

银河收益证券投资基金

【2013】 第四季度报告

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
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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法律责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 银河收益债券
交易代码 151002
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2003年8月4日
报告期末基金份额总额 1,283,979,846.80份

投资目标 以债券资产为主,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。

投资策略 根据对宏观经济运行状况、金融市场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。在控制利率风险、信用风险及流动性风险等的基础上,通过组合投资,为投资者获得长期稳定的回报。本基金的投资策略作为债券投资的辅助和补充,力争在严格控制风险的情况下,提高基金的收益水平。在正常情况下,债券投资的比例范围为基金资产净值的50%至95%,股票投资的比例范围为基金资产净值的0%至30%,现金的比例范围为基金资产净值的5%至20%。

业绩比较基准 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%+中信债债指数涨跌幅×49%。

风险收益特征 银河收益债券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,高于纯债型基金。

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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益 -8,377,857.53
2.本期利润 -66,770,049.22
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0365
4.期末基金资产净值 1,355,657,013.58
5.期末基金份额净值 1.0558

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。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.72% 0.28% -1.83% 0.19% -1.89% 0.09%

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

注:2003年08月04日本基金成立,根据《银河收益证券投资基金合同》规定,本基金应自基金合同生效之日起6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,本基金各项资产比例符合合同约定。

4 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)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
张矛 2011年8月25日 - 8 中央党校、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,历任基金经理,自2010年1月至2013年3月担任银河收益证券投资基金的基金经理,2012年4月起担任银河通利分级证券投资基金的基金经理。

注:1、上表中任职、离任日期均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工作的从业年限计算;
4.2 管理人对报告期内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》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着“诚实信用、勤勉尽责、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追求基金资产的保值和增值,努力实现基金份额持有人的利益,无损害基金份额持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规的规定,基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤俭律己、创新图强”的理念,严谨勤勉地开展投资,为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 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,在投资管理、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,公司对不同投资组合的授权和审批流程,在12月31日前,对公平交易制度的执行情况进行了检查,并针对发现的问题进行了整改,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)。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4季度经济增长趋于趋缓,通胀压力短期,但资金面持续性紧张,债市收益率进一步走高,导致债市的原因首先在于中期存款投放的力度与前期相比有所回落,冲销了外汇占款的正贡献,同时,央行在公开市场发行逆回购,在12月31日前,对公平交易制度的执行情况进行了检查,并针对发现的问题进行了整改,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)。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明
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》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着“诚实信用、勤勉尽责、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追求基金资产的保值和增值,努力实现基金份额持有人的利益,无损害基金份额持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规的规定,基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤俭律己、创新图强”的理念,严谨勤勉地开展投资,为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。

4.5 投资组合报告
4.5.1 报告期末基金资产组合情况

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
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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法律责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 银河银丰分级
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
报告期末基金份额总额 3,000,000,000.00份

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5%-25%;现金资产比例变动范围是:基金资产的0%-20%。

业绩比较基准 本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其风险和收益特征从长期平均及预期来看介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,或介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,力争使基金单位的长期收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

基金管理人 银河基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益 54,849,916.74
2.本期利润 -103,852,007.75
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0436
4.期末基金资产净值 2,739,147,641.66
5.期末基金份额净值 0.913

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。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.69% 2.54% -2.31% 1.72% -1.38% 0.82%

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

注:2002年8月15日本基金成立,根据《银河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之日起3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2013年11月15日,建仓期已满。建仓期结束时各项投资比例已符合基金合同约定。

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 银河银丰分级
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
报告期末基金份额总额 3,000,000,000.00份

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5%-25%;现金资产比例变动范围是:基金资产的0%-20%。

业绩比较基准 本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其风险和收益特征从长期平均及预期来看介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,或介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,力争使基金单位的长期收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

基金管理人 银河基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益 54,849,916.74
2.本期利润 -103,852,007.75
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0436
4.期末基金资产净值 2,739,147,641.66
5.期末基金份额净值 0.913

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。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.69% 2.54% -2.31% 1.72% -1.38% 0.82%

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

注:2002年8月15日本基金成立,根据《银河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之日起3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2013年11月15日,建仓期已满。建仓期结束时各项投资比例已符合基金合同约定。

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 银河银丰分级
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
报告期末基金份额总额 3,000,000,000.00份

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5%-25%;现金资产比例变动范围是:基金资产的0%-20%。

业绩比较基准 本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其风险和收益特征从长期平均及预期来看介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,或介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,力争使基金单位的长期收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

基金管理人 银河基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益 54,849,916.74
2.本期利润 -103,852,007.75
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0436
4.期末基金资产净值 2,739,147,641.66
5.期末基金份额净值 0.913

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。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.69% 2.54% -2.31% 1.72% -1.38% 0.82%

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

注:2002年8月15日本基金成立,根据《银河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之日起3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2013年11月15日,建仓期已满。建仓期结束时各项投资比例已符合基金合同约定。

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 银河银丰分级
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
报告期末基金份额总额 3,000,000,000.00份

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5%-25%;现金资产比例变动范围是:基金资产的0%-20%。

业绩比较基准 本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其风险和收益特征从长期平均及预期来看介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,或介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,力争使基金单位的长期收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

基金管理人 银河基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益 54,849,916.74
2.本期利润 -103,852,007.75
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0436
4.期末基金资产净值 2,739,147,641.66
5.期末基金份额净值 0.913

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。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.69% 2.54% -2.31% 1.72% -1.38% 0.82%

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

注:2002年8月15日本基金成立,根据《银河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之日起3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2013年11月15日,建仓期已满。建仓期结束时各项投资比例已符合基金合同约定。

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 银河银丰分级
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
报告期末基金份额总额 3,000,000,000.00份

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5%-25%;现金资产比例变动范围是:基金资产的0%-20%。

业绩比较基准 本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其风险和收益特征从长期平均及预期来看介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,或介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,力争使基金单位的长期收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

基金管理人 银河基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益 54,849,916.74
2.本期利润 -103,852,007.75
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0436
4.期末基金资产净值 2,739,147,641.66
5.期末基金份额净值 0.913

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。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.69% 2.54% -2.31% 1.72% -1.38% 0.82%

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

注:2002年8月15日本基金成立,根据《银河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之日起3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2013年11月15日,建仓期已满。建仓期结束时各项投资比例已符合基金合同约定。

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 银河银丰分级
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
报告期末基金份额总额 3,000,000,000.00份

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5%-25%;现金资产比例变动范围是:基金资产的0%-20%。

业绩比较基准 本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其风险和收益特征从长期平均及预期来看介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,或介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,力争使基金单位的长期收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

基金管理人 银河基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益 54,849,916.74
2.本期利润 -103,852,007.75
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0436
4.期末基金资产净值 2,739,147,641.66
5.期末基金份额净值 0.913

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。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.69% 2.54% -2.31% 1.72% -1.38% 0.82%

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

注:2002年8月15日本基金成立,根据《银河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之日起3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2013年11月15日,建仓期已满。建仓期结束时各项投资比例已符合基金合同约定。

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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法律责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 银河银丰分级
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
报告期末基金份额总额 3,000,000,000.00份

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5%-25%;现金资产比例变动范围是:基金资产的0%-20%。

业绩比较基准 本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其风险和收益特征从长期平均及预期来看介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,或介于纯债的股票型组合与纯债的债券型组合之间,力争使基金单位的长期收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

基金管理人 银河基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益 54,849,916.74
2.本期利润 -103,852,007.75
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0436
4.期末基金资产净值 2,739,147,641.66
5.期末基金份额净值 0.913

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。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 -3.69%