

银河银信添利债券型证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3月31日

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2012年4月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事及监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，并对内容的真实性、准确性、完整性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，复核结果是正确的。

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。

本报告期:2012年01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河银信添利债券
交易代码	519666
基金份额分级	契约开放式
基金合同生效日	2007年3月14日
报告期末基金份额总额	212,108,866.25份
投资目标	在满足基金稳定性与良好流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	通过合理的债券资产配置，综合运用利率预期、收益率曲线策略等新旧债两只配置策略，获取稳定收益。
业绩比较基准	新华巴克莱资本中国国债指数收益率×80%+恒生一年定期存款利率×20%。
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，以满足基金稳定性与良好流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值为基金的投资目标。本基金通过综合运用利率预期、收益率曲线策略等新旧债两只配置策略，获取稳定收益。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)
银银河信添利债券A	银银河信添利债券B
1.本期实现收益	640,499.85 1,772,062.12
2.本期利润	1,004,347.75 2,576,352.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0164 0.0148
4.期末基金份额净值	52,291,259.66 518,343,987.89
5.期末可供分配基金份额净值	0.9978 0.9999

注:本期实现收益指基金本期营业收入、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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

所有可供分配的利润均包括持有人认购交易费用的全部费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

对期末可供分配利润,采用去尾法计算,并用小数点后两位保留,与应付赎回金额相等的差额部分归基金所有。

3.2 基金的基本情况

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其相对比(相对基准收益率的比较)

3.2.2 本报告期来行业分类的股票投资组合

3.4 告期未按品种分类的债券投资组合

3.5 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

3.6 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

3.7 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.8 其他资产构成

3.9 告期未持有的处于转股期的可转换债券明细

3.10 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

3.11 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.12 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.13 其他

3.14 合计

3.15 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

3.16 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.17 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.18 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.19 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.20 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.21 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.22 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.23 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.24 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.25 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.26 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.27 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.28 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.29 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.30 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.31 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.32 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.33 其他

3.34 合计

3.35 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.36 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.37 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.38 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.39 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.40 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.41 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.42 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.43 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.44 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.45 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.46 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.47 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.48 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.49 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.50 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.51 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.52 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.53 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.54 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.55 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.56 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.57 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.58 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.59 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.60 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.61 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.62 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.63 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.64 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.65 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.66 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.67 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.68 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.69 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.70 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.71 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.72 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.73 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.74 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.75 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.76 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.77 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.78 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.79 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.80 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.81 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.82 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.83 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.84 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.85 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.86 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.87 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.88 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.89 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.90 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.91 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.92 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.93 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.94 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.95 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.96 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.97 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.98 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

3.99 告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细