

银河沪深300价值指数证券投资基金

[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:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人和基金管理人根据本基金合同规定，于2013年1月18日恢复了本报告中的财务指标、净值表现、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好基金资产，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:银河沪深300价值指数

交易代码:519671

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年12月28日

报告期末基金份额总额:835,917,248.12份

基金资产净值:345,917,248.12份

报告期基金利润总额:34,225,491.24份

期末可供分配基金份额总额:13,103,276.98份

期末基金资产净值:668,468,571.86份

基金份额净值:1.648,592.1472元

基金份额净值增长率:1.648%

基金份额净值增长率标准差:0.0265%

过去三个月净值增长率:3.14%

净值增长率标准差:1.00%

业绩比较基准:8.80%+上证综指收益

风险收益特征:本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种。

基金管理人:银河基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

§ 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

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -2,129,756.81

2.本期利润 86,063,139.12

3.加权平均基金份额本期利润 0.1176

4.期末基金资产净值 656,234,700.14

5.期末基金份额净值 0.785

注:1.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。

6.基金本期绩效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 报告期末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) 准收益差(4) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 15.78% 1.13% 8.80% 6.65%

16.68% 1.20% -0.90% -0.07%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.上表中报告日期为本基金合同生效日。

2.本基金从二级市场买入其他行业的从业经历累计年限计算。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金管理暂行办法》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为，基金投资运作符合基金合同的约定，基金资产运作情况良好，实现了基金的增值。

5.5 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。

6.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012年四季度，本基金收益率为15.78%，业绩比较基准收益率为16.68%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

任本基金的基金经理 证券从业年限

任职日期 离任日期

说明

注:1.中共党员，博士研究生学历，曾就职于华夏银行、中信万通证券有限公司，期间从事企业金融、投资银行业务及上市公司并购等工作。

2.2006年2月加入银河基金管理有限公司，历任产品经理、行业研究员、衍生品量化投资研究员、行业研究员等职务。

3.5.8 基金的投资由十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票之外的股票。

5.8.3 报告期末基金投资的股票组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600016 民生银行 5,061,598 39,784,160.28 6.06

2 600036 招商银行 2,769,459 3,080,061.25 5.80

3 601318 中国平安 740,471 33,535,931.59 5.11

4 601166 兴业银行 1,666,687 27,850,386.03 4.24

5 601328 交通银行 5,442,082 26,883,885.08 4.10

6 600000 潘行银行 2,473,493 24,537,050.56 3.74

7 000002 万科A 2,185,237 22,114,598.44 3.37

8 600030 中信证券 1,522,055 20,334,654.80 3.10

9 601088 中国神华 728,917 18,478,045.95 2.82

10 601288 农业银行 6,178,687 17,300,323.60 2.64

5.8.4 报告期内积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.8.5 报告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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.6 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.7 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.8 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.9 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.10 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.11 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.12 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.13 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.14 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.15 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.16 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.17 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.18 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.19 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.20 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.21 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.22 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.23 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.24 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.25 报告期内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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600002 万科A 22,114,598.44 3.37 重大事项停牌

5.8.26 报告期内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