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
送出日期:2014年3月28日

银河主题策略股票型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年03月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计,请投资者注意阅读。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河主题股票
基金主代码	519679
前端交易代码	–
后端交易代码	–
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
报告期末基金份额总额	680,699,379.53份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	–
上市日期	–

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金投资策略包括但不限于资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略等。 1.资产配置策略 本基金管理人使用多因素分析模型,结合定量和定性分析,从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素,综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势,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的比例。 2.股票投资策略 本基金的股票投资策略包括但不限于如下两个层次:主题投资策略和精选个股的投资策略等。 (1)主题投资策略 本基金根据市场实际情况、投资主题的特点及其演化趋势的预期,投资主题预期的风险与收益的匹配关系等多种可能的因素,采用比较灵活的主题投资策略,包括但不限于主题识别、主题配置,以及主题调整等三个阶段相应的各种可能的投资策略。 (2)个股投资策略 本基金将在确定的投资主题之内,选择基本面较好,估值相对合理,并且预期具有一定成长性的股票作为备选投资对象进行投资。 本基金将积极参与新股申购。 3.债券投资策略 本基金债券投资以久期管理为核心,采取久期配置、利率预期、收益率曲线估值、类属配置、单券选择等投资策略。 4.股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的。基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值,具体得出参与股指期货交易的买卖张数。基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。 5.权证投资策略 本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算,并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果,选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及预期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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	朱文明
	联系电话	021-38568881	010-65556899
	电子邮箱	chenyong@galaxyasset.com	zhuyiming@citicbank.com
客户服务电话		400-820-0860	95558
传真		021-38568880	010-65550832

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	1.上海市世纪大道1568号中建大厦15楼 2.北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2012年9月21日(基金合同生效日)-2012年12月31日	2011年
本期已实现收益	48,118,084.52	1,570,078.38	–
本期利润	110,734,411.30	5,906,031.26	–
加权平均基金份额本期利润	0.5731	0.0387	–
本期基金份额净值增长率	73.51%	11.00%	–
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.4198	0.0273	–
期末基金资产净值	1,311,164,012.48	51,518,597.05	–
期末基金份额净值	1.926	1.110	–

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。

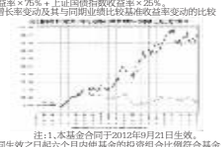
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	1.00%	1.54%	-2.25%	0.84%	3.25%	0.70%
过去六个月	37.57%	1.69%	4.85%	0.97%	32.72%	0.72%
过去一年	73.51%	1.65%	-4.73%	1.04%	78.24%	0.61%
自基金合同生效起至今	92.60%	1.48%	6.06%	1.03%	86.54%	0.45%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

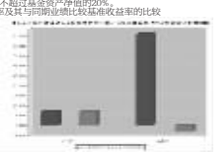
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金合同于2012年9月21日生效。

2.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50%-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%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.本基金合同于2012年9月21日生效。

2.本项目按实际存续期计算,不按整个会计年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2013	–	–	–	–	
2012	–	–	–	–	
合计	–	–	–	–	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理情况

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管理15只封闭式基金与16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势。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.银河策略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.银河银信求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4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。

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。

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。

13.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26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.银河测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.银河聚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:本基金在严格控制风险的前提下,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。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
成胜	银河主题策略股票型证券投资基金的基金经理、银河行业优选股票型证券投资基金的基金经理、股票投资部总监助理	2012年9月21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月加入银河基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理,2010年9月起担任银河行业优选股票型证券投资基金的基金经理,目前担任股票投资部总监助理。

注:1.上表中任期日期为基金合同生效日

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过制定严格的公平交易管理制度、投资管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等一系列制度,从授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控和分析评估等各个环节予以落实,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

在投资决策环节,公司实行统一研究平台和统一的投权管理,所有投资组合经理在获取研究成果及投资建议等方面享有均等机会。公司外不同投资组合类别分别建立了投备选库,不同投资组合经理之间的持仓和交易等需大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行方面,本基金管理人旗下管理的所有投资组合均会经执行集中交易制度,遵循"当时优先、价格优先"的原则,在满足系统公平交易的条件时自动进入公平交易程序,最大程度上确保公平对待各投资组合。在同日反向交易方面,除法规规定的特殊情况外,公司原则上禁止不同投资组合(完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合除外)之间的同日反向交易。

4.3.2 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,在投权管理、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、不同时期下(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公开竞价同日反向交易成交较少的申购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。

4.3.3 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

2013年股票市场结构分化明显,上证综指全年收跌6.75%,而创业板指数和中小板指数却分别上涨75.56%和27.54%。TMT和医药全年涨幅居前,煤炭、钢铁和有色金属等周期性行业跌幅较大。

本基金观察到新一轮政府调控经济结构和转型升级的决心显著,在维持经济平稳运行的同时,改革的各项措施在稳步推进,据此本基金继续维持增速缓降和经济转型是经济主要趋势,并据此进行相应的操作。在全球新一轮科技创新浪潮的大背景下,国内同时还受益于政府扶持和政策松绑,代表新兴经济方向的领域显示出了旺盛的活力,发展迅速。

由于对结构转型和新兴经济的基本面乐观,故在水平总体上比市场上股票型基金的平均值略高。从行业配置看,偏重于新兴经济板块,以成长股为主。个股集中度有所上升,并强化了重点行业和个股的研究深度,由于担心新股发行制度和大小非解禁的冲击,下半年下调了相对平衡的个股持仓。

本报告期内,本基金净值表现总体比较理想,主要得益于相对较大的行业配置比例比较高,同时是对个股表现较佳,期间又对一些高估品种进行了适时的减持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2013年净值增长率为73.51%,同期业绩比较基准增长率为-4.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计我国经济依然处于转型和去杠杆期间,经济增速下台阶,但经济结构合理性优化,与之对应的证券市场有结构性机会,对于转型意义较为明显的行业,如医药、新兴产业、国企改革等板块,我们会保持较高的关注度。

展望下半年,我们会继续以"转型和去杠杆"为主题,把握产业趋势,继续加强对行业和公司的研究和理解,优中选优,去伪存真,及时跟踪公司基本面的变化,关注优选个股带来的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益,监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则,依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度,采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查有机结合的方式,对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等情况进行了持续的监察稽核,对发现的问题进行提示和追踪落实,定期制作监察稽核报告,及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人本期的主要稽核包括:

(1)积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召,采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式,多次组织全体员工开展《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券投资基金、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动,使员工加深了对法律法规的认识,并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中,确保其行为"守法合规、严格自律,恪守诚实信用原则,以充分维护基金持有人的利益。

(2)继续完善公司的理结构,严格按照现代企业制度的要求,以规范经营法人、保护基金份额持有人利益为目标,建立、健全了相关结构和运行机制,明确职业董事会、监事会职责范围,认真贯彻了独立董事制度,重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意,保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥,保证了各项重大决策的客观公正。

(3)不断完善规章制度体系,根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求,对现有的规章制度体系不断进行完善,对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范,明确不同决策层和执行层的权利与责任,细化研究、投资、交易等各项工作流程,为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

4.7 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,切实防范利益输送。

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类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析。

4.8 管理人对报告期内基金运作合规性的说明

本报告期内,本基金管理人旗下管理的所有投资组合均按照有关法律法规及基金合同的规定,在投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2012年9月21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20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配"。截止2013年12月31日可供分配利润为228,757,885.60元,本年度未进行利润分配。

§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

自2012年09月21日银河主题策略股票型证券投资基金成立以来,作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求,对基金管理人银河基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中银河主题策略股票型证券投资基金管理人银河基金管理有限责任公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期内本基金由安永华明会计师事务所出具无保留意见审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:银河主题策略股票型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日 单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		205,307,345.84	11,368,105.96
结算备付金		4,703,756.25	830,447.21
存出保证金		776,248.44	–
交易性金融资产		1,143,973,049.60	40,450,280.99
其中:股票投资		1,143,973,049.60	40,450,280.99
基金投资		–	–
债券投资		–	–
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		9,627,248.84	525,413.45
应收利息		33,041.62	3,240.63
应收股利		–	–
应收申购款		13,881,706.16	30,541.87
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,378,302,396.75	53,208,030.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		31,656,849.26	–
应付赎回款		31,676,701.55	1,327,656.68
应付管理人报酬		1,439,354.56	75,466.22
应付托管费		239,892.40	12,577.68
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		1,636,233.35	93,728.77
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		489,353.15	180,003.71
负债合计		67,138,384.27	1,689,433.06
所有者权益:			
实收基金		680,699,379.53	46,414,572.44
未分配利润		630,464,632.95	5,104,024.61
所有者权益合计		1,311,164,012.48	51,518,597.05
负债和所有者权益总计		1,378,302,396.75	53,208,030.11

注:(1)报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.926元,基金份额总额680,699,379.53份。
(2)本基金自同于2012年9月21日生效,上年度可比期间自2012年9月21日至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:银河主题策略股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日 单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一.收入		121,206,220.88	7,005,849.12
1.利息收入		388,756.47	843,418.96
其中:存款利息收入		367,162.81	153,601.80
债券利息收入		–	–
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		21,593.66	689,817.16
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		56,979,781.12	1,445,491.18
其中:股票投资收益		56,568,812.00	1,445,491.18
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		3,900.00	–
股利收益		407,069.12	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		62,616,326.78	4,335,952.88
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,221,356.51	380,986.10
减:二.费用		10,471,809.58	1,099,817.86
1.管理人报酬		4,940,971.15	671,060.77
2.托管费		823,495.24	111,843.46
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		4,293,309.87	141,120.15
5.利息支出		–	–
其中:卖出回购金融资产支出		–	–
6.其他费用		414,033.32	175,793.48
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		110,734,411.30	5,906,031.26
减:所得税费用		–	–
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		110,734,411.30	5,906,031.26

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银河主题策略股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日 单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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)	46,414,572.44	5,104,024.61	51,518,597.05
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	110,734,411.30	110,734,411.30
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)	634,284,807.09	514,626,197.04	1,148,911,004.13
其中:1.基金申购款	1,199,639,263.97	926,884,428.08	2,126,523,692.05
2.基金赎回款	-565,354,456.88	-412,258,231.04	-977,612,687.92
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)	680,699,379.53	630,464,632.95	1,311,164,012.48

项目	上年度可比期间 2012年9月21日(基金合同生效日)至2012年12月31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)	342,362,482.82	–	342,362,482.82
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	5,906,031.26	5,906,031.26
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)	-295,947,910.38	-802,006.65	-296,749,917.03
其中:1.基金申购款	8,078,020.31	-40,990.65	8,037,029.66
2.基金赎回款	-304,025,930.69	-761,016.00	-304,786,946.69
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)	46,414,572.44	5,104,024.61	51,518,597.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

董事长、基金管理人负责人:无奈都 董事会主管会计工作负责人:董伯儒 董事会会计机构负责人:董伯儒

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易 金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月21日(基金合同生效日)至2012年12月31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
中信银河证券股份有限公司	2,424,085,257.57	76.24%	57,435,714.20	54.93%

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:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金 金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31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
中国银河证券股份有限公司	2,145,076.97	75.72%	1,288,628.14	78.76%

关联方名称	上年度可比期间 2012年9月21日(基金合同生效日)至2012年12月31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(%)
中国银河证券股份有限公司	50,824.87	54.23%	50,824.87	54.23%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除由证券公司承担的费用(包括但不限于公(交)经手费、证券结算风险基金和公(交)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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费 单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,940,971.15	671,060.77
其中:支付销售机构的客户维护费	1,820,629.57	80,445.35

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×1.50%/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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,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、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费 单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	823,495.24	111,843.46

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,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托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

注:无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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

	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年9月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
基金合同生效日(2012年9月21日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	7,055,443.55	–
期间申购/买入总份额	–	7,055,443.55
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	7,055,443.55	7,055,443.55
占基金总份额比例	1.04%	15.20%

注:期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	205,307,345.84	339,098.89	11,368,105.96	144,891.15

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过银河期货买卖股指期货成交额为人民币14,838,420.00元,应支付给银河期货的佣金为人民币667.75元,应付期货交易佣金期末无余额。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: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