

银河银泰理财分红证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9月30日

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:2012年10月24日

重要提示
基金管理人及基金托管人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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2012年10月19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。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,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。

本报告期内基金净值表现
本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

基金名称:银河银泰混合
交易代码:151013
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2007年3月30日

投资目标
追求资产的安全性、流动性和增值,为投资者创造长期稳定的投资回报。

投资策略
本基金将在投资风险控制的前提下,采取股票市场和债券市场的积极投资策略,通过分散化投资降低非系统性风险,追求基金资产的长期增值。

业绩比较基准
上证A股指数*60%+中信全债指数*40%

风险收益特征
本基金属于风险中性的投资品种,风险-收益水平介于债券基金与股票基金之间。

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

主要财务指标
本报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

1.本期已实现收益 65,589,817.49
2.本期利润 -55,410,518.28
3.加权平均基金份额本期利润 -0.0200

4.期末基金资产净值 2,618,413,391.65
5.期末基金份额净值 0.9550

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。

注:本基金业绩指标不扣除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 -2.08% -2.41% 0.40% 0.67%

注:本基金的投资比较基准为:上证A股指数*40%+中信全债指数*60%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金名称:银河银泰混合
基金合同生效日期:2007年3月30日

4.1 基金管理人 魏金峰 简介
姓名:魏金峰 职务:基金基金经理

魏金峰先生,1971年10月10日出生,硕士研究生学历,CFP二級证书,曾先后任职于上海证券期货交易所、东方证券股份有限公司、银河基金管理有限公司,从事经济及股票基金研究工作。

注:1、上表中上报日期为股东大会决定之日;
2、基金业绩指标不扣除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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在符合法律法规的前提下,为基金份额持有人谋求利益。

4.3 公平交易专项说明
报告期内,公司严格执行了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、会计核算等方面公平交易,确保公平对待不同投资组合,同时,公司对不同投资组合的整体收益率差异、申购赎回价差、基金份额净值差异进行了分析,未发现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行《基金合同》及《银河银泰混合基金基金合同》,在符合法律法规的前提下,为基金份额持有人谋求利益。

4.5 报告期内基金资产净值及基金份额净值
截至2012年9月30日,本基金资产净值为2,618,413,391.65元,基金份额净值为0.9550元。

4.6 报告期内基金管理人及基金经理的变更情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生变更。

4.7 报告期内基金管理人及基金经理的薪酬情况
报告期内,本基金管理人及基金经理的薪酬情况符合相关法律法规及公司制度的规定。

4.8 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.9 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.10 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.11 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.12 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.13 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.14 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.15 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.16 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.17 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.18 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.19 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.20 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.21 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.22 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.23 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.24 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.25 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.26 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.27 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

4.28 报告期内基金管理人及基金经理的违法违规情况
报告期内,本基金管理人及基金经理均未发生违法违规情况。

2012年3季度银泰基金净值收益率为-2.08%,银泰基金业绩比较基准收益率为-2.41%,超额收益率为0.33%

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,904,089,149.05 68.65
其中:股票 1,904,089,149.05 68.65
2 固定收益投资 752,824,668.50 27.14

3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 105,516,128.86 3.80

6 其他资产 11,110,007.12 0.40

7 合计 2,773,539,953.53 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林牧渔 4,681,477.26 0.18

B 制造业 3,464,179.95 0.13

C 建筑业 1,338,584,243.75 51.12

D 批发和零售业 502,433,645.90 19.19

E 交通运输、仓储业 28,237,217.57 1.08

F 信息、计算机和通信设备制造业 1,176,992.00 0.04

G 化学、医药、生物制品 205,260,000.00 7.84

H 金融业 48,800.00 0.02

I 金属、非金属 261,154,624.00 9.97

J 机械、设备、仪表 339,842,863.28 12.98

K 其他制造业 - -

L 电力、煤气及水的生产和供应业 - -

M 建筑业 94,944,406.81 3.63

N 交通运输、仓储业 - -

O 信息技术业 120,929,387.12 4.62

P 批发和零售业 74,014,097.24 2.83

Q 金融业 63,308,868.16 2.42

R 房地产业 - -

S 社会服务业 164,166,536.39 6.27

T 传播与文化产业 39,995,931.87 1.53

M 综合类 - -

合计 1,904,089,149.05 72.72

5.3 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 600115 上海家化 4,400,000 205,260,000.00 7.84

2 000423 深纺织A 4,531,916 175,475,787.52 6.70

3 000996 开滦股份 4,347,340 159,982,112.00 6.11

4 600519 贵州茅台 5,977,940 137,140,177.20 5.24

5 000968 泸州老窖 3,439,300 132,413,050.00 5.10

6 600518 康美药业 6,676,183 107,357,415.00 4.06

7 601717 郑煤机 10,035,038 103,862,643.30 3.97

8 600587 新华医疗 3,123,085 89,944,848.00 3.44

9 300079 数码视讯 5,947,218 87,543,048.96 3.34

10 600280 南京高科 1,871,808 67,347,651.84 2.57

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国债债券 237,789,543.70 9.08

2 央行票据 339,580,000.00 12.86

3 金融债券 90,643,000.00 3.46

4 企业债券 64,214,124.80 2.45

5 企业短期融资券 20,228,000.00 0.77

6 中期票据 - -

7 可转换债 - -

8 其他 - -

9 合计 752,824,668.50 28.75

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1101008 08国债(8) 804,600 81,023,220.00 3.09

2 1101032 11国债32 600,000 60,684,000.00 2.32

3 091913 11国债13 500,000 50,990,000.00 1.93

4 091217 12国债17 500,000 49,975,000.00 1.91

5 1001037 10国债37 500,000 49,910,000.00 1.91

5.6 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资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.8 投资组合报告附注
报告期内本基金投资的十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

5.8.1 其他资产构成
序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 2,000,000.00

2 应收利息 115,000.00

3 应收股利 6,808,457.12

4 其他应收款 2,166,450.00

5 其他 - -

6 其他 - -

7 其他 - -

8 其他 - -

9 合计 11,110,007.12

5.9 开放式基金份额变动
单位:份

本报告期初基金份额总额 2,794,302,269.80

本报告期间基金总申购份额 15,565,484.19

减:本报告期间基金总赎回份额 6,054,632.35

本报告期末基金份额总额 2,743,813,121.64

5.10 备查文件目录
1.中国证监会注册文件
2.银河银泰混合基金基金合同

3.银河银泰混合基金基金募集说明书
4.银河银泰混合基金基金托管协议

5.银河银泰混合基金基金定期报告
6.银河银泰混合基金基金临时报告

7.其他文件
8.基金管理人及基金托管人资格证明文件

9.基金管理人及基金托管人内部控制制度

10.基金管理人及基金托管人投资管理制度

11.基金管理人及基金托管人业绩考核制度

12.基金管理人及基金托管人薪酬管理制度

13.基金管理人及基金托管人信息披露制度

14.基金管理人及基金托管人法律意见书

15.基金管理人及基金托管人审计报告

16.基金管理人及基金托管人其他文件

17.基金管理人及基金托管人其他文件

18.基金管理人及基金托管人其他文件

19.基金管理人及基金托管人其他文件

20.基金管理人及基金托管人其他文件

21.基金管理人及基金托管人其他文件

22.基金管理人及基金托管人其他文件

23.基金管理人及基金托管人其他文件

24.基金管理人及基金托管人其他文件

25.基金管理人及基金托管人其他文件

26.基金管理人及基金托管人其他文件

27.基金管理人及基金托管人其他文件

28.基金管理人及基金托管人其他文件

29.基金管理人及基金托管人其他文件

30.基金管理人及基金托管人其他文件

31.基金管理人及基金托管人其他文件

32.基金管理人及基金托管人其他文件

33.基金管理人及基金托管人其他文件

34.基金管理人及基金托管人其他文件

35.基金管理人及基金托管人其他文件

36.基金管理人及基金托管人其他文件

37.基金管理人及基金托管人其他文件

38.基金管理人及基金托管人其他文件

39.基金管理人及基金托管人其他文件

40.基金管理人及基金托管人其他文件

41.基金管理人及基金托管人其他文件

42.基金管理人及基金托管人其他文件

43.基金管理人及基金托管人其他文件

44.基金管理人及基金托管人其他文件

45.基金管理人及基金托管人其他文件

46.基金管理人及基金托管人其他文件

47.基金管理人及基金托管人其他文件

48.基金管理人及基金托管人其他文件

49.基金管理人及基金托管人其他文件

50.基金管理人及基金托管人其他文件

51.基金管理人及基金托管人其他文件

52.基金管理人及基金托管人其他文件

53.基金管理人及基金托管人其他文件

54.基金管理人及基金托管人其他文件

55.基金管理人及基金托管人其他文件

56.基金管理人及基金托管人其他文件

57.基金管理人及基金托管人其他文件

58.基金管理人及基金托管人其他文件

59.基金管理人及基金托管人其他文件

60.基金管理人及基金托管人其他文件

61.基金管理人及基金托管人其他文件

62.基金管理人及基金托管人其他文件

63.基金管理人及基金托管人其他文件

64.基金管理人及基金托管人其他文件

65.基金管理人及基金托管人其他文件

66.基金管理人及基金托管人其他文件

67.基金管理人及基金托管人其他文件

68.基金管理人及基金托管人其他文件

69.基金管理人及基金托管人其他文件

70.基金管理人及基金托管人其他文件

71.基金管理人及基金托管人其他文件

72.基金管理人及基金托管人其他文件

73.基金管理人及基金托管人其他文件

74.基金管理人及基金托管人其他文件

75.基金管理人及基金托管人其他文件

76.基金管理人及基金托管人其他文件

77.基金管理人及基金托管人其他文件

78.基金管理人及基金托管人其他文件

79.基金管理人及基金托管人其他文件

80.基金管理人及基金托管人其他文件

81.基金管理人及基金托管人其他文件

82.基金管理人及基金托管人其他文件

83.基金管理人及基金托管人其他文件

84.基金管理人及基金托管人其他文件

85.基金管理人及基金托管人其他文件

86.基金管理人及基金托管人其他文件

87.基金管理人及基金托管人其他文件

88.基金管理人及基金托管人其他文件

89.基金管理人及基金托管人其他文件

90.基金管理人及基金托管人其他文件

91.基金管理人及基金托管人其他文件

92.基金管理人及基金托管人其他文件

93.基金管理人及基金托管人其他文件

94.基金管理人及基金托管人其他文件

95.基金管理人及基金托管人其他文件

96.基金管理人及基金托管人其他文件