

银河行业优选股票型证券投资基金 2014 年 半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

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 2014 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息	45

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河行业优选股票型证券投资基金
基金简称	银河行业股票
基金主代码	519670
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 24 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	2,956,016,829.22 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将“自上而下”的资产配置及动态行业配置与“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。
投资策略	<p>本基金的投资策略体现在资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略和其他品种投资策略等四个方面。</p> <p>资产配置策略，本基金管理人从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面、资金面和企业面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势，分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系，在此基础上，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券等资产的比例。</p> <p>股票投资策略方面，本基金致力于投资优选行业中的优势企业，本基金管理人相信通过双重优选，可以取得超额收益。本基金的股票投资策略分为两个层次，一是优选景气行业或预期景气行业的行业配置策略，一是优选企业的选股策略。以宏观经济的所处的不同运行阶段，同时考虑行业所处的生命周期，进而确定相对应的景气行业行业配置依据；在所确定的景气行业内，通过定性与定量分析相结合的办法，寻找行业内具有竞争优势或是高成长性的公司作为投资标的。</p> <p>本基金债券投资的主要策略包括利率预期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、单券选择策略、可转换债券投资策略。其他品种投资策略包括权证、资产支持证券投资等。</p>

业绩比较基准	本基金的业绩比较基准是：业绩基准收益率=沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的基金产品。

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	陈勇	田青
	联系电话	021-38568881	010-67595096
	电子邮箱	chenyong@galaxyasset.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67595096
传真		021-38568880	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		许国平	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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、北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
---------------	---------------------------------------

本期已实现收益	5,493,587.33
本期利润	86,362,702.58
加权平均基金份额本期利润	0.0329
本期加权平均净值利润率	2.07%
本期基金份额净值增长率	13.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	444,407,689.74
期末可供分配基金份额利润	0.1503
期末基金资产净值	4,714,590,654.41
期末基金份额净值	1.595
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	131.16%

注：1、本期已实现收益是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、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、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（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

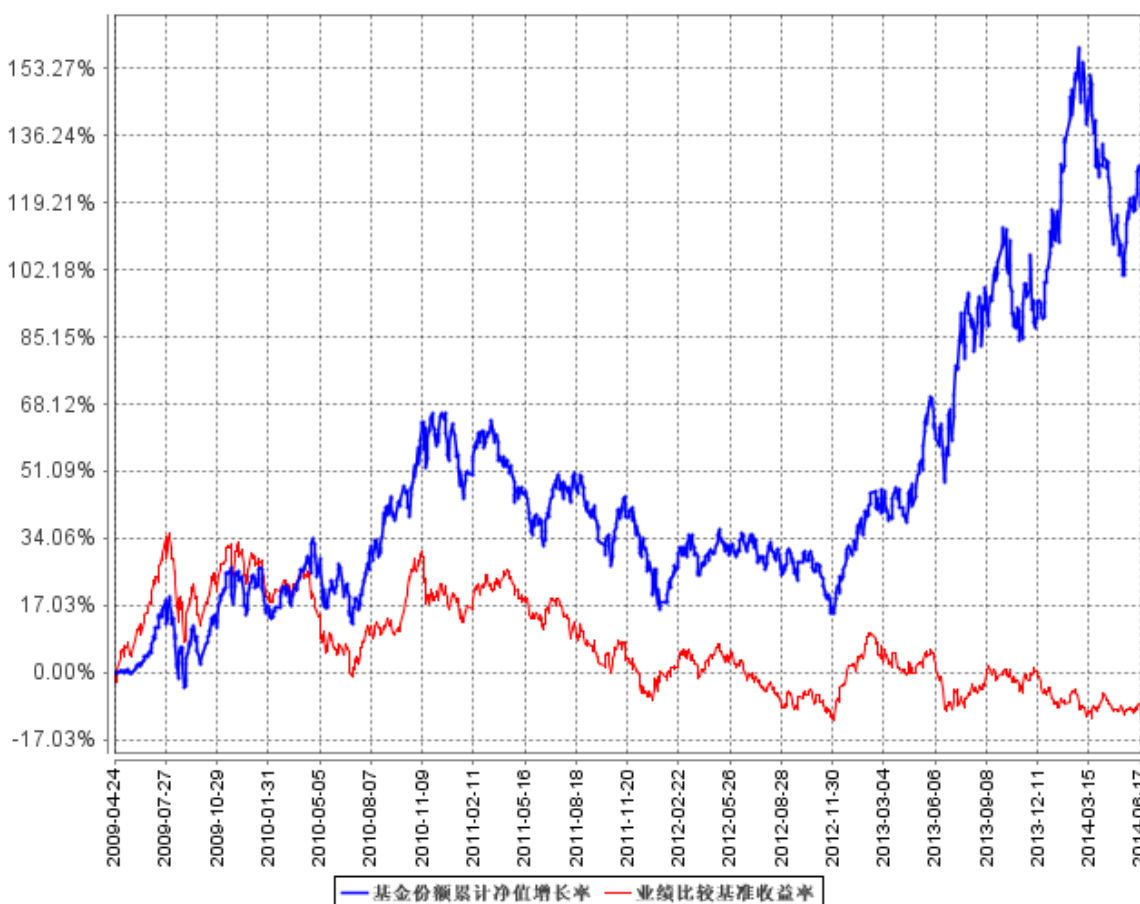
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.70%	1.17%	0.40%	0.62%	5.30%	0.55%
过去三个月	1.40%	1.32%	0.95%	0.70%	0.45%	0.62%
过去六个月	13.66%	1.57%	-5.27%	0.83%	18.93%	0.74%
过去一年	48.89%	1.72%	-0.47%	0.94%	49.36%	0.78%
过去三年	63.43%	1.43%	-21.56%	1.04%	84.99%	0.39%
自基金合同生效起至今	131.16%	1.44%	-8.66%	1.16%	139.82%	0.28%

注：本基金的业绩比较基准为：业绩基准收益率=沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

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：按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定：本基金投资的股票资产占基金资产的 60—95%，现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5—40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。截止至 2009 年 10 月 24 日，建仓期已满。建仓期结束时各项投资比例已符合基金合同约定。

§ 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、中国石油天然气集团公司、首都机场集团公司、上海市城市建设投资开发总公司、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 18 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

类型：契约型封闭式

成立日：2002 年 8 月 15 日

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。

基金合同生效日：2003 年 8 月 4 日

(1) 银河稳健证券投资基金

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

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 3 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 3 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 5 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。

8、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 7 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。

9、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。

10、银河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：2011 年 5 月 31 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，通过保本资产与风险资产的动态配置和组合管理，谋求基金资产在保本周期内的稳定增值。

11、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 7 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。

12、银河通利分级债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型

基金合同生效日：2012 年 4 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。

13、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 9 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。

14、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。

15、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 3 月 29 日

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%。

16、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 7 月 17 日

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。

17、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 8 月 9 日

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。

18、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 2 月 11 日

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。

19、银河定投宝中证腾安价值 100 指数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：2014 年 3 月 14 日

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%。

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		
成胜	银河行业优选股票型证券投资基金的基金经理、银河主题策略股票型证券投资基金的基金	2010 年 9 月 16 日	-	9	硕士研究生学历，曾就职于光大证券研究所，从事行业研究工作。2007 年 5 月加入银河基

	经理、银河美丽优萃股票型证券投资基金的基金经理、股票投资部副总监				基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理等职务，2012年9月起担任银河主题策略股票型证券投资基金的基金经理，2014年5月起担任银河美丽优萃股票型证券投资基金的基金经理，2014年4月起担任股票投资部副总监。
王海华	银河行业优选股票型证券投资基金的基金经理	2013年12月4日	-	9	硕士研究生学历，曾就职于中石化集团第三建设公司、宁波华能国际贸易与经济合作有限公司。2004年6月加入银河基金管理有限公司，历任交易员、研究员、高级研究员、

					基金经理 助理等 职。
--	--	--	--	--	-------------------

注：1、上表中任职、离职日期均为我公司做出决定之日；

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》、《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，努力实现基金份额持有人的利益，无损害基金份额持有人利益的行为，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定的回报。

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

上半年经济数据在阶段性下行后逐步企稳，政府在稳步推进改革转型的各项措施的同时，也需要维持经济的平稳运行。转型依然是对经济趋势的主要判断，本基金据此进行了相应的操作。

本基金在行业和股票配置上仍以成长股为主，仓位上，年初股票仓位维持在较高水平；三月份起考虑到成长股整体性的高估值未能与业绩增长完美配合，同时经济存在下行风险，因而下调了仓位；五月份随着经济的企稳又开始加仓。虽然改革进入“深水区”，但放在较长的时间跨度中，转型的趋势明确，市场仍处在技术革新叠加改革红利释放的良好基本面中。本基金希望选择出行业前景远大且公司治理优良、壁垒稳固的品种，分享其成长空间。上半年基金净值表现总体比较理想，主要得益于配置行业符合市场方向，重仓个股也表现较佳，但净值波动率大。未来本基金要加大覆盖广度和研究深度，优中选优，去伪存真，突出优选个股带来的投资回报，并通过板块的有效分散来降低风险和波动水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年上半年本基金收益率为 13.66%，比较基准收益率为-5.27%，跑赢基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计我国经济处于转型和去杠杆期间，经济短期稳定，但中期看增速仍有下降空间，与此同时，结构会持续优化，与之对应的，证券市场也有结构性机会，对于转型受益行业长期看好。虽然成长股质量整体参差不齐，但通过研究，仍有可能选择出行业前景远大且公司治理和运营能力优良的标的，其市值存在巨大空间。本基金希望跟随中国经济结构转型的主脉络，把握产业趋势，继续加强对行业和研究公司的研究和理解，通过持有优质成长股为持有人取得好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，基金会计部按照管理层批准后的估值政

策进行估值。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金可分配收益为 377,236,920.76 元，已经会计师事务所审计确认，根据公司分红安排，本基金于 2014 年 2 月 20 日进行利润分配，每单位分配收益 0.14 元。根据《证券投资基金投资法》有关规定及本基金《基金合同》的有关约定，经基金管理人计算并经基金托管人中国建设银行股份有限公司确认，利润分配方案符合上述约定。

§ 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

在本报告期内，本基金托管人在托管银河通利分级债券型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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。

本报告期内，本基金实施利润分配的金额为 290,375,268.08 元。

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

本托管人复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，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：银河行业优选股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	219,456,050.82	52,122,537.82
结算备付金		14,394,708.75	3,653,654.56
存出保证金		1,251,209.57	682,008.85
交易性金融资产	6.4.7.2	4,232,988,641.99	2,093,994,420.05
其中：股票投资		4,042,336,641.99	2,004,592,420.05
基金投资		-	-
债券投资		190,652,000.00	89,402,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	289,566,129.74	63,250,414.88
应收证券清算款		11,083,475.89	89,723,400.66
应收利息	6.4.7.5	3,445,295.81	2,047,613.72
应收股利		-	-
应收申购款		7,242,286.81	16,438,293.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,779,427,799.38	2,321,912,343.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		20,470,600.42	96,398,435.58
应付赎回款		34,281,210.02	18,573,098.89
应付管理人报酬		5,684,805.70	2,642,681.07
应付托管费		947,467.63	440,446.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,988,945.88	2,794,719.78
应交税费		129,200.00	129,200.00
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	334,915.32	479,100.32
负债合计		64,837,144.97	121,457,682.47
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,956,016,829.22	1,450,830,676.87
未分配利润	6.4.7.10	1,758,573,825.19	749,623,984.35
所有者权益合计		4,714,590,654.41	2,200,454,661.22
负债和所有者权益总计		4,779,427,799.38	2,321,912,343.69

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.595 元，基金份额总额 2,956,016,829.22 份。

6.2 利润表

会计主体：银河行业优选股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		134,975,075.96	293,344,280.81
1.利息收入		6,993,215.95	2,387,257.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,255,023.06	354,342.79
债券利息收入		3,773,701.37	1,630,803.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,964,491.52	402,111.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		43,648,518.16	181,820,647.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,884,434.59	172,578,683.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	34,910.00	111,286.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	21,729,173.57	9,130,678.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	80,869,115.25	108,787,064.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,464,226.60	349,310.83
减：二、费用		48,612,373.38	24,434,879.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	30,550,372.49	12,512,742.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,091,728.76	2,085,457.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	12,633,546.74	9,597,914.76
5. 利息支出		86,526.23	-
其中：卖出回购金融资产支出		86,526.23	-
6. 其他费用	6.4.7.20	250,199.16	238,765.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		86,362,702.58	268,909,401.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		86,362,702.58	268,909,401.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河行业优选股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 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）	1,450,830,676.87	749,623,984.35	2,200,454,661.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	86,362,702.58	86,362,702.58
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）	1,505,186,152.35	1,212,962,406.34	2,718,148,558.69
其中：1.基金申购款	3,387,340,635.41	2,405,523,188.86	5,792,863,824.27
2.基金赎回款	-1,882,154,483.06	-1,192,560,782.52	-3,074,715,265.58
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）	-	-290,375,268.08	-290,375,268.08
五、期末所有者权益（基金净值）	2,956,016,829.22	1,758,573,825.19	4,714,590,654.41
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	1,672,738,670.84	-24,146,522.92	1,648,592,147.92

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	268,909,401.25	268,909,401.25
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)	-260,980,798.24	-22,200,968.45	-283,181,766.69
其中:1.基金申购款	170,129,014.00	33,086,493.35	203,215,507.35
2.基金赎回款	-431,109,812.24	-55,287,461.80	-486,397,274.04
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)	1,411,757,872.60	222,561,909.88	1,634,319,782.48

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:

<u>尤象都</u>	<u>董伯儒</u>	<u>董伯儒</u>
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

银河行业优选股票型证券投资基金(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”)证监许可[2008]1253号文《关于核准银河行业优选股票型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发起人向社会公开发行募集,基金合同于2009年4月24日生效。首次设立募集规模为692,688,077.60份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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。

本基金投资于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、债券回购、权证、中央银行票据、资产支持证券等,以及法律法规或中国证监会允许的其它投资品种。其中,本基金投资的股票资产占基金资产的60—95%,债券、现金等金融工具占基金资产的比例为5%—40%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证的投资比例不超过基金资产净值的3%,资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的20%。如果法律法规或中国证监会允许基金投资于其它品种,本基金在履行适当的程序后,可以将其纳入到基金的投资范

围，并依据有关法律法规进行投资管理。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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，也参考了中国证券业协会制定的《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 3 号《半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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

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、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、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；

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	219,456,050.82
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	219,456,050.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	3,582,529,490.76	4,042,336,641.99	459,807,151.23	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	190,522,670.00	190,652,000.00	129,330.00
	合计	190,522,670.00	190,652,000.00	129,330.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,773,052,160.76	4,232,988,641.99	459,936,481.23	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	289,566,129.74	-
合计	289,566,129.74	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	89,443.04
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6,481.34
应收债券利息	3,267,517.81
应收买入返售证券利息	81,290.52
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	563.10
合计	3,445,295.81

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,978,059.99
银行间市场应付交易费用	10,885.89
合计	2,988,945.88

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	126,642.24
预提费用	208,273.08
合计	334,915.32

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,450,830,676.87	1,450,830,676.87
本期申购	3,387,340,635.41	3,387,340,635.41
本期赎回(以“-”号填列)	-1,882,154,483.06	-1,882,154,483.06
本期末	2,956,016,829.22	2,956,016,829.22

注：1. 申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	377,236,920.76	372,387,063.59	749,623,984.35
本期利润	5,493,587.33	80,869,115.25	86,362,702.58
本期基金份额交易产生的变动数	352,052,449.73	860,909,956.61	1,212,962,406.34
其中：基金申购款	735,471,557.08	1,670,051,631.78	2,405,523,188.86
基金赎回款	-383,419,107.35	-809,141,675.17	-1,192,560,782.52
本期已分配利润	-290,375,268.08	-	-290,375,268.08
本期末	444,407,689.74	1,314,166,135.45	1,758,573,825.19

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	165,761.54
其他	8,005.97
合计	1,255,023.06

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日

卖出股票成交总额	3,556,482,016.59
减：卖出股票成本总额	3,534,597,582.00
买卖股票差价收入	21,884,434.59

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	82,988,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	79,965,090.00
减：应收利息总额	2,988,000.00
债券投资收益	34,910.00

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金未进行贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	21,729,173.57
基金投资产生的股利收益	-
合计	21,729,173.57

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	80,869,115.25
——股票投资	80,204,765.25
——债券投资	664,350.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	80,869,115.25

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	3,307,291.62
其他	16,000.00
转换费收入	140,934.98
合计	3,464,226.60

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	12,632,846.74
银行间市场交易费用	700.00
合计	12,633,546.74

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	158,684.51
上清所数字证书费	400.00
帐户维护费	18,000.00
资金汇划费	23,526.08
合计	250,199.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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没有发生变化。

6.4.9.2 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、基金发起人、基金注册登记机构
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

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	637,738,933.21	7.06%	10,076,897.77	0.16%

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

注：本基金本报告期末及上一报告期末本科目余额均为零。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1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	564,336.50	7.01%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	9,174.03	0.16%	9,174.03	0.39%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	30,550,372.49	12,512,742.52
其中：支付销售机构的客户维护费	2,601,026.67	1,115,978.21

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,091,728.76	2,085,457.05

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金报告期及上一报告期末均未与关联方进行银行间同业债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30 日
基金合同生效日（2009年4月24日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	24,245,714.32	10,000,700.07
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	24,245,714.32	10,000,700.07
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.8200%	0.7100%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金系在正常业务范围内按一般商业条款进行，投资本基金的费率是公允的。

6.4.10.4.2 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：报告期末不存在除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013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	219,456,050.82	1,081,255.55	9,141,903.03	305,164.03

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期间及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	-	2014年2月20日	2014年2月20日	1.4000	193,300,926.21	97,074,341.87	290,375,268.08	
合计	-	-	-	1.4000	193,300,926.21	97,074,341.87	290,375,268.08	

6.4.12 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603369	今世缘	2014年6月25日	2014年7月3日	新股流通受限	16.93	16.93	12,758	215,992.94	215,992.94	-

注：该可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 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
002551	尚荣医疗	2014年6月12日	重大事项	34.01	-	-	2,380,004	97,480,630.23	80,943,936.04	-
300323	华灿光电	2014年4月28日	重大事项	18.68	2014年7月28日	11.21	3,000,001	37,035,982.00	56,040,018.68	-
000925	众合机电	2014年3月27日	重大事项	13.40	2014年8月22日	14.74	3,600,000	40,933,367.80	48,240,000.00	-
002502	骅威股份	2014年5月14日	重大事项	12.83	2014年7月28日	14.11	287,596	3,426,207.91	3,689,856.68	-
002707	众信旅游	2014年6月13日	重大事项	90.00	-	-	1,000	75,868.72	90,000.00	-
300295	三五网	2014年4月11日	重大事项	100.10	2014年7月8日	105.00	300,090	25,143,412.13	30,039,009.00	-
300253	卫宁软件	2014年5月28日	重大事项	43.92	2014年8月1日	37.50	8,100,047	220,224,898.32	355,754,064.24	-
300166	东方国信	2014年4月9日	重大事项	18.71	2014年7月9日	20.58	956,956	18,702,800.43	17,904,646.76	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 06 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.12.4 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）总经理领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督；（4）董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。

公司设立独立的风险控制专员岗，专门负责对投资管理全过程进行监督，出具监督意见和风险建议；对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督；对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

6.4.12.5 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；同时，公司建立了内部评级体系和交易对手库，在进行银行间同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式，以控制相应的信用风险。

6.4.12.6 流动性风险

流动性风险是因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金管理人每日对本基金的流动性需求进行测算，并同时通过独立的风控专员定期对基金流动性进行检查，并对潜在的流动性风险进行提示。

6.4.12.7 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.7.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	219,456,050.82	-	-	-	-	-	219,456,050.82
结算备付金	14,394,708.75	-	-	-	-	-	14,394,708.75
存出保证金	1,251,209.57	-	-	-	-	-	1,251,209.57
交易性金融资产	10,000,000.00	-180,652,000.00	-	-	-	-4,042,336,641.99	4,232,988,641.99
买入返售金融资产	289,566,129.74	-	-	-	-	-	289,566,129.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	11,083,475.89	11,083,475.89
应收利息	-	-	-	-	-	3,445,295.81	3,445,295.81

应收申购款	-	-	-	-	-	7,242,286.81	7,242,286.81
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	534,668,098.88	-	-180,652,000.00	-	-	-4,064,107,700.50	4,779,427,799.38
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,470,600.42	20,470,600.42
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,281,210.02	34,281,210.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,684,805.70	5,684,805.70
应付托管费	-	-	-	-	-	947,467.63	947,467.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,988,945.88	2,988,945.88
应交税费	-	-	-	-	-	129,200.00	129,200.00
其他负债	-	-	-	-	-	334,915.32	334,915.32
负债总计	-	-	-	-	-	64,837,144.97	64,837,144.97
利率敏感度缺口	534,668,098.88	-	-180,652,000.00	-	-	-3,999,270,555.53	4,714,590,654.41
上年度末 2013年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	52,122,537.82	-	-	-	-	-	52,122,537.82
结算备付金	3,653,654.56	-	-	-	-	-	3,653,654.56
存出保证金	682,008.85	-	-	-	-	-	682,008.85
交易性金融资产	-	-	89,402,000.00	-	-	-2,004,592,420.05	2,093,994,420.05
买入返售金融资产	63,250,414.88	-	-	-	-	-	63,250,414.88
应收证券清算款	-	-	-	-	-	89,723,400.66	89,723,400.66
应收利息	-	-	-	-	-	2,047,613.72	2,047,613.72
应收申购款	10,691,430.16	-	-	-	-	5,746,862.99	16,438,293.15
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	130,400,046.27	-	89,402,000.00	-	-	-2,102,110,297.42	2,321,912,343.69
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	96,398,435.58	96,398,435.58
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,573,098.89	18,573,098.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,642,681.07	2,642,681.07
应付托管费	-	-	-	-	-	440,446.83	440,446.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,794,719.78	2,794,719.78
应交税费	-	-	-	-	-	129,200.00	129,200.00
其他负债	-	-	-	-	-	479,100.32	479,100.32

负债总计	-	-	-	-	-	121,457,682.47	121,457,682.47
利率敏感度缺口	130,400,046.27	-	89,402,000.00	-	-	-1,980,652,614.95	2,200,454,661.22

6.4.12.7.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	292,082.52	87,905.62
	市场利率上升 25 个基点	-292,082.52	-87,905.62

6.4.12.7.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.7.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格及比例实施监控。

6.4.12.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	4,042,336,641.99	85.74	2,004,592,420.05	91.10

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,042,336,641.99	85.74	2,004,592,420.05	91.10

6.4.12.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	测算时期为 3 个月，对于交易少于 3 个月的资产，默认其波动与指数同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	221,181,087.80	116,792,366.55
	沪深 300 指数下降 5%	-221,181,087.80	-116,792,366.55

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	4,042,336,641.99	84.58
	其中：股票	4,042,336,641.99	84.58
2	固定收益投资	190,652,000.00	3.99
	其中：债券	190,652,000.00	3.99
	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	289,566,129.74	6.06
	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	233,850,759.57	4.89
7	其他各项资产	23,022,268.08	0.48
8	合计	4,779,427,799.38	100.00

7.2 期末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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	43,005,690.82	0.91
B	采矿业	71,105,300.00	1.51
C	制造业	2,227,404,411.38	47.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,878,628.88	0.17
F	批发和零售业	133,089,306.62	2.82
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	1,365,007,405.34	28.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	90,000.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	99,936,569.75	2.12
N	水利、环境和公共设施管理业	53,594,430.20	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,377.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	41,220,522.00	0.87
S	综合	-	-
	合计	4,042,336,641.99	85.74

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300253	卫宁软件	8,100,047	355,754,064.24	7.55
2	300287	飞利信	9,700,000	269,466,000.00	5.72
3	300075	数字政通	6,495,095	209,986,421.35	4.45

4	300005	探路者	9,299,940	143,591,073.60	3.05
5	600557	康缘药业	4,799,952	137,758,622.40	2.92
6	600587	新华医疗	1,510,014	112,571,543.70	2.39
7	300168	万达信息	6,000,142	110,102,605.70	2.34
8	002421	达实智能	3,800,014	96,824,356.72	2.05
9	300298	三诺生物	2,300,000	91,770,000.00	1.95
10	300073	当升科技	4,830,078	90,805,466.40	1.93
11	002516	江苏旷达	7,370,012	84,681,437.88	1.80
12	002690	美亚光电	2,399,281	84,622,640.87	1.79
13	002551	尚荣医疗	2,380,004	80,943,936.04	1.72
14	002609	捷顺科技	5,250,087	75,811,256.28	1.61
15	300157	恒泰艾普	5,495,000	71,105,300.00	1.51
16	600079	人福医药	2,299,910	68,652,313.50	1.46
17	002030	达安基因	3,388,803	65,912,218.35	1.40
18	002368	太极股份	1,920,000	64,300,800.00	1.36
19	600867	通化东宝	4,900,063	63,847,820.89	1.35
20	300238	冠昊生物	1,250,019	63,575,966.34	1.35
21	600114	东睦股份	5,527,050	63,174,181.50	1.34
22	600422	昆明制药	3,000,000	63,030,000.00	1.34
23	300129	泰胜风能	4,600,000	62,330,000.00	1.32
24	300347	泰格医药	1,784,434	59,778,539.00	1.27
25	002191	劲嘉股份	4,480,000	59,584,000.00	1.26
26	300273	和佳股份	1,940,000	59,558,000.00	1.26
27	002614	蒙发利	3,200,000	56,480,000.00	1.20
28	300323	华灿光电	3,000,001	56,040,018.68	1.19
29	002454	松芝股份	4,444,778	55,959,755.02	1.19
30	002531	天顺风能	4,321,925	55,925,709.50	1.19
31	002653	海思科	2,649,683	50,873,913.60	1.08
32	600660	福耀玻璃	5,899,994	49,559,949.60	1.05
33	000925	众合机电	3,600,000	48,240,000.00	1.02
34	300206	理邦仪器	1,999,995	42,459,893.85	0.90
35	002539	新都化工	3,868,028	42,122,824.92	0.89
36	600373	中文传媒	2,944,323	41,220,522.00	0.87
37	002371	七星电子	2,010,075	40,322,104.50	0.86
38	300012	华测检测	2,049,925	40,158,030.75	0.85
39	300070	碧水源	1,350,244	39,494,637.00	0.84
40	300147	香雪制药	1,400,000	37,800,000.00	0.80
41	300246	宝莱特	1,430,076	37,010,366.88	0.79
42	002642	荣之联	1,480,000	33,966,000.00	0.72

43	002296	辉煌科技	1,300,020	33,800,520.00	0.72
44	600175	美都控股	5,525,000	31,768,750.00	0.67
45	600998	九州通	2,350,000	31,466,500.00	0.67
46	600718	东软集团	2,230,007	30,082,794.43	0.64
47	300295	三六五网	300,090	30,039,009.00	0.64
48	002299	圣农发展	2,477,578	28,715,129.02	0.61
49	000963	华东医药	519,966	28,078,164.00	0.60
50	300003	乐普医疗	1,309,745	27,373,670.50	0.58
51	002470	金正大	1,409,950	27,056,940.50	0.57
52	000516	开元投资	3,999,948	26,879,650.56	0.57
53	300113	顺网科技	1,079,836	26,132,031.20	0.55
54	300150	世纪瑞尔	1,500,007	23,760,110.88	0.50
55	600066	宇通客车	1,299,912	20,980,579.68	0.45
56	600332	白云山	799,984	19,911,601.76	0.42
57	300166	东方国信	956,956	17,904,646.76	0.38
58	300255	常山药业	600,269	16,921,583.11	0.36
59	002179	中航光电	910,089	15,972,061.95	0.34
60	002462	嘉事堂	800,013	14,896,242.06	0.32
61	300030	阳普医疗	1,183,740	14,737,563.00	0.31
62	002584	西陇化工	939,986	14,616,782.30	0.31
63	000998	隆平高科	520,035	14,290,561.80	0.30
64	002159	三特索道	749,989	14,099,793.20	0.30
65	600699	均胜电子	500,000	12,565,000.00	0.27
66	600037	歌华有线	999,932	10,519,284.64	0.22
67	300016	北陆药业	759,981	9,454,163.64	0.20
68	300274	阳光电源	559,999	9,245,583.49	0.20
69	002230	科大讯飞	340,000	9,044,000.00	0.19
70	002241	歌尔声学	299,934	7,996,240.44	0.17
71	300262	巴安水务	499,913	7,878,628.88	0.17
72	600594	益佰制药	180,000	7,403,400.00	0.16
73	000513	丽珠集团	100,000	4,723,000.00	0.10
74	300026	红日药业	149,917	4,392,568.10	0.09
75	002502	骅威股份	287,596	3,689,856.68	0.08
76	600366	宁波韵升	200,000	2,968,000.00	0.06
77	601965	中国汽研	139,973	1,731,466.01	0.04
78	300386	飞天诚信	21,122	1,219,373.06	0.03
79	002726	龙大肉食	62,656	1,068,911.36	0.02
80	300037	新宙邦	20,000	726,000.00	0.02
81	002436	兴森科技	11,528	290,505.60	0.01

82	002385	大北农	20,000	227,200.00	0.00
83	603369	今世缘	12,758	215,992.94	0.00
84	603006	联明股份	9,081	129,858.30	0.00
85	300085	银之杰	5,468	94,651.08	0.00
86	002707	众信旅游	1,000	90,000.00	0.00
87	300244	迪安诊断	100	4,377.00	0.00
88	600597	光明乳业	100	1,604.00	0.00

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	300253	卫宁软件	154,926,695.00	7.04
2	600998	九州通	126,576,862.54	5.75
3	600557	康缘药业	122,315,591.17	5.56
4	002191	劲嘉股份	115,062,002.62	5.23
5	300298	三诺生物	113,507,928.29	5.16
6	002531	天顺风能	109,930,075.54	5.00
7	300129	泰胜风能	102,803,040.90	4.67
8	002516	江苏旷达	99,215,486.78	4.51
9	002421	达实智能	98,506,083.43	4.48
10	002551	尚荣医疗	97,480,630.23	4.43
11	002368	太极股份	95,989,138.09	4.36
12	600587	新华医疗	95,381,016.91	4.33
13	600422	昆明制药	86,439,100.52	3.93
14	002030	达安基因	85,533,050.75	3.89
15	300273	和佳股份	80,584,321.95	3.66
16	002609	捷顺科技	79,488,557.06	3.61
17	300073	当升科技	78,979,357.12	3.59
18	300133	华策影视	75,102,808.16	3.41
19	600066	宇通客车	74,956,053.74	3.41
20	600079	人福医药	72,807,446.24	3.31
21	300157	恒泰艾普	72,747,241.63	3.31
22	600660	福耀玻璃	72,529,529.10	3.30

23	600867	通化东宝	70,690,223.83	3.21
24	300005	探路者	70,013,990.63	3.18
25	002470	金正大	68,764,834.16	3.13
26	002614	蒙发利	66,387,807.65	3.02
27	002241	歌尔声学	65,169,300.32	2.96
28	000625	长安汽车	62,685,068.76	2.85
29	300274	阳光电源	62,185,356.96	2.83
30	002219	恒康医疗	59,071,354.05	2.68
31	600114	东睦股份	58,346,203.06	2.65
32	002653	海思科	55,880,193.49	2.54
33	002390	信邦制药	55,536,505.39	2.52
34	300251	光线传媒	50,865,481.96	2.31
35	600597	光明乳业	50,174,841.31	2.28
36	002454	松芝股份	49,328,759.35	2.24
37	600600	青岛啤酒	48,211,480.98	2.19
38	002690	美亚光电	48,086,533.81	2.19
39	300113	顺网科技	47,909,291.95	2.18
40	002539	新都化工	46,743,476.23	2.12
41	002610	爱康科技	46,092,169.05	2.09
42	300238	冠昊生物	45,426,538.31	2.06
43	002642	荣之联	45,339,403.94	2.06
44	600276	恒瑞医药	44,840,271.38	2.04

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	300287	飞利信	107,575,090.24	4.89
2	002241	歌尔声学	103,701,303.60	4.71
3	002353	杰瑞股份	96,769,242.12	4.40
4	600597	光明乳业	94,913,386.11	4.31
5	002368	太极股份	88,532,282.03	4.02
6	300182	捷成股份	81,330,668.92	3.70
7	600998	九州通	68,848,664.74	3.13
8	000625	长安汽车	61,395,514.08	2.79
9	600557	康缘药业	58,133,338.90	2.64

10	300274	阳光电源	53,511,048.97	2.43
11	600703	三安光电	52,469,612.42	2.38
12	300133	华策影视	51,011,507.95	2.32
13	600600	青岛啤酒	49,587,780.66	2.25
14	000826	桑德环境	48,470,935.36	2.20
15	002470	金正大	48,341,866.21	2.20
16	300251	光线传媒	48,239,402.58	2.19
17	600066	宇通客车	47,369,300.79	2.15
18	603008	喜临门	46,909,454.03	2.13
19	600081	东风科技	46,625,097.07	2.12
20	002219	恒康医疗	46,139,454.84	2.10
21	002390	信邦制药	45,934,710.30	2.09
22	300090	盛运股份	44,948,668.44	2.04
23	600276	恒瑞医药	44,611,141.33	2.03
24	002030	达安基因	44,214,047.02	2.01
25	002531	天顺风能	44,085,788.68	2.00

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	5,492,137,038.69
卖出股票收入（成交）总额	3,556,482,016.59

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	190,652,000.00	4.04
	其中：政策性金融债	190,652,000.00	4.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	190,652,000.00	4.04

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	140204	14 国开 04	600,000	60,270,000.00	1.28
2	140207	14 国开 07	500,000	50,180,000.00	1.06
3	140410	14 农发 10	300,000	30,090,000.00	0.64
4	140320	14 进出 20	200,000	20,076,000.00	0.43
5	140317	14 进出 17	200,000	20,036,000.00	0.42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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**

本基金未投资国债期货。

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：本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前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。

7.12.2

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	1,251,209.57
2	应收证券清算款	11,083,475.89
3	应收股利	-
4	应收利息	3,445,295.81
5	应收申购款	7,242,286.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,022,268.08

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
138,014	21,418.24	252,738,944.08	8.55%	2,703,277,885.14	91.45%

8.2 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	376,704.03	0.0127%

8.3 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	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年4月24日）基金份额总额	692,688,077.60
本报告期期初基金份额总额	1,450,830,676.87
本报告期基金总申购份额	3,387,340,635.41
减：本报告期基金总赎回份额	1,882,154,483.06
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	2,956,016,829.22

§ 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：

1、2014年1月21日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于董事长离职及总经理代行董事长职务的公告》，徐旭女士不再担任本公司董事长，尤象都先生代任本公司董事长。

2、2014 年 6 月 10 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于董事长任职的公告》，许国平先生任本公司董事长。

二、报告期内基金托管人发生以下重大人事变动：

1、本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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

报告期内无涉及基金投资策略的改变。

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	
中信证券	2	2,026,293,645.99	22.43%	1,799,992.53	22.35%	-
国海证券	1	1,148,398,160.52	12.71%	1,016,219.02	12.62%	-
兴业证券	2	983,239,621.93	10.88%	874,915.94	10.86%	-
银河证券	2	637,738,933.21	7.06%	564,336.50	7.01%	-
宏源证券	1	600,528,449.88	6.65%	546,720.13	6.79%	-
中投证券	1	514,559,483.62	5.70%	468,450.95	5.82%	-
国金证券	1	490,042,374.20	5.42%	433,638.82	5.38%	-
中银国际	2	417,733,631.56	4.62%	369,653.20	4.59%	-

申银万国	1	291,943,316.57	3.23%	258,340.62	3.21%	-
安信证券	3	291,406,942.06	3.23%	260,353.49	3.23%	-
中信建投	1	259,346,833.70	2.87%	229,496.58	2.85%	-
广发证券	1	240,494,750.95	2.66%	212,814.75	2.64%	-
东北证券	2	217,183,409.74	2.40%	197,722.16	2.45%	-
海通证券	1	205,288,285.84	2.27%	186,893.85	2.32%	-
东兴证券	1	190,733,466.61	2.11%	168,780.39	2.10%	-
瑞银证券	1	165,545,519.09	1.83%	150,711.92	1.87%	-
国泰君安	2	155,550,524.68	1.72%	137,646.65	1.71%	-
平安证券	1	79,626,740.25	0.88%	72,492.41	0.90%	-
民生证券	1	51,392,507.71	0.57%	45,477.43	0.56%	-
东方证券	1	34,198,011.54	0.38%	31,134.02	0.39%	-
浙商证券	1	32,283,420.06	0.36%	29,390.63	0.36%	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

注：本期租用证券公司交易单元新增东北证券交易席位 1 个。

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
中信证券	-	-	2,430,000,000.00	19.01%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	845,000,000.00	6.61%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	2,160,000,000.00	16.89%	-	-
中投证券	-	-	3,050,000,000.00	23.86%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	200,000,000.00	1.56%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	50,000,000.00	0.39%	-	-
海通证券	-	-	950,000,000.00	7.43%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	700,000,000.00	5.48%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	1,740,000,000.00	13.61%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	360,000,000.00	2.82%	-	-
浙商证券	-	-	300,000,000.00	2.35%	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河基金管理有限公司关于参加中国工商银行股份有限公司“2014 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014 年 1 月 2 日

2	银河基金管理有限公司关于银河行业优选股票型证券投资基金减持北京飞利信科技股份有限公司股票的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014 年 1 月 9 日
3	银河行业优选股票型证券投资基金 2013 年度 4 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014 年 1 月 21 日
4	银河基金管理有限公司关于董事长离职及总经理代行董事长职务的公告	《证券时报》、公司网站	2014 年 1 月 21 日
5	银河基金管理有限公司关于部分基金在北京银行股份有限公司开通转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014 年 1 月 24 日
6	银河行业优选股票型证券投资基金分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014 年 2 月 17 日
7	银河行业优选股票型证券投资基金参加建设银行网上银行等电子渠道费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014 年 2 月 17 日
8	关于旗下基金所持有股票“银之杰”因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014 年 2 月 21 日
9	关于旗下部分基金在交通银行开通基金定投及转换业务并参加相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014 年 2 月 26 日
10	银河基金管理有限公司关于参加中山证券有限责任公司开放式基金代销费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2014 年 2 月 26 日

11	关于旗下基金所持有股票“新华医疗”因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年3月3日
12	银河行业基金暂停大额申购（含转换转入及定期定额投资）的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年3月6日
13	关于旗下部分基金在安信证券开通基金定投业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年3月10日
14	银河基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增南京银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2014年3月12日
15	关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年3月14日
16	银河行业优选股票型证券投资基金 2013 年度年报摘要	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年3月28日
17	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京增财基金销售有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年4月16日
18	银河行业优选股票型证券投资基金 2014 年度第一季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年4月18日
19	关于旗下部分基金在广发证券开通基金定投并参加相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年4月29日

20	关于旗下基金所持有股票“三六五网”因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年4月30日
21	关于旗下基金所持有股票“日发精机”因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年5月5日
22	关于旗下基金所持有股票“万达信息”因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年5月6日
23	银河基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年5月9日
24	银河基金管理有限公司关于设立银河资本资产管理有限公司的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年5月9日
25	银河行业优选股票型证券投资基金招募说明书（更新摘要）	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年6月7日
26	银河基金管理有限公司关于董事长任职的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年6月10日
27	关于旗下基金所持有股票“卫宁软件”因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年6月14日
28	银河基金管理有限公司关于网上交易基金转换补差费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2014年6月21日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准设立银河行业优选股票型证券投资基金的文件
2. 《银河行业优选股票型证券投资基金基金合同》
3. 《银河行业优选股票型证券投资基金托管协议》
4. 中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
5. 银河行业优选股票型证券投资基金财务报表及报表附注
6. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼

12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人营业时间内免费查阅，也可通过本基金管理人网站（<http://www.galaxyasset.com>）查阅；在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

银河基金管理有限公司
2014 年 8 月 27 日