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】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:2016年3月25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。本年度报告已经三分之一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2016年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2015年1月1日起至12月31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
场内简称	-
基金主代码	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
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	341,595,768.43份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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指数中的基准权重和建议股票投资组合,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,明显改进指数跟踪效果。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%。
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。

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	021-38568888	010-67596096
	电子邮箱	dongborou@galaxyasset.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67596096
传真		021-38568769	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年	2014年3月14日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	-1,666,849.64	31,146,023.29
本期利润	14,641,658.29	37,314,524.65
加权平均基金份额本期利润	0.0377	0.3667
本期基金份额净值增长率	36.28%	33.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0038	0.2169
期末基金资产净值	620,928,358.11	247,475,265.94
期末基金份额净值	1.818	1.334

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. 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(为期末余额,不是当期发生数)。

4.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)扣除费用后的余额。

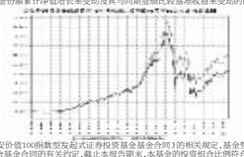
3.2 基金净值表现

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标准差③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	28.48%	1.93%	27.08%	1.91%	1.40%	0.02%
过去六个月	-12.00%	3.28%	-7.68%	3.09%	-4.32%	0.19%
过去一年	36.28%	2.83%	67.14%	2.70%	-30.86%	0.13%
自基金合同生效起至今	81.80%	2.18%	112.95%	2.14%	-31.05%	0.04%

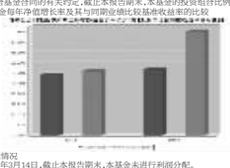
注:本基金的业绩比较基准为中证腾安价值100指数收益率*95% + 银行活期存款利率(税后)*5%。

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: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》的相关规定,基金管理人应当在基金合同生效日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,截止本报告期末,本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金合同生效日为2014年3月14日,截止本报告期末,本基金未进行利润分配。

§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1只封闭式基金与26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

类型:契约型封闭式

成立日:2002年6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。

基金合同生效日:2003年8月4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.银河证券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3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.银河银富货币市场基金

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.银河银信资料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3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:2008年5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:2008年4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:2008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.银河基筹精选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:2010年7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,力争使基金的投资持有人分享中国经济持续成长的成果。

10.银河创新成长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: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:2011年6月31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:2011年7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.银河德利债券型证券投资基金(LOF)

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年4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:2012年9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3月29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。力争把解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%。

17.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7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适合,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6月9日

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3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.银河银富货币市场基金

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.银河银信资料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3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:2008年5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:2008年4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:2008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.银河筹精选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:2010年7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,力争使基金的投资持有人分享中国经济持续成长的成果。

10.银河创新成长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: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:2011年6月31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:2011年7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.银河德利债券型证券投资基金(LOF)

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年4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:2012年9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3月29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。力争把解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%。

17.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7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适合,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6月9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2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,在确保基础业绩比较基准,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.银河英雄优势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:2014-05-29

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英雄主题相关股票,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.银河顺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:2014-08-06

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期满内的稳定增值。

22.银河康乐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:2014-11-18

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:2015-04-09

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期满内的稳定增值。

24.银河优服务主题动态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:2015-04-22

基金投资目标:本基金投资于具有竞争优势的本基金定义的健康快乐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.银河嘉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:2015-06-12

基金投资目标:本基金将充分根据我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济政策在国过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司研究实力优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的过程中,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。

27.银河国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:2015-06-26

基金投资目标:本基金主要投资于固定收益类品种,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。

28.银河转型增长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:2015-06-12

基金投资目标:本基金将充分根据我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济政策在国过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司研究实力优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的过程中,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。

29.银河转型增长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:2015-06-12

基金投资目标:本基金将充分根据我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济政策在国过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司研究实力优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的过程中,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。

30.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:2015-06-26

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。

31.银河蓝筹精选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:2015-06-26

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,力争使基金的投资持有人分享中国经济持续成长的成果。

32.银河沪港深精选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:2015-07-29

基金投资目标:本基金主要投资于沪港深两地证券市场的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。

33.银河利率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:2015-08-26

基金投资目标:在严格控制风险的前提下,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。

34.银河主题策略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:2015-09-23

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。

35.银河转型增长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:2015-06-12

基金投资目标:本基金将充分根据我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济政策在国过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司研究实力优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的过程中,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。

36.银河沪港深精选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:2015-07-29

基金投资目标:本基金主要投资于沪港深两地证券市场的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。

37.银河利率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:2015-08-26

基金投资目标:在严格控制风险的前提下,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。

38.银河主题策略混合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:2015-09-23

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。

39.银河转型增长主题灵活配置混合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:2015-06-12

基金投资目标:本基金将充分根据我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济政策在国过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司研究实力优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的过程中,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。

40.银河沪港深精选灵活配置混合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:2015-07-29

基金投资目标:本基金主要投资于沪港深两地证券市场的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。

41.银河利率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:2015-08-26

基金投资目标:在严格控制风险的前提下,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。

42.银河主题策略混合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:2015-09-23

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。

43.银河转型增长主题灵活配置混合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:2015-06-12

基金投资目标:本基金将充分根据我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济政策在国过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司研究实力优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的过程中,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。

44.银河沪港深精选灵活配置混合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:2015-07-29

基金投资目标:本基金主要投资于沪港深两地证券市场的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。

45.银河利率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:2015-08-26

基金投资目标:在严格控制风险的前提下,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。

46.银河主题策略混合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:2015-09-23

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。

47.银河转型增长主题灵活配置混合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:2015-06-12

基金投资目标:本基金将充分根据我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济政策在国过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司研究实力优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的过程中,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。

48.银河沪港深精选灵活配置混合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:2015-07-29

基金投资目标:本基金主要投资于沪港深两地证券市场的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。

49.银河利率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:2015-08-26

基金投资目标:在严格控制风险的前提下,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。

50.银河主题策略混合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:2015-09-23

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。

51.银河转型增长主题灵活配置混合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:2015-06-12

基金投资目标:本基金将充分根据我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济政策在国过程中呈现的转型增长主题投资机会,充分利用我公司研究实力优势,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的过程中,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。

52.银河沪港深精选灵活配置混合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:2015-07-29

基金投资目标:本基金主要投资于沪港深两地证券市场的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。

53.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:2016年3月25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。本年度报告已经三分之一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2016年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2015年1月1日起至12月31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
场内简称	-
基金主代码	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
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	341,595,768.43份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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指数中的基准权重和建议股票投资组合,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,明显改进指数跟踪效果。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%。
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。

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	021-38568888	010-67596096
	电子邮箱	dongborou@galaxyasset.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67596096
传真		021-38568769	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年	2014年3月14日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	-1,666,849.64	31,146,023.29
本期利润	14,641,658.29	37,314,524.65
加权平均基金份额本期利润	0.0377	0.3667
本期基金份额净值增长率	36.28%	33.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0038	0.2169
期末基金资产净值	620,928,358.11	247,475,265.94
期末基金份额净值	1.818	1.334

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. 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(为期末余额,不是当期发生数)。

4.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)扣除费用后的余额。

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标准差③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	28.48%	1.93%	27.08%	1.91%	1.40%	0.02%
过去六个月	-12.00%	3.28%	-7.68%	3.09%	-4.32%	0.19%
过去一年	36.28%	2.83%	67.14%	2.70%	-30.86%	0.13%
自基金合同生效起至今	81.80%	2.18%	112.95%	2.14%	-31.05%	0.04%

注: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%。

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: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》的相关规定,基金管理人应当在基金合同生效日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,截止本报告期末,本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金合同生效日为2014年3月14日,截止本报告期末,本基金未进行利润分配。

§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1只封闭式基金与26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

类型:契约型封闭式

成立日:2002年6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。

基金合同生效日:2003年8月4日

(1)银河稳健证券投资基金

基金投