

银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起 式证券投资基金 2015 年半年度报告 摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河定投宝中证腾安指数
基金主代码	519677
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 14 日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	492,208,121.67 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数基金，力求对中证腾安价值 100 指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离和跟踪误差的前提下追求跟踪误差的最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数跟踪方法，按照成份股在中证腾安价值 100 指数中的基准权重构建股票投资组合。并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金将采用数量化模型，对跟踪误差及其相关指标进行动态管理，根据结果对基金投资组合进行相应调整；并将定期或不定期对数量化模型进行优化改善，力求减少跟踪误差，期望改进指数跟踪效果。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>在建仓期，或遇有特殊情况，或在一定时间内的跟踪误差或其相关指标超过相应的控制目标值，或出现其他实际情况导致本基金不能投资或无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据情况，对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p>
业绩比较基准	中证腾安价值 100 指数收益率*95% + 银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，预期风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	董伯儒	田青
	联系电话	021-38568988	010-67595096
	电子邮箱	dongboru@galaxyasset.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67595096
传真		021-38568769	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金半年度报告备置地点	1、上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼 2、北京市西城闹市口大街 1 号院 1 号楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	318,161,578.39
本期利润	165,579,356.29
加权平均基金份额本期利润	0.4479
本期基金份额净值增长率	54.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.8096
期末基金资产净值	1,016,981,308.32
期末基金份额净值	2.066

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。

2、所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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

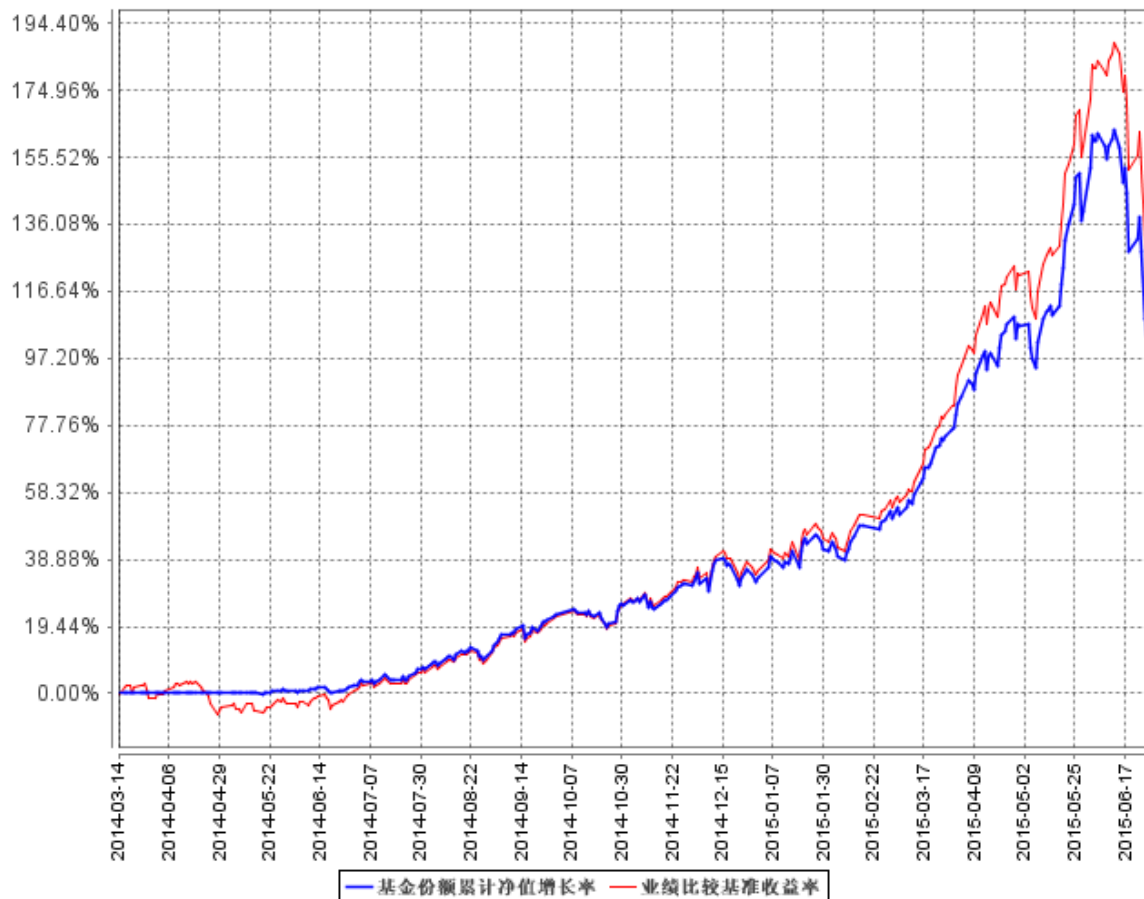
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-13.84%	3.87%	-10.86%	3.69%	-2.98%	0.18%
过去三个月	16.79%	2.87%	25.50%	2.75%	-8.71%	0.12%
过去六个月	54.87%	2.25%	70.21%	2.19%	-15.34%	0.06%
过去一年	101.36%	1.75%	128.60%	1.72%	-27.24%	0.03%
自基金合同生效起至今	106.60%	1.54%	130.55%	1.61%	-23.95%	-0.07%

注：本基金业绩比较基准为中证腾安价值 100 指数收益率*95% + 银行活期存款利率（税后）*5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2014 年 3 月 14 日，根据《银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式
第 5 页 共 46 页

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。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司设立于 2002 年 6 月 14 日，公司的股东分别为中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团公司、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

目前，除本基金外，银河基金管理有限公司另管理 1 只封闭式基金与 24 只开放式证券投资基金，基本情况如下：

1、银丰证券投资基金

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2002 年 08 月 15 日

基金投资目标：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。

2、银河银联系列证券投资基金

本系列基金为契约型开放式基金，由两只基金构成，包括银河稳健证券投资基金和银河收益证券投资基金，每只基金彼此独立运作，并通过基金间相互转换构成一个统一的基金体系。

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2003 年 08 月 04 日

(1) 银河稳健证券投资基金

基金投资目标：以稳健的投资风格，构造资本增值与收益水平适度匹配的投资组合，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

(2) 银河收益证券投资基金

基金投资目标：以债券投资为主，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。

3、银河银泰理财分红证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 03 月 30 日

基金投资目标：追求资产的安全性和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报。

4、银河银富货币市场基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 12 月 20 日

基金投资目标：在确保基金资产安全和高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的回报。

5、银河银信添利债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007 年 03 月 14 日

基金投资目标：在满足本金稳妥与良好流动性的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

6、银河竞争优势成长股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2008 年 05 月 26 日

基金投资目标：在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中长期资本增值。

7、银河行业优选股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009 年 04 月 24 日

基金投资目标：本基金将“自上而下”的资产配置以及动态行业配置策略与“自下而上”的个股优选策略相结合，优选景气行业或预期景气行业中的优势企业进行投资，在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中长期资本增值。

8、银河沪深 300 价值指数证券投资基金

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

基金投资目标：通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段，追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。

9、银河蓝筹精选股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010 年 07 月 16 日

基金投资目标：本基金投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司，在有效控制风险

的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果。

10、银河创新成长股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010 年 12 月 29 日

基金投资目标：本基金投资于具有良好成长性的创新类上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

11、银河强化收益债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 06 月 09 日

基金投资目标：本基金主要投资于固定收益类品种，在控制风险，保持资产良好流动性的前提下，追求一定的当期收入和基金资产的长期稳健增值。

12、银河消费驱动股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011 年 07 月 29 日

基金投资目标：本基金通过深入研究，重点投资与居民消费密切相关的行业中具有竞争优势的上市公司，分享由于中国巨大的人口基数、收入增长和消费结构变革所带来的投资机会，在严格控制风险的前提下，追求基金资产长期稳定增值。

13、银河通利债券型证券投资基金（LOF）

基金运作方式：上市契约型开放式（LOF）

基金合同生效日：2012 年 04 月 25 日

基金投资目标：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业绩比较基准的投资收益。

14、银河主题策略股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012 年 09 月 21 日

基金投资目标：本基金在严格控制风险的前提下，采用主题投资策略和精选个股策略的方法进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。

15、银河领先债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012 年 11 月 29 日

基金投资目标：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业绩比较基准的投资收益。

16、银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013 年 03 月 29 日

基金投资目标：本基金为增强型股票指数基金，力求对沪深 300 成长指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

17、银河增利债券型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013 年 07 月 17 日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的具有投资价值的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

18、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式（本基金以定期开放的方式运作，运作周期和自由开放期相结合，以 1 年为一个运作周期，每个运作周期共包含为 4 个封闭期和 3 个受限开放期。）

基金合同生效日：2013 年 08 月 09 日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，通过严谨的风险管理与主动管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

19、银河灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 02 月 11 日

基金投资目标：本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，在确保超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值的前提下，力求获取超额收益。

20、银河美丽优萃股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 05 月 29 日

基金投资目标：本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的美丽主题相关股票，在严格

控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

21、银河润利保本混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 08 月 06 日

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略，并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

22、银河康乐股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 11 月 18 日

基金投资目标：本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的健康快乐主题相关的股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

23、银河泽利保本混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015 年 04 月 08 日

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略（优化的 CPPI 策略），并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

24、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015 年 04 月 22 日

基金投资目标：本基金将充分把握中国经济可持续发展过程中现代服务主题相关行业及子行业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中现代服务主题相关行业及子行业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

25、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015 年 04 月 22 日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的

投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗博	银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金的基金经理、银河沪深300价值指数证券投资基金的基金经理、银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金的基金经理	2014年3月14日	-	10	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购并等工作。2006年2月加入银河基金管理有限公司，历任产品设计经理、衍生品数量化投资研究员、行业研究员等职务，2009年12月起担任银河沪深300价值指数证券投资基金的基金经理，2013年3月起担任银河沪深300成长增强

					指数分级 证券投资 基金的基 金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------

- 注：1、上表中任职日期为该基金合同生效之日；
2、证券从业年限按其从事证券相关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》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、勤奋律己、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、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤奋律己、创新图强”的理念，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，为基金份额持有人谋求长期稳健的风险回报。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，在授权管理、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，公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析。

针对同向交易部分，本报告期内，公司对旗下管理的所有投资组合（完全复制的指数基金除外），连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公开竞价交易的证券进行了价差分析，并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

针对反向交易部分，公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，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量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）。

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易，由各投资组合经理均严格按照制度规定，事前确定好申购价格和数量，按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年对市场的预判：未来海外的风险，主要是美元的升值风险。欧洲、中国、日本、韩国会维持宽松的货币政策，若美联储在明年四季度加息，对美元形成升值预期，会引导国际基本回流美元资产，引起新兴市场国家的市场动荡。

经济再次下行，通胀维持低位，为货币的放松提供了实际需求和现实可能。但是为了控制人民币的贬值预期，货币政策放松的空间也是有限制的。全球经济处于衰退的格局，未来经济的发展方向尚未形成，众多国家还是在依靠宽货币来支撑经济，世界经济的根基是不稳的。对市场保持一点谨慎，且行且观察。紧跟政府的政策走向，发掘投资机会。

本基金依据基金合同的规定，以控制跟踪误差最小化为管理目标，未进行股指期货的投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年银河定投宝指数基金净值增长 54.87%，同期业绩比较基准增长 70.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期市场大跌的机理：

- 一、过高的杠杆运用。
- 二、创业板累计涨幅过高，有回调的压力。
- 三、央行操作了几次正回购，对货币政策转向或二阶拐点的疑虑。
- 四、打新股抽离资金
- 五、希腊债务问题的扰动

哪些发生了变化？

央行降息和降存准，以及重启逆回购，暂时消除了货币政策转向或二阶拐点的疑虑，其余四个问题尚存，第一个和第二个问题尚在回归中，第四个问题受新股发行暂停，暂时对市场的

影响解除。第五个问题有所缓解。

市场的预期:

短期市场维持震荡格局，这次央行降准降息的操作，救市的意味浓厚，市场迅速形成上攻突破的动能不足，但这次央行的操作对提升市场重心是有利的，政府的救市行为，短期防范了流动性风险的集中爆发，有时间换空间的意味。反弹应该为降低创业板仓位，调结构提供了很好的机会。

风险因素

1) 美国加息预期

对于上市公司再融资重新放开

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照新准则、中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及基金合同的约定，制定了健全、有效的估值政策和程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了估值工作决策、监督、审查的专门部门，组成人员包括投资研究部门、监察稽核部门及会计核算部门的工作负责人或资深业务人员，其多数拥有十年以上的证券、风控、估值经验，根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。

同时不断建立起一套完整、有效的估值工作管理规定及程序，对估值相关的各个环节均配有专门的人员实施、把控，并保证环节的各方不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2014 年 3 月 14 日成立，根据《基金合同》有关规定：“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”。截止 2015 年 6 月 30 日，本基金可供分配利润为 398,467,778.34 元。截至本报告期末，本报告期本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		86,831,432.56	17,195,370.39
结算备付金		2,855,314.04	307,590.31
存出保证金		481,681.23	67,490.45
交易性金融资产		1,032,950,023.27	230,776,157.91
其中：股票投资		1,031,911,056.77	230,776,157.91
基金投资		-	-

债券投资		1,038,966.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		107,517,751.32	12,245,055.25
应收利息		24,919.46	4,852.27
应收股利		-	-
应收申购款		24,493,698.63	4,173,913.35
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,255,154,820.51	264,770,429.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		233,031,329.10	16,440,685.09
应付管理人报酬		612,062.28	98,403.20
应付托管费		183,618.70	29,520.98
应付销售服务费		306,031.14	49,201.61
应付交易费用		3,806,194.19	367,589.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		234,276.78	309,764.09
负债合计		238,173,512.19	17,295,163.99
所有者权益:			
实收基金		492,208,121.67	185,565,320.32
未分配利润		524,773,186.65	61,909,945.62
所有者权益合计		1,016,981,308.32	247,475,265.94
负债和所有者权益总计		1,255,154,820.51	264,770,429.93

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.066，基金份额总额 492,208,121.67 份。

6.2 利润表

会计主体：银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 3 月 14 日(基 金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		175,686,605.93	1,807,833.72
1.利息收入		281,698.12	423,117.28
其中：存款利息收入		281,638.57	49,731.01
债券利息收入		59.55	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	373,386.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		327,987,129.91	884,504.54
其中：股票投资收益		320,576,714.33	588,835.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		7,410,415.58	295,668.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-152,582,222.10	497,420.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	2,791.72
减：二、费用		10,107,249.64	371,106.25
1. 管理人报酬		1,838,847.66	92,185.05
2. 托管费		551,654.34	27,655.51
3. 销售服务费		919,423.86	46,092.53
4. 交易费用		6,540,924.59	84,648.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		256,399.19	120,524.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		165,579,356.29	1,436,727.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		165,579,356.29	1,436,727.47

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	185,565,320.32	61,909,945.62	247,475,265.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	165,579,356.29	165,579,356.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	306,642,801.35	297,283,884.74	603,926,686.09
其中：1. 基金申购款	1,704,901,101.54	1,772,349,266.72	3,477,250,368.26
2. 基金赎回款	-1,398,258,300.19	-1,475,065,381.98	-2,873,323,682.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	492,208,121.67	524,773,186.65	1,016,981,308.32
项目	上年度可比期间 2014 年 3 月 14 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	69,792,833.07	-	69,792,833.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,436,727.47	1,436,727.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-13,931,857.17	-11,630.27	-13,943,487.44
其中：1. 基金申购款	12,151,348.61	73,431.36	12,224,779.97
2. 基金赎回款	-26,083,205.78	-85,061.63	-26,168,267.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以	-	-	-

“-”号填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	55,860,975.90	1,425,097.20	57,286,073.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 尤象都	_____ 尤象都	_____ 秦长建
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监【2013】1654 号《关于核准银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由银河基金管理有限公司作为管理人自 2013 年 2 月 14 日到 2014 年 3 月 7 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第 60821717_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2014 年 3 月 14 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 69,751,292.04 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 41,541.03 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 69,792,833.07 元，折合 69,792,833.07 份基金份额。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。股票投资包括中证腾安价值 100 指数成份股、备选成份股等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%、且占非现金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；权证、股指期货以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

本基金的业绩比较基准为：中证腾安价值 100 指数收益率*95% + 银行活期存款利率（税后）

*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 26 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期会计估计变更的说明在 6.4.4 所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致说明中披露。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司	同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 3 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
银河证券	1,185,282,766.91	26.07%	70,737,452.41	100.00%

债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 3 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	---

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
银河证券	-	-	500,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
银河证券	1,052,678.54	25.78%	1,022,895.72	26.87%
关联方名称	上年度可比期间 2014年3月14日(基金合同生效日)至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
银河证券	63,600.94	100.00%	63,600.94	100.00%

注：佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括买(卖)经手费、证券结算风险基金、证券交易所买(卖)证管费和深圳买(卖)过户费)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年3月14日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付 的管理费	1,838,847.66
其中：支付销售机构的客 户维护费	96,804.59	1,617.38

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 3 月 14 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	551,654.34	27,655.51

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
银河直销	293,903.23
银河证券公司	31,748.70
合计	325,651.93
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2014 年 3 月 14 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
银河直销	27,863.34
银河证券公司	8,173.25
合计	36,036.59

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 3 月 14 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 3 月 14 日）持有的基金份额	10,000,900.00	10,000,900.00
期初持有的基金份额	10,000,900.00	10,000,900.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,900.00	10,000,900.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.0318%	17.9030%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 3 月 14 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	86,831,432.56	260,837.36	12,360,103.29	46,832.01

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300113	顺网科技	2015年5月5日	重大事项停牌	53.60	2015年8月6日	51.93	299,315	14,392,125.95	16,043,284.00	-
002226	江南化工	2015年6月8日	重大事项停牌	13.18	-	-	1,171,894	12,279,970.30	15,445,562.92	-
002191	劲嘉股份	2015年6月18日	重大事项停牌	19.22	-	-	773,240	10,536,660.03	14,861,672.80	-
002398	建研集团	2015年6月8日	重大事项停牌	28.49	2015年7月1日	25.64	488,955	9,458,235.95	13,930,327.95	-
600872	中炬高新	2015年5月5日	重大事项停牌	21.62	-	-	597,272	8,723,923.76	12,913,020.64	-
300195	长荣股份	2015年6月23日	重大事项停牌	31.96	2015年8月24日	28.76	357,065	14,515,595.70	11,411,797.40	-
002238	天威视讯	2015年6月29日	重大事项停牌	23.76	-	-	470,242	10,879,369.02	11,172,949.92	-

300047	天源迪科	2015年6月3日	重大事项停牌	23.99	2015年7月30日	32.29	437,746	9,275,049.20	10,501,526.54	-
000786	北新建材	2015年4月10日	重大事项停牌	18.58	-	-	533,660	8,029,349.15	9,915,402.80	-
000708	大冶特钢	2015年5月13日	重大事项停牌	13.92	-	-	668,959	8,620,003.08	9,311,909.28	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 907,442,569.02 元，属于第二层次的余额为人民币 125,507,454.25 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2. 3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,031,911,056.77	82.21
	其中：股票	1,031,911,056.77	82.21
2	固定收益投资	1,038,966.50	0.08
	其中：债券	1,038,966.50	0.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	89,686,746.60	7.15
7	其他各项资产	132,518,050.64	10.56
8	合计	1,255,154,820.51	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,501,497.56	1.13
C	制造业	642,767,855.62	63.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,225,286.07	0.91
E	建筑业	28,654,306.22	2.82
F	批发和零售业	31,055,428.71	3.05
G	交通运输、仓储和邮政业	93,937,165.79	9.24
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,950,287.42	4.52
J	金融业	19,776,912.00	1.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,463,134.54	3.00
M	科学研究和技术服务业	13,930,327.95	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	18,665,208.44	1.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	51,555,703.36	5.07
S	综合	8,480,853.63	0.83
	合计	1,005,963,967.31	98.92

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	15,445,562.92	1.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,501,526.54	1.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	25,947,089.46	2.55

7.3 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

7.3.1 指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300113	顺网科技	299,315	16,043,284.00	1.58
2	002191	劲嘉股份	773,240	14,861,672.80	1.46
3	002449	国星光电	641,736	14,118,192.00	1.39
4	002398	建研集团	488,955	13,930,327.95	1.37
5	300079	数码视讯	473,395	13,155,647.05	1.29
6	600872	中炬高新	597,272	12,913,020.64	1.27
7	000830	鲁西化工	1,279,396	12,742,784.16	1.25
8	002543	万和电气	501,154	12,418,596.12	1.22
9	601238	广汽集团	809,262	12,381,708.60	1.22
10	002099	海翔药业	467,300	12,159,146.00	1.20

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于银河基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.3.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002226	江南化工	1,171,894	15,445,562.92	1.52
2	300047	天源迪科	437,746	10,501,526.54	1.03

注：投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细，应阅读登载于银河基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601766	中国中车	67,424,615.90	27.24

2	601390	中国中铁	30,519,460.50	12.33
3	601299	中国北车	29,038,956.45	11.73
4	000089	深圳机场	26,924,494.55	10.88
5	600978	宜华木业	26,488,887.20	10.70
6	600380	健康元	25,246,563.55	10.20
7	300171	东富龙	25,149,538.40	10.16
8	600518	康美药业	24,940,482.56	10.08
9	600271	航天信息	24,551,048.49	9.92
10	600060	海信电器	24,185,398.98	9.77
11	002238	天威视讯	23,751,726.86	9.60
12	002283	天润曲轴	23,668,043.03	9.56
13	601608	中信重工	23,242,076.00	9.39
14	600373	中文传媒	22,155,925.73	8.95
15	002152	广电运通	22,151,934.34	8.95
16	300332	天壕节能	21,411,704.07	8.65
17	601222	林洋电子	20,976,963.62	8.48
18	002533	金杯电工	20,899,819.98	8.45
19	002156	通富微电	20,686,516.73	8.36
20	300204	舒泰神	20,467,496.09	8.27
21	300002	神州泰岳	20,039,532.77	8.10
22	002546	新联电子	19,928,671.05	8.05
23	002191	劲嘉股份	19,885,974.05	8.04
24	600757	长江传媒	19,616,181.27	7.93
25	603366	日出东方	19,268,800.99	7.79
26	600352	浙江龙盛	18,961,825.60	7.66
27	002478	常宝股份	18,804,139.98	7.60
28	600143	金发科技	18,776,717.83	7.59
29	002449	国星光电	18,714,985.28	7.56
30	002394	联发股份	18,713,977.21	7.56
31	002315	焦点科技	18,702,906.36	7.56
32	600363	联创光电	18,681,952.32	7.55
33	002406	远东传动	18,661,604.74	7.54
34	002233	塔牌集团	18,438,644.47	7.45
35	600551	时代出版	18,414,490.98	7.44
36	002415	海康威视	18,359,180.57	7.42
37	000830	鲁西化工	18,353,624.67	7.42

38	603001	奥康国际	18,316,266.48	7.40
39	600664	哈药股份	18,263,271.49	7.38
40	600195	中牧股份	18,148,175.34	7.33
41	002595	豪迈科技	18,143,909.66	7.33
42	600894	广日股份	18,135,437.88	7.33
43	002236	大华股份	18,035,973.50	7.29
44	601678	滨化股份	17,963,922.03	7.26
45	600436	片仔癀	17,914,566.41	7.24
46	002597	金禾实业	17,898,078.39	7.23
47	601801	皖新传媒	17,860,173.35	7.22
48	002674	兴业科技	17,740,724.27	7.17
49	002028	思源电气	17,725,614.88	7.16
50	002561	徐家汇	17,686,559.50	7.15
51	002271	东方雨虹	17,677,145.87	7.14
52	002144	宏达高科	17,664,389.52	7.14
53	601098	中南传媒	17,530,970.27	7.08
54	600761	安徽合力	17,506,599.47	7.07
55	002099	海翔药业	17,460,026.38	7.06
56	600252	中恒集团	17,440,459.90	7.05
57	002226	江南化工	17,428,635.72	7.04
58	600386	北巴传媒	17,405,279.00	7.03
59	600583	海油工程	17,351,905.80	7.01
60	600004	白云机场	17,258,684.77	6.97
61	600059	古越龙山	17,064,209.84	6.90
62	002543	万和电气	17,041,992.19	6.89
63	600284	浦东建设	16,788,561.25	6.78
64	000823	超声电子	16,759,561.59	6.77
65	601929	吉视传媒	16,750,623.89	6.77
66	300113	顺网科技	16,749,950.58	6.77
67	000423	东阿阿胶	16,732,965.20	6.76
68	002585	双星新材	16,550,851.01	6.69
69	600426	华鲁恒升	16,525,686.90	6.68
70	601117	中国化学	16,443,361.80	6.64
71	600153	建发股份	16,299,959.72	6.59
72	600422	昆药集团	16,253,551.90	6.57
73	601179	中国西电	16,219,152.51	6.55

74	600350	山东高速	16,092,797.58	6.50
75	002033	丽江旅游	16,084,644.13	6.50
76	600125	铁龙物流	16,080,667.27	6.50
77	601607	上海医药	16,054,373.50	6.49
78	002054	德美化工	16,052,899.92	6.49
79	002675	东诚药业	16,042,090.89	6.48
80	600754	锦江股份	16,035,387.59	6.48
81	002185	华天科技	16,023,774.32	6.47
82	002483	润邦股份	15,986,513.68	6.46
83	002181	粤传媒	15,927,343.31	6.44
84	300079	数码视讯	15,910,607.00	6.43
85	601238	广汽集团	15,903,641.92	6.43
86	600529	山东药玻	15,844,502.76	6.40
87	002025	航天电器	15,758,157.59	6.37
88	000598	兴蓉环境	15,719,392.38	6.35
89	000919	金陵药业	15,649,365.70	6.32
90	600270	外运发展	15,594,780.94	6.30
91	601339	百隆东方	15,408,358.53	6.23
92	600033	福建高速	15,398,581.58	6.22
93	002088	鲁阳股份	15,351,147.01	6.20
94	601333	广深铁路	15,213,587.74	6.15
95	000826	桑德环境	15,202,504.87	6.14
96	600269	赣粤高速	15,189,905.19	6.14
97	002372	伟星新材	15,159,605.24	6.13
98	600723	首商股份	15,134,625.37	6.12
99	000726	鲁泰A	15,118,642.74	6.11
100	600138	中青旅	15,038,941.97	6.08
101	002433	太安堂	14,960,632.14	6.05
102	002032	苏泊尔	14,821,404.97	5.99
103	601677	明泰铝业	14,809,838.12	5.98
104	300137	先河环保	14,774,555.03	5.97
105	600168	武汉控股	14,752,410.05	5.96
106	002603	以岭药业	14,745,582.01	5.96
107	600585	海螺水泥	14,674,907.90	5.93
108	000729	燕京啤酒	14,672,043.21	5.93
109	600563	法拉电子	14,668,947.25	5.93

110	002661	克明面业	14,640,122.16	5.92
111	300160	秀强股份	14,598,542.77	5.90
112	600050	中国联通	14,563,959.94	5.89
113	601996	丰林集团	14,554,600.77	5.88
114	300195	长荣股份	14,515,595.70	5.87
115	600292	中电远达	14,503,044.31	5.86
116	002294	信立泰	14,476,297.68	5.85
117	300095	华伍股份	14,455,715.74	5.84
118	600596	新安股份	14,424,953.90	5.83
119	300183	东软载波	14,389,314.02	5.81
120	600056	中国医药	14,359,608.83	5.80
121	601006	大秦铁路	14,323,445.77	5.79
122	002056	横店东磁	14,317,634.53	5.79
123	600880	博瑞传播	14,269,455.03	5.77
124	300082	奥克股份	14,222,615.94	5.75
125	000999	华润三九	14,217,401.61	5.74
126	600177	雅戈尔	14,174,987.54	5.73
127	002398	建研集团	14,165,172.23	5.72
128	000876	新希望	14,115,149.83	5.70
129	300047	天源迪科	14,094,276.88	5.70
130	600642	申能股份	14,072,156.59	5.69
131	000685	中山公用	14,068,764.84	5.68
132	600062	华润双鹤	14,010,342.80	5.66
133	600703	三安光电	13,948,277.56	5.64
134	600104	上汽集团	13,885,671.70	5.61
135	600660	福耀玻璃	13,884,085.88	5.61
136	600089	特变电工	13,859,296.00	5.60
137	600805	悦达投资	13,718,984.90	5.54
138	601398	工商银行	13,717,567.78	5.54
139	601288	农业银行	13,676,672.00	5.53
140	000623	吉林敖东	13,597,078.11	5.49
141	000895	双汇发展	13,560,993.04	5.48
142	000905	厦门港务	13,531,020.39	5.47
143	000858	五粮液	13,518,154.34	5.46
144	601668	中国建筑	13,257,276.47	5.36
145	600522	中天科技	13,030,840.18	5.27

146	600742	一汽富维	12,848,611.27	5.19
147	601888	中国国旅	12,658,814.21	5.12
148	600196	复星医药	12,635,056.09	5.11
149	000538	云南白药	12,582,488.32	5.08
150	002429	兆驰股份	11,967,153.27	4.84
151	000708	大冶特钢	11,046,516.32	4.46
152	600872	中炬高新	11,010,316.60	4.45
153	000786	北新建材	6,409,326.19	2.59

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601766	中国中车	56,204,067.54	22.71
2	600978	宜华木业	43,777,599.77	17.69
3	601390	中国中铁	41,004,884.18	16.57
4	300171	东富龙	38,399,383.82	15.52
5	600271	航天信息	36,572,218.36	14.78
6	002283	天润曲轴	36,290,230.81	14.66
7	600060	海信电器	34,681,362.91	14.01
8	002546	新联电子	32,792,632.45	13.25
9	600380	健康元	32,058,109.12	12.95
10	002406	远东传动	32,042,593.04	12.95
11	002156	通富微电	32,031,605.38	12.94
12	300332	天壕节能	30,066,003.53	12.15
13	300204	舒泰神	29,353,403.51	11.86
14	300002	神州泰岳	28,607,603.10	11.56
15	601608	中信重工	28,236,547.60	11.41
16	600363	联创光电	28,232,298.54	11.41
17	002152	广电运通	28,220,866.65	11.40
18	600153	建发股份	26,749,115.68	10.81
19	600352	浙江龙盛	25,820,922.75	10.43
20	600436	片仔癀	25,361,355.61	10.25
21	002315	焦点科技	25,313,768.09	10.23
22	600894	广日股份	24,829,064.20	10.03
23	000089	深圳机场	24,070,395.84	9.73
24	002595	豪迈科技	23,940,673.32	9.67

25	002025	航天电器	23,545,416.40	9.51
26	002271	东方雨虹	23,095,162.91	9.33
27	600050	中国联通	22,817,712.97	9.22
28	002236	大华股份	22,557,518.76	9.12
29	000826	桑德环境	22,418,702.21	9.06
30	000598	兴蓉环境	22,250,249.84	8.99
31	002185	华天科技	22,164,112.32	8.96
32	600703	三安光电	22,003,202.88	8.89
33	600880	博瑞传播	21,995,493.14	8.89
34	300095	华伍股份	21,755,945.71	8.79
35	600754	锦江股份	21,680,860.98	8.76
36	601607	上海医药	21,676,563.58	8.76
37	600422	昆药集团	21,676,216.94	8.76
38	600596	新安股份	21,530,748.30	8.70
39	601996	丰林集团	21,455,263.33	8.67
40	002603	以岭药业	21,404,664.05	8.65
41	600518	康美药业	21,403,416.05	8.65
42	002675	东诚药业	21,221,794.77	8.58
43	000685	中山公用	20,546,431.86	8.30
44	000999	华润三九	20,238,970.15	8.18
45	002238	天威视讯	20,075,619.57	8.11
46	000858	五粮液	19,311,635.47	7.80
47	600056	中国医药	19,233,225.67	7.77
48	600089	特变电工	18,981,614.15	7.67
49	000876	新希望	18,942,625.45	7.65
50	600168	武汉控股	18,796,380.89	7.60
51	600585	海螺水泥	18,215,350.41	7.36
52	000905	厦门港务	17,413,076.53	7.04
53	002429	兆驰股份	17,298,213.94	6.99
54	600373	中文传媒	17,263,999.60	6.98
55	000895	双汇发展	17,215,169.98	6.96
56	600196	复星医药	17,072,425.97	6.90
57	600742	一汽富维	16,667,618.68	6.74
58	000538	云南白药	16,634,345.41	6.72
59	002533	金杯电工	15,348,240.97	6.20
60	002191	劲嘉股份	15,010,835.42	6.07
61	600143	金发科技	14,853,430.61	6.00
62	600195	中牧股份	14,589,397.49	5.90

63	603366	日出东方	14,345,225.28	5.80
64	002415	海康威视	13,558,244.87	5.48
65	601222	林洋电子	13,482,928.17	5.45
66	002233	塔牌集团	13,380,041.63	5.41
67	000830	鲁西化工	12,324,634.13	4.98
68	600004	白云机场	11,777,602.54	4.76
69	600583	海油工程	11,623,065.94	4.70
70	601179	中国西电	11,240,201.82	4.54
71	002394	联发股份	11,232,012.15	4.54
72	002478	常宝股份	10,744,836.87	4.34
73	002028	思源电气	10,506,771.69	4.25
74	002033	丽江旅游	10,488,546.09	4.24
75	600757	长江传媒	10,396,991.37	4.20
76	600761	安徽合力	10,127,621.85	4.09
77	002372	伟星新材	10,111,409.36	4.09
78	600551	时代出版	10,102,419.15	4.08
79	601098	中南传媒	9,881,149.21	3.99
80	600252	中恒集团	9,728,866.32	3.93
81	601678	滨化股份	9,683,441.74	3.91
82	000423	东阿阿胶	9,406,599.59	3.80
83	600284	浦东建设	9,307,515.06	3.76
84	300082	奥克股份	8,985,887.14	3.63
85	300079	数码视讯	8,756,610.45	3.54
86	601117	中国化学	8,674,129.89	3.51
87	002226	江南化工	8,588,968.95	3.47
88	300047	天源迪科	8,510,993.41	3.44
89	600529	山东药玻	8,399,514.09	3.39
90	002674	兴业科技	8,271,047.00	3.34
91	002398	建研集团	7,853,625.33	3.17
92	002661	克明面业	7,729,328.24	3.12
93	000823	超声电子	7,489,257.94	3.03
94	601299	中国北车	7,047,553.79	2.85
95	300113	顺网科技	6,583,754.77	2.66
96	600872	中炬高新	5,582,291.76	2.26
97	000708	大冶特钢	5,465,061.16	2.21

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,624,676,582.86
卖出股票收入（成交）总额	1,991,212,209.73

注：买入股票成本及卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,038,966.50	0.10
8	其他	-	-
9	合计	1,038,966.50	0.10

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	7,150	1,038,966.50	0.10

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	481,681.23
2	应收证券清算款	107,517,751.32
3	应收股利	-
4	应收利息	24,919.46
5	应收申购款	24,493,698.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	132,518,050.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300113	顺网科技	16,043,284.00	1.58	重大事项停牌
2	002191	劲嘉股份	14,861,672.80	1.46	重大事项停牌
3	002398	建研集团	13,930,327.95	1.37	重大事项停牌
4	600872	中炬高新	12,913,020.64	1.27	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002226	江南化工	15,445,562.92	1.52	重大事项停牌
2	300047	天源迪科	10,501,526.54	1.03	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
68,303	7,206.24	11,074,972.80	2.25%	481,133,148.87	97.75%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	71,746.19	0.0146%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总 数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	10,000,900.00	2.03	10,000,900.00	2.03	自基金合同生 效之日起持有 期限不少于 3 年。
基金管理人高级管 理人员	-	0.00	-	0.00	-

基金经理等人员	-	0.00	-	0.00	-
基金管理人股东	-	0.00	-	0.00	-
其他	-	0.00	-	0.00	-
合计	10,000,900.00	2.03	10,000,900.00	2.03	自基金合同生效之日起持有期限不少于 3 年。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 3 月 14 日）基金份额总额	69,792,833.07
本报告期期初基金份额总额	185,565,320.32
本报告期基金总申购份额	1,704,901,101.54
减:本报告期基金总赎回份额	1,398,258,300.19
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	492,208,121.67

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	1,363,534,034.10	29.99%	1,241,357.33	30.40%	-
中信证券	3	1,327,208,328.29	29.19%	1,177,916.88	28.85%	-
银河证券	2	1,185,282,766.91	26.07%	1,052,678.54	25.78%	-
国信证券	1	670,964,151.39	14.76%	610,845.52	14.96%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

华信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本期新增华信证券 1 个交易单元。

2、选择证券公司专用席位的标准：

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

银河基金管理有限公司

2015 年 8 月 26 日