(上接B68版)

本基金的托管人中国光大银行根据本基金合同已于2015年7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。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 1,869,295,683.03 | 80.92 |
| | 其中：股票 | 1,869,295,683.03 | 80.92 |
| 2 | 固定收益投资 | 80,280,000.00 | 3.48 |
| | 其中：债券 | 80,280,000.00 | 3.48 |
| | 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 | 356,232,226.28 | 15.42 |
| 7 | 其他资产 | 4,143,496.07 | 0.18 |
| 8 | 合计 | 2,309,951,405.38 | 100.00 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | - | - |
| C | 制造业 | 1,138,905,289.68 | 51.63 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 14,397,698.48 | 0.65 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 18,853,270.56 | 0.85 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 21,384,864.00 | 0.97 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 401,544,666.66 | 18.20 |
| J | 金融业 | 274,720.00 | 0.01 |
| K | 房地产业 | 25,431,817.52 | 1.15 |
| L | 租赁和商务服务业 | 56,612,459.77 | 2.57 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 27,201,540.00 | 1.23 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 61,431,554.04 | 2.78 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 12,908,193.80 | 0.59 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 90,349,608.52 | 4.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,869,295,683.03 | 84.74 |

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300253 | 卫宁软件 | 3,818,988 | 198,587,376.00 | 9.00 |
| 2 | 300049 | 福瑞股份 | 1,162,595 | 104,621,924.05 | 4.74 |
| 3 | 002292 | 奥飞动漫 | 2,476,306 | 92,341,450.74 | 4.19 |
| 4 | 002348 | 高乐股份 | 5,393,250 | 84,296,497.50 | 3.82 |
| 5 | 000887 | 中鼎股份 | 3,399,977 | 84,149,430.75 | 3.81 |
| 6 | 002184 | 海得控制 | 1,600,375 | 73,489,220.00 | 3.33 |
| 7 | 600571 | 信雅达 | 524,162 | 55,482,547.70 | 2.52 |
| 8 | 002740 | 爱迪尔 | 770,497 | 46,568,838.68 | 2.11 |
| 9 | 002712 | 思美传媒 | 432,366 | 43,733,820.90 | 1.98 |
| 10 | 600869 | 智慧能源 | 1,347,728 | 43,194,682.40 | 1.96 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 80,280,000.00 | 3.64 |
| | 其中：政策性金融债 | 80,280,000.00 | 3.64 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 80,280,000.00 | 3.64 |

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150211 | 15国开11 | 800,000 | 80,280,000.00 | 3.64 |

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8、投资组合报告附注
8.1 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
8.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,264,799.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 402,363.44 |
| 5 | 应收申购款 | 1,476,332.68 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,143,496.07 |

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002348 | 高乐股份 | 84,296,497.50 | 3.82 | 重大事项 |
| 2 | 000887 | 中鼎股份 | 84,149,430.75 | 3.81 | 重大事项 |

注：本基金截至2015年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。
8.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

## 十三、基金的业绩

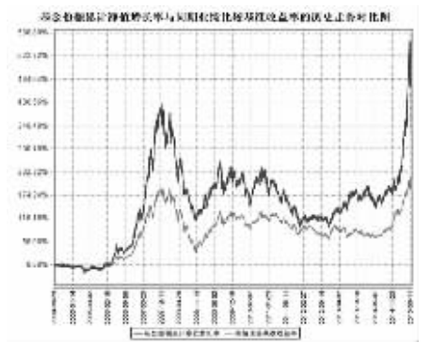
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本基金合同生效日为2004年6月28日。基金合同生效以来（截至2015年6月30日）的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 20150101-20150630 | 57.97% | 2.69% | 21.85% | 1.44% | 36.12% | 1.25% |
| 20140101-20141231 | 6.68% | 1.31% | 29.63% | 0.77% | -22.95% | 0.54% |
| 20130101-20131231 | 27.15% | 1.26% | -3.78% | 0.89% | 30.93% | 0.37% |
| 20120101-20121231 | -0.34% | 1.04% | 4.54% | 0.85% | -4.88% | 0.19% |
| 20110101-20111231 | -31.24% | 1.28% | -17.72% | 0.86% | -13.52% | 0.42% |
| 20100101-20101231 | -4.44% | 1.58% | -4.44% | 1.01% | 0.00% | 0.57% |
| 20090101-20091231 | 44.62% | 1.76% | 55.03% | 1.32% | -10.41% | 0.44% |
| 20080101-20081231 | -48.15% | 1.92% | -47.05% | 1.98% | -1.10% | -0.06% |
| 20070101-20071231 | 126.73% | 2.10% | 99.77% | 1.50% | 26.96% | 0.60% |
| 20060101-20061231 | 108.35% | 1.37% | 78.37% | 0.91% | 29.98% | 0.46% |
| 20050101-20051231 | -1.32% | 1.07% | -4.80% | 0.93% | 3.48% | 0.14% |
| 20040628-20041231 | -5.80% | 0.80% | -4.93% | 0.98% | -0.87% | -0.18% |
| 20040628-20150630 | 362.08% | 1.56% | 182.88% | 1.17% | 179.20% | 0.39% |

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，及与同期业绩比较基准的变动进行比较：

（2004年6月28日至2015年6月30日）




注：1、本基金基金合同于2004年6月28日正式生效。
2、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。在正常市场情况下，本基金组合投资的基本范围为：股票资产30%－95%，债券资产0%－65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。

## 十四、费用概览

（一）与基金运作有关的费用
1、基金管理人的管理费
（1）基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
（2）基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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，托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
2、基金托管人的托管费
（1）基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
（2）基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。
3、其它与基金运作有关的费用
（1）基金信息披露费用；
（2）基金份额持有人大会费用；
（3）与基金相关的会计师费和律师费；
（4）证券交易费用；
（5）按照国家有关规定和本基金合同规定可以列入的其他费用。
法律法规另有规定时从其规定。
上述基金费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。
（二）与基金销售有关的费用
1、申购费
本基金的申购费按申购金额采用差别费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

| 申购金额（元） | 申购费率 |
|---|---|
| 50万以下 | 1.50% |
| 50万≤M<100万 | 1.20% |
| 100万≤M<250万 | 0.75% |
| 250万≤M<500万 | 0.50% |
| M≥500万 | 每笔1000元 |

申购费保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，不向投资者收取。
2、赎回费
赎回费率随基金持有时间的增加而递减，费率分为四档。持有期限的起始日为基金权益登记日。

| 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|
| 0-90天 | 0.5% |
| 91-180天 | 0.35% |
| 181-365天 | 0.18% |
| 366-730天 | 0.1% |
| 731天及以上 | 0 |

赎回费用由赎回人承担，75%用于支付销售代理费用和注册登记费用等相关手续费，25%归基金资产。
3、申购、赎回费率的调整
基金管理人可以在基金合同许可的范围内调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在公开说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前2个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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5号<基金招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规及《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》的规定，结合泰信先行策略开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）近半年的投资经营情况，对2015年2月10日公告的《泰信先行策略开放式证券投资基金更新招募说明书》的内容进行了必要的补充和更新。
具体情况说明如下：
1、在“重要提示”中明确了本次更新招募说明书更新内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、第三节“基金管理人”部分：
（1）在“（一）基金管理人概况”部分，对公司正式员工人数、公司旗下基金及资产管理计划情况进行了更新。
（2）在“（三）主要人员情况”部分，对公司董事的任职信息及基金经理的变动情况进行了更新。
3、第四节“基金托管人”部分，对基金托管人的主要人员情况和托管业务经营情况进行了更新。
4、第五节“相关服务机构”代销机构部分，对本基金代销机构的信息进行了必要的更新。
5、第七节“基金的转换”部分，更新了截止2015年6月28日可办理本基金定期定额投资、开通基金转换的销售机构情况。
6、第九节“基金的投资”部分，根据本基金2015年第2季度报告的相关内容，重新调整了“七、基金投资组合报告”的内容（未经审计）。
7、第十节“基金的业绩”部分，修订了本基金自合同生效以来的投资业绩，该部分内容均按规定格式要求编制，并经基金托管人复核。
8、第二十二节“其他应披露事项”中，汇总了本报告期内已经披露的与本基金有关的公告信息。

泰信基金管理有限公司
2015年8月11日

(上接B66版)

4.权证投资策略
本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算，并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果，选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。采用的策略包括但不限于下列策略或策略组合：
(1)本基金采取现金套利策略，兑现部分标的证券的投资收益，并通过购买该证券认购权证的方式，保留未来股票上涨所带来的获利空间。
(2)本基金根据权证与标的证券的内在价值联系，合理配置权证与标的证券的投资比例，构建权证与标的证券的避险组合，控制投资组合的下跌风险。同时，本基金积极发现可能存在的套利机会，构建权证与标的证券的套利组合，获取较高的投资收益。
(五)投资决策依据和投资程序
1.投资决策依据
(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
(2)国内外宏观经济发展状况、宏观经济政策导向、微观经济运行环境和证券市场发展态势；
(3)投资产的预期收益率及风险水平等。
2.投资程序
(1)研究与分析
本基金管理人内设研究部，通过对宏观、政策、行业、公司、市场等方面的分析，制定投资策略建议和投资建议。
本基金管理人内设绩效与风险评估小组，运用风险模型及监测指标定期或根据需要对基金绩效进行评估，并向基金经理反馈。
(2)构建投资组合
投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，审批确定基金资产配置和行业配置方案，并审批重大单项投资决定。
基金经理在投资决策委员会的授权下，参考研究部和绩效与风险评估小组的研究分析，制定基金的投资策略，在其权限范围进行基金的日常投资组合管理工作。
(3)交易
基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。
(4)组合监控与调整
基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况。监察部对基金投资进行日常监督。绩效与风险评估小组定期对基金投资进行绩效评估和风险分析，并通过监察部呈报给合规审查与风险控制委员会及督察长办公室、投资决策委员会、基金经理及相关人员。在监察部和绩效与风险评估小组提供的绩效评估和风险分析报告的基础上，基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行反思，对基金投资组合不断进行调整和优化。
(六)业绩比较基准
本基金的业绩比较基准是：
业绩基准收益率=中证500指数收益率×75%＋上证国债指数收益率×25%。
随着市场环境的变化，或因指数编制及发布等方面的原因，如果上述业绩比较基准不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应履行相关程序，并报中国证监会备案，基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。
(七)风险收益特征
本基金是股票型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的品种。
(八)投资限制
1.组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：
(1)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
(2)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
(6)本基金投资的股票资产占基金资产的60%－95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为5%－40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；本基金将不低于80%的股票资产投资于具有创新能力和成长潜力的上市公司；
(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
(8)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
(11)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
(12)基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
(13)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%。
本基金投资流通受限证券，将根据中国证监会相关规定，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。
如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。
基金管理人应当自基金合同生效之日起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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：
(1)承销证券；
(2)向他人贷款或者提供担保；
(3)从事承担无限责任的投资；
(4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
(8)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
(9)法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
(九)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法
1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
2.不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3.有利于基金财产的安全与增值；
4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。
(十)基金的融资、融券
本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。
（十一）基金投资组合报告(未经审计)
本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日，基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。本报告中所列财务数据未经审计。
1. 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 977,084,031.37 | 82.63 |
| | 其中：股票 | 977,084,031.37 | 82.63 |
| 2 | 固定收益投资 | 40,048,000.00 | 3.39 |
| | 其中：债券 | 40,048,000.00 | 3.39 |
| | 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 | 142,235,099.57 | 12.03 |
| 7 | 其他资产 | 23,152,546.83 | 1.96 |
| 8 | 合计 | 1,182,519,677.77 | 100.00 |

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 45,979,322.40 | 3.99 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 390,473,379.40 | 33.89 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 10,985,490.00 | 0.95 |
| F | 批发和零售业 | 88,913,896.35 | 7.72 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 29,696,252.80 | 2.58 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 324,858,071.22 | 28.19 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 3,430.40 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 86,171,800.00 | 7.48 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,388.80 | 0.00 |
| 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 | 977,084,031.37 | 84.80 |

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002292 | 奥飞动漫 | 2,954,624 | 111,832,518.40 | 9.71 |
| 2 | 002183 | 怡亚通 | 1,310,000 | 86,171,800.00 | 7.48 |
| 3 | 002714 | 牧原股份 | 782,760 | 45,979,322.40 | 3.99 |
| 4 | 002439 | 启明星辰 | 1,200,000 | 41,160,000.00 | 3.57 |
| 5 | 300295 | 三六五网 | 350,000 | 40,386,500.00 | 3.51 |
| 6 | 002405 | 四维图新 | 850,000 | 37,230,000.00 | 3.23 |
| 7 | 002250 | 联化科技 | 1,600,000 | 35,840,000.00 | 3.11 |
| 8 | 002462 | 嘉事堂 | 609,900 | 32,385,690.00 | 2.81 |
| 9 | 300348 | 长亮科技 | 280,000 | 30,800,000.00 | 2.67 |
| 10 | 600476 | 湘邮科技 | 797,342 | 30,147,501.02 | 2.62 |

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 40,048,000.00 | 3.48 |
| | 其中：政策性金融债 | 40,048,000.00 | 3.48 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 40,048,000.00 | 3.48 |

5. 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 110219 | 11国开19 | 400,000 | 40,048,000.00 | 3.48 |

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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. 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：本基金未进行贵金属投资。
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权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注：本基金契约规定，无法投资股指期货。
9.2. 本基金投资股指期货的投资政策
本基金契约规定，无法投资股指期货。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1. 本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。
10.2.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注：本基金未投资国债期货。
10.3. 本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。
11. 投资组合报告附注
11.1.
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。
11.2.
报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
11.3.其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,619,983.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | 20,685,002.25 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 352,263.58 |
| 5 | 应收申购款 | 495,297.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 23,152,546.83 |

11.4.报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券
11.5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002292 | 奥飞动漫 | 111,832,518.40 | 9.71 | 重大事项停牌 |
| 2 | 002183 | 怡亚通 | 86,171,800.00 | 7.48 | 重大事项停牌 |

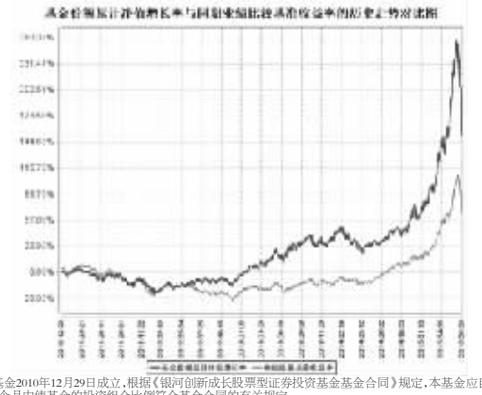
11.6.投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

## 第六节、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本报告中所列财务数据经基金托管人复核，未经审计。
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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2010.12.29-2010.12.31 | 0.00% | 0.00% | 3.26% | 0.74% | -3.26% | -0.74% |
| 2011.01.01-2011.12.31 | -18.07% | 0.90% | -25.49% | 1.15% | 7.42% | -0.25% |
| 2012.01.01-2012.12.31 | 18.77% | 1.08% | 1.59% | 1.15% | 17.18% | -0.07% |
| 2013.01.01-2013.12.31 | 38.84% | 1.40% | 13.72% | 1.08% | 25.12% | 0.32% |
| 2014.01.01-2014.12.31 | 18.84% | 1.33% | 29.87% | 0.93% | -11.03% | 0.40% |
| 2015.01.01-2015.06.30 | 64.30% | 2.52% | 49.01% | 1.72% | 15.29% | 0.80% |
| 自基金合同生效起至今 | 163.82% | 1.40% | 72.00% | 1.17% | 91.82% | 0.23% |

注：本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率×75%＋上证国债指数收益率×25%，每日进行再平衡过程。
2.自基金合同生效以来基金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：本基金2010年12月29日成立，根据《银河创新成长股票型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。

## 第七节 基金的费用

(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费；
2.基金托管人的托管费；
3.基金财产拨划支付的银行费用；
4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
5.基金份额持有人大会费用；
6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7.基金的证券交易费用；
8.依法可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。
(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
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3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。
2.基金托管人的托管费
在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
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，基金托管人复核后于次月首日起3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，支付日期顺延。
3.除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。
(四)不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
(五) 基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

## 第八节 对招募说明书更新部分的说明

银河创新成长股票型证券投资基金本次更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法规及《银河创新成长股票型证券投资基金基金合同》进行更新编写，更新的内容主要包括以下几部分：
1、“重要提示”日期根据实际情况进行了相应更新，本招募说明书所载内容截止日为2015年6月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日(财务数据未经审计)，定于2015年8月11日前公告。
2、“第三节 基金管理人”公司注册资本由1.5亿人民币增加至2亿元人民币，各持股单位出资额也进行了变更，但占总股本比例不变；持股单位上海市城市建设投资开发总公司更名为上海城投（集团）有限公司。基金经理信息根据实际情况进行了更新。
3、“第四节 基金托管人”根据实际情况进行了相应更新。
4、“第五节 相关服务机构”对基金份额发售机构和登记结算机构信息进行了更新。
5、“第十节 基金的投资”更新了“（十一）基金投资组合报告”，本报告截止日为2015年6月30日，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但未经审计。
6、“第十一节 基金的业绩”，对基金成立以来至2015年6月30日的基金业绩表现进行了披露。该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。
7、“第二十四节 其他应披露事项”中列示了本报告期内本基金及本基金管理公司在指定报纸上披露的临时报告。

银河基金管理有限公司
二〇一五年八月十一日

(上接B65版)

| 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 | 23,417,778.98 | 5.05 |
| C | 制造业 | 74,679,234.75 | 16.11 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 36,925,145.55 | 7.96 |
| E | 建筑业 | 31,045,763.74 | 6.70 |
| F | 批发和零售业 | 7,131,468.71 | 1.54 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 28,015,487.25 | 6.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,555,177.19 | 0.98 |
| J | 金融业 | 200,350,349.45 | 43.21 |
| K | 房地产业 | 21,671,679.04 | 4.67 |
| 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 | 3,459,468.54 | 0.75 |
| 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 | 431,251,553.20 | 93.00 |

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

| 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 | 1,087,556.17 | 0.23 |
| C | 制造业 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | 1,087,556.17 | 0.23 |

1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
1.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 397,048 | 32,534,113.12 | 7.02 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 1,223,961 | 22,912,549.92 | 4.94 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 1,609,114 | 15,994,593.16 | 3.45 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 837,867 | 14,453,205.75 | 3.12 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 820,313 | 13,912,508.48 | 3.00 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 1,438,355 | 11,852,045.20 | 2.56 |
| 7 | 000651 | 格力电器 | 176,450 | 11,275,155.00 | 2.43 |
| 8 | 000002 | 万 科A | 710,923 | 10,322,601.96 | 2.23 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 1,945,682 | 10,273,200.96 | 2.