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:2014年8月27日

# 银丰证券投资基金

## 2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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2014年8月22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。

本半年报摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年报正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014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 | 银河银丰封闭 |
| 场内简称 | 基金银丰 |
| 基金主代码 | 500058 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 2002年8月15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 | 3,000,000,000.00份 |
| 基金合同存续期 | 15 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2002-09-10 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为平衡型基金,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。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的精选个股相结合的投资策略。在正常的市场情况下,股票投资比例变动范围是:基金资产的25%-75%;债券投资比例变动范围是:基金资产的25%-55%;现金资产比例的变动范围是:基金资产的0%-20%。 |
| 业绩比较基准 | 上证A股指数涨跌幅*75%+同期国债收益率*25%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为封闭式平衡型基金,在证券投资基金中属风险相对较低品种,其风险与收益特征从长期平均及预期来看介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间,或介于单纯的成长型组合与单纯的价值型组合之间,力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。 |

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 | 陈勇 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-38568881 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | chenyong@galaxyasset.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-820-0860 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-38568880 | 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<br>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(2014年1月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 32,533,403.81 |
| 本期利润 | 63,960,346.29 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0213 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1677 |
| 期末基金资产净值 | 2,803,107,987.87 |
| 期末基金份额净值 | 0.934 |

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)。

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 | 2.41% | 2.00% | 0.42% | 1.21% | 1.99% | 0.79% |
| 过去三个月 | 3.55% | 2.00% | 0.90% | 1.25% | 2.65% | 0.75% |
| 过去六个月 | 2.30% | 2.10% | -1.60% | 1.36% | 3.90% | 0.74% |
| 过去一年 | 6.26% | 2.19% | 3.38% | 1.45% | 2.88% | 0.74% |
| 过去三年 | -9.50% | 2.27% | -17.44% | 1.69% | 7.94% | 0.58% |
| 自基金合同生效起至今 | 240.97% | 2.71% | 38.54% | 2.51% | 202.43% | 0.20% |

注:本基金的业绩比较基准为:上证A股指数涨跌幅*75%+同期国债收益率*25%。

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:2002年8月15日本基金成立,根据《银丰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三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截止本报告期末,本基金各项资产配置比例符合合同约定:(1)股票投资比例变动范围是:基金资产的25%-75%;(2)债券投资比例变动范围是:基金资产的25%-55%;(3)现金资产比例的变动范围是:基金资产的0%-20%。

### §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、上海市城市建设投资开发总公司、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19只开放式证券投资基金,基本情况如下:

1、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

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

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。

2、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

3、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

4、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。

5、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。

6、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。

7、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。

8、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,力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果。

9、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。

10、银河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:2011年5月31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,通过保本资产与风险资产的动态配置和组合管理,谋求基金资产在保本周期内的稳定增值。

11、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。

12、银河通利分级债券型证券投资基金

基金运作方式:契约型

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。

13、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。

14、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。

15、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

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%。

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7月17日

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8月9日

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2月11日

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,在确保超额业绩比较基准、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3月14日

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%。

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 | | |
| 神玉飞 | 银丰证券投资基金的基金经理 | 2012年12月21日 | - | 6 | 中共党员,博士研究生学历,2007年9月加入银河基金管理有限公司,曾担任宏观策略研究员、行业研究员、银丰证券投资基金的基金经理助理等职,期间主要从事宏观策略行业研究和股票投资策略研究工作。 |
| 钱春南 | 银丰证券投资基金的基金经理<br>银河稳健证券投资基金的基金经理、总经理助理、股票投资部总监 | 2012年12月21日 | - | 13 | 硕士研究生学历。曾先后在中国华融信托投资公司、中国银河证券有限责任公司工作。2002年6月加入银河基金管理有限公司,历任交易主管、基金经理助理、银河创新成长股票型证券投资基金的基金经理等职,2008年2月起担任银河稳健证券投资基金的基金经理,现任总经理助理、股票投资部总监。 |

注:1.上表中任职日期为我公司做出决定之日;

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,由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

本基金管理人在上半年策略报告中判断:一季度市场有望借IPO重启走出先扬后抑的行情并对2014年二季度的结构性行情继续演绎持有相对谨慎的态度,比较担心今年市场会重复2011年二季度的市场特征,强势板块经历了年初的大幅上涨后需要时间来消化估值压力,叠加IPO重启效应以及二季度的流动性紧缩的风险从而导致中小板和创业板面临着消化高估值的风险和压力。2014年上半年市场运行基本符合前期策略判断,一季度在春节前市场借助于IPO重启走出了一波上涨行后一路调整,直至5月中旬以前市场持续下跌,而此后创业板和中小板强劲反弹。截止6月30日,沪深300指数、中小板指数分别下跌7.08%和3.72%,但是创业板指数上涨7.69%。目前回顾总结,本基金管理人上半年对市场方向总体正确,但是仍然低估了创业板指数、传媒和通信等行业波动的幅度和力度,另外对于一线成长股持续去估值的风险的判断也出现了一定的失误。

本基金管理人上半年操作基本遵循了各季度初制订的投资策略。今年上半年,考虑到市场大幅波动的风险,本基金管理人将灵活控制了仓位水平,努力尝试通过选择仓位来控规机会和规避风险。本基金今年半年重点持有了医药生物、信息服务、电子、轻工制造和农业等行业,同时也优化了旅游、非银金融和环保等行业的配置结构;相比于年初明显降低了食品饮料和纺织服装等行业配置比重。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金上半年净值增长2.30%,而比较基准上半年涨幅为-1.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人判断下半年市场有望维持相对活跃的态势。 经历了前期的调整,权重股估值接近底位对市场估值形成了一定的支撑;同时考虑到经济刺激政策效应的逐渐释放将在一定程度上对冲经济下滑,宏观经济的持续下滑担忧或将得到一定缓和,从而两方面对市场产生一定程度上的积极支撑;但是本基金管理人也不能排除中小板和创业板由于较高的风险收益比而出现的回调风险。基于上述判断,本基金管理人下半年将保持相对灵活的仓位,密切关注各种投资机会并警惕相关风险,重点关注符合转型方向的成长行业,优选业绩稳定估值合理存在转型意愿的标的,同时关注低估值价值股超跌后可能出现的投资机会;精选和更新组合个股标的,力争规避持股的中报业绩风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序,基金会计部按照管理层批准后的估值政策进行估值。

对于在交易所上市的证券,采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种,采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

除了投资总监外,其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种,基金经理可以提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》,“基金收益分配比例不得低于基金净收益的90%”,“基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额”,“基金收益分配采取现金方式,每年至少分配一次”。截至本报告期末本基金不符合基金合同中分红相关规定,未进行利润分配。

### §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,中国建设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。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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:银丰证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 86,976,128.62 | 13,539,274.28 |
| 结算备付金 | | 8,281,148.89 | 4,804,469.77 |
| 存出保证金 | | 503,770.25 | 624,258.60 |
| 交易性金融资产 | | 2,745,630,592.63 | 2,727,919,095.90 |
| 其中:股票投资 | | 2,000,461,286.63 | 1,919,923,463.90 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 745,169,306.00 | 807,995,632.00 |
| 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 | | 55,770,857.73 | 110,321,911.83 |
| 应收利息 | | 14,248,441.85 | 13,515,830.50 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 2,911,410,939.97 | 2,870,724,840.88 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013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 | | 90,000,000.00 | 120,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 8,788,594.53 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 3,389,660.87 | 3,438,111.75 |
| 应付托管费 | | 564,943.50 | 573,018.63 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 1,032,990.95 | 2,859,912.76 |
| 应交税费 | | 2,143,158.46 | 2,143,158.46 |
| 应付利息 | | 95,496.73 | 102,997.70 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 2,288,107.06 | 2,460,000.00 |
| 负债合计 | | 108,302,952.10 | 131,577,199.30 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 未分配利润 | | -196,892,012.13 | -260,852,358.42 |
| 所有者权益合计 | | 2,803,107,987.87 | 2,739,147,641.58 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,911,410,939.97 | 2,870,724,840.88 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.934元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

6.2 利润表

会计主体:银丰证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 94,293,608.90 | 169,251,727.37 |
| 1.利息收入 | | 14,448,584.06 | 12,630,001.65 |
| 其中:存款利息收入 | | 307,270.97 | 391,790.95 |
| 债券利息收入 | | 13,542,504.31 | 11,221,506.18 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 598,808.78 | 1,016,704.52 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 48,418,082.36 | -17,118,530.82 |
| 其中:股票投资收益 | | 43,488,267.69 | -24,177,964.94 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | -5,428,970.32 | -2,054,849.51 |
| 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 | | 10,358,784.99 | 9,114,283.63 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | 31,426,942.48 | 173,740,256.54 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 减:二、费用 | | 30,333,262.61 | 31,516,911.57 |
| 1.管理人报酬 | | 20,668,006.46 | 19,657,013.97 |
| 2.托管费 | | 3,444,667.77 | 3,276,168.99 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | | 4,802,986.57 | 7,929,407.39 |
| 5.利息支出 | | 1,163,802.53 | 392,632.78 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 1,163,802.53 | 392,632.78 |
| 6.其他费用 | | 253,799.28 | 261,688.44 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 63,960,346.29 | 137,734,815.80 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 63,960,346.29 | 137,734,815.80 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银丰证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 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) | 3,000,000,000.00 | -260,852,358.42 | 2,739,147,641.58 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 63,960,346.29 | 63,960,346.29 |
| 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) | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | 3,000,000,000.00 | -196,892,012.13 | 2,803,107,987.87 |
| 项目 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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) | 3,000,000,000.00 | -501,643,420.54 | 2,498,356,579.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 137,734,815.80 | 137,734,815.80 |
| 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) | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | 3,000,000,000.00 | -363,908,604.74 | 2,636,091,395.26 |

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:

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

银丰证券投资基金(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”)证监基金字[2002]39号文《关于同意设立银丰证券投资基金的批复》的核准,由中国银河证券有限责任公司(现名:中国银河投资管理有限公司)、首都机场集团公司、上海市城市建设投资开发总公司、湖南广播电视产业中心、银河基金管理有限公司于2002年8月15日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式,存续期为15年,发行规模为30亿份基金份额。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2002]12号文审核同意,于2002年9月10日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金只投资于在国内依法公开发行上市、具有良好流动性的金融工具,主要包括在上海证券交易所和深圳证券交易所挂牌的股票和债券、法律、法规及中国证监会允许的其他金融工具也将纳入本基金投资范围。本基金的投资组合遵循下列比例规定:(1)本基金投资于股票、债券的比例,不得低于基金资产总值的80%;(2)本基金投资于债券的比例不低于基金资产总值的25%,不高于基金资产总值的55%;(3)本基金持有的一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(4)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的一家公司发行的证券总和,不得超过该证券的10%;(5)本基金投资于国家债券的比例,不得低于基金资产净值的20%;(6)遵守法律、法规、中国证监会及本基金契约所规定的其他比例限制。

本基金的业绩比较基准为:上证A股指数涨跌幅*75%+同期国债收益率*25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中国财政部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,也参考了中国证券业协会制定的《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模板第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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日止的经营成果和净值变动情况。

6.4.4本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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、国家税务总局财税字[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、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128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,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、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、国家税务总局财税字[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、基金发起人、基金注册登记机构 |
| 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 | 间受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 |
| - | - | - | - | - |

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。

债券交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

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。

6.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - |

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 20,668,006.46 | 19,657,013.97 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,444,667.77 | 3,276,168.99 |

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。