

银河行业优选股票型证券投资基金 2013 年 半年度报告 摘要

2013 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 28 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 2013 年 8 月 20 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 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	银河行业股票
基金主代码	519670
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	1,411,757,872.60 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将“自上而下”的资产配置及动态行业配置与“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。
投资策略	<p>本基金的投资策略体现在资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略和其他品种投资策略等四个方面。</p> <p>资产配置策略，本基金管理人从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面、资金面和企业面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势，分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系，在此基础上，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券等资产的比例。</p> <p>股票投资策略方面，本基金致力于投资优选行业中的优势企业，本基金管理人相信通过双重优选，可以取得超额收益。本基金的股票投资策略分为两个层次，一是优选景气行业或预期景气行业的行业配置策略，一是优选企业的选股策略。以宏观经济的所处的不同运行阶段，同时考虑行业所处的生命周期，进而确定相对应的景气行业行业配置依据；在所确定的景气行业内，通过定性与定量分析相结合的办法，寻找行业内具有竞争优势或是高成长性的公司作为投资标的。</p> <p>本基金债券投资的主要策略包括利率预期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、单券选择策略、可转换债券投资策略。其他品种投资策略包括权证、资产支持证券投资等。</p>

业绩比较基准	本基金的业绩比较基准是：业绩基准收益率=沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险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、预期收益较高的基金产品。

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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67595096
传真		021-38568880	010-66275865

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 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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	160,122,336.83
本期利润	268,909,401.25
加权平均基金份额本期利润	0.1747
本期基金份额净值增长率	17.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0399
期末基金资产净值	1,634,319,782.48
期末基金份额净值	1.158

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、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

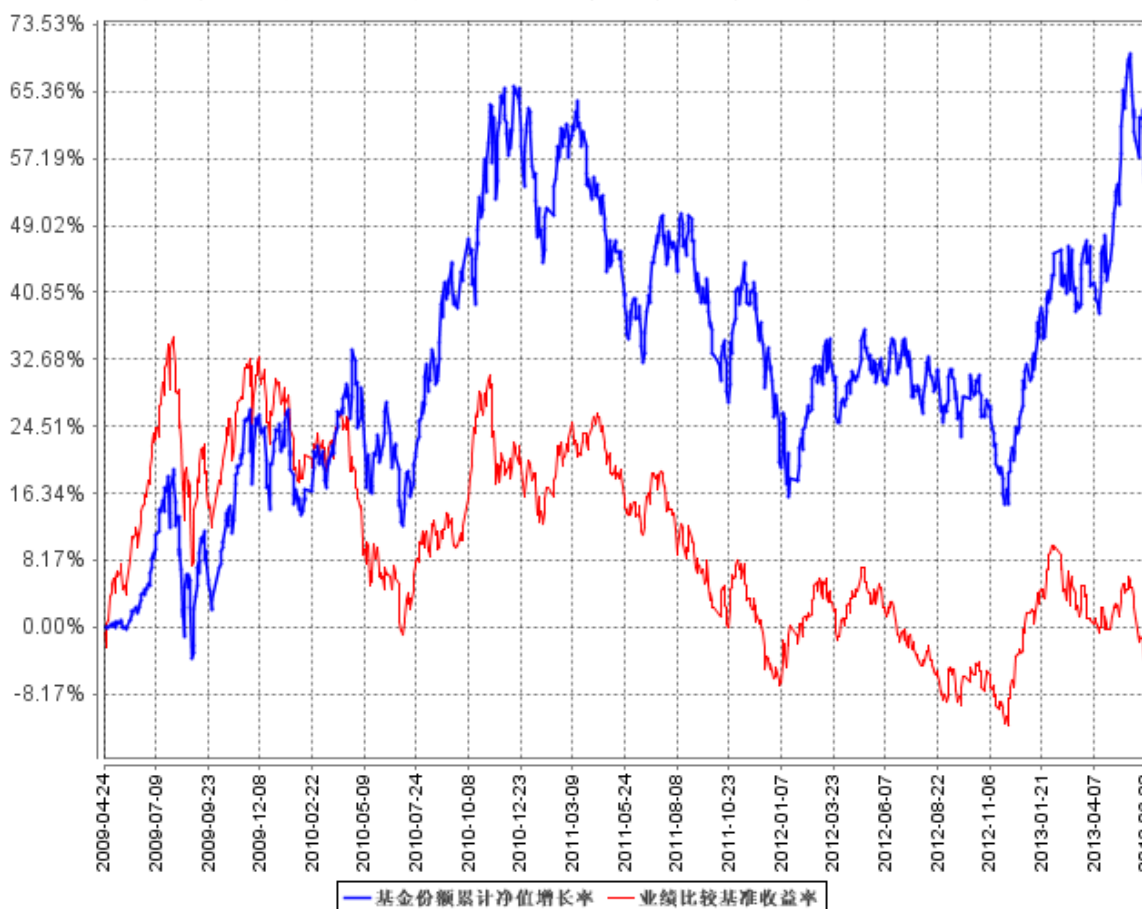
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.46%	2.21%	-12.55%	1.49%	4.09%	0.72%
过去三个月	7.52%	1.71%	-9.32%	1.16%	16.84%	0.55%
过去六个月	17.44%	1.55%	-9.86%	1.20%	27.30%	0.35%
过去一年	16.62%	1.30%	-7.65%	1.09%	24.27%	0.21%
过去三年	34.38%	1.30%	-8.79%	1.10%	43.17%	0.20%
自基金合同生效起至今	55.25%	1.37%	-8.22%	1.21%	63.47%	0.16%

注：本基金的业绩比较基准为：业绩基准收益率=沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%

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：按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定：本基金投资的股票资产占基金资产的 60—95%，现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 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%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。截止至 2009 年 10 月 24 日，建仓期已满。建仓期结束时各项投资比例已符合基金合同约定。

§ 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、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 1 只封闭式基金与 14 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 8 月 15 日

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

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。

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。

6、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。

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%。

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		
成胜	银河行业优选股票型证券投资基金的基金经理、银河主题策略	2010 年 9 月 16 日	-	8	硕士研究生学历，曾就职于光大证券研究所，从事行业研究工

	股票型证券投资基金的基金经理、股票投资部总监助理				作。2007年5月加入银河基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理等职务，2012年9月起兼任银河主题策略股票型证券投资基金的基金经理，2012年4月起担任股票投资部总监助理。
王海华	银河行业优选股票型证券投资基金的基金经理助理	2012年8月23日	-	8	硕士研究生学历，曾就职于中石化集团第三建设公司、宁波华能国际贸易与经济合作有限公司。2004年6月加入银河基金管理有限公司，历任交易员、研究员、高级研究员等职。

注：1、上表中任职日期均为我公司做出决定之日，离任日期为对外公告之日；

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》、《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，努力实现基金份额持有人的利益，无损害基金份额持有人利益的行为，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定的回报。

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

本基金观察到新一届政府调经济结构和转型升级的决心日益明显，而实现这一目标大概率伴随着经济降速，因此判断去年年底开始的经济复苏和市场回暖难以持续，但受益于政府扶持、领域放开、技术进步和企业主体的能动性，代表新兴经济方向的领域在今年显示出旺盛的活力，值得期待。

由于对结构转型和新兴经济的基本面乐观，故仓位水平总体上比市场上股票型基金的平均值略高。从行业配置看，偏重于新兴经济板块，并下调了周期类配置。上半年个股集中度有所上升，并强化了重点个股的跟踪力度，适当降低了业绩存在风险的品种的持仓比例。由于担心新股发行制度和大小非解禁的的冲击，下调了相对平庸的个股持仓。本基金希望跟随中国经济结构转型的主脉络，把握产业趋势，继续加强对行业和研究和理解，发掘核心品种并坚定持有，突出优选个股带来的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013 年上半年银河行业优选业绩比较基准收益率为-9.86%，银河行业优选净值收益率为17.44%，业绩高于基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计我国经济依然处于转型和去杠杆期间，经济增速下台阶，但经济结构会持续优化，与之对应的证券市场有结构性机会，对于转型受益行业长期看好。

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《基金合同》有关约定，“基金收益分配后每一单位份额净值不能低于面值。”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关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：银河行业优选股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		9,141,903.03	60,232,744.07
结算备付金		4,731,874.58	1,892,444.94
存出保证金		674,713.19	17,575.69
交易性金融资产		1,541,039,110.15	1,530,462,792.33
其中：股票投资		1,450,995,110.15	1,400,527,792.33
基金投资		-	-
债券投资		90,044,000.00	129,935,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		50,000,000.00	69,940,424.91
应收证券清算款		33,343,678.58	-
应收利息		2,597,015.98	1,978,224.48
应收股利		-	-
应收申购款		1,201,097.61	405,594.18
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,642,729,393.12	1,664,929,800.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		-	-
应付证券清算款		-	8,729,740.00
应付赎回款		3,338,045.97	3,280,668.76
应付管理人报酬		2,112,196.08	1,964,665.80
应付托管费		352,032.67	327,444.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,335,942.79	1,582,469.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		271,393.13	452,664.02
负债合计		8,409,610.64	16,337,652.68
所有者权益：			
实收基金		1,411,757,872.60	1,672,738,670.84
未分配利润		222,561,909.88	-24,146,522.92
所有者权益合计		1,634,319,782.48	1,648,592,147.92
负债和所有者权益总计		1,642,729,393.12	1,664,929,800.60

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.158 元，基金份额总额 1,411,757,872.60 份。

6.2 利润表

会计主体：银河行业优选股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		293,344,280.81	87,214,493.23
1.利息收入		2,387,257.69	3,649,925.45
其中：存款利息收入		354,342.79	652,741.15
债券利息收入		1,630,803.84	1,876,918.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		402,111.06	1,120,266.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		181,820,647.87	-77,404,125.80
其中：股票投资收益		172,578,683.40	-87,862,034.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益		111,286.03	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		9,130,678.44	10,457,908.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		108,787,064.42	160,620,255.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		349,310.83	348,438.31
减：二、费用		24,434,879.56	23,639,015.47
1. 管理人报酬		12,512,742.52	14,035,437.11
2. 托管费		2,085,457.05	2,339,239.46

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		9,597,914.76	7,032,320.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		238,765.23	232,018.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		268,909,401.25	63,575,477.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		268,909,401.25	63,575,477.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河行业优选股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,672,738,670.84	-24,146,522.92	1,648,592,147.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	268,909,401.25	268,909,401.25
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）	-260,980,798.24	-22,200,968.45	-283,181,766.69
其中：1.基金申购款	170,129,014.00	33,086,493.35	203,215,507.35
2.基金赎回款	-431,109,812.24	-55,287,461.80	-486,397,274.04
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）	1,411,757,872.60	222,561,909.88	1,634,319,782.48
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	2,082,741,796.22	-90,253,759.32	1,992,488,036.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	63,575,477.76	63,575,477.76
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）	-211,228,295.71	13,864,794.95	-197,363,500.76
其中：1.基金申购款	116,081,715.54	-3,802,023.43	112,279,692.11
2.基金赎回款	-327,310,011.25	17,666,818.38	-309,643,192.87
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）	1,871,513,500.51	-12,813,486.61	1,858,700,013.90

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：

尤象都

董伯儒

董伯儒

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

银河行业优选股票型证券投资基金（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[2008]1253号文《关于核准银河行业优选股票型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发起人向社会公开发行募集，基金合同于2009年4月24日生效。首次设立募集规模为692,688,077.60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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金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、债券回购、权证、中央银行票据、资产支持证券等，以及法律法规或中国证监会允许的其它投资品种。其中，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%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。如果法律法规或中国证监会允许基金投资于其它品种，本基金在履行适当的程序后，可以将其纳入到基金的投资范围，并依据有关法律法规进行投资管理。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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。

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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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[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	同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

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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
银河证券	10,076,897.77	0.16%	1,252,595,291.44	27.25%

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。

债券回购交易

注：本基金本报告期末及上一报告期末本科目余额均为零。

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均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 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
银河证券	9,174.03	0.16%	9,174.03	0.39%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
银河证券	1,034,901.77	27.07%	340,526.70	20.30%

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 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	12,512,742.52
其中：支付销售机构的客户维护费	1,115,978.21	1,198,276.36

注：1. 截至 2011 年 6 月 30 日未支付管理费余额：2,772,490.62 元，截至 2010 年 6 月 30 日未支付管理费余额：335,130.80 元。

2. 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：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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，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 2013年1月1日至2013年6月	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30

	30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	2,085,457.05	2,339,239.46

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金报告期及上一报告期末本科目余额均为零

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2009 年 4 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,000,700.07	10,000,700.07
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,700.07	10,000,700.07
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.71%	0.53%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金系在正常业务范围内按一般商业条款进行，投资本基金的费率是公允的。

6.4.8.4.2 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

注：报告期末不存在除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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
中国建设银行	9,141,903.03	305,164.03	83,597,948.42	605,642.05

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期间及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末 2013 年 06 月 30 日止，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。

6.4.9.2 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
300027	华谊兄弟	2013 年 6 月 5 日	重大事项停牌	28.55	2013 年 7 月 24 日	31.41	900,000	20,441,940.97	25,695,000.00	-
600292	中电远达	2013 年 6 月 5 日	重大事项停牌	16.90	2013 年 7 月 1 日	17.50	500,027	8,597,565.20	8,450,456.30	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 06 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	1,450,995,110.15	88.33
	其中：股票	1,450,995,110.15	88.33
2	固定收益投资	90,044,000.00	5.48
	其中：债券	90,044,000.00	5.48
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	3.04
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	13,873,777.61	0.84
6	其他各项资产	37,816,505.36	2.30
7	合计	1,642,729,393.12	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	25,428,606.36	1.56
B	采矿业	15,906,800.00	0.97
C	制造业	491,553,649.40	30.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,828,856.30	0.54
E	建筑业	84,490,740.18	5.17
F	批发和零售业	28,500,564.30	1.74
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	533,657,186.60	32.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	114,612,528.14	7.01
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	9,138,780.55	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	87,952,280.58	5.38
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	50,925,117.74	3.12
S	综合	-	-
	合计	1,450,995,110.15	88.78

7.3 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

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	300253	卫宁软件	3,941,650	160,030,990.00	9.79
2	300287	飞利信	5,175,057	117,318,542.19	7.18
3	300075	数字政通	3,227,243	91,330,976.90	5.59
4	000826	桑德环境	2,270,070	73,255,158.90	4.48
5	601117	中国化学	7,000,054	66,640,514.08	4.08
6	300090	盛运股份	2,029,992	62,686,152.96	3.84
7	000024	招商地产	2,500,075	60,701,821.00	3.71
8	002353	杰瑞股份	780,085	53,825,865.00	3.29
9	300205	天喻信息	3,000,000	50,100,000.00	3.07
10	600570	恒生电子	3,900,000	48,750,000.00	2.98

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于银河基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

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	600157	永泰能源	118,078,756.58	7.16

2	000002	万 科A	109,131,339.89	6.62
3	601117	中国化学	95,453,135.42	5.79
4	600585	海螺水泥	87,558,824.33	5.31
5	000826	桑德环境	84,028,445.96	5.10
6	002038	双鹭药业	80,871,804.73	4.91
7	000731	四川美丰	80,155,127.29	4.86
8	000024	招商地产	76,111,038.94	4.62
9	600332	广州药业	68,304,113.68	4.14
10	600517	置信电气	67,830,225.82	4.11
11	300090	盛运股份	64,322,600.25	3.90
12	002296	辉煌科技	63,302,440.21	3.84
13	300287	飞利信	58,551,562.57	3.55
14	300168	万达信息	54,861,375.84	3.33
15	300039	上海凯宝	51,489,405.55	3.12
16	300074	华平股份	49,248,300.92	2.99
17	000522	白云山A	48,043,620.25	2.91
18	300075	数字政通	46,614,930.91	2.83
19	600048	保利地产	43,622,854.28	2.65
20	000423	东阿阿胶	43,456,921.75	2.64
21	600000	浦发银行	42,871,326.31	2.60
22	300027	华谊兄弟	42,312,809.24	2.57
23	600693	东百集团	40,465,096.05	2.45
24	300205	天喻信息	39,873,461.74	2.42
25	002353	杰瑞股份	39,235,612.12	2.38
26	300206	理邦仪器	38,895,348.23	2.36
27	000028	国药一致	38,183,979.13	2.32
28	601166	兴业银行	36,803,682.08	2.23
29	600027	华电国际	36,470,238.07	2.21
30	601918	国投新集	34,283,082.28	2.08
31	600108	亚盛集团	33,673,859.18	2.04
32	002022	科华生物	33,550,647.76	2.04
33	000937	冀中能源	33,040,172.66	2.00

注：本项及下项 7.4.2，7.4.3 的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	000002	万 科 A	132,784,928.18	8.05
2	600741	华域汽车	123,176,625.47	7.47
3	600570	恒生电子	95,587,666.00	5.80
4	600157	永泰能源	93,308,656.17	5.66
5	601669	中国水电	93,200,709.38	5.65
6	600585	海螺水泥	85,765,630.90	5.20
7	300168	万达信息	76,384,905.34	4.63
8	300075	数字政通	72,188,146.62	4.38
9	002296	辉煌科技	66,816,884.50	4.05
10	300253	卫宁软件	66,085,666.85	4.01
11	002038	双鹭药业	64,612,532.32	3.92
12	600315	上海家化	64,216,652.54	3.90
13	300074	华平股份	62,617,925.64	3.80
14	600332	广州药业	59,975,671.28	3.64
15	601117	中国化学	58,823,475.03	3.57
16	300039	上海凯宝	52,817,733.64	3.20
17	600519	贵州茅台	50,311,023.42	3.05
18	600518	康美药业	49,316,104.23	2.99
19	601601	中国太保	46,809,176.25	2.84
20	600048	保利地产	45,370,016.44	2.75
21	000998	隆平高科	43,620,367.07	2.65
22	002415	海康威视	42,349,059.41	2.57
23	000423	东阿阿胶	42,119,714.90	2.55
24	002049	同方国芯	41,696,837.28	2.53
25	600000	浦发银行	41,136,614.46	2.50
26	000731	四川美丰	40,966,453.32	2.48
27	000651	格力电器	40,193,585.36	2.44
28	601918	国投新集	39,370,668.61	2.39
29	002236	大华股份	39,104,382.50	2.37
30	002022	科华生物	36,142,129.49	2.19
31	600027	华电国际	34,859,326.23	2.11
32	000028	国药一致	34,651,900.95	2.10
33	601166	兴业银行	34,274,403.56	2.08

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	3,089,804,505.68
卖出股票收入（成交）总额	3,320,615,828.55

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,940,000.00	4.89
	其中：政策性金融债	79,940,000.00	4.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,104,000.00	0.62
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	90,044,000.00	5.51

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120228	12 国开 28	700,000	69,965,000.00	4.28
2	041259047	12 华友钴业 CP001	100,000	10,104,000.00	0.62
3	070203	07 国开 03	100,000	9,975,000.00	0.61

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不能投资股指期货, 因此不存在需要披露的信息。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

2013 年 6 月 9 日, 中国证券监督管理委员会上海稽查局对盛运股份董事会秘书刘玉斌下达《调查通知书》(编号: 沪调查通字 2013-2-012 号), 随后刘玉斌辞去董事会秘书一职。本次立案调查事项, 是涉及刘玉斌 2011 年发生相关事情的专项调查, 未对公司当前正常经营活动产生影响。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名股票的发行主体没有出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.10.3 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	674,713.19
2	应收证券清算款	33,343,678.58
3	应收股利	-
4	应收利息	2,597,015.98
5	应收申购款	1,201,097.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,816,505.36

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		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
48,851	28,899.26	378,183,690.22	26.79%	1,033,574,182.38	73.21%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	333,474.74	0.0236%

注：截止 2013 年 6 月 30 日，公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份(含)；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份(含)。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年4月24日）基金份额总额	692,688,077.60
本报告期期初基金份额总额	1,672,738,670.84
本报告期基金总申购份额	170,129,014.00
减：本报告期基金总赎回份额	431,109,812.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,411,757,872.60

§ 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：

报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

二、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

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

报告期内无涉及基金投资策略的改变。

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	2	1,431,455,703.84	22.82%	1,278,863.13	22.76%	-
中信建投	1	919,288,738.37	14.65%	813,479.08	14.48%	-
兴业证券	2	821,237,903.27	13.09%	745,675.23	13.27%	-
中银国际	2	789,206,128.49	12.58%	698,369.90	12.43%	-
国信证券	1	385,806,767.56	6.15%	351,238.10	6.25%	-
国金证券	1	306,389,596.16	4.88%	271,124.09	4.83%	-
国海证券	1	261,709,522.56	4.17%	231,586.96	4.12%	-
安信证券	3	190,979,404.67	3.04%	171,458.02	3.05%	-
中投证券	1	189,031,523.00	3.01%	172,094.58	3.06%	-
宏源证券	1	177,740,192.66	2.83%	161,814.43	2.88%	-
海通证券	1	159,287,489.28	2.54%	145,015.66	2.58%	-
东北证券	1	156,066,920.51	2.49%	142,083.22	2.53%	-
浙商证券	1	133,369,157.87	2.13%	121,419.03	2.16%	-
民生证券	1	128,691,150.05	2.05%	113,878.67	2.03%	-
瑞银证券	1	103,655,209.70	1.65%	94,366.10	1.68%	-
东兴证券	1	99,772,598.51	1.59%	88,288.71	1.57%	-
银河证券	2	10,076,897.77	0.16%	9,174.03	0.16%	-
东方证券	1	10,047,202.60	0.16%	9,147.36	0.16%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

注：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。

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	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	95,000,000.00	18.81%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	150,000,000.00	29.70%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	50,000,000.00	9.90%	-	-
东北证券	-	-	120,000,000.00	23.76%	-	-
浙商证券	-	-	70,000,000.00	13.86%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	20,000,000.00	3.96%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

银河基金管理有限公司

2013 年 8 月 28 日