

银河消费驱动股票型证券投资基金 2013 年 半年度报告

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 21 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 2013 年 1 月 1 日起至 6 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.....	5
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
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	40
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.....	40
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.10 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42

§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
§11 备查文件目录	47
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河消费驱动股票型证券投资基金
基金简称	银河消费股票
基金主代码	519678
交易代码	519678
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	93,747,345.48 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。
投资策略	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%。本基金将不低于 80% 的股票资产投资于受消费驱动的上市公司。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及预期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	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	400-820-0860	010-67595096
传真	021-38568880	010-66275865
注册地址	上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	200122	100033
法定代表人	徐旭	王洪章

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、北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

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公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号 中国保险大厦

§ 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	13,490,342.18
本期利润	12,637,645.26
加权平均基金份额本期利润	0.0699
本期加权平均净值利润率	6.92%
本期基金份额净值增长率	3.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-10,590.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0001
期末基金资产净值	93,736,755.22
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.00%

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

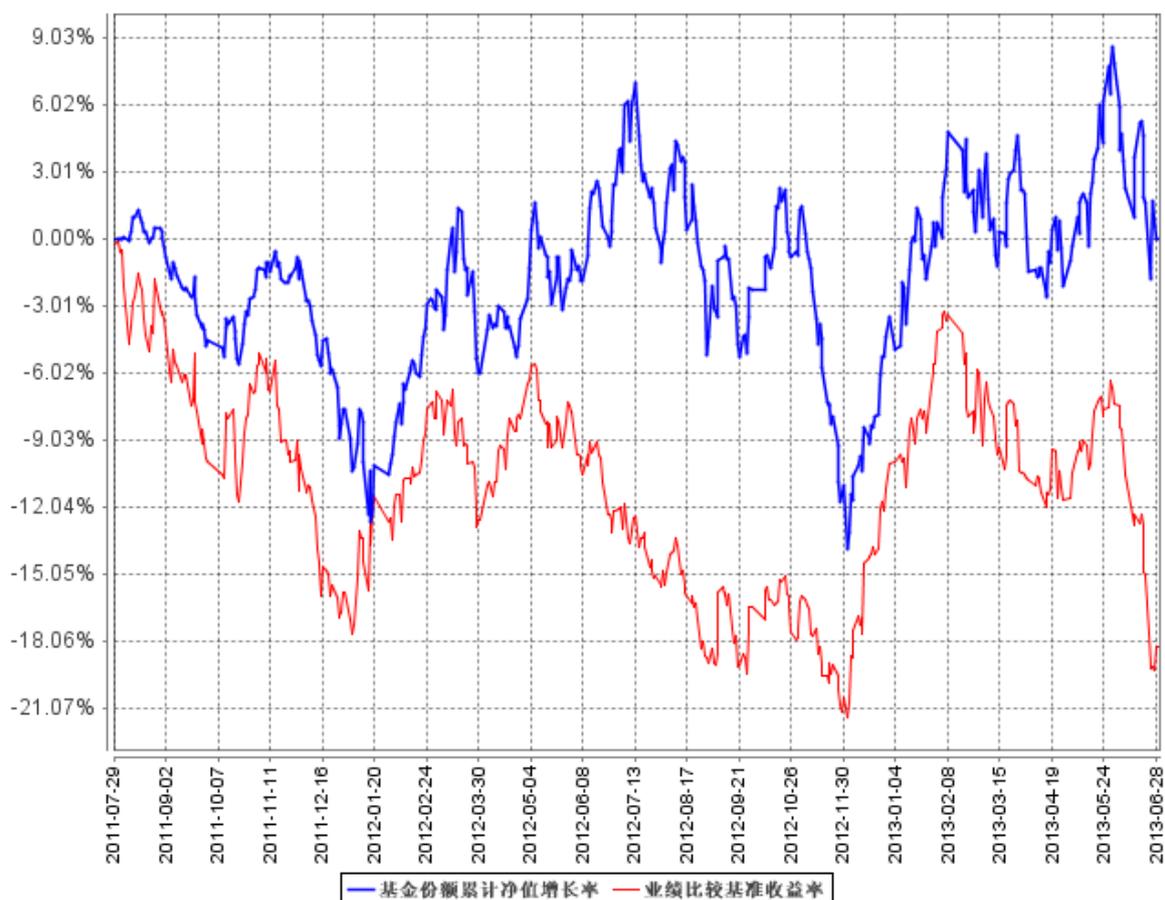
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-7.32%	1.66%	-11.78%	1.40%	4.46%	0.26%
过去三个月	-2.15%	1.35%	-8.69%	1.09%	6.54%	0.26%
过去六个月	3.63%	1.28%	-9.14%	1.12%	12.77%	0.16%
过去一年	-2.34%	1.19%	-6.92%	1.02%	4.58%	0.17%
自基金合同生效起至今	0.00%	1.03%	-18.30%	1.02%	18.30%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×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

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：1、本基金合同于 2011 年 7 月 29 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，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：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%。

本基金将不低于 80% 的股票资产投资于受消费驱动的上市公司。

3、截止 2012 年 1 月 29 日建仓期满，本基金各项资产配置符合合同约定。

§ 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（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 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。

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。

10、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。

11、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。

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		
卢轶乔	银河消费驱动股票型证券投资基金的基金经理	2012年12月21日	-	5	博士研究生学历，曾就职于建设银行。2008年7月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、银河消费驱动股票型证券投资基金的基金经理助理等职。
刘风华	银河消费驱动股票型证券投资基金的基金经理、研究部总监	2011年7月29日	2013年2月26日	15	硕士研究生学历，曾先后在中国信达信托投资公司、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，历任行业研究员、基金经理助理、银河银泰理财分红证券投资基金的基金经理等职务，现任研究部总监。

注：1、上表中任职、离职日期均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

2013 年上半年市场出现较明显的调整和风格偏好，上证指数跌 12.78%，深成指下跌 15.60%，而中小板上涨 5.19%，创业板上涨 41.72%。上半年市场结构分化严重，优质成长股表现优异，而不少行业创出历史新低。市场结束对经济复苏期望，强周期行业出现大幅度下跌，而以消费电子、医药等代表未来经济发展方向的行业表现突出。

我们整体仓位上保持在中等水平，主要以医药、食品作为主要核心配置行业，部分持有环保、电子、软件等行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013 年上半年本基金业绩比较基准收益率为-9.14%，净值收益率为 3.63%，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

对于三季度的市场趋势，我们认为市场仍将宽幅震荡，一方面短期内市场仍将保持较为宽松的资金环境，政府出台极端调控政策概率较低，通货膨胀压力较小，资金面可能对市场有一定的支撑，另一方面，我们也看到政府对经济转型的决心较大，对经济增速容忍度较高。在这种背景下，我们将集中持有基本面较好的成长股，用优选成长的积极防御的策略应对本轮市场震荡期，通过重点持有稳定增长的行业和个股获取超额收益。

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

本基金于 2011 年 7 月 29 日成立，根据《基金合同》有关规定“本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%”。截至 2013 年 6 月 30 日底，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：银河消费驱动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	6.4.7.1	5,011,138.39	11,897,598.64
结算备付金		1,369,979.58	-
存出保证金		215,452.75	1,341.67
交易性金融资产	6.4.7.2	70,230,075.52	207,923,088.54
其中：股票投资		66,028,475.52	184,999,188.54
基金投资		-	-
债券投资		4,201,600.00	22,923,900.00
资产支持证券投资		-	-
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		18,197,278.80	-
应收利息	6.4.7.5	72,751.23	515,210.36
应收股利		-	-
应收申购款		9,310.67	27,959.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		95,105,986.94	220,365,198.24
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	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		376,573.42	140,405.95
应付管理人报酬		119,605.75	264,014.63
应付托管费		19,934.30	44,002.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	668,876.18	121,324.26
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	184,242.07	380,528.80
负债合计		1,369,231.72	950,276.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	93,747,345.48	227,461,831.54
未分配利润	6.4.7.10	-10,590.26	-8,046,909.36
所有者权益合计		93,736,755.22	219,414,922.18
负债和所有者权益总计		95,105,986.94	220,365,198.24

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 93,747,345.48 份。

6.2 利润表

会计主体：银河消费驱动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		16,598,116.84	39,124,014.28
1.利息收入		284,349.48	701,909.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	89,183.79	265,555.91
债券利息收入		160,315.63	163,397.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		34,850.06	272,956.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,063,841.81	-1,688,076.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	16,082,569.73	-2,621,636.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	439,207.14	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	542,064.94	933,559.44

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-852,696.92	39,977,413.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	102,622.47	132,768.50
减：二、费用		3,960,471.58	3,486,443.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,354,891.50	2,493,423.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	225,815.28	415,570.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,185,153.44	373,313.65
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	194,611.36	204,136.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,637,645.26	35,637,570.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,637,645.26	35,637,570.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河消费驱动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）	227,461,831.54	-8,046,909.36	219,414,922.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,637,645.26	12,637,645.26
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）	-133,714,486.06	-4,601,326.16	-138,315,812.22
其中：1.基金申购款	7,909,713.47	200,268.70	8,109,982.17
2.基金赎回款	-141,624,199.53	-4,801,594.86	-146,425,794.39
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)	93,747,345.48	-10,590.26	93,736,755.22
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)	363,526,921.68	-28,060,932.94	335,465,988.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	35,637,570.90	35,637,570.90
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)	-24,017,444.93	642,288.75	-23,375,156.18
其中：1.基金申购款	84,438,981.61	-1,602,742.65	82,836,238.96
2.基金赎回款	-108,456,426.54	2,245,031.40	-106,211,395.14
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)	339,509,476.75	8,218,926.71	347,728,403.46

注：本基金合同于 2011 年 7 月 29 日生效，无上年度可比期间。

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

银河消费驱动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[2011]710号《关于核准银河消费驱动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管理人于 2011 年 6 月 23 日至 2011 年 7 月 22 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2011）验字第 60821717_B02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2011 年 7 月 29 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 524,035,493.20 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 97,444.68 元，以上实收

基金（本息）合计为人民币 524,132,937.88 元，折合 524,132,937.88 份基金份额。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。

本基金的投资范围为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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券，以及法律法规或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的相关规定）。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%。本基金将不低于 80% 的股票资产投资于受消费驱动的上市公司。

本基金的业绩比较标准是：沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

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。

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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 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。

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

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、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、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；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	5,011,138.39
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,011,138.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	63,905,044.64	66,028,475.52	2,123,430.88	
债券	交易所市场	4,233,597.40	4,201,600.00	-31,997.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,233,597.40	4,201,600.00	-31,997.40
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	68,138,642.04	70,230,075.52	2,091,433.48	

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：本基金本报告期末未持有有买入返售金融资产。

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 2013年6月30日
应收活期存款利息	1,543.58
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	616.50
应收债券利息	70,494.25
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	96.90
合计	72,751.23

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	668,876.18
银行间市场应付交易费用	-
合计	668,876.18

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	762.37
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	158,684.51
合计	184,242.07

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	227,461,831.54	227,461,831.54
本期申购	7,909,713.47	7,909,713.47
本期赎回(以“-”号填列)	-141,624,199.53	-141,624,199.53
本期末	93,747,345.48	93,747,345.48

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	-8,488,637.81	441,728.45	-8,046,909.36
本期利润	13,490,342.18	-852,696.92	12,637,645.26
本期基金份额交易产生的变动数	1,764,322.87	-6,365,649.03	-4,601,326.16
其中：基金申购款	-43,001.04	243,269.74	200,268.70
基金赎回款	1,807,323.91	-6,608,918.77	-4,801,594.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,766,027.24	-6,776,617.50	-10,590.26

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	70,310.62
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	8,630.97
其他	10,242.20
合计	89,183.79

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 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	770,022,038.39
减：卖出股票成本总额	753,939,468.66
买卖股票差价收入	16,082,569.73

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,935,888.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,847,705.53
减：应收利息总额	648,975.35
债券投资收益	439,207.14

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	542,064.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	542,064.94

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-852,696.92
——股票投资	-744,505.05
——债券投资	-108,191.87

——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-852,696.92

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	98,907.53
转换费收入	3,714.94
合计	102,622.47

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	2,184,978.44
银行间市场交易费用	175.00
合计	2,185,153.44

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	158,684.51
上清所数字证书服务费	400.00
资金汇划费	1,731.66
帐户维护费	9,000.00
合计	194,611.36

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
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	受基金管理人第一大股东控制、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

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

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
中国银河证券	50,302,413.06	3.59%	41,919,768.02	15.38%

债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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
中国银河证券股份有限公司	45,795.35	3.65%	-	-
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
中国银河证券股份有限公司	35,281.89	15.60%	13,628.89	52.99%

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。

6.4.10.2 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 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	1,354,891.50	2,493,423.09
其中：支付销售机构的客户维护费	139,500.96	332,442.10

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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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 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，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 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托管费	225,815.28	415,570.57

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。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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，支付日期顺延。

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

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未投资本基金。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	5,011,138.39	70,310.62	25,129,894.04	262,667.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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

本基金本期间无其他关联交易。

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（2013 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
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	340,000	6,009,889.68	5,746,000.00	-
600436	片仔癀	2013 年 6 月 21 日	配股临时停牌	136.82	2013 年 7 月 1 日	118.73	30,000	2,615,304.25	4,104,600.00	-
000998	隆平高科	2013 年 5 月 3 日	重大事项停牌	18.47	2013 年 7 月 8 日	20.50	49,953	1,017,535.08	922,631.91	-

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 2013 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 2013 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。

6.4.13 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，除在附注 7.4.12 中列示的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。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013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	5,011,138.39	-	-	-	-	-	5,011,138.39
结算备付金	1,369,979.58	-	-	-	-	-	1,369,979.58
存出保证金	215,452.75	-	-	-	-	-	215,452.75
交易性金融资产	-	-	-	-	4,201,600.00	66,028,475.52	70,230,075.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-	18,197,278.80	18,197,278.80
应收利息	-	-	-	-	-	72,751.23	72,751.23
应收申购款	-	-	-	-	-	9,310.67	9,310.67
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,596,570.72	-	-	-	4,201,600.00	84,307,816.22	95,105,986.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	376,573.42	376,573.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	119,605.75	119,605.75
应付托管费	-	-	-	-	-	19,934.30	19,934.30
应付交易费用	-	-	-	-	-	668,876.18	668,876.18
其他负债	-	-	-	-	-	184,242.07	184,242.07
负债总计	-	-	-	-	-	1,369,231.72	1,369,231.72
利率敏感度缺口	6,596,570.72	-	-	-	4,201,600.00	82,938,584.50	93,736,755.22
上年度末 2012年12	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

月 31 日							
资产							
银行存款	11,897,598.64	-	-	-	-	-	11,897,598.64
存出保证金	-	-	-	-	-	1,341.67	1,341.67
交易性金融资产	-	-	22,923,900.00	-	-	184,999,188.54	207,923,088.54
应收利息	-	-	-	-	-	515,210.36	515,210.36
应收申购款	497.02	-	-	-	-	27,462.01	27,959.03
资产总计	11,898,095.66	-	22,923,900.00	-	-	185,543,202.58	220,365,198.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	140,405.95	140,405.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	264,014.63	264,014.63
应付托管费	-	-	-	-	-	44,002.42	44,002.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	121,324.26	121,324.26
其他负债	-	-	-	-	-	380,528.80	380,528.80
负债总计	-	-	-	-	-	950,276.06	950,276.06
利率敏感度缺口	11,898,095.66	-	22,923,900.00	-	-	184,592,926.52	219,414,922.18

注：本基金各期限分类按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	69,550.29	39,555.63
	市场利率上升 25 个基点	-69,550.29	-39,555.63

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格及比例实施监控。

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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	66,028,475.52	70.44	184,999,188.54	84.31
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	66,028,475.52	70.44	184,999,188.54	84.31

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 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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	2,220,143.78	6,951,822.81
沪深 300 指数下降 5%	-2,220,143.78	-6,951,822.81	

6.4.14 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	66,028,475.52	69.43
	其中：股票	66,028,475.52	69.43
2	固定收益投资	4,201,600.00	4.42
	其中：债券	4,201,600.00	4.42
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	6,381,117.97	6.71
6	其他各项资产	18,494,793.45	19.45
7	合计	95,105,986.94	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,226,631.91	2.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,815,343.61	53.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,746,000.00	6.13
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	2,652,500.00	2.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,196,000.00	3.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,392,000.00	2.55

Q	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	66,028,475.52	70.44

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

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	000895	双汇发展	200,000	7,688,000.00	8.20
2	600292	中电远达	340,000	5,746,000.00	6.13
3	600518	康美药业	250,000	4,807,500.00	5.13
4	000848	承德露露	200,000	4,542,000.00	4.85
5	000538	云南白药	49,974	4,198,315.74	4.48
6	600436	片仔癀	30,000	4,104,600.00	4.38
7	002223	鱼跃医疗	199,950	3,769,057.50	4.02
8	300071	华谊嘉信	200,000	3,196,000.00	3.41
9	603008	喜临门	449,927	2,654,569.30	2.83
10	600315	上海家化	50,000	2,249,500.00	2.40
11	300146	汤臣倍健	49,910	2,195,540.90	2.34
12	300273	和佳股份	100,000	2,142,000.00	2.29
13	002020	京新药业	199,969	1,999,690.00	2.13
14	002415	海康威视	50,000	1,767,000.00	1.89
15	600597	光明乳业	129,993	1,753,605.57	1.87
16	002255	海陆重工	99,904	1,718,348.80	1.83
17	000826	桑德环境	50,000	1,613,500.00	1.72
18	600132	重庆啤酒	100,000	1,503,000.00	1.60
19	300075	数字政通	50,000	1,415,000.00	1.51
20	600108	亚盛集团	200,000	1,304,000.00	1.39
21	002649	博彦科技	50,000	1,237,500.00	1.32
22	002563	森马服饰	49,999	999,980.00	1.07
23	002456	欧菲光	20,000	953,200.00	1.02
24	000998	隆平高科	49,953	922,631.91	0.98
25	000888	峨眉山A	50,000	778,500.00	0.83
26	300005	探路者	49,960	476,618.40	0.51

27	002507	涪陵榨菜	9,222	200,117.40	0.21
28	000012	南玻A	10,000	92,700.00	0.10

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	000895	双汇发展	24,546,412.25	11.19
2	000848	承德露露	19,259,981.00	8.78
3	000650	仁和药业	18,021,848.50	8.21
4	002557	洽洽食品	14,002,025.09	6.38
5	002254	泰和新材	13,622,516.38	6.21
6	600633	浙报传媒	12,537,243.90	5.71
7	600518	康美药业	11,655,483.03	5.31
8	002570	贝因美	11,437,391.98	5.21
9	002415	海康威视	11,165,126.55	5.09
10	600016	民生银行	10,558,000.00	4.81
11	600318	巢东股份	10,251,291.00	4.67
12	601166	兴业银行	9,801,912.68	4.47
13	601688	华泰证券	9,577,416.27	4.36
14	002142	宁波银行	9,425,181.55	4.30
15	600720	祁连山	9,326,709.30	4.25
16	002020	京新药业	9,316,218.60	4.25
17	600298	安琪酵母	9,098,913.43	4.15
18	000430	张家界	9,047,124.09	4.12
19	002255	海陆重工	8,689,799.71	3.96
20	600535	天士力	8,195,743.45	3.74
21	000860	顺鑫农业	7,484,543.82	3.41
22	600340	华夏幸福	7,174,686.45	3.27
23	601233	桐昆股份	7,103,739.79	3.24
24	600559	老白干酒	7,073,469.17	3.22
25	002296	辉煌科技	6,888,624.37	3.14
26	600517	置信电气	6,834,344.22	3.11
27	000024	招商地产	6,817,020.51	3.11

28	002146	荣盛发展	6,447,029.79	2.94
29	601318	中国平安	6,244,242.00	2.85
30	002327	富安娜	6,181,587.37	2.82
31	002091	江苏国泰	6,127,281.49	2.79
32	600292	中电远达	6,114,178.94	2.79
33	300256	星星科技	6,022,012.03	2.74
34	300115	长盈精密	5,880,609.00	2.68
35	600073	上海梅林	5,854,609.00	2.67
36	002450	康得新	5,623,455.20	2.56
37	600048	保利地产	5,558,205.42	2.53
38	002241	歌尔声学	5,505,922.20	2.51
39	600526	菲达环保	5,392,352.71	2.46
40	300074	华平股份	5,260,527.02	2.40
41	000800	一汽轿车	5,222,325.00	2.38
42	002353	杰瑞股份	4,994,726.59	2.28
43	000888	峨眉山A	4,763,403.74	2.17
44	300037	新宙邦	4,731,800.25	2.16
45	601009	南京银行	4,665,451.30	2.13
46	600887	伊利股份	4,619,570.00	2.11
47	600027	华电国际	4,591,496.86	2.09
48	000656	金科股份	4,588,447.55	2.09
49	002022	科华生物	4,515,816.05	2.06
50	600132	重庆啤酒	4,488,288.03	2.05
51	600157	永泰能源	4,469,469.00	2.04
52	603366	日出东方	4,419,670.00	2.01
53	601918	国投新集	4,403,266.00	2.01
54	002277	友阿股份	4,400,806.30	2.01
55	002234	民和股份	4,391,481.01	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	600518	康美药业	27,303,312.10	12.44

2	000895	双汇发展	24,138,270.71	11.00
3	600315	上海家化	21,398,318.40	9.75
4	000568	泸州老窖	21,222,291.28	9.67
5	000848	承德露露	18,014,222.30	8.21
6	000423	东阿阿胶	17,591,628.49	8.02
7	600809	山西汾酒	17,199,375.01	7.84
8	000650	仁和药业	16,003,111.63	7.29
9	002557	洽洽食品	15,363,853.41	7.00
10	002254	泰和新材	14,105,870.16	6.43
11	002223	鱼跃医疗	13,299,656.67	6.06
12	600633	浙报传媒	13,166,421.92	6.00
13	600048	保利地产	11,818,272.89	5.39
14	002570	贝因美	11,260,951.78	5.13
15	600720	祁连山	10,312,604.77	4.70
16	603366	日出东方	10,158,425.64	4.63
17	002293	罗莱家纺	10,008,149.12	4.56
18	002327	富安娜	9,974,216.73	4.55
19	600535	天士力	9,575,705.37	4.36
20	601166	兴业银行	9,520,215.00	4.34
21	600016	民生银行	9,501,362.65	4.33
22	601688	华泰证券	9,444,969.77	4.30
23	002415	海康威视	9,442,232.58	4.30
24	600318	巢东股份	9,250,925.70	4.22
25	002142	宁波银行	9,141,314.35	4.17
26	600298	安琪酵母	8,390,269.85	3.82
27	002020	京新药业	8,310,917.81	3.79
28	000860	顺鑫农业	8,064,145.99	3.68
29	000430	张家界	8,051,077.53	3.67
30	600436	片仔癀	7,825,753.33	3.57
31	000596	古井贡酒	7,820,436.26	3.56
32	600340	华夏幸福	7,767,502.48	3.54
33	000100	TCL 集团	7,560,000.00	3.45
34	002255	海陆重工	7,461,474.01	3.40
35	600104	上汽集团	7,157,431.70	3.26
36	601233	桐昆股份	7,082,946.46	3.23
37	002296	辉煌科技	7,033,774.45	3.21
38	000538	云南白药	6,979,740.53	3.18
39	600073	上海梅林	6,615,818.05	3.02

40	002241	歌尔声学	6,486,386.98	2.96
41	600517	置信电气	6,482,311.30	2.95
42	002091	江苏国泰	6,472,490.72	2.95
43	600559	老白干酒	6,466,357.17	2.95
44	000024	招商地产	6,254,660.75	2.85
45	002146	荣盛发展	6,196,097.00	2.82
46	300256	星星科技	6,019,831.20	2.74
47	601318	中国平安	6,010,117.80	2.74
48	300074	华平股份	5,772,124.51	2.63
49	300228	富瑞特装	5,720,394.15	2.61
50	000800	一汽轿车	5,657,563.67	2.58
51	002450	康得新	5,603,471.90	2.55
52	300115	长盈精密	5,592,495.00	2.55
53	002353	杰瑞股份	5,363,739.26	2.44
54	600526	菲达环保	5,360,220.46	2.44
55	000661	长春高新	5,319,564.16	2.42
56	000961	中南建设	5,162,187.23	2.35
57	601918	国投新集	4,689,037.63	2.14
58	300037	新宙邦	4,573,694.31	2.08
59	002234	民和股份	4,550,933.88	2.07
60	600887	伊利股份	4,462,272.50	2.03
61	601009	南京银行	4,404,703.46	2.01

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	635,713,260.69
卖出股票收入（成交）总额	770,022,038.39

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	4,201,600.00	4.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	4,201,600.00	4.48

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	010107	21 国债(7)	40,000	4,201,600.00	4.48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 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：本基金本报告期末进行股指期货投资。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

按照基金契约，本基金未从事股指期货交易。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

云南白药股份有限公司于 2012 年 12 月 25 日公告：公司产品云南白药胶囊在四川泸州药检所抽检中被发现水分项不合格，公司已对相关产品进行召回，召回金额占公司上年度收入的万分之 1.19，公司公告其生产经营情况正常。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的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	215,452.75
2	应收证券清算款	18,197,278.80
3	应收股利	-
4	应收利息	72,751.23
5	应收申购款	9,310.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,494,793.45

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

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	600292	中电远达	5,746,000.00	6.13	重大事项停牌
2	600436	片仔癀	4,104,600.00	4.38	配股临时停牌

§ 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
2,898	32,348.98	31,269,195.29	33.35%	62,478,150.19	66.65%

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	1,152,730.57	1.2296%

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 50 万份至 100 万份(含)；本基金的基金经理持有本基金份额总量为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 7 月 29 日）基金份额总额	524,132,937.88
本报告期期初基金份额总额	227,461,831.54
本报告期基金总申购份额	7,909,713.47
减：本报告期基金总赎回份额	141,624,199.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	93,747,345.48

§ 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、2013 年 2 月 28 日在《证券时报》上刊登了《银河基金管理有限公司关于银河消费驱动股票型证券投资基金变更基金经理的公告》，刘风华女士不再担任本基金的基金经理。

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：

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

报告期内本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	376,763,882.18	26.86%	336,740.26	26.81%	-
中银国际	2	223,516,391.31	15.94%	197,790.15	15.75%	-
中信建投	1	172,374,997.07	12.29%	152,534.52	12.14%	-
国海证券	1	159,631,965.96	11.38%	141,258.67	11.25%	-
东北证券	1	136,745,981.63	9.75%	124,494.17	9.91%	-
宏源证券	1	96,094,254.25	6.85%	87,483.90	6.97%	-
浙商证券	1	70,435,615.38	5.02%	64,124.47	5.11%	-
兴业证券	2	59,446,732.04	4.24%	54,120.12	4.31%	-
银河证券	2	50,302,413.06	3.59%	45,795.35	3.65%	-
安信证券	3	27,280,294.86	1.95%	24,836.07	1.98%	-
国泰君安	2	9,434,668.54	0.67%	8,348.75	0.66%	-
瑞银证券	1	9,066,210.82	0.65%	8,253.89	0.66%	-
东兴证券	1	6,262,874.13	0.45%	5,542.07	0.44%	-
东方证券	1	2,910,619.98	0.21%	2,649.84	0.21%	-
海通证券	1	2,168,585.66	0.15%	1,974.34	0.16%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-

注：本期新增瑞银证券 1 个交易单元，中投证券 1 个交易单元。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	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	4,233,597.40	100.00%	5,000,000.00	11.11%	-	-
浙商证券	-	-	35,000,000.00	77.78%	-	-
兴业证券	-	-	5,000,000.00	11.11%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下基金对长期停牌的股票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	2013 年 1 月 5 日
2	关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价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	2013 年 1 月 22 日
3	银河消费驱动股票型证券投资基金 2012 年 4 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2013 年 1 月 22 日
4	银河基金管理有限公司关于银河消费驱动股票型证券投资基金变更基金经理的公告	《证券时报》、公司网站	2013 年 2 月 28 日
5	关于旗下基金对长期停牌的股票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	2013 年 3 月 5 日
6	银河消费驱动股票型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	2013 年 3 月 13 日

		报》、公司网站	
7	银河消费驱动股票型证券投资基金 2012 年年报摘要	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2013 年 3 月 29 日
8	银河基金管理有限公司关于参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行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	2013 年 3 月 29 日
9	关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价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	2013 年 4 月 9 日
10	银河消费驱动股票型证券投资基金 2013 年 1 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2013 年 4 月 19 日
11	银河基金管理有限公司关于调整上海家化股票估值的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2013 年 5 月 15 日
12	关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价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	2013 年 5 月 17 日
13	关于旗下基金对长期停牌的股票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	2013 年 5 月 28 日
14	银河基金管理有限公司关于在中信银行股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2013 年 5 月 29 日
15	银河基金管理有限公司关于调整网上直销定投旗下部分基金的最	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2013 年 6 月 6 日

	低金额的公告	报》、《证券日报》、 公司网站	
16	银河基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购的最低金额、追加投资的最低金额和最低持有份额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2013 年 6 月 6 日
17	银河基金管理有限公司关于中信银行股份有限公司直销账户银行账户信息变更的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站	2013 年 6 月 17 日
18	关于旗下基金持有的“九龙电力”股票估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站	2013 年 6 月 19 日
19	关于旗下基金持有的“新华医疗”股票估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站	2013 年 6 月 27 日
20	关于旗下基金持有的“中国重工”股票估值调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站	2013 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河消费驱动股票型证券投资基金的文件
- 2、《银河消费驱动股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河消费驱动股票型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、银河消费驱动股票型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

11.2 存放地点

上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼

11.3 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

2013 年 8 月 28 日