

银河沪深300价值指数证券投资基金

[2015]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:2015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对本基金合同规定，于2015年10月22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，确认本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金销售机构承诺在本报告披露后3个工作日内将本报告登载在各自网站上，供投资者查阅。
基金的过往业绩并不代表未来表现。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。
本报告中财务数据未经审计。

报告期为2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河沪深300价值指数
交易代码	610971
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2000年1月29日
报告期末基金份额总额	161,206,838.07份
投资目标	通过股票投资获取收益，追求超越沪深300指数的长期资本增值。 本基金主要采用股票指数投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数化投资方法，按照行业分类配置股票，在此基础上根据市场情况适当调整，以使跟踪误差控制在合理的范围内。本基金将利用数理化模型，对跟踪误差及其构成进行动态管理，根据股票市值占比投资组合进行相应调整，并将定期或不定期地对量化模型进行优化调整，力求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金在正常情况下采用完全复制的股票投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数化投资方法，按照行业分类配置股票，在此基础上根据市场情况适当调整，以使跟踪误差控制在合理的范围内。本基金将利用数理化模型，对跟踪误差及其构成进行动态管理，根据股票市值占比投资组合进行相应调整，并将定期或不定期地对量化模型进行优化调整，力求跟踪误差最小化。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*96%+银行同期存款利率(税后)*4%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于股票型基金中高风险、高收益类型的基金。 本基金的风险承受能力高于货币型基金、债券型基金、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

主要财务指标	报告期(2015年7月1日—2015年9月30日)
1.本期已实现收益	306,371.03
2.期初现金及现金等价物余额	-86,109,404.13
3.报告期基金份额本期利润	-0.3013
4.期末基金资产净值	170,149,182.79
5.期末基金份额净值	1.066

注:1.本期已实现收益指基金本期收入扣减所有费用后的余额，本期利润为期初至报告期末实际收益水平低于所列数字。

2.基金本期利润不包括持有人认购或申购基金所产生的认购费或申购费，计入利润后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金现金分红

3.21 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

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

3.4 主要财务指标

3.5 主要财务指标

3.6 主要财务指标

3.7 主要财务指标

3.8 主要财务指标

3.9 主要财务指标

3.10 主要财务指标

3.11 主要财务指标

3.12 主要财务指标

3.13 主要财务指标

3.14 主要财务指标

3.15 主要财务指标

3.16 主要财务指标

3.17 主要财务指标

3.18 主要财务指标

3.19 主要财务指标

3.20 主要财务指标

3.21 主要财务指标

3.22 主要财务指标

3.23 主要财务指标

3.24 主要财务指标

3.25 主要财务指标

3.26 主要财务指标

3.27 主要财务指标

3.28 主要财务指标

3.29 主要财务指标

3.30 主要财务指标

3.31 主要财务指标

3.32 主要财务指标

3.33 主要财务指标

3.34 主要财务指标

3.35 主要财务指标

3.36 主要财务指标

3.37 主要财务指标

3.38 主要财务指标

3.39 主要财务指标

3.40 主要财务指标

3.41 主要财务指标

3.42 主要财务指标

3.43 主要财务指标

3.44 主要财务指标

3.45 主要财务指标

3.46 主要财务指标

3.47 主要财务指标

3.48 主要财务指标

3.49 主要财务指标

3.50 主要财务指标

3.51 主要财务指标

3.52 主要财务指标

3.53 主要财务指标

3.54 主要财务指标

3.55 主要财务指标

3.56 主要财务指标

3.57 主要财务指标

3.58 主要财务指标

3.59 主要财务指标

3.60 主要财务指标

3.61 主要财务指标

3.62 主要财务指标

3.63 主要财务指标

3.64 主要财务指标

3.65 主要财务指标

3.66 主要财务指标

3.67 主要财务指标

3.68 主要财务指标

3.69 主要财务指标

3.70 主要财务指标

3.71 主要财务指标

3.72 主要财务指标

3.73 主要财务指标

3.74 主要财务指标

3.75 主要财务指标

3.76 主要财务指标

3.77 主要财务指标

3.78 主要财务指标

3.79 主要财务指标

3.80 主要财务指标

3.81 主要财务指标

3.82 主要财务指标

3.83 主要财务指标

3.84 主要财务指标

3.85 主要财务指标

3.86 主要财务指标

3.87 主要财务指标

3.88 主要财务指标

3.89 主要财务指标

3.90 主要财务指标

3.91 主要财务指标

3.92 主要财务指标

3.93 主要财务指标

3.94 主要财务指标

3.95 主要财务指标

3.96 主要财务指标

3.97 主要财务指标

3.98 主要财务指标

3.99 主要财务指标

3.100 主要财务指标

3.101 主要财务指标

3.102 主要财务指标

3.103 主要财务指标

3.104 主要财务指标

3.105 主要财务指标

3.106 主要财务指标

3.107 主要财务指标

3.108 主要财务指标

3.109 主要财务指标

3.110 主要财务指标

3.111 主要财务指标

3.112 主要财务指标

3.113 主要财务指标

3.114 主要财务指标

3.115 主要财务指标

3.116 主要财务指标

3.117 主要财务指标

3.118 主要财务指标

3.119 主要财务指标

3.120 主要财务指标

3.121 主要财务指标

3.122 主要财务指标

3.123 主要财务指标

3.124 主要财务指标

3.125 主要财务指标

3.126 主要财务指标

3.127 主要财务指标

3.128 主要财务指标

3.129 主要财务指标

3.130 主要财务指标

3.131 主要财务指标

3.132 主要财务指标

3.133 主要财务指标

3.134 主要财务指标

3.135 主要财务指标

3.136 主要财务指标

3.137 主要财务指标

3.138 主要财务指标

3.139 主要财务指标

3.140 主要财务指标

3.141 主要财务指标

3.142 主要财务指标

3.143 主要财务指标

3.144 主要财务指标

3.145 主要财务指标

3.146 主要财务指标

3.147 主要财务指标

3.148 主要财务指标

3.149 主要财务指标

3.150 主要财务指标

3.151 主要财务指标

3.152 主要财务指标

3.153 主要财务指标

3.154 主要财务指标

3.155 主要财务指标

3.156 主要财务指标