

银河通利分级债券型证券投资基金 [2012]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:北京银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月22日

§ 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 银河通利分级债券

交易代码 161505

前端交易代码 -

后端交易代码 -

基金运作方式 约定型基金。本基金《基金合同》生效之日起2年内,银河通利(自《基金合同》生效之日起每满6个月开放一次,银河通利封闭运作上市交易),本基金《基金合同》生效后2年期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

基金合同生效日 2012年4月25日

报告期末基金份额总额 1,528,678,777.25份

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行业基准收益的回报。

投资目标 本基金在综合考虑宏观经济形势、市场利率变化、债券市场资金供求等因素分析的基础上,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的管理构建及调整固定收益投资组合。

投资策略 本基金在综合考虑宏观经济形势、市场利率变化、债券市场资金供求等因素分析的基础上,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的管理构建及调整固定收益投资组合。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为中债国债指数(见有关责任公司编制并发布的中债国债指数)。

风险收益特征 从本基金的整体运作来看,本基金为债券型基金,属于债券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 银河基金管理有限公司

下属两级基金的基金简称 通利债A 通利债B

下属两级基金的交易代码 161506 150079

下属两级基金的前端交易代码 -

下属两级基金的后端交易代码 -

报告期末下属两级基金的份额总额 767,577,943.96份

761,100,833.29份

下属两级基金的风险收益特征 本基金A份额将表现出低风险,银河通利B份额将表现出较高风险,收益相对稳定的特征。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

基金简称 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 25,129,894.00

2.本期利润 40,671,958.75

3.加权平均基金份额本期利润 0.0231

4.期末基金份额净值 1,569,091,952.94

5.期末基金资产净值 1,026

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)扣减相关费用后的余额,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 2.59% 0.10% -0.13% 0.02% 2.72% 0.08%

注:本基金的业绩比较基准为中债国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合价格指数,每日进行再平衡过程。

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:本基金合同生效日为2012年4月25日,根据《银河通利分级债券型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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

3.3 其他指标

单位:人民币元

其他指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

通利债A份额参考净值 1.007

通利A累计份额参考净值 1.030

通利债B份额参考净值 1.046

通利债B累计份额参考净值 1.046

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(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

刘风华 银河通利分级债券型证券投资基金基金经理,银河通利货币型基金基金经理,总经理助理,固定收益部总监 2012年4月25日 - 18 本科学历,硕士研究生,曾就职于浙商证券有限公司,主要从事股权投资、债券投资及风险管理等工作。2008年10月加入银河基金管理有限公司,担任银河通利货币型基金基金经理,银河通利分级债券型证券投资基金基金经理,总经理助理,固定收益部总监。

卢轶乔 银河通利分级债券型证券投资基金基金经理,银河通利货币型基金基金经理,总经理助理,固定收益部总监 2012年4月25日 - 7 中共党员,硕士研究生,曾就职于浙商证券有限公司,主要从事股权投资、债券投资及风险管理等工作。2010年9月担任银河基金管理有限公司,担任银河通利货币型基金基金经理,银河通利分级债券型证券投资基金基金经理,总经理助理,固定收益部总监。

注:刘风华任本基金日期为基金合同成立之日。

2.证券从业年限以其从事证券行业的从业经历累计年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。

4.3 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。

4.4 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。

4.5 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。

4.6 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。

4.7 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。

4.8 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。

4.9 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。

4.10 基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《基金法》、《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、勤勉尽责,不断创新的原则和运用基金资产,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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

本基金的发行政策、扩大基金规模、赎回安排、诚信稳健、勤勉尽责,不断创新的原则,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

基金持有人谋取长期稳定的回报。