

银河沪深300价值指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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
基金合同生效日期:2011年8月27日

1.1 重要提示
基金管理人承诺:基金管理人承诺不以虚假记载、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法律责任。
基金管理人承诺:基金管理人承诺不以虚假记载、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法律责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:银河沪深300价值指数
基金代码:519671
基金简称:银河沪深300
基金合同生效日期:2011年8月27日

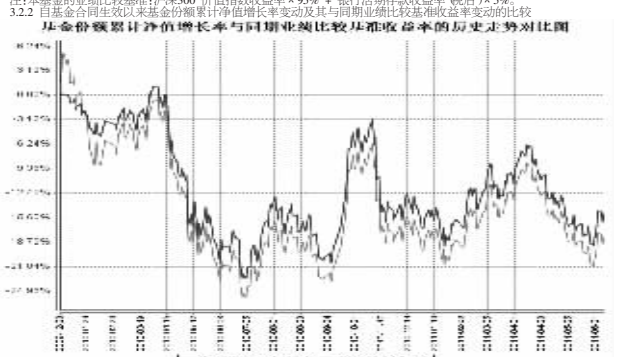
2.2 基金业绩比较基准
沪深300价格指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%
本基金为股票型指数基金,属于证券投资基金中高风险的品种,其预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人
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
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

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益: -8,799,876.84

3.1.2 期末数据和指标
报告期末(2011年6月30日)
期末基金份额净值: 1.074
期末基金资产净值: 716,214,568.85

3.2 基金业绩比较基准
沪深300价值指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%
本基金为股票型指数基金,属于证券投资基金中高风险的品种,其预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。



注:本基金合同约定,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约定,本基金合同约定的投资组合比例自基金合同生效之日起6个月内不受上述比例限制,但基金管理人应当在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约定。

4.1 基金管理人及基金托管人
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
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

4.2 基金业绩比较基准
沪深300价值指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%
本基金为股票型指数基金,属于证券投资基金中高风险的品种,其预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。

4.3 基金管理人及基金托管人
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
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

4.4 基金管理人及基金托管人
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
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

4.5 基金管理人及基金托管人
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
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

4.6 基金管理人及基金托管人
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
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

4.7 基金管理人及基金托管人
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
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

4.8 基金管理人及基金托管人
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
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

4.9 基金管理人及基金托管人
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
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

上述资产估值流程与方法之间无任何矛盾冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金资产估值调整的说明
本基金合同约定于2009年12月28日生效,根据基金合同约定,本基金收益每半年分配一次,半年分配比例不低于可供分配收益的90%。基金收益按合同约定的基金资产净值或每份基金份额净值扣除不高于0.5%的费用后,按照基金合同约定进行分配。

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况
报告期内,中国建设银行股份有限公司作为本基金的托管人,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,不存在有损基金份额持有人利益的行为,切实履行了托管人应尽的义务。

5.2 报告期内本基金管理人遵守情况
报告期内,银河基金管理有限公司作为本基金的基金管理人,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,不存在有损基金份额持有人利益的行为,切实履行了基金管理人应尽的义务。

6.1 资产负债表
截至2011年6月30日
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Assets, Liabilities, and Equity.

6.2 利润表
截至2011年6月30日
单位:人民币元
项目 本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Income Statement items like Interest Income, Investment Income, etc.

6.3 现金流量表
截至2011年6月30日
单位:人民币元
项目 本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Cash Flow items like Cash from Operations, Cash from Financing, etc.

6.4 所有者权益变动表
截至2011年6月30日
单位:人民币元
项目 本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Equity items like Net Assets, etc.

6.5 基金份额持有人户数及持有人数量
截至2011年6月30日
单位:人民币元
项目 本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Shareholder statistics like Total Shares, etc.

6.6 基金管理人及基金托管人
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
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

6.7 基金管理人及基金托管人
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
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

6.8 基金管理人及基金托管人
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
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

6.9 基金管理人及基金托管人
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
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

6.10 基金管理人及基金托管人
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
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

6.11 基金管理人及基金托管人
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
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

6.12 基金管理人及基金托管人
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
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

6.13 基金管理人及基金托管人
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
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

6.14 基金管理人及基金托管人
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
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

6.15 基金管理人及基金托管人
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
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

6.16 基金管理人及基金托管人
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
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

本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Assets, Liabilities, and Equity.

6.1 资产负债表
截至2011年6月30日
单位:人民币元
资产 负债和所有者权益

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Assets, Liabilities, and Equity.

6.2 利润表
截至2011年6月30日
单位:人民币元
项目 本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Income Statement items like Interest Income, Investment Income, etc.

6.3 现金流量表
截至2011年6月30日
单位:人民币元
项目 本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Cash Flow items like Cash from Operations, Cash from Financing, etc.

6.4 所有者权益变动表
截至2011年6月30日
单位:人民币元
项目 本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Equity items like Net Assets, etc.

6.5 基金份额持有人户数及持有人数量
截至2011年6月30日
单位:人民币元
项目 本期 上期

Table with 5 columns: Item, Current Period (2011.6.30), Previous Period (2010.12.31), Current Period, Previous Period. Rows include Shareholder statistics like Total Shares, etc.

6.6 基金管理人及基金托管人
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
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

6.7 基金管理人及基金托管人
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
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

6.8 基金管理人及基金托管人
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
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

6.9 基金管理人及基金托管人
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
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

6.10 基金管理人及基金托管人
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
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

6.11 基金管理人及基金托管人
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
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

6.12 基金管理人及基金托管人
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
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

6.13 基金管理人及基金托管人
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
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

6.14 基金管理人及基金托管人
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
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

6.15 基金管理人及基金托管人
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
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

6.16 基金管理人及基金托管人
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
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

6.17 基金管理人及基金托管人
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
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

6.18 基金管理人及基金托管人
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
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

6.19 基金管理人及基金托管人
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
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

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

Table with 6 columns: Stock Code, Stock Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 stocks held at the end of the period.

7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

Table with 6 columns: Stock Code, Stock Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 stocks held at the end of the period.

7.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资明细

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 5 bonds held at the end of the period.

7.4 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

单位:人民币元
363,667,839.07

7.4.1 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 bonds held at the end of the period.

7.4.2 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 bonds held at the end of the period.

7.4.3 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

单位:人民币元
194,382,915.49

7.5 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 bonds held at the end of the period.

7.6 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 bonds held at the end of the period.

7.7 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 bonds held at the end of the period.

7.8 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 bonds held at the end of the period.

7.9 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 bonds held at the end of the period.

7.10 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额

Table with 6 columns: Bond Code, Bond Name, Quantity, Fair Value, Proportion of Net Assets. Lists top 10 bonds held at the end of the period.

7.11 报告期内买入债券的成本及卖出债券的收入总额