银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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:2015年8月26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2015年8月25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2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河定投宝中证腾安指数
基金主代码	519677
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
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	492,208,121.67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方目标的指数跟踪方法,按照成分股在中证腾安价值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分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,降低交易成本,提高投资效益。 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,或出现其他交易障碍时,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、债券基金和混合型基金。

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	董伯儒	田青
	联系电话	021-38568988	010-67595096
	电子邮箱	dongboru@galaxyasset.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67595096
传真		021-38568769	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§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(2015年1月1日-2015年6月30日)
本期已实现收益	318,161,578.39
本期利润	165,579,356.29
加权平均基金份额本期利润	0.4479
本期基金份额净值增长率	54.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.8096
期末基金资产净值	1,016,981,308.32
期末基金份额净值	2.066

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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或赎回基金的有关费用,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。

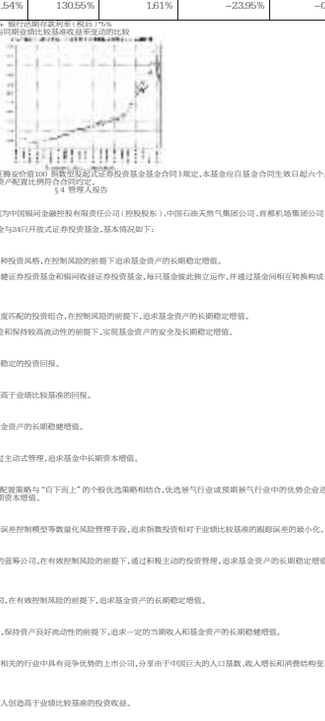
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-13.84%	3.87%	-10.86%	3.69%	-2.98%	0.18%
过去三个月	16.79%	2.87%	25.50%	2.75%	-8.71%	0.12%
过去六个月	54.87%	2.25%	70.21%	2.19%	-15.34%	0.06%
过去一年	101.36%	1.75%	128.60%	1.72%	-27.24%	0.03%
自基金合同生效起至今	106.60%	1.54%	130.55%	1.61%	-23.95%	-0.07%

注:本基金业绩比较基准为中证腾安价值100指数收益率*95% + 银行活期存款利率(税后)*5%。

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:本基金合同生效日为2014年3月14日,根据《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规定的有关规定,截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§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成立于2002年8月7日,公司的股东分别为中国铜业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、上海城投(集团)有限公司、湖南省产业投资集团有限公司。
目前,除本基金外,银河基金管理有限公司另管理15只封闭式基金与24只开放式证券投资基金,基本情况如下:
1.股票证券投资基金
基金运作方式:契约型封闭式
基金合同生效日:2002年08月15日
基金投资目标: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,每只基金规此独立运作,并通过基金间相互转换构成一个统一的基金体系。
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年03月04日
(1)银河稳健证券投资基金
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
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03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.银河银盛货币市场基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2005年10月21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03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.银河业务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05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:2008年04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:通过严格的投资纪律和分析,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07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:本基金投资于具有较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.银河保证收益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:2011年06月09日
基金投资目标:本基金主要投资于固定收益类品种,在控制风险,保持资产良好流动性的前提下,追求一定的当期收入和基金资产的长期稳健增值。
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07月17日
基金投资目标:本基金主要投资于拥有较好成长性的企业上市公司,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.银河稳利债券型证券投资基金(LOF)
基金运作方式:上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日:2012年04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09月21日
基金投资目标:本基金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。
15.银河转债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28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。
16.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02月28日
基金投资目标: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7.5%。
17.银河照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07月17日
基金投资目标: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。
18.银河岁岁平稳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,运作周期和日由开放期和封闭期组成,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08月09日
基金投资目标: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。
19.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02月11日
基金投资目标: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。
20.银河来丽优享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:2014年06月26日
基金投资目标:本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的美丽主题相关股票,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
21.银河转利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:2014年06月06日
基金投资目标:本基金应用优化的恒定性资产投资保险策略,并引入保证人,在保证本金安全的基础上,本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下,力争实现基金资产在保本期间的稳定增值。
22.银河音乐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:2014年11月18日
基金投资目标:本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的健康快乐主题相关的股票,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
23.银河津利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:2015年04月08日
基金投资目标:本基金应用优化的恒定性资产投资保险策略(优化的CPPI策略),并引入保证人,在保证本金安全的基础上,本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下,力争实现基金资产在保本期间的稳定增值。
24.银河现代服务主题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:2015年04月22日
基金投资目标:本基金将充分把握中国经济可持续发展过程中现代服务主题相关行业及子行业呈现出的投资机会,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济发展方式的过程中现代服务主题相关行业及子行业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的条件下,力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
25.银河鑫利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:2015年04月23日
基金投资目标:本基金在合理控制风险的前提下,在深入的基本面研究的基础上,通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理,分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇,追求实现基金资产的持续稳定增值。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会成员情况

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		
罗博	银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金的基金经理、银河沪深300价值指数证券投资基金的基金经理、银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金的基金经理	2014年3月14日	-	10	中共党员,博士研究生学历。曾就职于华夏银行,中国人民财产保险股份有限公司,南京证券股份有限公司,南京证券股份有限公司从事企业金融、投资银行业务及上市公司财务等工作。2006年2月加入银河基金管理有限公司,历任产品设计经理、产品数据研究及投资研究员、行业研究员等职务。2009年12月起担任银河沪深300价值指数证券投资基金的基金经理,2013年3月起担任银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金的基金经理。

注:1.上表中任职日期为该基金的生效之日;
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》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"诚信勤健、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控控制体系,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 公平交易制度的执行情况
本报告期内,公司施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。
针对同周交易日(T日)内,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),选择两个季度期间内,不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公开竞价交易的证券进行了价差分析,并针对最价金额、流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。
针对发生交易量较大、公司对旗下不同投资组合指数比例(投资组合指数比例=投资组合指数市值/全部组合指数市值)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或交易价格差的情况或交易量比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般性场中购券交易,由各投资组合经理根据相关规定,事前确定申购价格和数量,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
上半年对市场的预判:未来趋势的风险,主要是美元的升值风险。欧洲、中国、日本、韩国会维持宽松的货币政策,若美联储在明年四季度加息,对美元形成升值预期,会引导国际基本面流美元资产,引起新型市场国家的市场动荡。
经济风险下行,通胀维持低位,为货币政策提供了实际需求和现实可能。但是为了控制人民币的贬值预期,货币政策放松的空间也是有限制的。全球经济处于衰退的格局,未来经济的发展方向尚未形成,众多国家还是在依靠宽货币来支撑经济,世界经济的根基是不稳的。对市场保持一点谨慎,且行且观察。紧跟政府的政策走向,发掘投资机会。
本基金依据基金合同的规定,以控制跟踪误差最小化为管理目标,未进行投资时间的投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
2015年上半年银河定投宝指数基金净值增长54.87%,同期业绩比较基准增长23.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业发展的展望展望
近期市场大家的判断:
一、过高的杠杆运用。
二、创业板更计强幅过高,有回调的压力。
三、央行操作了几次降息,对货币政策有向或二阶拐点的疑虑。
四、打新股抽离资金。
五、港股券外资的影响扰动。
概念发生了变化?
央行降息和降存准,以及重启逆回购,暂时消除了货币政策转向或二阶拐点的疑虑,其余四个问题尚存,第一个和第二个问题尚在回归中,第四个问题受新股发行暂停,暂时对市场的影响解除。第五个问题有所缓解。
市场的预期:
短期市场维持震荡格局,这次央行降息降息的操作,救市的意味浓厚,市场还是很谨慎,市场还需要时间,但这次央行的操作对提升市场重心是有利的,政府的救市行为,短期的范围之内应该风险的集中爆发,有时间换空间的意味。反弹应该为降低信业板仓位,调结构提供了良好的机会。

风险因素
1)美国加息预期
对于上市公司再融资重新放开
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人严格按照新准则,中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及基金合同的约定,制定了健全、有效的估值政策和程序,对基金所持有的投资品种进行估值。

§5 投资组合报告

5.1 报告期内本基金投资情况
本报告期内,中国建设银行股份有限公司作为基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全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
本报告期,本托管人按照国家有关规定,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方面进行了监督,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 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内,中国建设银行股份有限公司作为基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履行了基金托管人应尽的义务。

5.4 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
本报告期,本托管人按照国家有关规定,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方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.5 报告期内本基金财务指标、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。

§6 年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表
会计主体:银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款		86,831,432.56	17,195,370.39
结算备付金		2,855,314.04	307,590.31
存出保证金		481,681.23	67,490.45
交易性金融资产		1,032,950,023.27	230,776,157.91
其中:股票投资		1,031,911,056.77	230,776,157.91
基金投资		-	-
债券投资		1,038,966.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生工具投资		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		107,517,751.32	12,245,055.25
应收利息		24,919.46	4,852.27
应收股利		-	-
应收申购款		24,493,688.63	4,173,913.35
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,255,154,820.51	264,770,429.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		-	-
应付赎回款		233,031,329.10	16,440,685.09
应付管理人报酬		612,062.28	98,403.20
应付托管费		183,618.70	29,520.96
应付销售服务费		306,031.14	49,201.61
应付交易费用		3,806,194.19	367,589.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		234,276.78	309,764.09
负债合计		238,173,512.19	17,295,163.99
所有者权益:			
实收基金		492,208,121.67	185,565,320.32
未分配利润		524,773,186.65	61,909,945.62
所有者权益合计		1,016,981,308.32	247,475,265.94
负债和所有者权益总计		1,255,154,820.51	264,770,429.93

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值2.066,基金份额总额492,208,121.67份。

6.2 利润表
会计主体:银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年3月14日(基金合同生效日)至2014年6月30日
一、收入		175,686,606.93	1,807,833.72
1.利息收入		281,698.12	423,117.28
其中:存款利息收入		281,638.57	49,731.01
债券利息收入		59.55	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	373,386.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		327,987,129.91	884,504.54
其中:股票投资收益		320,576,714.33	588,835.86
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		-	-
股利收益		7,410,415.58	295,668.68
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-152,582,222.10	497,420.18
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	2,791.72
减:二、费用		10,107,249.64	371,106.25
1、管理人报酬		1,838,847.66	92,185.05
2、托管费		551,654.34	27,655.51
3、销售服务费		919,423.86	46,092.53
4、交易费用		6,540,924.59	84,648.66
5、利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6、其他费用		256,399.19	120,524.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		165,579,356.29	1,436,727.47
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		165,579,356.29	1,436,727.47

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	185,565,320.32	61,909,945.62	247,475,265.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	165,579,356.29	165,579,356.29
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)	306,642,801.35	297,283,884.74	603,926,686.09
其中:1.基金申购款	1,704,901,101.54	1,772,349,266.72	3,477,250,368.26
2.基金赎回款	-1,398,258,300.19	-1,475,065,381.98	-2,873,323,682.17
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)	492,208,121.67	524,773,186.65	1,016,981,308.32

项目	上年度可比期间 2014年3月14日(基金合同生效日)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)	69,792,833.07	-	69,792,833.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,436,727.47	1,436,727.47
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)	-13,931,857.17	-11,630.27	-13,943,487.44
其中:1.基金申购款	12,151,348.61	73,431.36	12,224,779.97
2.基金赎回款	-26,083,205.78	-85,061.63	-26,168,267.41
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)	55,860,975.90	1,425,097.20	57,286,073.10

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:
尤雅都 尤雅都 姜长建
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
银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金(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【2013】165号《关于核准银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式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于其自2014年3月7日上期间向社会公开发行募集,募集期间募集资金本息利息折算为本基金份额等各所涉及资金的有关事项经毕永恒会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具验字第(2014)第字第0022772_B03号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年3月14日正式生效;本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币492,751,202.04元,在募集期间产生的银行存款利息为人民币41,541.03元,以上实收基金(本金)及计息为人民币492,792,833.07元,折合492,792,833.07份基金份额。本基金的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。
本基金的投资范围为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、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。股票投资包括中证腾安价值100指数成份股、备选成份股。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中权的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%,且占非现金资产的比例不低于80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;投证、股指期货以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。
本基金的业绩比较基准为:中证腾安价值100指数收益率*95% + 银行活期存款利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础
本财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计数据和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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引规定》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务处理办法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管理办法》、《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>》及其他中国证监会发布的证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2015年6月30日的财务状况以及自2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本基金本报告期期初中国证券投资基金业协会颁布并执行的2014年以来(关于发布《中国证券投资基金会计估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知)的规定,自2015年3月26日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更的说明
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
本基金本报告期会计估计变更的说明在6.4.4 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中披露。
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)交易印花税税率横纵印花税,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《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执行对价而发生股权变动,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《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,暂免征收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《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《关于证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,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《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,储蓄存款利息收入,由上市公司、银行按照税法规定代扣代缴个人所得税;
根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号《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;
根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;
根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号《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,证券投资基金从证券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。

6.4.7 关联方关系
6.4.7.1 本报告期内存在控制关系或其他重大利益关系的关联方发生变化的情况
本报告期内存在控制关系或其他重大利益关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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、基金销售机构
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

6.4.8 本期及前期上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。
以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年3月14日(基金合同生效日)至2014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	1,185,282,766.91	26.07%	70,737,452.41	100.00%

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年3月14日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
银河证券	-	-	500,000,000