

信息披露

银河收益证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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

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	601318	中国平安	198,000	7,799,320.00	0.56
2	000002	万科A	500,000	4,135,000.00	0.31
3	000625	长安汽车	300,000	3,693,000.00	0.26
4	000858	五粮液	199,507	3,584,870.41	0.26
5	600606	招商银行	305,215	3,125,401.60	0.22
6	300386	飞天诚信	500	286,650.00	0.00
7	002226	天龙集团	500	8,530.00	0.00

注:投资者欲了解本报告期内本基金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

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	000002	万科A	4,211,000.00	0.31
2	000625	长安汽车	3,582,500.00	0.26
3	000858	五粮液	3,489,143.30	0.26
4	600605	南方科技	2,969,800.00	0.22
5	601318	中国平安	1,198,800.00	0.09
6	300386	飞天诚信	16,565.00	0.00
7	002226	天龙集团	4,895.00	0.00

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

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	600605	南方科技	5,261,156.66	0.39

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额
-	15,472,763.30
-	5,261,156.66

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	中期票据	61,230,000.00	4.39
4	企业债	119,605,520.00	8.58
5	公司债及可转债	-	-
6	中期票据	39,791,000.00	2.85
7	可转债	1,072,409,527.65	76.90
8	其他	-	-
9	合计	1,293,036,047.65	92.72

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

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	1118001	工行转债	2,298,050	233,918,509.50	16.77
2	110015	石化转债	1,615,000	17,437,158.00	1.25
3	1113005	平安转债	1,594,490	19,325,421.80	1.21
4	110018	国电转债	1,400,000	146,040,000.00	10.48
5	113002	工行转债	1,100,000	115,940,000.00	8.31

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

注:本基金本报告期末未持有股指期货,因此不存在需要披露的信息

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

本基金本报告期末未持有国债期货

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:本基金本报告期末未持有国债期货

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券中,没有发行主体被监管部门立案调查的情形,在报告编制日前一年也没有受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定选股库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,156.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,726,795.43
5	应收申购款	103,891.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	预付款项	-
9	合计	8,866,753.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	央行转债	233,918,509.50	16.77
2	110015	石化转债	17,437,158.00	1.25
3	113005	平安转债	19,325,421.80	1.21
4	110018	国电转债	146,040,000.00	10.48
5	113002	工行转债	115,940,000.00	8.31
6	113003	重工转债	104,244,675.20	7.48
7	110023	民生转债	60,320,000.00	4.33
8	110024	隧道转债	42,081,000.00	3.02
9	110016	川路转债	10,520,221.10	0.75
10	110011	顺华转债	2,779,639.60	0.20

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

持有人结构	个人投资者
持有户数(户)	9,748
持有基金份额	129,543.43
持有基金份额占基金份额总额比例	93.75%
持有基金份额占基金份额总额比例	6.25%

8.2 期末基金份额持有人的从业人员持有本基金的情况

持有基金份额人	持有基金份额占基金份额总额比例	占基金总份额比例
持有基金份额人	0	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金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等合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

项目	基金份额
基金合同生效日(2003年8月4日)基金份额总额	1,802,248,568.23
本报告期期初基金份额总额	1,283,979,846.80
本报告期间基金总申购份额	9,330,386.62
减:本报告期间基金总赎回份额	30,520,837.20
本报告期间基金净申购份额(申购减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	1,262,789,396.22

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议

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:

2014年12月25日基金管理人刊登了《银河基金管理有限公司关于董事长张发林及总经理刘建明先生职务的公告》,经第三届十次临时股东大会审议通过,张发林先生辞去本公司董事长职务,2014年6月6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张发林先生辞去本公司董事长职务的公告》。

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发生如下重大人事变动:

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的重大改变

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

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员均无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和佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	股票交易成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	备注
银河证券	2	11,282,643.30	63.59%	14,459.34	28.36%	-
银河证券	1	6,459,956.66	36.41%	36,532.22	71.64%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
浦发证券	1	-	-	-	-	-

注:1、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) 具备基金业务所需的高效、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门的高素质的研究人员,能及时提供高质量的研究支持和咨询服务,并能提供研究报告、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) 本基金选择其他重要的其他条件。

2、选择证券公司专用席位的方式:

(1) 价格考核;

(2) 研究考核;

(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

券商名称	债券交易成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	19,281,180.39	5.86%	-	-	-	-
银河证券	309,667,983.40	94.14%	1,618,100,000.00	100.00%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浦发证券	-	-	-	-	-	-

银河基金管理有限公司

2014年8月27日

B356

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年8月27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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称中国农业银行)根据本基金合同规定,于2014年8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,也不保证基金份额持有人收益,对投资者因依赖基金管理人提供信息而造成的投资决策失误不承担法律责任。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,也不保证基金份额持有人收益,对投资者因依赖基金管理人提供信息而造成的投资决策失误不承担法律责任。

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2014年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

基金基本情况	基金管理人	基金托管人
基金名称	银河收益证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
基金代码	151002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年8月4日	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,262,789,396.22份	
基金合同期限	不定期	

2.2 基金投资说明

投资目标	本基金为证券投资基金,主要投资于具有良好流动性的固定收益类资产,在有效控制风险和保持较高流动性的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略合理配置资产。在控制风险和保持流动性的前提下,本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类资产,在有效控制风险和保持较高流动性的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	债券指数收益率×85%+上证A股指数收益率×15%,其中债券指数为中信债券指数收益率×85%+中信国债指数收益率×49%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其风险收益特征为低风险、稳健型固定收益类基金,预期风险收益水平低于股票基金、混合基金、权益类基金收益水平。

2.3 基金管理人及基金托管人

名称	基金管理人	基金托管人
名称	银河基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李秀芳
联系电话	021-38568881	010-66060069
电子邮箱	chenyong@galaxyasset.com	hufang@abcchina.com
客户服务电话	400-820-0860	95599
传真	021-38568880	010-68121816

2.4 信息披露方式

基金半年度报告备置地点	1、上海市世纪大道1668号中银大厦15楼 2、北京市西城区复兴门内大街28号贵诚基金中心东单9F
-------------	---

3.1 主要会计数据和财务指标

基金基本情况	基金管理人	基金托管人
基金名称	银河收益证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
基金代码	151002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年8月4日	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,262,789,396.22份	
基金合同期限	不定期	

4.1 基金管理人及基金托管人

4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况

银河基金管理有限公司成立于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、湖南广电传媒股份有限公司。

目前,除基金管理人、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、银河证券投资基金

基金合同生效日:2002年8月15日

投资目标:为平衡型基金,力求为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增值。

2、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6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

3、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

4、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:在满足本金稳定与良好流动性的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。

5、银河银华保本增值证券投资基金

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年6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。

6、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“自下而上”的资产配置以及动态行业配置策略与“自上而下”的个股选择策略相结合,优选具有良好发展前景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,追求基金资产的长期增值。

7、银河沪深300价值证券投资基金

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年12月29日

基金投资目标:通过严格的资产配置约束、数学模型化风险和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段,追求跟踪投资相对业绩比较基准的跟踪误差的最小化。

8、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: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,通过主动式管理,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增长带来的成果。

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6月21日

基金投资目标:本基金采用可优化的恒定比例投资保险策略,并引入保证