银河银信添利债券型证券投资基金

【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	银河银信添利债券	
场内简称	-	
交易代码	519666	
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	
报告期末基金份额总额	221,626,953.50份	
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。	
投资策略	通过合理的债券资产配置,综合运用利率预期、收益率曲线和其他动态增强策略特别是新股申购等,获取稳定收益。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率×80%+税后一年期定期存款利率×20%	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,以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为基金的投资目标。本基金还可以通过参与新股申购提高基金的收益水平。本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和收益水平高于货币市场基金和中短期债券基金,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	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
下属两级基金的交易代码	519667	519666
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	132,558,692.31份	89,068,261.19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)	
	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
1.本期已实现收益	1,931,263.88	1,234,865.36
2.本期利润	3,104,176.98	2,183,417.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0226	0.0235
4.期末基金资产净值	137,001,468.51	91,569,058.33
5.期末基金份额净值	1.0335	1.0281

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。

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。

3.2 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

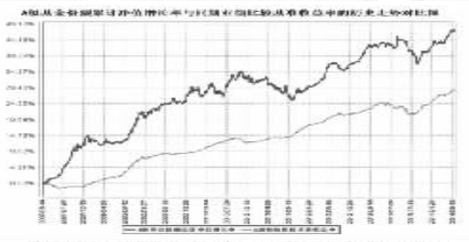
银河银信添利债券A

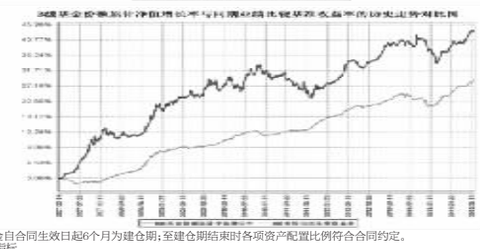
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.47%	0.09%	1.40%	0.05%	1.07%	0.04%

银河银信添利债券B

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	2.37%	0.09%	1.40%	0.05%	0.97%	0.04%

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:本基金自合同生效日起6个月为建仓期;至建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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		
韩晶	银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理、银河领先债券型证券投资基金的基金经、银河收益证券投资基金的基金经理	2011年8月25日	-	12	中共党员,经济学硕士。曾就职于中国民族证券有限责任公司,期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。2008年6月加入银河基金管理有限公司,从事固定收益产品研究工作,历任债券经理助理、债券经理等职务,银河收益证券投资基金的基金经理等职务,2012年11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理,2014年7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理。

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

本基金三季度拟订的策略是:密切跟踪政策动向,重时兑现利率品种的波段投资收益,并逐步以中高评级城投债和短久期的资质较好的商收益债来加大组合杠杆,转债投资将以国企改革主题为主,加大其它明显获益于放松政策的相关品种的投资力度。

三季度国内经济数据表现疲弱,通胀水平持续低于预期,国内经济稳增长面临较大的压力。报告期内政策放松不断加码,诸如加大房地产消费贷款、放开房地产公司的融资及央行继续加大支农贷款的扶持力度、定向发放SLF和降低正回购利率20BP等等宽松政策的实施,都在不断向市场传递着稳经济的信号。

受资金面持续宽松及政策面相关改革推进的影响,权益市场做多情绪高涨,出现了连续三个月的上涨,转债受此影响整体表现突出。市场对经济预期的分歧导致债券市场利率品种波动较大。季末,中长期利率最终报收于年内新低水平。而信用债市场则大多延续了年初以来的上涨行情。交易所高收益债表现亮眼,在一些风险偏好较高的资产管理产品的需求推动之下,出现了持续的上涨。而银行间市场基于对信用风险和流动性的综合考虑,城投债仍然是上涨获益最大的品种。低评级的短融、中票则表现相对较弱。债券市场整体而言中长端品种涨幅优于短端,季末收益率曲线异常平坦。

报告期内,银信添利基金按照策略逐步减持了利率品种,增持了城投债,期间针对高评级的城投债和可转债做了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内银河银信添利债券A净值增长2.47%,银河银信添利债券B净值增长2.37%,比较基准为1.40%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	302,803,027.52	73.75
	其中:债券	302,803,027.52	73.75
	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	6,537,334.56	1.59
7	其他资产	101,256,006.21	24.66
8	合计	410,596,368.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	20,039,000.00	8.77
	其中:政策性金融债	20,039,000.00	8.77
4	企业债券	239,998,575.92	105.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,148,000.00	8.81
7	可转债	22,617,451.60	9.90
8	其他	-	-
9	合计	302,803,027.52	132.48

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	1280315	12玉环交投债	200,000	20,756,000.00	9.08
2	124040	12绍迪落	200,000	20,380,000.00	8.92
2	124820	14济高债	200,000	20,380,000.00	8.92
3	1280388	12蒙路债	200,000	20,314,000.00	8.89
4	124822	14台滨投	200,000	20,224,000.00	8.85
5	124054	12株云龙	200,000	20,016,000.00	8.76

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

国债期货暂不属于本基金可投资品种范畴。

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	15,960.65
2	应收证券清算款	2,115,920.74
3	应收股利	-
4	应收利息	8,852,380.85
5	应收申购款	90,271,743.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,256,006.21

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	110015	石化转债	10,903,000.00	4.77
2	113005	平安转债	6,238,650.00	2.73
3	128004	久立转债	1,437,087.52	0.63

5.10.5 报告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。

5.10.6 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

项目	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
报告期期初基金份额总额	184,594,919.13	96,404,596.84
报告期期间基金总申购份额	101,321,841.62	9,375,543.50
减:报告期期间基金总赎回份额	153,358,068.44	16,711,879.15
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	132,558,692.31	89,068,261.19

§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 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银信添利债券型证券投资基金的文件

2、《银河银信添利债券型证券投资基金基金合同》

3、《银河银信添利债券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、银河银信添利债券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:(021)38568888/400-820-0860

银河基金管理有限公司
2014年10月24日

银河行业优选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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	银河行业股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	2,880,465,911.41份
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	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。 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。 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。 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。
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。
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

§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	82,230,156.59
2.本期利润	656,507,610.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.2307
4.期末基金资产净值	5,250,084,405.12
5.期末基金份额净值	1.823

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。

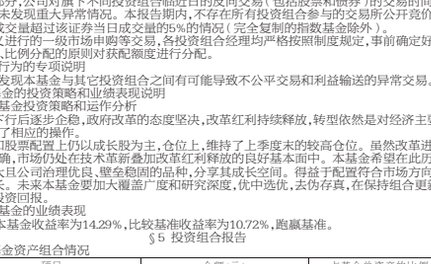
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	14.29%	1.07%	10.72%	0.72%	3.57%	0.35%

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:1、本基金合同于2009年4月24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	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、壁垒稳固的品种,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14.29%,比较基准收益率为10.72%,跑赢基准。

§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	4,853,605,198.73	90.10
	其中:股票	4,853,605,198.73	90.10
2	固定收益投资	180,371,000.00	3.35
	其中:债券	180,371,000.00	3.35
	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	315,585,993.39	5.86
7	其他资产	37,535,531.94	0.70
8	合计	5,387,097,724.06	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	96,327,239.33	1.83
B	采矿业	98,525,350.00	1.88
C	制造业	2,699,930,880.37	51.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,449,165.58	2.28
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	137,921,827.14	2.63
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	1,534,934,103.60	29.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,629,036.40	0.43
L	租赁和商务服务业	105,060.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	35,964,000.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	27,818,772.39	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,050,000.00	0.27
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	65,949,763.92	1.26
S	综合	-	-
	合计	4,853,605,198.73	92.45

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	8,000,000	346,400,000.00	6.60
2	300287	飞利信	9,000,000	286,110,000.00	5.45
3	300075	数字政通	6,495,095	224,990,090.80	4.29
4	300168	万达信息	7,199,920	198,717,792.00	3.79
5	300005	探路者	9,000,000	157,500,000.00	3.00
6	002516	江苏旷达	7,370,012	132,291,715.40	2.52
7	600557	康缘药业	4,700,001	128,827,027.41	2.45
8	002421	达实智能	3,696,432	117,176,894.40	2.23
9	300073	当升科技	5,000,029	107,250,622.05	2.04
10	300157	恒泰艾普	5,495,000	98,525,350.00	1.88

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	180,371,000.00	3.44
	其中:政策性金融债	180,371,000.00	3.44
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	180,371,000.00	3.44

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	1.15
2	140207	14国开07	500,000	50,115,000.00	0.95
3	140410	14农发10	300,000	30,048,000.00	0.57
4	140320	14进出20	200,000	20,046,000.00	0.38
5	140317	14进出17	200,000	20,018,000.00	0.38

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未持有股指期货合约

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

依照基金合同,未对股指期货进行投资

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本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内也没有受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,153,471.27
2	应收证券清算款	23,756,452.52
3	应收股利	-
4	应收利息	5,166,277.47
5	应收申购款	7,459,330.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,535,531.94

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。

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	224,990,090.80	4.29	重大资产重组
2	300157	恒泰艾普	98,525,350.00	1.88	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,956,016,829.22
报告期期间基金总申购份额	888,113,384.51
减:报告期期间基金总赎回份额	963,664,302.32
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	2,880,465,911.41

§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	24,245,714.32
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	24,245,714.32
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.84

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

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。

银河基金管理有限公司
2014年10月24日

银河定投宝中证腾安价值100指数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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	银河定投宝中证腾安指数
场内简称	-
交易代码	519677
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	2014年3月14日
报告期末基金份额总额	156,587,629.41份
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	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,朝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%。 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。
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。
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

§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