

银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 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

送出日期：2016 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

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 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
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.....	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 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贵金属投资明细.....	47
7.9 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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47

7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金		
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		
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	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	35,757,761.10 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 年 6 月 6 日		
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	26,481,905.10 份	4,637,928.00 份	4,637,928.00 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 7.75%。
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适度超越目标指数。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。

下属分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	021-38568888	021-62677777-213117
	电子邮箱	dongboru@galaxyasset.com	011693@cib.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95561
传真		021-38568769	021-62535823
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	福建省福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	上海市静安区江宁路 168 号兴 业大厦 20 楼
邮政编码		200122	200041
法定代表人		许国平	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,890,415.97
本期利润	-6,199,693.95
加权平均基金份额本期利润	-0.1659
本期加权平均净值利润率	-15.48%

本期基金份额净值增长率	-12.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	6,658,467.77
期末可供分配基金份额利润	0.1862
期末基金资产净值	39,679,536.53
期末基金份额净值	1.110
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	20.03%

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

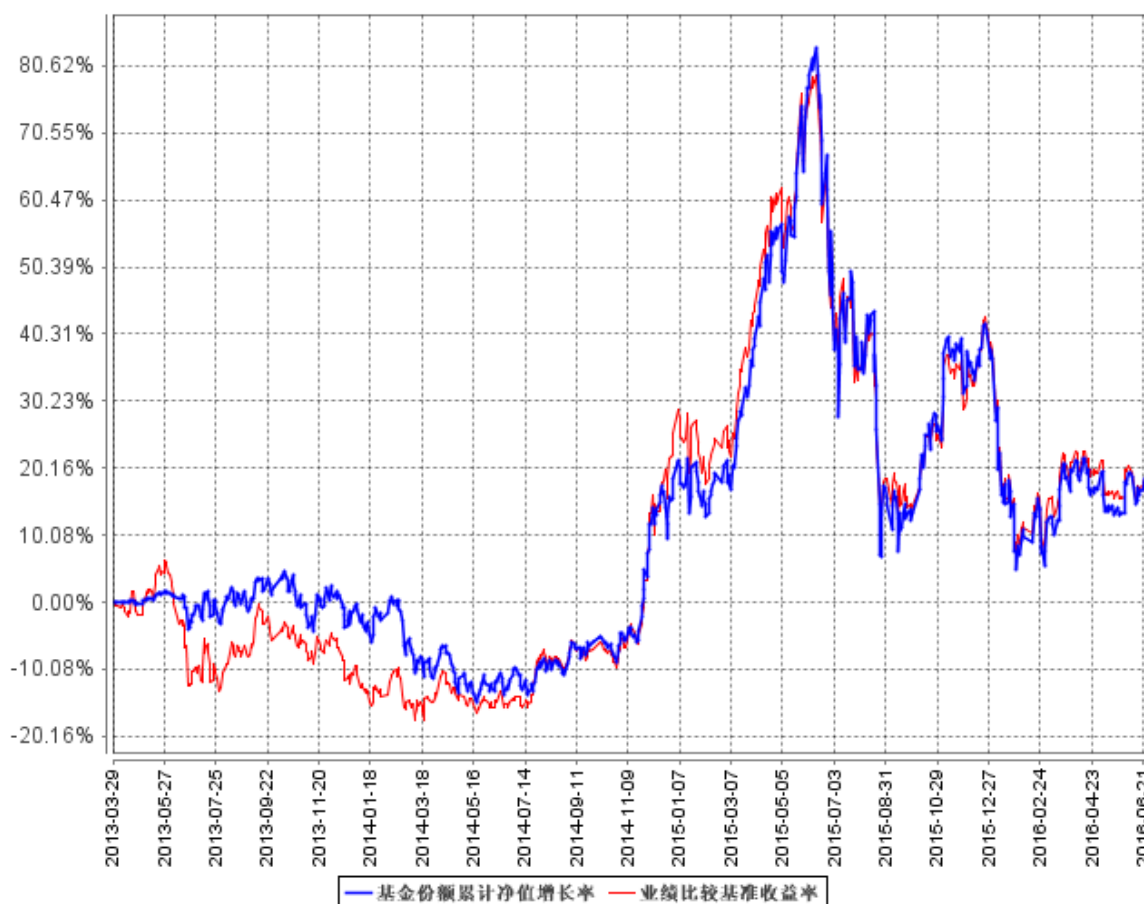
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.65%	1.15%	-0.60%	1.01%	2.25%	0.14%
过去三个月	0.18%	1.17%	-1.56%	1.00%	1.74%	0.17%
过去六个月	-12.10%	1.91%	-13.37%	1.79%	1.27%	0.12%
过去一年	-22.94%	2.33%	-22.70%	2.16%	-0.24%	0.17%
过去三年	22.35%	1.77%	32.82%	1.73%	-10.47%	0.04%
自基金合同生效起至今	20.03%	1.71%	19.25%	1.71%	0.78%	0.00%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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 29 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 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：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 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：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 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 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 05 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 08 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前提下，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。

26、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 年 5 月 12 日

基金投资目标：本基金将充分把握我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济战略布局过程中呈现的转型增长主题投资机会，充分利用我公司的研究投资优势，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、产业优化升级的红利，在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

27、银河鸿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 6 月 19 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。

28、银河智联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 12 月 17 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，追求实现基金资产持续稳定增值的前提下，力求获取超额收益。

29、银河大国智造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：2016 年 3 月 11 日

基金投资目标：在实现《中国制造 2025》规划的工业未来发展纲领和顶层设计目标的过程中，本基金将充分把握大国智造主题涵盖领域中相关行业和企业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享大国智造主题涵盖领域中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前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

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	2013 年 3 月 29 日	-	11	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，

	金经理、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				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、上表中任职日期为基金合同生效之日。

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合规守信情况的说明

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，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 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，人民币大幅贬值，引发了市场的调整，一月初，主动大幅降低了基金的仓位，维持在基金合同规定的下限，90%多一点的水平。一月份，适度参与了供给侧改革的品种的投资机会，如钢铁和煤炭的个股，

二月份，增加了基金的仓位，参与了供给侧改革，房地产行业去库存、大数据等方面的投资机会。

三月份，维持了二月份的仓位水平，参与了家电、装饰、大数据、军工信息化的投资。

四月份、五月份，市场缺乏明确的方向，对组合配置基本回归了指数成份股。

六月份，适度参与了有业绩支撑的计算机板块的反弹。

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

2016 年上半年沪深 300 成长指数基金净值收益率为-12.10%，沪深 300 成长指数基金业绩比较基准收益率为-13.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期英国脱欧对经济和政治格局的影响将持续发酵，未来全球经济一体化的进程将受阻，保护主义将抬头，中国经济增长的三驾马车中出口拉动作用将持续调低预期，投资和消费成为倚重的方向。

短期来看，市场依然维持区间震荡格局，上涨和下跌的空间都不大。

选股逻辑的梳理

供给学派的兴起源于对凯恩斯主义专注于经济需求管理的质疑，供给学派的政策主张是：

经济增长动能不足，企业杠杆高企的情况下，为了追求经济增长，放大居民的杠杆是危险的，这还是以往需求管理思想的体现，现有的情况是经济下行压力依然存在，有效需求不足，经历过 4 万亿的加杠杆，以及后危机时期的将息降准，货币、财政刺激政策的边际效用迅速下降，应当更多地采用供给管理的思想。

新供给经济学政策主张的现实意义

供给学派从萨伊定律出发，认为在自由竞争的市场经济中供求总是均衡的。认为企业家的创业精神和自由经营活动是促进生产、增加供给的关键因素，反对政府过多干预。

供给能自动创造需求，生产要素的投入取决于各种刺激，这些刺激应以提高储蓄率和投资率为目标。在所有的刺激中，税率的变动是最重要、最有效的因素。储蓄不只受收入的影响，投资也不仅取决于利率，在货币稳定的条件下，税率将对储蓄和投资产生决定性的影响。

资本，特别是智力资本是人类福利的源泉，只有当有形资本和智力资本达到最大化时，人类的福利才能达到最大化。

供给学派的政策主张，对于治理滞胀是有效的，在中国的国情下，中国不可能执行纯粹的供给经济学的治理之策，但是可以做有益的借鉴，比如通过营改增进行结构性减税，适当调高的赤字率，也为减税提供了一定的空间；放松传统垄断行业管制，鼓励私人资本的进入；鼓励智力资本的形成，推动国家、企业、个人的创新活动。

但是里根政府的供给学派的政策也有负面的影响，由于和苏联的军备竞赛，造成了财政赤字高企，政府的财政增长失去可持续性。

因此，中国的现实经济状况，应当用供给经济学政策主张，实现经济内生的转型增长，用凯恩斯主义和货币主义的政策主张作兜底。

所以，未来一段时间的宏观环境，对货币刺激和财政刺激的预期必须下降，财政和货币对股市的影响也必然下降，寻找有提高投资率动力和创新动能的公司是未来的选股方向。

业绩持续增长的行业，有提高投资率的动力。通过对一季度的业绩分析，发现娱乐影视、新能源汽车产业链、涉及到老年人用药的制药行业及部分医药服务业、供应链服务、互联网金融、水务行业都有比较好的业绩增长，接下来将结合半年报的预告，从这些行业中挖掘投资机会。

从创新动能选择公司，需要结合公司的商业模式，未来的盈利状况来综合分析，现阶段，物联网平台的运营公司、VR 的内容提供商和平台运营商应该比较好的前景。

行业配置策略

本基金的市场组合，采用基本面分析选股的策略，主要关注以下投资机会：

供给侧改革，作为一项重要的经济政策，配套的措施正在慢慢落地，市场由质疑到慢慢相信，

对装饰、家电、建材等周期类行业带来好的投资机会，但地产调控，对周期股及地产产业链带来压力。

分析美国经济复苏中的增长动力，我们发现，服务业的景气度提升，为经济复苏的拉动因素。映射到中国，中国的转型，其中很重要的一部分就是发展服务业，包括医疗、养老、教育、体育、文化娱乐消费等行业具有持续的投资机会。

中国经济走到今天，人口红利已经释放完毕，接下来促进中国经济增长的红利是智力红利，体现在创新和劳动生产率的提升。包括一些技术创新性公司和智能制造类的公司，以及企业级服务的公司具有持续的投资价值。

在经济下行的区间，环保行业表现出了较好的成长性，医药行业中的一些估值较低，业绩增长稳健的公司都具有很好的防御价值。

寻找业绩有增长，具有一定安全边际的细分行业的投资机会。包括电动汽车、自动驾驶、能源互联网等。对三元材料重点关注，谨防锂电池板块的冲高回落。

主题投资参与物联网、教育等。

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业务人员，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。”本基金本报告期末进行利润分配。

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

本报告期内，《公开募集证券投资基金运作管理办法》实施后，本基金已连续 60 个工作日出

现资产净值低于五千万元的情形。我司已于今年 4 月向中国证券监督管理委员会提交了《关于银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金基金净值连续 60 个交易日低于 5000 万元解决方案的报告》。

§ 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关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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,433,546.15	2,943,540.56
结算备付金		-	15,697.55
存出保证金		13,779.09	35,639.50
交易性金融资产	6.4.7.2	37,472,481.08	42,574,948.26
其中：股票投资		37,472,481.08	42,574,948.26
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,069.10	1,552.87
应收股利		-	-
应收申购款		5,924.90	5,002,868.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		39,926,800.32	50,574,247.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		80,440.68	85,007.95
应付管理人报酬		32,081.40	38,998.58
应付托管费		6,416.31	7,799.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	9,613.91	46,529.48
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	118,711.49	137,214.65
负债合计		247,263.79	315,550.39
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	33,021,068.76	36,809,761.61
未分配利润	6.4.7.10	6,658,467.77	13,448,935.35
所有者权益合计		39,679,536.53	50,258,696.96
负债和所有者权益总计		39,926,800.32	50,574,247.35

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金银河沪深 300 成长分级份额净值 1.110 元，基金银河沪深 300 成长分级 A 份额净值 1.025 元，基金银河沪深 300 成长分级 B 份额净值 1.195 元，基金份额总额 35,757,761.10 份，其中银河沪深 300 成长分级份额 26,481,905.10 份，银河沪深 300 成长分级 A 份额 4,637,928.00 份，银河沪深 300 成长分级 B 份额 4,637,928.00 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-5,697,995.22	65,045,003.11
1.利息收入		24,333.39	108,987.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,333.39	108,987.29
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）		-1,426,180.18	69,127,559.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,919,865.39	68,252,273.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	493,685.21	875,285.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,309,277.98	-4,793,349.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,129.55	601,805.11
减：二、费用		501,698.73	2,402,207.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	199,314.00	769,890.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,862.85	153,978.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	45,844.06	1,262,444.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	216,677.82	215,893.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,199,693.95	62,642,795.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,199,693.95	62,642,795.78

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	36,809,761.61	13,448,935.35	50,258,696.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,199,693.95	-6,199,693.95
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）	-3,788,692.85	-590,773.63	-4,379,466.48
其中：1.基金申购款	5,618,740.40	772,292.64	6,391,033.04
2.基金赎回款	-9,407,433.25	-1,363,066.27	-10,770,499.52
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）	33,021,068.76	6,658,467.77	39,679,536.53
项目	上年度可比期间 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

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：

_____ 刘立达 _____	_____ 刘立达 _____	_____ 秦长建 _____
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

银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金(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”)证监许可[2012]1594 号文《关于核准银河沪深 300 成长增强指数分级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作为管理人向社会公开发行人募集，基金合同于 2013 年 3 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 414,991,791.49 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于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、央行票据、现金、股指期货等，以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会得相关规定)。股票投资包括沪深 300 成长指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)等。以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并依法进行投资管理。

本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 成长指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 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，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。权证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。如法律法规允许，本基金可以将股票投资比例提高到基金资产净值的 100%，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 价值指数收益率*95% + 银行活期存款收益率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，

同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值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内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年度上半年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

注：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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

本基金本报告期无会计估计变更。

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）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《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向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《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 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《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、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《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[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》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 号文《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，证券投资基金从公开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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	2,433,546.15
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,433,546.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	41,231,252.88	37,472,481.08	-3,758,771.80
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券		-	-
基金		-	-
其他		-	-
合计	41,231,252.88	37,472,481.08	-3,758,771.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末买入返售金融资产余额为 0。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,062.90
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.20
合计	1,069.10

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	9,613.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,613.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	298.18
预提费用	116,856.74
应付指数使用费	1,556.57
合计	118,711.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,829,432.36	36,809,761.61
本期申购	3,544.99	3,359.71
本期赎回(以“-”号填列)	-3,943.73	-3,737.61
2016 年 1 月 4 日 基金拆分/份额折算前	38,829,033.62	36,809,383.71
基金拆分/份额折算变动份额	1,030,421.56	-
本期申购	6,081,798.90	5,615,380.69
本期赎回(以“-”号填列)	-10,183,492.98	-9,403,695.64
本期末	35,757,761.10	33,021,068.76

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2016 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对本基金进行了定期折算。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,142,788.61	-9,693,853.26	13,448,935.35
本期利润	-1,890,415.97	-4,309,277.98	-6,199,693.95

本期基金份额交易产生的变动数	-2,255,633.99	1,664,860.36	-590,773.63
其中：基金申购款	3,408,194.06	-2,635,901.42	772,292.64
基金赎回款	-5,663,828.05	4,300,761.78	-1,363,066.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,996,738.65	-12,338,270.88	6,658,467.77

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	23,833.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	329.85
其他	170.18
合计	24,333.39

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	14,890,174.03
减：卖出股票成本总额	16,810,039.42
买卖股票差价收入	-1,919,865.39

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期间无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期间无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	493,685.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	493,685.21

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,309,277.98
——股票投资	-4,309,277.98
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-4,309,277.98

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,038.81
转换费收入	90.74
合计	13,129.55

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	45,844.06
银行间市场交易费用	-
合计	45,844.06

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	62,158.46
上市年费	29,835.26
指数使用费	99,631.08
银行费用	190.00
合计	216,677.82

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 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
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司	同受基金管理人的第一大股东控制、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：1、本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

2、佣金按市场佣金率计算, 扣除证券公司需承担的费用(包括买(卖)经手费、证券结算风险基金、

证券交易所买(卖)证管费和深圳买(卖)过户费)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	199,314.00	769,890.58
其中：支付销售机构的客户维护费	27,019.38	48,004.16

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.0% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	39,862.85	153,978.10

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	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
基金合同生效日 (2013年3月29日)持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	6,786,107.83	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	180,085.87	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	6,966,193.70	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	19.4816%	-	-

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	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
基金合同生效日 (2013年3月29日)持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	6,599,559.96	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	186,547.87	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	6,786,107.83	-	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	11.8289%	-	-
-----------------------	----------	---	---

注：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》、《关于银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金定期份额折算结果公告》，管理人以 2016 年 1 月 4 日为基金份额折算基准日，本期管理人持有本基金份额的增加全部来自于折算造成的份额增加。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

银河沪深 300 成长分级 A				
关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中国银河证券股 份有限公司	100.00	0.0022%	-	-

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	2,433,546.15	23,833.36	6,498,310.83	100,464.16

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项停牌	22.04	-	-	31,450	614,316.19	693,158.00	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项停牌	12.44	-	-	15,200	275,418.87	189,088.00	-
000728	国元证券	2016年6月8日	重大事项停牌	16.72	2016年7月8日	17.37	10,900	315,333.95	182,248.00	-
002065	东华软件	2015年12月22日	重大事项停牌	18.72	2016年7月4日	22.59	7,387	185,945.29	138,284.64	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项停牌	8.29	-	-	11,211	139,537.88	92,939.19	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程

序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）总经理领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督；（4）董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。

公司设立独立的风险控制专员岗，专门负责对投资管理全过程进行监督，出具监督意见和风险建议；对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督；对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；同时，公司建立了内部评级体系和交易对手库，在进行银行间同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金管理人每日对本基金的流动性需求进行测算，并同时通过独立的风控专员定期对基金流动性进行检查，并对潜在的流动性风险进行提示。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数基金，采用在法律法规允许范围内最大复制指数的策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,433,546.15	-	-	-	-	-	2,433,546.15
存出保证金	13,779.09	-	-	-	-	-	13,779.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-	37,472,481.08	37,472,481.08
应收利息	-	-	-	-	-	1,069.10	1,069.10
应收申购款	-	-	-	-	-	5,924.90	5,924.90
资产总计	2,447,325.24	-	-	-	-	37,479,475.08	39,926,800.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	80,440.68	80,440.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,081.40	32,081.40
应付托管费	-	-	-	-	-	6,416.31	6,416.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,613.91	9,613.91
其他负债	-	-	-	-	-	118,711.49	118,711.49
负债总计	-	-	-	-	-	247,263.79	247,263.79
利率敏感度缺口	2,447,325.24	-	-	-	-	37,232,211.29	39,679,536.53
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,943,540.56	-	-	-	-	-	2,943,540.56
结算备付金	15,697.55	-	-	-	-	-	15,697.55
存出保证金	35,639.50	-	-	-	-	-	35,639.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	42,574,948.26	42,574,948.26
应收利息	-	-	-	-	-	1,552.87	1,552.87
应收申购款	9.97	-	-	-	-	5,002,858.64	5,002,868.61
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,994,887.58	-	-	-	-	47,579,359.77	50,574,247.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	85,007.95	85,007.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,998.58	38,998.58
应付托管费	-	-	-	-	-	7,799.73	7,799.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	46,529.48	46,529.48
其他负债	-	-	-	-	-	137,214.65	137,214.65
负债总计	-	-	-	-	-	315,550.39	315,550.39
利率敏感度缺口	2,994,887.58	-	-	-	-	47,263,809.38	50,258,696.96

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于 2016 年 6 月 30 日未持有债券资产，基金资产受市场利率的波动影响较小。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股、备选成份股，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	37,472,481.08	94.44	42,574,948.26	84.71
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	37,472,481.08	94.44	42,574,948.26	84.71

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 成长指数变动时，股票资产相应的理论变动值；		
	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化；		
	测算时期为 3 个月，对于交易少于 3 个月的资产，默认其波动与指数同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 成长指数上升 5%	2,111,872.89	2,301,401.13
	沪深 300 成长指数下降 5%	-2,111,872.89	-2,301,401.13

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 36,176,763.25 元，属于第二层次的余额为人民币 1,295,717.83 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,472,481.08	93.85
	其中：股票	37,472,481.08	93.85
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,433,546.15	6.10
7	其他各项资产	20,773.09	0.05
8	合计	39,926,800.32	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
B	采矿业	76,800.00	0.19
C	制造业	8,650,458.58	21.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	395,556.55	1.00
E	建筑业	425,754.28	1.07
F	批发和零售业	284,477.80	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	446,490.00	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,143,165.20	5.40
J	金融业	20,140,012.00	50.76
K	房地产业	1,215,220.51	3.06
L	租赁和商务服务业	297,350.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	503,552.04	1.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,095,637.29	2.76
S	综合	164,400.00	0.41
	合计	35,838,874.25	90.32

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	868,922.19	2.19
D	电力、热力、燃气及水生产	-	-

	和供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	764,684.64	1.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,633,606.83	4.12

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	169,269	2,501,795.82	6.31
2	000001	平安银行	268,208	2,333,409.60	5.88
3	600016	民生银行	217,861	1,945,498.73	4.90
4	601318	中国平安	60,000	1,922,400.00	4.84
5	600519	贵州茅台	5,519	1,611,106.48	4.06
6	600000	浦发银行	98,002	1,525,891.14	3.85
7	002736	国信证券	77,200	1,331,700.00	3.36
8	600030	中信证券	73,074	1,185,991.02	2.99
9	601009	南京银行	125,888	1,182,088.32	2.98

10	000686	东北证券	61,323	791,679.93	2.00
11	000333	美的集团	32,850	779,202.00	1.96
12	002739	万达院线	8,600	687,140.00	1.73
13	600276	恒瑞医药	14,601	585,646.11	1.48
14	300059	东方财富	26,100	579,420.00	1.46
15	600369	西南证券	79,000	573,540.00	1.45
16	300104	乐视网	10,000	529,100.00	1.33
17	600015	华夏银行	53,252	526,662.28	1.33
18	000623	吉林敖东	20,600	513,970.00	1.30
19	600485	信威集团	28,600	510,224.00	1.29
20	601555	东吴证券	34,929	468,048.60	1.18
21	600340	华夏幸福	18,476	450,444.88	1.14
22	000413	东旭光电	51,185	439,679.15	1.11
23	601668	中国建筑	80,029	425,754.28	1.07
24	300017	网宿科技	6,316	424,435.20	1.07
25	601377	兴业证券	53,730	397,064.70	1.00
26	002594	比亚迪	6,000	366,060.00	0.92
27	603885	吉祥航空	13,800	362,250.00	0.91
28	002294	信立泰	13,300	361,760.00	0.91
29	002195	二三四五	29,400	361,326.00	0.91
30	300070	碧水源	23,173	344,814.24	0.87
31	000783	长江证券	29,300	339,880.00	0.86
32	002450	康得新	19,034	325,481.40	0.82
33	601901	方正证券	41,984	321,597.44	0.81
34	000625	长安汽车	21,624	295,600.08	0.74
35	000540	中天城投	47,400	295,302.00	0.74
36	002673	西部证券	11,300	292,218.00	0.74
37	601211	国泰君安	16,400	291,756.00	0.74
38	600048	保利地产	33,701	290,839.63	0.73
39	600893	中航动力	8,100	280,665.00	0.71
40	600109	国金证券	20,600	277,688.00	0.70
41	600741	华域汽车	19,679	275,702.79	0.69
42	601099	太平洋	43,060	263,957.80	0.67
43	600535	天士力	7,122	254,682.72	0.64
44	601336	新华保险	6,300	254,520.00	0.64
45	600066	宇通客车	12,000	237,600.00	0.60
46	600705	中航资本	40,314	237,046.32	0.60
47	600867	通化东宝	11,040	228,417.60	0.58
48	600674	川投能源	27,100	223,846.00	0.56

49	002183	怡亚通	15,000	214,800.00	0.54
50	002252	上海莱士	5,400	203,472.00	0.51
51	000963	华东医药	2,957	199,301.80	0.50
52	300124	汇川技术	10,000	194,000.00	0.49
53	002500	山西证券	11,700	193,752.00	0.49
54	600958	东方证券	11,400	191,634.00	0.48
55	002465	海格通信	15,200	189,088.00	0.48
56	000728	国元证券	10,900	182,248.00	0.46
57	601788	光大证券	10,500	177,870.00	0.45
58	300315	掌趣科技	16,600	174,134.00	0.44
59	300027	华谊兄弟	12,757	172,729.78	0.44
60	000750	国海证券	23,370	172,704.30	0.44
61	600027	华电国际	34,689	171,710.55	0.43
62	002236	大华股份	13,080	171,348.00	0.43
63	000009	中国宝安	12,000	164,400.00	0.41
64	002475	立讯精密	8,337	163,822.05	0.41
65	002292	奥飞娱乐	5,382	161,190.90	0.41
66	000826	启迪桑德	5,196	158,737.80	0.40
67	600177	雅戈尔	10,600	146,174.00	0.37
68	300133	华策影视	7,943	123,672.51	0.31
69	600074	保千里	8,000	119,360.00	0.30
70	600816	安信信托	7,000	118,090.00	0.30
71	000977	浪潮信息	5,000	117,250.00	0.30
72	300144	宋城演艺	4,500	112,095.00	0.28
73	601198	东兴证券	4,000	97,760.00	0.25
74	600398	海澜之家	8,631	97,530.30	0.25
75	600704	物产中大	9,100	85,176.00	0.21
76	601872	招商轮船	18,000	84,240.00	0.21
77	002027	分众传媒	5,000	82,550.00	0.21
78	600871	石化油服	20,000	76,800.00	0.19
79	600685	中船防务	3,000	76,080.00	0.19
80	300085	银之杰	2,500	74,750.00	0.19
81	600666	奥瑞德	2,000	69,520.00	0.18
82	000712	锦龙股份	2,000	41,520.00	0.10
83	600606	绿地控股	3,000	32,460.00	0.08
84	002568	百润股份	1,000	22,000.00	0.06

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	31,450	693,158.00	1.75
2	300339	润和软件	10,000	358,400.00	0.90
3	300287	飞利信	20,000	268,000.00	0.68
4	002065	东华软件	7,387	138,284.64	0.35
5	002129	中环股份	11,211	92,939.19	0.23
6	300252	金信诺	2,500	82,825.00	0.21

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,920,000.00	3.82
2	000001	平安银行	711,720.60	1.42
3	002142	宁波银行	581,323.00	1.16
4	600037	歌华有线	542,970.00	1.08
5	002081	金螳螂	521,344.00	1.04
6	600016	民生银行	503,111.36	1.00
7	300287	飞利信	477,113.00	0.95
8	002594	比亚迪	358,790.00	0.71
9	600019	宝钢股份	339,600.00	0.68
10	300339	润和软件	319,031.00	0.63
11	601088	中国神华	303,200.00	0.60
12	002736	国信证券	301,824.00	0.60
13	601009	南京银行	278,439.00	0.55
14	000686	东北证券	259,773.32	0.52
15	000100	TCL 集团	236,798.00	0.47
16	600066	宇通客车	236,640.00	0.47
17	600352	浙江龙盛	235,307.00	0.47
18	600519	贵州茅台	222,830.00	0.44
19	000523	广州浪奇	209,861.00	0.42
20	300252	金信诺	207,958.00	0.41

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002081	金螳螂	1,023,614.40	2.04
2	000100	TCL 集团	856,981.98	1.71
3	600037	歌华有线	562,295.00	1.12
4	002230	科大讯飞	520,467.13	1.04
5	000001	平安银行	518,295.00	1.03
6	002142	宁波银行	499,140.00	0.99
7	600279	重庆港九	480,428.00	0.96
8	600016	民生银行	439,674.00	0.87
9	001979	招商蛇口	427,601.88	0.85
10	000400	许继电气	416,644.49	0.83
11	600703	三安光电	368,935.75	0.73
12	600000	浦发银行	346,580.00	0.69
13	600019	宝钢股份	324,800.00	0.65
14	002456	欧菲光	319,634.35	0.64
15	601088	中国神华	266,726.00	0.53
16	600030	中信证券	266,339.00	0.53
17	000514	渝开发	260,586.05	0.52
18	002736	国信证券	258,522.00	0.51
19	300059	东方财富	244,864.00	0.49
20	601009	南京银行	243,734.00	0.48

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	16,016,850.22
卖出股票收入（成交）总额	14,890,174.03

注：买入股票成本及卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末投资贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金现阶段, 未进行股指期货的投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金现阶段, 未进行股指期货的投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金现阶段, 未进行国债期货的投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金现阶段, 未进行国债期货的投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金现阶段, 未进行国债期货的投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,779.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,069.10
5	应收申购款	5,924.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,773.09

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	693,158.00	1.75	重大事项停牌
2	002065	东华软件	138,284.64	0.35	重大事项停牌
3	002129	中环股份	92,939.19	0.23	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

	持有人户	户均持有的	持有人结构
--	------	-------	-------

	数(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
银河沪深 300 成长分级	976	27,133.10	17,821,699.02	67.30%	8,660,206.08	32.70%
银河沪深 300 成长分级 A	161	28,807.01	2,092,915.00	45.13%	2,545,013.00	54.87%
银河沪深 300 成长分级 B	397	11,682.44	1,416.00	0.03%	4,636,512.00	99.97%
合计	1,534	23,310.14	19,916,030.02	55.70%	15,841,731.08	44.30%

8.2 期末上市基金前十名持有人

银河沪深 300 成长分级 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	黄松友	860,300.00	2.41%
2	中国人民财产保险股份有限公司-自有资金	812,343.00	2.27%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	511,200.00	1.43%
4	海通资管-上海银行-海通赢家系列-月月赢集合资产管理计划	500,000.00	1.40%
5	汤(岑)	285,100.00	0.80%
6	方春娣	159,342.00	0.45%
7	李大鹏	145,300.00	0.41%
8	赖明理	120,500.00	0.34%
9	海通期货有限公司-四川金鼎产融股权投资基金管理有限公司	91,494.00	0.26%
10	林炳权	89,100.00	0.25%

银河沪深 300 成长分级 B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	魏灵峰	503,295.00	1.41%
2	洪一权	258,879.00	0.72%
3	孔瑞珍	249,400.00	0.70%
4	刘启凯	201,221.00	0.56%

5	雷春怡	130,500.00	0.36%
6	丁贵怡	110,531.00	0.31%
7	陈敏芳	110,000.00	0.31%
8	郁万福	100,000.00	0.28%
9	苏维维	100,000.00	0.28%
10	沈蕊蕊	89,438.00	0.25%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	银河沪深 300 成长分级	0.00	0.0000%
	银河沪深 300 成长分级 A	0.00	0.0000%
	银河沪深 300 成长分级 B	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银河沪深 300 成长分级	0
	银河沪深 300 成长分级 A	0
	银河沪深 300 成长分级 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银河沪深 300 成长分级	0
	银河沪深 300 成长分级 A	0
	银河沪深 300 成长分级 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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
基金合同生效日（2013 年 3 月 29 日）	220,701,691.49	97,145,050.00	97,145,050.00
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	29,521,912.36	4,653,760.00	4,653,760.00
本报告期基金总申购份额	6,085,343.89	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	10,187,436.71	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	1,062,085.56	-15,832.00	-15,832.00
本报告期期末基金份额总额	26,481,905.10	4,637,928.00	4,637,928.00

注：拆分变动份额为本基金三类份额之间的配对转换份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2016 年 2 月 19 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于总经理任职的公告》，由银河基金管理有限公司第四届董事会审议通过，决定聘任刘立达先生担任公司总经理。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

无

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	16,466,552.61	53.69%	15,006.14	53.15%	-
国海证券	1	14,202,703.22	46.31%	13,226.94	46.85%	-

注：1、选择证券公司专用席位的标准：

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (6) 本基金管理人要求的其他条件。

2、选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行股份有限公司开通定投并参加开放式公募基金组合申购、定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	银河基金管理有限公司关于银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间银河优先份额停复牌的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 5 日
3	银河基金管理有限公司关于发生指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 5 日
4	银河基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 6 日
5	关于银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金定期份额折算结果公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 6 日
6	关于银河优先定期份额折算前收盘价调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 6 日
7	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰科技服务（深圳）前海有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 1 月 8 日
8	银河基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 8 日
9	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 9 日
10	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2016 年 1 月 12 日

	估值方法的提示性公告	报》、公司网站	
11	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 14 日
12	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 15 日
13	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 1 月 18 日
14	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 19 日
15	银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金 2015 年 4 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 1 月 22 日
16	关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 23 日
17	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 29 日
18	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 2 日
19	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 6 日
20	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 16 日
21	银河基金管理有限公司关于总经理任职的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 19 日
22	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票估值调整的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 23 日
23	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国银河证券股份有限公司开通定投业务并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 26 日
24	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016 年 3 月 10 日

	基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	券时报》、《上海证券报》、公司网站	
25	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 3 月 11 日
26	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 3 月 18 日
27	银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 3 月 25 日
28	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 3 月 29 日
29	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为代销机构并转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 4 月 11 日
30	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 4 月 13 日
31	银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金 2016 年 1 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 4 月 21 日
32	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 4 月 22 日
33	银河基金管理有限公司关于网上交易系统关闭支付宝基金支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 5 日
34	银河基金管理有限公司关于淘宝店关闭基金申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 5 日
35	银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金招募说明书（更新摘要）	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 12 日
36	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 14 日
37	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016 年 5 月 17 日

	基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	券时报》、《上海证券报》、公司网站	
38	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 18 日
39	银河基金管理有限公司关于网上交易开通基金赎回极速回倍利宝业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 5 月 30 日
40	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 6 月 22 日
41	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 6 月 30 日
42	银河基金管理有限公司关于旗下基金在京东电子商务平台进行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金的文件
- 2、《银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《银河沪深 300 成长增强指数分级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、银河沪深 300 成长增强指数分级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

12.2 存放地点

上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼

12.3 查阅方式

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

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日