调整了投资策略,强调以债券投资为重点,回归银信添利基金债券基金的本色,坚定地加大债券投资力度,在组合久期和组合规模上都较上半年有重大转变,同时很好地兼顾了市场结构性变化的机会,迅速提升了业绩,使得基金净值的表现有了比较大的改观,全年基金年化收益为6.1%,较好地体现了银信添利作为债券投资基金本金安全和收益稳定的特征。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

综合目前国际国内面临的严峻金融经济形势、物价走势、我们对未来一段时期宏观经济金融政策的预期以及债券市场供需情况的分析,我们对09年债券市场持谨慎乐观的观点,认为09年仍然面临着较好的债券市场环境,前期我们判断市场运行趋势的一些主要方面目前来看并没有发生重大的变化和转折,市场仍有一定上升空间。但是,由于各年期债券已接近历史低位,持续的、爆发性的机会在09年不会再有,绝对收益率期望不能过高,09年债券市场更多的可能是以震荡向上或者说是波浪上升的形式出现,存在较多的结构性和波段操作机会。因此,在具体操作上,应把握好市场波段性与结构性的机会,精耕细作。此外,由于股票市场前期跌幅巨大,风险大量释放,应关注可转债和其他权益类资产的投资机会。

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

1、根据法律法规以及《基金合同》的约定,本基金在满足法律、法规规定的基金分红条件且每份基金份额可分配收益超过0.001元的前提下,本基金每季度至少分配收益一次,每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%。本基金截至2008年3月31日,可分配收益为186,114,032.68元,单位可分配收益0.060元,6月23日基金进行利润分配,每单位分配收益0.031元,超过可分配收益的50%;截至2008年6月30日,可分配收益为79,021,377.21元,单位可分配收益0.033元,9月22日基金进行利润分配,每单位分配收益0.017元,超过可分配收益的50%;截至2008年9月30日,可分配收益为49,834,901.29元,单位可分配收益0.029元,12月23日基金进行利润分配,每单位分配收益0.015元,超过可分配收益的50%

2、截至2008年12月31日,可分配收益为57,214,735.79元,单位可分配收益0.043元,根据公司分红安排,本基金于2009年3月24日进行利润分配,每单位分配收益0.220元,超过可分配收益的50%

§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

2008年度,本托管人在对银河银信添利债券型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、托管协议和其他有关规定,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

2008年度,银河基金管理有限公司在银河银信添利债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,本托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对基金管理人—银河基金管理有限公司在2008年度所编制和披露的银河银信添利债券型证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容具有真实、准确和完整性。

中信银行股份有限公司

§6 审计报告

本报告期内本基金由中瑞岳华会计师事务所有限公司出具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:银河银信添利债券型证券投资基金

报告截止日:2008年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资产:			
银行存款		28,979,694.65	396,636,866.41
结算备付金		4,024,432.65	22,881,331.92
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产		1,606,306,368.22	3,692,229,543.74
其中:股票投资		479,536.47	282,289,588.14
基金投资		-	-
债券投资		1,605,826,831.75	3,409,939,955.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	9,087,735.20
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		27,954,283.32	60,959,413.71
应收股利		-	-
应收申购款		455,477.66	181,801,431.59
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,667,970,256.50	4,363,846,322.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007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		229,999,545.00	-
应付证券清算款		-	110,960,780.29
应付赎回款		273,524.67	899,683.01
应付管理人报酬		776,434.38	2,241,480.31
应付托管费		238,902.86	689,686.25
应付销售服务费		153,671.12	1,379,372.52
应付交易费用		16,948.69	155,755.80
应交税费		-	-
应付利息		15,497.12	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,104,000.00	740,000.00
负债合计		232,578,523.84	117,066,758.18
所有者权益:			
实收基金		1,326,513,318.35	3,790,522,194.95
未分配利润		108,878,414.31	456,257,369.44
所有者权益合计		1,435,391,732.66	4,246,779,564.39
负债和所有者权益总计		1,667,970,256.50	4,363,846,322.57

注:基金于2008年5月23日实施分级,报告截止日2008年12月31日银信添利基金份额总额为1,326,513,318.35份,其中A类基金净值为1.0829元,基金份额895,325,104.63份,B类基金净值为1.0805元,基金份额431,188,213.72份。

7.2 利润表

会计主体:银河银信添利债券型证券投资基金

本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日
一、收入		112,093,710.95	567,220,696.53
1. 利息收入		84,157,712.91	53,276,172.74
其中:存款利息收入		3,401,041.84	10,526,999.57
债券利息收入		80,756,671.07	34,410,357.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	8,338,815.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以"-"号填列)		126,393,030.07	335,202,583.15
其中:股票投资收益		89,017,074.00	321,891,005.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益		25,796,592.08	2,552,191.72
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		11,435,962.71	10,754,073.37
股利收益		143,401.28	5,312.25
3. 公允价值变动收益(净损失以"-"号填列)		-98,753,884.47	176,845,408.67
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以"-"填列)		296,852.44	1,896,531.97
二、费用(以"-"填列)		-46,142,970.72	-74,371,024.90
1. 管理人报酬		-16,182,582.05	-17,508,920.55
2. 托管费		-4,979,256.04	-5,387,360.20
3. 销售服务费		-6,789,729.21	-10,774,720.40
4. 交易费用		-1,502,392.16	-2,738,153.51
5. 利息支出		-16,315,254.77	-37,583,563.73
其中:卖出回购金融资产支出		-16,315,254.77	-37,583,563.73
6. 其他费用		-373,756.49	-378,306.51
三、利润总额(亏损以"-"号填列)		65,950,740.23	492,849,671.63
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(亏损以"-"号填列)		65,950,740.23	492,849,671.63

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银河银信添利债券型证券投资基金

本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

项目	本期2008年1月1日至2008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)	3,790,522,194.95	456,257,369.44	4,246,779,564.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	65,950,740.23	65,950,740.23
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)	-2,464,008,876.60	-169,582,724.72	-2,633,591,601.32
其中:1.基金申购款	2,808,076,253.97	205,438,243.98	3,013,514,497.95
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-5,272,085,130.57	-375,020,968.70	-5,647,106,099.27
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)	-	-243,746,970.64	-243,746,970.64
五、期末所有者权益(基金净值)	1,326,513,318.35	108,878,414.31	1,435,391,732.66
项目	上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	492,849,671.63	492,849,671.63
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)	3,790,522,194.95	38,139,022.52	3,828,661,217.47
其中:1.基金申购款	8,880,891,113.34	394,568,631.40	9,275,459,744.74
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-5,090,368,918.39	-356,429,608.88	-5,446,798,527.27
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)	-	-74,731,324.71	-74,731,324.71
五、期末所有者权益(基金净值)	3,790,522,194.95	456,257,369.44	4,246,779,564.39

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银河银信添利债券投资基金(以下简称"本基金"或"基金")系经中国证监会2007年1月22日证监基金字[2007]14号文批准,由银河基金管理有限公司作为基金发起人,于2007年3月14日正式成立的契约型开放式债券基金。本基金运作方式为契约型开放式,存续期为不定期,本基金合同生效日的基金份额总额为2,450,672,675.34份,本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金经中国证监会证监基金字[2007]14号文件批准,于2007年2月6日起向全社会公开募集。截止到2007年3月6日,基金募集工作已经顺利结束。经中瑞华恒信会计师事务所有限公司验资,本次募集的净认购金额为2,449,832,613.05元人民币,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计843,320.87元人民币。募集资金已于2007年3月12日划入本基金在基金托管人中信银行开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为19,133户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,设立募集期募集及利息结转的基金份额共计2,450,672,675.34份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金募集费用中列支,不从基金资产中支付。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《银河银信添利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")、《银河银信添利债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,银河基金管理有限公司已向中国证监会办理基金备案手续,并于2007年3月14日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,基金管理人开始正式管理本基金。

根据<<银河基金管理有限公司关于银河银信添利债券型证券投资基金份额分类及费率调整的公告>>,基金于2008年5月23日始实施分级,分级后本基金设两级基金:A类基金份额和B类基金份额。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础,根据实际发生的交易和事项,按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》(财政部令第33号)及《财政部关于印发<企业会计准则第1号-存货>等38项具体准则的通知》(财会[2006]3号)和2006年10月30日颁布的《财政部关于印发<企业会计准则-应用指南>的通知》(财会[2006]18号)(以下简称"新会计准则")和中国证券监督管理委员会2007年2月15日发布的《公开发行证券的公司信息披露规范问答第7号—新旧会计准则过渡期间比较财务会计信息的编制和披露》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《银河银信添利债券型证券投资基金基金合同》及中国证监会的有关规定,并基于以下所述主要会计政策、会计估计进行编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合中华人民共和国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》及其他各项会计准则、中国证券业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《银河银信添利债券型证券投资基金基金合同》及中国证监会有关规定的要求,真实、完整地反映了基金财务状况、经营成果和基金净值变动等有关信息。

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一致

7.4.5 本报告期无前期差错更正

7.4.6 税项

1、营业税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的有关规定,以发行基金方式募集资金,不属于营业税的征收范围,不征收营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》和财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的有关规定,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的收入,在2003年底前暂免征收营业税,自2004年1月1日起继续免征。

2、企业所得税

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》和财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的有关规定,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的收入,在2003年底前暂免征收企业所得税,自2004年1月1日起继续免征。

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》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。

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》的有关规定,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。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的有关规定,对基金取得的股票的股息、红利收入以及债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业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[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的有关规定,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,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,依照现行税法规定计征个人所得税。

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》的有关规定,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。

4、印花税

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》的有关规定,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。

根据财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》(2007)财税[2007]84号的有关规定,经国务院批准,从2007年5月30日起,调整证券(股票)交易印花税税率。对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据,由立据双方当事人分别按3‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定,从2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税率,由原先的3‰调整为1‰。即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据,由立据双方当事人分别按1‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

经国务院批准,财政部决定从2008年9月19日起,对证券交易印花税政策进行调整,由现行双边征收改为单边征收,税率保持1‰。即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据,由立据双方当事人分别按1‰的税率缴纳股票交易印花税,改为由出让方按1‰的税率缴纳股票交易印花税,授让方不再征收。

7.4.7 关联方关系

7.4.7.1 本报告期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

2008年6月23日,根据中国证监会《关于核准银河基金管理有限公司变更股权及修改公司章程的批复》(证监许可[2008]827号文),本基金管理人银河基金管理有限公司股东中国银河证券有限责任公司(以下简称"银河证券")将其持有50%的股份全部转让给中国银河金融控股有限责任公司。

(1)2008年6月23日前本基金的关联方:

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
中信银行股份有限公司	基金托管人
中国银河证券有限责任公司	基金管理人的控股股东
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

(2)2008年6月23日后本基金的关联方:

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
中信银行股份有限公司	基金托管人
中国银河金融控股有限责任公司	基金管理人的控股股东
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
中国银河证券有限责任公司	同受基金管理人控股股东控制

7.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中信银行股份有限公司	基金托管人
中国银河证券有限责任公司	同受基金管理人控股股东控制

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2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007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
中国银河证券有限责任公司	94,733,333.43	20.29%	278,427,620.21	36.35%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金2008年度及2007年度均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

关联方名称	本期2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007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
中国银河证券有限责任公司	80,542,613.12	18.10%	3,031,614.00	0.52%

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金2008年度及2007年度均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2008年1月1日至2008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
中国银河证券有限责任公司	76,971.65	100.00%	4,523.69	100.00%
关联方名称	上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007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
中国银河证券有限责任公司	217,871.49	99.61%	125,223.07	100.00%

注:1、交易佣金按买(卖)股票成交金额的1‰,扣除买卖股票的经手费、证管费及证券交易结算风险金等计算;债券现货及债券回购交易不计交易佣金,但债券现货及债券回购交易产生的证券交易结算风险金从股票交易佣金中扣除。该基金共有两个席位,中信证券的席位后来不再收取股票佣金,但债券现货及债券回购交易产生的证券交易结算风险金由基金公司承担,所以大部分佣金都是支付给银河证券的。

2、根据银河证券与基金管理人签订的《证券交易席位租赁协议》,银河证券还需向基金管理人提供证券研究综合服务,服务内容包括银河证券的投资银行部门、营业部、研究部门等部门在法律允许范围内对管理人基金管理业务的研究支持与配合。

3、本基金与银河证券发生的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立,交易佣金的计算及佣金比率是公允的。

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2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日
当期应支付的管理费	16,182,582.05	17,508,920.55
其中:当期已支付	15,406,147.67	-
期末未支付	776,434.38	-

注:本基金应支付基金管理人管理费,按前一日基金资产净值0.65%的年费率逐日计提,累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值× 0.65% ÷ 当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日
当期应支付的托管费	4,979,256.04	5,387,360.20
其中:当期已支付	4,740,353.18	-
期末未支付	238,902.86	-

注:本基金应支付基金托管人托管费,按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提,累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20% ÷ 当年天数

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

B类:

获得销售服务费的各关联方名称	本期2008年1月1日至2008年12月31日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
银河基金管理有限公司	4,406,390.03	11,943.95	4,418,333.98
中信银行股份有限公司	597,699.25	46,581.65	644,280.90
中国银河证券有限责任公司	955,072.04	71,975.09	1,027,047.13
合计	5,959,161.32	130,500.69	6,089,662.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
银河基金管理有限公司	6,390,513.60	1,065,656.83	7,456,170.43
中信银行股份有限公司	751,036.77	66,325.89	817,362.66
中国银河证券有限责任公司	1,524,856.58	118,763.27	1,643,619.85
合计	8,666,406.95	1,250,745.99	9,917,152.94

注:基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金管理人将通过定期的审计和监察稽核监督基金销售服务费的支出和使用情况,确保其用于约定的用途。在通常情况下,本基金销售服务年费率为0.40%,计算方法如下:

每日应支付的基金销售服务费=前一日基金份额的基金资产净值×0.40% ÷ 当年天数

根据<<银河基金管理有限公司关于银河银信添利债券型证券投资基金份额分类及费率调整的公告>>,基金于2008年5月23日实施分级,分级后本基金设两类基金:A类基金份额和B类基金份额,其中A类基金不在计提销售服务费,B类基金按原来0.40%的年费率继续计提。

B类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40% ÷ 当年天数。

本基金在2008年1月1日至2008年5月22日发生的销售服务费为5,399,353.13元,2008年5月23日至2008年12月31日发生B类基金销售服务费1,390,376.08元,2007年3月14日至2007年12月31日发生基金销售服务费10,774,720.40元。

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期2008年1月1日至2008年12月31日					
	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
中信银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日					
	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
中信银行股份有限公司	101,453,184.93	-	-	-	-	-

注:本基金与中信银行发生的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.4 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

份额单位:份

投资B类:

项目	本期2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日
期初持有的基金份额	49,314,528.06	-
期间认购总份额	-	
期间申购/买入总份额	-	49,314,528.06
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	49,314,528.06	49,314,528.06
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.72%	1.30%

注:本基金管理人运用固有资金投资本基金系在正常业务范围内,按一般的商业条款进行,投资本基金的费率是公允的。

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

截至2008年12月31日止及截至2007年12月31日止,银河基金管理有限公司主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

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2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007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
中信银行股份有限公司	28,979,694.65	2,778,001.53	396,636,866.41	10,209,094.13

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
本期2008年1月1日至2008年12月31日					
				数量(单位:张)	总金额
中国银河证券有限责任公司	126011	08石化债	网下中签	539,010	41,292,243.52
上年度可比期间2007年3月14日(基金合同生效日)至2007年12月31日					
				数量(单位:股)	总金额
中国银河证券有限责任公司	600030	中信证券	增发	485,974	36,404,312.34
中国银河证券有限责任公司	600048	保利地产	增发	38,000	2,108,240.00

注:本基金无参与托管人中信银行股份有限公司股东承销证券的情况存在。

7.4.9 期末(2008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

单位:人民币元

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	期末成本总额	期末估值总额
7.4.12.1.1 受限证券类别:股票									
							(单位:股)		
002257	立立电子	2008-6-30	-	网下配售部分未流通	21.81	21.81	21987	479,536.47	479,536.47
7.4.12.1.2 受限证券类别:债券									
							(单位:张)		
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 受限证券类别:权证									
							(单位:份)		
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票

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2008年12月31日止,本基金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为169,999,545.00元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
080417	08农发17	2009-1-6	106.97	1,200,000	128,364,000.00
080420	08农发20	2009-1-6	102.78	500,000	51,390,000.00
合计	-	-	-	1,700,000	179,754,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至2008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为60,000,000.00元,于2009年1月5日到期。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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	占基金总资产比例
1	权益投资	479,536.47	0.03%
	其中:股票	479,536.47	0.03%
2	固定收益投资	1,605,826,831.75	96.27%
	其中:债券	1,605,826,831.75	96.27%
	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	33,004,127.30	1.98%
6	其他资产	28,659,760.98	1.72%
7	合计	1,667,970,256.50	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	479,536.47	0.03%
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	479,536.47	0.03%
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	479,536.47	0.03%

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002257	立立电子	21,987	479,536.47	0.03%

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.galaxyasset.com网站的年度报告正文。

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	累计买入金额	占期初资产净值比例
1	600456	宝钛股份	45,305,410.04	1.07%
2	600409	三友化工	29,999,970.00	0.71%
3	600026	中海发展	29,947,888.71	0.71%
4	601186	中国铁建	25,805,360.00	0.61%
5	601958	金钼股份	17,552,816.41	0.41%
6	000402	金融街	16,238,766.28	0.38%
7	601899	紫金矿业	16,163,068.30	0.38%
8	600481	双良股份	13,826,231.54	0.33%
9	601766	中国南车	5,300,768.10	0.12%
10	002003	伟星股份	2,679,012.45	0.06%
11	002211	宏达新材	2,142,425.15	0.05%
12	002267	陕天然气	2,095,400.94	0.05%
13	002269	美邦服饰	2,086,893.12	0.05%
14	002244	滨江集团	1,756,368.18	0.04%
15	002237	恒邦股份	1,205,212.20	0.03%
16	002258	利尔化学	1,099,050.04	0.03%
17	002242	九阳股份	1,070,379.52	0.03%
18	002254	烟台氨纶	1,056,060.72	0.02%
19	002215	诺普信	915,708.45	0.02%
20	002236	大华股份	874,409.52	0.02%

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	累计卖出金额	占期出资产净值比例
1	600456	宝钛股份	41,095,401.07	0.97%
2	601857	中国石油	34,597,284.88	0.81%
3	600026	中海发展	30,605,192.09	0.72%
4	601186	中国铁建	29,899,038.28	0.70%
5	601939	建设银行	27,920,886.48	0.66%
6	601601	中国太保	26,381,492.22	0.62%
7	600409	三友化工	25,488,908.53	0.60%
8	601866	中海集运	24,815,174.49	0.58%
9	601169	北京银行	23,129,220.07	0.54%
10	601390	中国中铁	22,231,172.45	0.52%
11	601899	紫金矿业	20,491,168.56	0.48%
12	601958	金钼股份	20,156,807.96	0.47%
13	000402	金融街	14,656,781.82	0.35%
14	601808	中海油服	13,120,939.43	0.31%
15	600481	双良股份	11,012,744.53	0.26%
16	601766	中国南车	9,503,427.00	0.22%
17	601918	国投新集	9,409,833.32	0.22%
18	002211	宏达新材	4,718,243.00	0.11%
19	002202	金风科技	4,128,764.56	0.10%
20	002172	澳洋科技	3,899,600.97	0.09%

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	233,090,597.07
卖出股票收入(成交)总额	466,892,252.41

注:卖出股票的收入总额按成交单价乘以成交数量进行填列

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	218,607,995.60	15.23%
2	央行票据	427,075,000.00	29.75%
3	金融债券	656,394,000.00	45.73%
	其中:政策性金融债	656,394,000.00	45.73%
4	企业债券	223,169,832.67	15.55%
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	80,580,003.48	5.61%
7	其他	-	-
8	合计	1,605,826,831.75	111.87%

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	080417	08农发17	1,200,000	128,364,000.00	8.94%
2	0801062	08央票62	1,000,000	107,170,000.00	7.47%
3	0801038	08央票38	1,000,000	106,770,000.00	7.44%
4	0801017	08央票17	1,000,000	106,390,000.00	7.41%
5	080217	08国开17	1,000,000	104,500,000.00	7.28%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

8.9.2 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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,954,283.32
5	应收申购款	455,477.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,659,760.98

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	110598	北大荒转债	23,172,457.00	1.61%
2	110002	南山转债	17,964,223.60	1.25%
3	125528	柳工转债	15,663,250.88	1.09%
4	125960	锡业转债	7,096,055.00	0.49%
5	110971	恒源转债	6,009,465.60	0.42%
6	110567	山鹰转债	2,410,688.90	0.17%
7	110368	五洲转债	2,389,455.00	0.17%
8	125572	海马转债	2,172,200.00	0.15%
9	110227	赤化转债	812,740.50	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	002257	立立电子	479,536.47	0.03	网下配售部分未流通

§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
银信添利A类	53	16,892,926.50	894,263,732.26	67.41%	1,061,372.37	0.08%
银信添利B类	7,128	60,492.17	121,999,267.62	9.20%	309,188,946.10	23.31%
合计	7,181	16,953,418.67	1,016,262,999.88	76.61%	310,250,318.47	23.39%

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	B类	50,000	0.00%
	合计	50,000	0.00%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金名称	银信添利基金A类	银信添利基金B类
基金合同生效日(2007年3月14日)基金份额总额	-	2,450,672,675.34
报告期期初基金份额总额	-	3,790,522,194.95
报告期期间基金总申购份额	1,965,003,356.77	843,072,897.20
报告期期间基金总赎回份额	1,069,678,252.14	4,202,406,878.43
报告期期末基金份额总额	895,325,104.63	431,188,213.72

注:红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源,统一计入本期总申购份额,基金转换转出作为本期赎回资金的支付,统一计入本期总赎回份额。本基金于2008年5月23日进行分级。

§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、2008年8月29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变更高级管理人员的公告》,聘任王娟凤女士为公司副总经理。

2、2008年12月16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副总经理姜皓同志代为履行督察长职务的公告》,公司同意屈艳萍同志提出辞去督察长职务的申请,同时聘任副总经理姜皓同志代为履行督察长职务。

二、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

报告期内基金未改聘会计师事务所。本报告期内支付2007年度基金审计费用60,000元,本报告期内已计提尚未支付2008年度基金审计费用60,000元,本基金成立以来一直由该会计师事务所提供审计服务。

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

1、基金租用席位数量情况

证券公司名称	银信添利基金金租用席位数量
银河证券股份有限公司	1
中信建投证券有限责任公司	1

注:报告期内本系列基金无席位变更情况。

1、银信添利基金席位交易量情况

金额单位:人民币元

券商名称	股票成交金额	占股票成交总额比例	债券成交金额	占债券成交总额比例	回购成交金额	占回购成交总额比例	权证成交金额	占权证成交总额比例	实付佣金	占佣金总额比例
银河证券	94,733,333.43	20.29%	80,542,613.12	18.10%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	76,971.65	100.00%
中信建投	372,158,918.98	79.71%	364,437,062.11	81.90%	39,157,800,000.00	100.00%	53,818,869.80	100.00%	0.00	0.00%
合计	466,892,252.41	100.00%	444,979,675.23	100.00%	39,157,800,000.00	100.00%	53,818,869.80	100.00%	76,971.65	100.00%

3、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。

银河基金管理有限公司

二〇〇九年三月二十七日