

银河沪深300价值指数证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12月31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
报告送出日期:2014年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17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，确认报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的托管费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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称 银沪深300价值指数

交易代码 519671

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

报告期末基金资产总额 446,821,049.90元

投资目标 通过严谨的投资纪律约束，数学模型化和跟踪误差控制策略等数据化风险管理方法，结合量化分析和基本面研究，精选出真正具备长期投资价值的股票，力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 在严格遵守基金契约的前提下，本基金主要通过以下途径实现投资目标：

（1）行业配置：根据宏观经济周期、行业景气度、行业政策等对不同行业的配置比例进行动态调整。

（2）个股选择：根据公司质地、盈利能力、估值水平、成长性、股息率、分红派息政策、行业地位、市场地位、行业景气度、行业政策等综合因素，精选出真正具备长期投资价值的股票。

（3）风险管理：通过严格的风险控制，降低投资组合的波动率，为投资者减少投资风险，同时对跟踪误差进行有效管理，力求实现基金净值的持续增长。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×55%+银行定期存款收益率(税后)×45%。

风险收益特征 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益品种，其预期风险、预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

基金管理人 银河基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期: (2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 6,485,530.00

2.本期利润 -6,136,829.29

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0133

4.期末基金资产净值 318,587,661.46

5.期末基金份额净值 0.713

注:1.本期利润为本期已实现收益加上本期利润的分配金额，即扣除相关费用后的余额，本期利润与本期已实现收益之和等于本期利润；2.本期利润不包括持有人认购或申购基金所产生的费用，赎回或卖出基金所产生的费用；3.2.本基金未向持有人支付现金红利。

3.2.1.本期基金份额净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.2.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.3.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.4.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.5.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.6.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.7.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.8.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.9.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.10.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.11.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.12.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.13.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.14.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.15.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.16.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.17.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.18.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.19.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.20.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.21.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.22.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.23.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.24.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.25.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.26.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.34% 0.00%

3.2.27.本基金成立以来至净值增长率为-1.59%，与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准净值增长③ (%) 业绩比较基准标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 -1.93% 1.08% -1.59% 0.88% -0.