银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金

【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:兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业银行股份有限公司(以下简称:兴业银行)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	银河沪深300成长分级		
场内简称	银河增强		
基金主代码	161507		
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		
基金管理人	银河基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	57,368,817.38份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2013-06-06		
下属分级基金的基金简称	银河沪深300成长分级	银河沪深300成长分级A	银河沪深300成长分级B
下属分级基金场内简称:	银河增强	银河优先	银河进取
下属分级基金的交易代码	161507	150121	150122
报告期末下属分级基金份额总额	38,382,289.38份	9,493,264.00份	9,493,264.00份

2.2 基金产品说明

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稳健的组合管理。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%。
投资策略	本基金以“指数化投资为主,主动性投资为辅”,在有效复制目标指数的基础上,在一定程度内调整个股在投资组合中的权重,力求投资收益能够跟踪并超越超目标指数。本基金将利用数量化模型,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,改进指数跟踪效果。
业绩比较基准	沪深300成长指数收益率*95% + 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,预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金,从本基金所分离的两类基金份额看,银河沪深300成长优先份额具有低风险、收益相对稳定的特征;银河沪深300成长进取份额具有高风险、高预期收益的特征。
下属三级基金的风险收益特征	- | - | -

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	董伯儒	吴荣
	联系电话	021-38568988	021-62677777-213117
	电子邮箱	dongborui@galaxyasset.com	0116930@cib.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95561
传真		021-38568769	021-62538523

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.上海市静安区江宁路168号兴业大厦20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	67,436,144.84
本期利润	62,642,795.78
加权平均基金份额本期利润	0.5197
本期基金份额净值增长率	31.38%
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	0.5276
期末基金资产净值	84,652,674.65
期末基金份额净值	1.476

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.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.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。

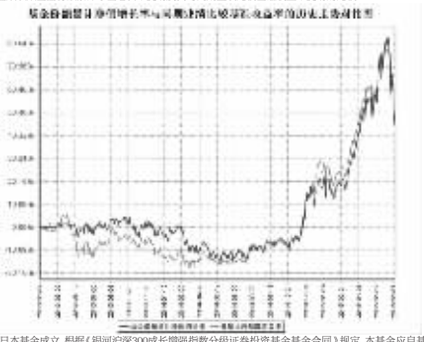
3.2 基金净值表现

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	-6.35%	3.25%	-6.70%	3.24%	0.35%	0.01%
过去三个月	14.86%	2.42%	9.02%	2.41%	5.84%	0.01%
过去六个月	31.38%	2.07%	22.95%	2.08%	8.43%	-0.01%
过去一年	74.97%	1.65%	80.46%	1.71%	-5.49%	-0.06%
自基金合同生效起至今	55.75%	1.34%	54.27%	1.46%	1.48%	-0.12%

注:本基金业绩比较基准为沪深300成长指数收益率*95% + 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:2013年03月29日本基金成立,根据《银河沪深300成长增强指数分级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。截止建仓期结束,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、上海城投(集团)有限公司、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、银丰证券投资基金
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,每只基金彼此独立运作,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:2003年08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.银河银信货币市场基金
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:2009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.银河强化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:2014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25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。

15.银河领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。

16.银河增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。

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。

18.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。

19.银河定投宝中证腾安价值100指数型发起式证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2014年03月14日
基金投资目标: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%。

20.银河美丽优萃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29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.银河润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,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周期内的稳定增值。

22.银河康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.银河泽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比例投资保险策略(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周期内的稳定增值。

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22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)及基金经理助理简介

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	银河沪深300成长增强指数分级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、银河岁岁安心定期开放债券型证券投资基金的基金经理	2013年3月29日	-	10	中共党员,博士研究生学历,曾就职于华夏银行,中信万通证券有限公司,期间从事企业金融、投资银行业务及上市公司购并等工作。2006年2月加入银河基金管理有限公司,历任产品设计经理、衍生品数量化投资研究员、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。2014年3月起担任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。

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)公开竞价交易的比例进行了价差分析,并针对超价金额、占优比情况及证券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,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 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

一月份,适当降低了银行和券商的配置,增加了电子、有色、互联网的配置。

二月份,基本保持了一月份的组合配置,适度调整了有色的配置。三月份,基本延续了二月份的组合配置,增加了基因检测的配置。

四月份,基本延续了三月份的组合配置。五月份,适度参与了政府数据资源互联网化带来的投资机会。六月份,随着市场的回调,不断减持了创业板,以及互联网金融类的股票。

从量化投资的角度,借用市场优质指数的研究成果,在此基础上进行优化,以提升投资组合中市场组合的收益。

现阶段,未进行股指期货的投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年上半年沪深300成长指数基金净值收益率为31.38%,业绩比较基准收益率为22.95%,领先业绩基准8.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期市场大跌的机理:

一、过高的杠杆运用。

二、创业板累计涨幅过高,有回调的压力。

三、央行操作了几次正回购,对货币政策转向或二阶拐点的疑虑。

四、打新股抽离资金

五、希腊债务问题的扰动

哪些发生了变化?

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,这次央行降准降息的操作,救市的意味浓厚,市场迅速形成上攻突破的动能不足,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,短期防范了流动性风险的集中爆发,有时间换空间的意味。反弹应该为降低创业板仓位,调结构提供了很好的机会。

风险因素

1)美国加息预期

2)对于上市公司再融资重新放开

行业配置策略

未来看好:国企改革和军工板块,以及政府信息的互联网化运用、中国制造2025,还有回调后的互联网+龙头。

1)银行业维持标准配置。

2)选择基因检测、细胞治疗、新能源汽车、智能家电、电子等的投资机会

3)经济转型,本质上是发展高端服务业,走美国的发展路线。拉美国家的转型是转到了低端服务业,转型是失败的。所以要转型成功,必须依托制造业的发展,寻找制造业中的服务业这样的标的。

4)继续关注传媒、环保行业的投资机会,国企改革以及军工、农业行业的投资机会。

5)关注移动互联网对传统行业的颠覆,以及专注移动互联网应用提供商的投资机会。关注传统企业构建商品交易互联网平台,进行商业模式创新的投资机会。平台性公司估值风险在逐步释放,接机介入。

6)关注政策红利的释放,对国企改革的机会进行深入挖掘。关注福建海西板块、迪斯尼板块和“一带一路”的主题投资机会。

7)关注房地产政策放松,对传统周期行业和装饰行业的拉动机会。

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。

为确保估值的合规、公允,本基金管理人设立了估值工作决策、监督、审查的专门部门,组成人员包括投资研究部门、监察稽核部门及会计核算部门的工作负责人或资深证券务人员,其多数拥有十年以上的证券、风控、估值经验,根据基金管理公司制定的相关制度,估值政策决策机构中不包括基金经理,但对于非活跃投资品种,基金经理可以提供估值建议。

同时不断建立起一套完整、有效的估值工作管理规定及程序,对估值相关的各个环节均配有专门的人员实施、把控,并保证环节的各方不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2013年3月29日成立,根据《基金合同》有关规定:“在存续期内,本基金(包括银河沪深300 成长份额、银河沪深300 成长优先份额、银河沪深300 成长进取份额)不进行收益分配。”本基金本报告期未进行利润分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期,兴业银行股份有限公司在本基金的托管过程中,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,完全尽职尽责地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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表
会计主体:银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金
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		6,498,310.83	9,976,520.43
结算备付金		76,395.61	254,616.20
存出保证金		352,914.08	37,878.17
交易性金融资产		82,649,545.89	157,046,838.30
其中:股票投资		82,649,545.89	157,046,838.30
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		324,428.55	2,184,628.70
应收利息		2,821.29	6,484.63
应收股利		-	-
应收申购款		17,856.45	1,692.37
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		89,922,272.70	169,508,558.80
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		4,737,983.56	2,623,360.35
应付管理人报酬		92,219.38	133,389.11
应付托管费		18,443.88	26,677.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		284,921.70	409,542.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		136,029.53	282,387.76
负债合计		5,269,598.05	3,475,357.28
所有者权益:			
实收基金		54,386,239.02	140,074,381.16
未分配利润		30,266,435.63	25,958,820.36
所有者权益合计		84,652,674.65	166,033,201.52
负债和所有者权益总计		89,922,272.70	169,508,558.80

注:报告截止日2015年6月30日,基金银河沪深300成长分级份额净值1.476元,基金银河沪深300成长分级A份额净值1.031元,基金银河沪深300成长分级B份额净值1.921元,基金份额总额57,368,817.38份,其中银河沪深300成长分级份额38,382,289.38份,银河沪深300成长分级A份额9,493,264.00份,银河沪深300成长分级B份额9,493,264.00份。

6.2 利润表
会计主体:银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金
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1月1日至2014年6月30日
一、收入		65,045,003.11	-5,496,473.40
1.利息收入		108,987.29	32,252.60
其中:存款利息收入		108,987.29	32,252.60
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		69,127,559.77	-1,623,847.03
其中:股票投资收益		68,252,273.87	-1,951,388.72
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		875,285.90	327,541.69
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-4,793,349.06	-3,917,531.90
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		601,805.11	12,652.93
减:二、费用		2,402,207.33	843,700.00
1. 管理人报酬		769,890.58	271,401.29
2. 托管费		153,978.10	54,280.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,262,444.79	215,411.14
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		215,893.86	302,607.35
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		62,642,795.78	-6,340,173.40
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		62,642,795.78	-6,340,173.40

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金
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)	140,074,381.16	25,958,820.36	166,033,201.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	62,642,795.78	62,642,795.78
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)	-85,688,142.14	-58,335,180.51	-144,023,322.65
其中:1.基金申购款	270,329,316.99	81,069,432.98	351,398,749.97
2.基金赎回款	-356,017,459.13	-139,404,613.49	-495,422,072.62
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)	54,386,239.02	30,266,435.63	84,652,674.65
项目	上年度可比期间 2014年1月1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)	66,415,402.86	-404,358.91	66,011,043.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-6,340,173.40	-6,340,173.40
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)	-12,290,207.81	792,530.14	-11,497,677.67
其中:1.基金申购款	993,121.92	-80,400.97	912,720.95
2.基金赎回款	-13,283,329.73	872,931.11	-12,410,398.62
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)	54,125,195.05	-5,952,002.17	48,173,192.88

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:

_____ _____ _____
_____ _____ _____
_____ _____ _____