

# 银河收益证券投资基金

## 2012 年度 报告摘要

本基金的业绩比较基准为：债券指数涨跌幅×85%+上证A股指数涨跌幅×15%，其中债券指数为：中信国债指数涨跌幅×51%+中期国债指数涨跌幅×49%。

7.2.2 会计报表的编制基础  
7.2.3 会计报表的编制方法  
7.2.4 会计报表的编制程序

7.3 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.3.1 内部控制制度的专项说明  
7.3.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.4 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.4.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.4.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.5 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.5.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.5.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.6 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.6.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.6.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.7 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.7.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.7.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.8 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.8.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.8.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.9 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.9.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.9.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.10 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.10.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.10.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.11 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.11.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.11.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.12 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.12.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.12.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.13 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.13.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.13.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.14 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.14.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.14.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.15 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.15.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.15.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.16 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.16.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.16.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.17 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.17.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.17.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.18 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.18.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.18.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.19 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.19.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.19.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.20 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.20.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.20.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.21 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.21.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.21.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.22 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.22.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.22.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.23 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.23.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.23.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

7.24 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.24.1 基金管理人内部控制制度的专项说明  
7.24.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

基金管理人：银河基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
基金合同生效日期：2012年12月29日

1.1 重要提示  
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

2.1 基金简介  
基金名称：银河收益债券  
基金代码：151002  
基金运作方式：契约型开放式

3.1 基金管理人  
基金管理人：银河基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

4.1 基金的投资目标  
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，实现基金资产的长期稳定增值。

5.1 基金的投资策略  
根据对宏观经济运行状况、金融环境及利率走势的综合判断，采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，合理配置资产。

6.1 基金的风险收益特征  
本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其中长期平均的预期收益和风险低于指数型基金、平衡型基金、价值型基金及收益型基金，高于纯债券基金。

7.1 基金管理人及基金托管人  
基金管理人：银河基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

8.1 基金的销售网络  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金销售机构：银河基金管理有限公司

9.1 基金的费用  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金费用：基金管理人及基金托管人

10.1 基金的信息披露  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金信息披露：基金管理人及基金托管人

11.1 基金的公告  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金公告：基金管理人及基金托管人

12.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

13.1 基金的法律顾问  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金法律顾问：基金管理人及基金托管人

14.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

15.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

16.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

17.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

18.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

19.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

20.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

21.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

22.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

23.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

24.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

25.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

26.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

27.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

28.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

29.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

30.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

基金管理人：银河基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
基金合同生效日期：2012年12月29日

1.1 重要提示  
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

2.1 基金简介  
基金名称：银河收益债券  
基金代码：151002  
基金运作方式：契约型开放式

3.1 基金管理人  
基金管理人：银河基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

4.1 基金的投资目标  
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，实现基金资产的长期稳定增值。

5.1 基金的投资策略  
根据对宏观经济运行状况、金融环境及利率走势的综合判断，采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，合理配置资产。

6.1 基金的风险收益特征  
本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其中长期平均的预期收益和风险低于指数型基金、平衡型基金、价值型基金及收益型基金，高于纯债券基金。

7.1 基金管理人及基金托管人  
基金管理人：银河基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

8.1 基金的销售网络  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金销售机构：银河基金管理有限公司

9.1 基金的费用  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金费用：基金管理人及基金托管人

10.1 基金的信息披露  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金信息披露：基金管理人及基金托管人

11.1 基金的公告  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金公告：基金管理人及基金托管人

12.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

13.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

14.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

15.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

16.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

17.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

18.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

19.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

20.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

21.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

22.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

23.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

24.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

25.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

26.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

27.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

28.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

29.1 基金的其他事项  
基金管理人及基金托管人：银河基金管理有限公司  
基金其他事项：基金管理人及基金托管人

| 代码 | 行业类别          | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------------|---------------|--------------|
| A  | 农林牧渔、渔业       | -             | -            |
| B  | 采矿业           | -             | -            |
| C  | 制造业           | 9,333,516.78  | 0.29         |
| 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            | -             | -            |
| C6 | 金属、非金属        | -             | -            |
| C7 | 机械、设备、仪表      | 5,391,516.78  | 0.17         |
| C8 | 医药、生物制品       | 3,942,000.00  | 0.12         |
| C9 | 其他制造业         | -             | -            |
| D  | 电力、煤气及水的生产和供应 | -             | -            |
| 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        | 11,183,431.25 | 0.35         |
| J  | 房地产业          | -             | -            |
| K  | 社会服务业         | -             | -            |
| L  | 传播与文化业        | 920,000.00    | 0.03         |
| M  | 综合类           | 21,436,948.03 | 0.67         |

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

| 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  | 601318 | 中国平安 | 168,000 | 7,608,720.00 | 0.24         |
| 2  | 600518 | 康美药业 | 300,000 | 3,942,000.00 | 0.12         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 259,979 | 3,574,711.25 | 0.11         |
| 4  | 002662 | 京威股份 | 400,000 | 3,380,000.00 | 0.11         |
| 5  | 600741 | 华域汽车 | 179,921 | 2,011,516.78 | 0.06         |
| 6  | 300058 | 蓝色光标 | 40,000  | 920,000.00   | 0.03         |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

| 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  | 601318 | 中国平安 | 12,778,933.88 | 5.24           |
| 2  | 600046 | 国电南瑞 | 6,345,328.84  | 2.60           |
| 3  | 600518 | 康美药业 | 6,156,387.33  | 2.52           |
| 4  | 002662 | 京威股份 | 5,131,954.97  | 2.10           |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药 | 4,528,590.00  | 1.86           |
| 6  | 600587 | 新华医疗 | 3,298,632.79  | 1.35           |
| 7  | 300058 | 蓝色光标 | 2,961,609.78  | 1.21           |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 2,786,584.58  | 1.14           |
| 9  | 002144 | 卓达高科 | 2,629,587.62  | 1.08           |
| 10 | 601628 | 中国人寿 | 2,550,947.00  | 1.05           |
| 11 | 601009 | 南京银行 | 2,452,081.00  | 1.00           |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 2,444,950.00  | 0.99           |
| 13 | 600305 | 恒顺醋业 | 1,729,448.00  | 0.73           |
| 14 | 600763 | 通顺医疗 | 1,777,938.00  | 0.73           |
| 15 | 601601 | 中国太保 | 1,721,000.00  | 0.71           |
| 16 | 002025 | 航天电器 | 1,636,655.00  | 0.67           |
| 17 | 002423 | 东方阿胶 | 1,625,100.00  | 0.67           |
| 18 | 600741 | 华域汽车 | 1,572,410.33  | 0.64           |
| 19 | 601336 | 新华保险 | 1,433,566.00  | 0.59           |
| 20 | 600517 | 置信电气 | 1,429,341.25  | 0.59           |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 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  | 600518 | 康美药业 | 6,817,150.13 | 2.79           |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 6,188,366.20 | 2.54           |
| 3  | 600046 | 国电南瑞 | 5,880,953.96 | 2.41           |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 5,223,364.26 | 2.14           |
| 5  | 000568 | 泸州老窖 | 4,231,198.82 | 1.73           |
| 6  | 600587 | 新华医疗 | 2,915,244.65 | 1.19           |
| 7  | 300058 | 蓝色光标 | 2,903,866.49 | 1.19           |
| 8  | 000596 | 吉视传媒 | 2,860,965.99 | 1.17           |
| 9  | 601628 | 中国人寿 | 2,837,163.37 | 1.16           |
| 10 | 002144 | 卓达高科 | 2,518,831.87 | 1.03           |
| 11 | 601009 | 南京银行 | 2,391,277.71 | 0.98           |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 2,124,000.00 | 0.87           |
| 13 | 600305 | 恒顺醋业 | 2,027,129.24 | 0.83           |
| 14 | 600079 | 人福医药 | 1,968,086.33 | 0.81           |
| 15 | 002152 | 泰达股份 | 1,928,760.00 | 0.79           |
| 16 | 601336 | 新华保险 | 1,770,000.00 | 0.73           |
| 17 | 600763 | 通顺医疗 | 1,752,152.55 | 0.72           |
| 18 | 601601 | 中国太保 | 1,684,822.73 | 0.67           |
| 19 | 002423 | 东方阿胶 | 1,640,000.00 | 0.67           |
| 20 | 600517 | 置信电气 | 1,532,596.65 | 0.63           |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 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  | 600518 | 康美药业 | 6,817,150.13 | 2.79           |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 6,188,366.20 | 2.54           |
| 3  | 600046 | 国电南瑞 | 5,880,953.96 | 2.41           |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 5,223,364.26 | 2.14           |
| 5  | 000568 | 泸州老窖 | 4,231,198.82 | 1.73           |
| 6  | 600587 | 新华医疗 | 2,915,244.65 | 1.19           |
| 7  | 300058 | 蓝色光标 | 2,903,866.49 | 1.19           |
| 8  | 000596 | 吉视传媒 | 2,860,965.99 | 1.17           |
| 9  | 601628 | 中国人寿 | 2,837,163.37 | 1.16           |
| 10 | 002144 | 卓达高科 | 2,518,831.87 | 1.03           |
| 11 | 601009 | 南京银行 | 2,391,277.71 | 0.98           |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 2,124,000.00 | 0.87           |
| 13 | 600305 | 恒顺醋业 | 2,027,129.24 | 0.83           |
| 14 | 600079 | 人福医药 | 1,968,086.33 | 0.81           |
| 15 | 002152 | 泰达股份 | 1,928,760.00 | 0.79           |
| 16 | 601336 | 新华保险 | 1,770,000.00 | 0.73           |
| 17 | 600763 | 通顺医疗 | 1,752,152.55 | 0.72           |
| 18 | 601601 | 中国太保 | 1,684,822.73 | 0.67           |
| 19 | 002423 | 东方阿胶 | 1,640,000.00 | 0.67           |
| 20 | 600517 | 置信电气 | 1,532,596.65 | 0.63           |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 11 | 601009 | 南京银行 | 2,391,277.71 | 0.98 |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 2,124,000.00 | 0.87 |
| 13 | 600305 | 恒顺醋业 | 2,027,129.24 | 0.83 |
| 14 | 600079 | 人福医药 | 1,968,086.33 | 0.81 |
| 15 | 002152 | 广电运通 | 1,928,760.00 | 0.79 |
| 16 | 601336 | 新华保险 | 1,770,000.00 | 0.73 |
| 17 | 600763 | 通策医疗 | 1,752,152.55 | 0.72 |