银河增利债券型发起式证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河增利债券
场内简称	-
交易代码	519660
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
报告期末基金份额总额	277,564,475.96份
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。
投资策略	本基金是以债券等固定收益类资产的投资为主的债券型投资基金,通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益,并适度参与股票等权益类资产的投资以增强回报,投资策略主要包括资产配置策略、VPPI策略、债券投资策略、个股精选策略、新股申购策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:三年期定期存款利率(税后)+1.5%。
风险收益特征	本基金是以债券等固定收益类资产投资为主的债券型投资基金,属于中低风险、中低收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	银河增利债券A / 银河增利债券C
下属两级基金的交易代码	519660 / 519661
下属两级基金的前端交易代码	- / -
下属两级基金的后端交易代码	- / -
报告期末下属两级基金的份额总额	248,956,247.97份 / 28,608,227.99份
下属两级基金的风险收益特征	- / -

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)	
	银河增利债券A	银河增利债券C
1.本期已实现收益	8,911,806.46	616,456.79
2.本期利润	15,768,027.45	1,201,336.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0506	0.0501
4.期末基金资产净值	277,760,160.90	31,773,989.35
5.期末基金份额净值	1.116	1.111

注: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。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

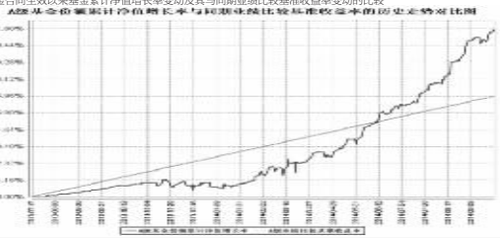
银河增利债券A

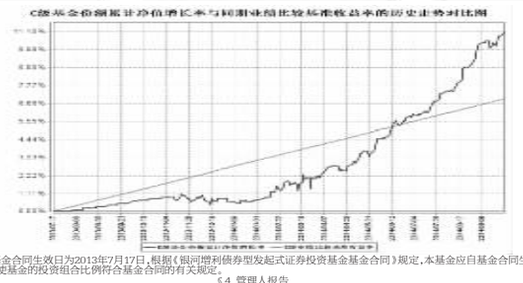
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.99%	0.16%	1.45%	0.01%	3.54%	0.15%

银河增利债券C

阶段	净值增长率①	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	4.91%	0.14%	1.45%	0.01%	3.46%	0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金合同生效日为2013年7月17日,根据《银河增利债券型发起式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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟仓	银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理、银河岁岁回报债券型证券投资基金的基金经理、银河润利保本债券型证券投资基金的基金经理	2013年7月17日	-	6	硕士研究生学历。2008年5月加入银河基金管理有限公司,历任数量研究员、债券经理,期间主要从事数量研究和债券投资工作。2012年12月起担任银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理,2013年8月起担任银河岁岁回报债券型证券投资基金的基金经理,2014年8月起担任银河润利保本债券型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》、《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 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在二季度运作期内,通货紧胀继续低位运行,资金面也维持较为宽松的状态,债券市场整体走势较强,尤其是信用债,各品种收益率均有不同程度下行,供给虽然减少,需求仍然保持旺盛,资金配置压力较大,债市延续了春节以来的上涨态势。进入三季度,七月初利率债因为资金面的局部紧张出现了一波调整,十年期国开收益率上行超过30BP,在利率债收益率上行过程中,信用债尤其是城投债表现非常稳健,收益率继续小幅下行,信用利差进一步缩小;利率债短期调整后,七月底八月初逐步企稳,收益率开始下行,而城投债收益率继续快速下行,出现一波交投热情的急速行情,目前城投债收益率基本下行到去年初的低位,行情高位盘整,市场交易较为清淡。三季度股票市场情绪好转,出现了一波普涨行情;可转债受益于股市的上涨,也出现了一波明显的上涨,各个品种均有不错表现。

债券市场方面,增利三季度维持了前期债券配置,以静制动,期间被动增仓,目前信用债维持较高仓位,且券种结构较好,有效的享受到了三季度这波信用债的上涨。可转债维持了中性配置,整体仓位维持在10%以下,一定程度上享受到了可转债的上涨。股票方面,增利配置了少量仓位,期间增配了少量低估值品种,严控风险的前提下博取一定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年第3季度银河增利债券A净值增长率为4.99%,银河增利债券C净值增长率为4.91%,同期比较基准为1.45%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,845,436.60	1.30
	其中:股票	8,845,436.60	1.30
2	固定收益投资	606,667,687.01	89.16
	其中:债券	606,667,687.01	89.16
	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	41,919,406.47	6.16
7	其他资产	22,989,274.78	3.38
8	合计	680,421,804.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,565,436.60	1.80
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	1,695,000.00	0.55
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	1,585,000.00	0.51
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	8,845,436.60	2.86

5.3 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600690	青岛海尔	199,977	3,159,636.60	1.02
2	600486	扬农化工	100,000	2,402,000.00	0.78
3	600998	九州通	100,000	1,695,000.00	0.55
4	002421	达实智能	50,000	1,585,000.00	0.51
5	300400	劲拓股份	500	3,800.00	0.00

5.4 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,010,000.00	6.46
	其中:政策性金融债	20,010,000.00	6.46
4	企业债券	553,334,556.17	178.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	33,323,130.84	10.77
8	其他	-	-
9	合计	606,667,687.01	195.99

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124374	13塔国资	400,000	41,120,000.00	13.28
1	124543	14临港控	400,000	41,120,000.00	13.28
2	124822	14合滨投	400,000	40,448,000.00	13.07
3	122877	10渝南岸	313,240	31,324,000.00	10.12
4	124429	13亭公投	300,000	31,320,000.00	10.12
5	124432	13翼建投	300,000	31,107,000.00	10.05

5.6 报告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。

5.7 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:本基金未进行贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	145,172.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,816,682.99
5	应收申购款	27,178.74
6	其他应收款	240.20
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,989,274.78

5.10.4 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	14,614,512.00	4.72
2	110015	石化转债	10,983,682.20	3.55
3	113005	平安转债	6,567,000.00	2.12

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300400	劲拓股份	3,800.00	0.00	新股锁定

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	银河增利债券A	银河增利债券C
报告期期初基金份额总额	422,791,424.02	29,885,576.03
报告期期间基金总申购份额	4,266,763.30	12,274,583.12
减:报告期期间基金总赎回份额	178,101,939.35	13,551,931.16
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	248,956,247.97	28,608,227.99

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末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	10,005,400.54	3.60	10,005,400.54	3.60	自合同生效之日起不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,400.54	3.60	10,005,400.54	3.60	自合同生效之日起不低于三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立银河增利债券型发起式证券投资基金的文件
2、《银河增利债券型发起式证券投资基金合同》
3、《银河增利债券型发起式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、银河增利债券型发起式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

10.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦15楼
北京市西城区金融大街丙17号

10.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。
咨询电话:(021)38568888 /400-820-0860
公司网址:http://www.galaxyasset.com

银河基金管理有限公司
2014年10月24日

银河主题策略股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河主题股票
场内简称	-
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,113,754,141.86份
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。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	26,069,911.58
2.本期利润	329,105,638.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.3004
4.期末基金资产净值	2,692,879,149.54
5.期末基金份额净值	2.418

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	14.22%	1.07%	10.11%	0.67%	4.11%	0.40%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

3.3 其他指标

注:无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、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	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,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。

注:1、上表中任职、离任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》、《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 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济在下行后逐步企稳,政府改革的态度坚决,改革红利持续释放,转型依然是对经济主要趋势的判断,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,维持了上季度末的较高仓位。虽然改革进入攻坚阶段,但转型的趋势明确,市场仍处在技术革新叠加改革红利释放的良好基本面中。本基金希望在此历史背景下,优选出行业前景远大且公司治理优良、盈亏稳固的品种,分享其成长空间。得益于配置符合市场方向,三季度基金净值实现较快增长。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,在保持组合更新的同时突出优选个股带来的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年三季度本基金收益率为14.22%,比较基准收益率为10.11%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,528,227,786.05	92.33
	其中:股票	2,528,227,786.05	92.33
2	固定收益投资	120,240,000.00	4.39
	其中:债券	120,240,000.00	4.39
	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	66,548,762.84	2.43
7	其他资产	23,155,637.31	0.85
8	合计	2,738,172,186.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	35,907,812.06	1.33
B	采矿业	75,842,375.95	2.82
C	制造业	1,308,991,255.03	48.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,958,226.61	2.78
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	42,714,759.36	1.59
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	853,668,898.24	31.70
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	19,980,000.00	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	17,701,482.60	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,430,000.00	0.31
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	90,032,976.20	3.34
S	综合	-	-
	合计	2,528,227,786.05	93.89

5.3 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300253	卫宁软件	4,250,000	184,025,000.00	6.83
2	300075	数字政通	4,200,006	145,488,207.84	5.40
3	300287	飞利信	3,500,015	111,265,476.85	4.13
4	300168	万达信息	4,000,014	110,400,386.40	4.10
5	300005	探路者	5,300,000	92,750,000.00	3.44
6	002516	江苏旷达	4,860,046	87,237,825.70	3.24
7	300157	恒泰艾普	4,229,915	75,842,375.95	2.82
8	600557	康缘药业	2,699,941	74,005,382.81	2.75
9	002421	达实智能	2,300,006	72,910,190.20	2.71
10	300073	当升科技	2,820,070	60,490,501.50	2.25

5.4 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,240,000.00	4.47
	其中:政策性金融债	120,240,000.00	4.47
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	120,240,000.00	4.47

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140204	14国开04	600,000	60,144,000.00	2.23
2	140320	14进出20	300,000	30,069,000.00	1.12
3	140317	14进出17	300,000	30,027,000.00	1.12

5.6 报告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。

5.7 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:本基金未进行贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,011,516.39
2	应收证券清算款	15,161,508.63
3	应收股利	-
4	应收利息	3,597,692.89
5	应收申购款	3,384,919.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,155,637.31

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300075	数字政通	145,488,207.84	5.40	重大事项停牌
2	300157	恒泰艾普	75,842,375.95	2.82	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,118,492,000.49
报告期期间基金总申购份额	449,903,946.39
减:报告期期间基金总赎回份额	454,641,805.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,113,754,141.86

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	7,055,443.55
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,055,443.55
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.63

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立银河主题策略股票型证券投资基金的文件
2.《银河主题策略股票型证券投资基金基金合同》
3.《银河主题策略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.银河主题策略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

9.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦15楼

9.3 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制件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司,咨询电话:400-820-0860/(021)38568888

银河基金管理有限公司
2014年10月24日

银河银泰理财分红证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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、勤奋律己、创新图强"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