银河行业优选股票型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012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:2012年8月23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2012年8月22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2012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

基金名称	银河行业优选股票型证券投资基金
基金简称	银河行业股票
基金主代码	519670
基金交易代码	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	1,871,513,500.51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	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。 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。 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。 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。
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	李立生	尹东
	联系电话	021-38568699	010-67595003
	电子邮箱	lilisheng@galaxyasset.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67595096
传真		021-38568568	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(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-97,044,777.51
本期利润	63,575,477.76
加权平均基金份额本期利润	0.0325
本期基金份额净值增长率	3.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0068
期末基金资产净值	1,858,700,013.90
期末基金份额净值	0.993

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)。

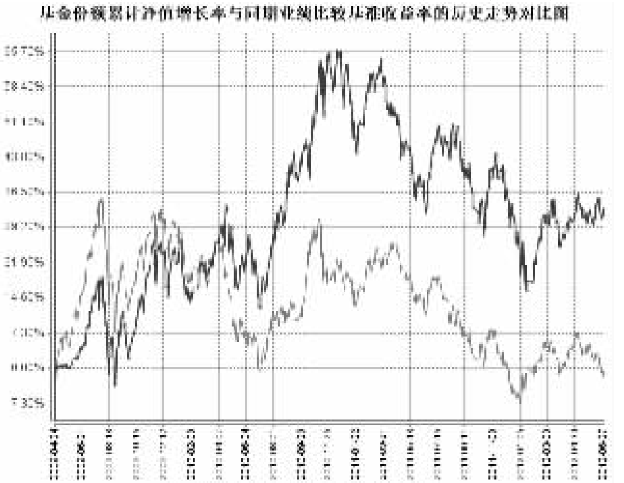
3.2 基金净值表现

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	0.30%	0.92%	-5.14%	0.87%	5.44%	0.05%
过去三个月	6.55%	0.86%	0.47%	0.90%	6.08%	-0.04%
过去六个月	3.76%	1.25%	4.47%	1.06%	-0.71%	0.19%
过去一年	-5.88%	1.22%	-14.66%	1.08%	8.78%	0.14%
过去三年	26.67%	1.43%	-15.41%	1.25%	42.08%	0.18%
自基金合同生效起至今	33.13%	1.39%	-0.62%	1.25%	33.75%	0.14%

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11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:契约型债券型

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。

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、股票投资部总监助理	2010年9月16日	-	7	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4月起担任股票投资部总监助理。

注:1、上表中任职日期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遵规守信情况的说明

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。

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易,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

上证指数在上半年先扬后抑呈现出振荡行情,期间市场热点切换频繁,风格变化较快。上半年上证指数上涨1.18%,上证指数波动区间在2132-2478点,深成指上涨6.52%,中小板和创业板指数分别上涨4.23%和下跌-0.39%。

从风格来看,一季度由于预期政策转向经济回暖,早周期行业表现较好,但之后实体经济和政策力度均不达预期,这类资产又出现了较大幅度的下跌,而中小盘个股开始跑赢主板指数,尤其是稳定成长、业绩预期明朗的白马股。行业方面表现最好的包括具有政策向好预期的房地产、受益于金融创新的非银行金融、稳定成长的医药、餐饮旅游和食品饮料,其它如公用事业、苹果和安防产业链等也涨幅居前;而表现较差的行业包括通讯、电力设备、软件、建材、银行等。同时由于新入市资金有限,未出现资金推动行情,版块和行业内个股分化差异巨大。由于我们本身对经济情况的判断比较谨慎,因此整体仓位保持在中等水平,持仓结构以软件、食品饮料、医药、通信等相对稳定成长、受经济波动影响小的行业为主,并辅以业务稳健的低估值大盘蓝筹。与年初相比,报告期内增加了火电、软件、大盘蓝筹的配置,但下调了部分估值偏高的白马成长股的仓位。本季度资产配置思路符合市场方向,但有部分重仓行业和股票基本面情况弱于预期,拖累了净值表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012年上半年银河行业优选基金业绩比较基准收益率为4.47%,银河行业优选基金净值收益率为3.76%,业绩低于基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看经济情况依然较差,剔除金融行业A股上市公司盈利下滑远超市场预期,全年盈利有比较大的下调空间。从政策来看,通胀回落后政策弹性空间加大,但由于前期大规模基建投资带来的不良后果已经被充分认识,且政府的资产负债率和现金流情况同比08年有较大程度恶化,未来的刺激政策将弱于“四万亿投资”阶段,将以精细化和结构性为主,或导致经济逐步探底,但难有明显回升。目前市场估值也处于历史底部,向下的空间并不大。股票相对其它大类资产已经具备配置价值,因此市场结构分化严重,预期良好的优质成长股表现优异,不少股票创了历史新高,但大盘中轴持续下移,不少行业创出历史新低。在此背景下,我们预计估值合理、代表未来转型方向的优质成长股仍将战胜市场。

投资策略方面,3季度的股票仓位依然保持中性,核心配置上软件、食品饮料、医药、保险等行业,仍然积极寻找优质成长股的投资机会,同时配置部分稳健的大盘蓝筹股来对抗市场风险,然后根据经济和政策的情况,阶段性会增持地产等具有政策预期的行业来增加组合弹性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、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半年度报告中的财务指标、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:2012年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	83,597,948.42	138,332,322.52
结算备付金		3,056,266.72	5,002,964.99
存出保证金		700,577.43	1,075,554.31
交易性金融资产	6.4.7.2	1,727,698,578.24	1,763,398,109.42
其中:股票投资		1,627,538,578.24	1,683,120,109.42
基金投资		-	-
债券投资		100,160,000.00	80,278,000.00
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	50,000,275.00	100,000,470.00
应收证券清算款		1,556,050.35	14,532.77
应收利息	6.4.7.5	1,525,207.30	996,691.37
应收股利		323,977.37	-
应收申购款		488,820.99	7,335,634.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,868,947,701.82	2,016,156,280.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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		4,668,610.10	16,255,088.49
应付赎回款		1,038,482.31	1,691,207.54
应付管理人报酬		2,269,086.24	2,645,159.45
应付托管费		378,181.03	440,859.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,681,176.95	2,219,837.04
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	212,151.29	416,090.84
负债合计		10,247,687.92	23,668,243.28
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,871,513,500.51	2,082,741,796.22
未分配利润	6.4.7.10	-12,813,486.61	-90,253,759.32
所有者权益合计		1,858,700,013.90	1,992,488,036.90
负债和所有者权益总计		1,868,947,701.82	2,016,156,280.18

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.993元,基金份额总额1,871,513,500.51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:2012年1月1日 至 2012年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入		87,214,493.23	-279,820,376.48
1.利息收入		3,649,925.45	1,969,731.99
其中:存款利息收入	6.4.7.11	652,741.15	1,236,378.24
债券利息收入		1,876,918.16	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,120,266.14	733,353.75
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-77,404,125.80	-149,945,732.05
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-87,862,034.47	-157,953,148.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	10,457,908.67	8,007,416.72
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	160,620,255.27	-133,041,229.78
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	348,438.31	1,196,853.36
减:二、费用		23,639,015.47	31,789,536.90
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	14,035,437.11	16,880,612.20
2.托管费	6.4.10.2.2	2,339,239.46	2,813,435.35
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	7,032,320.44	11,858,212.30
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	232,018.46	237,277.05
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		63,575,477.76	-311,609,913.38
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		63,575,477.76	-311,609,913.38

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:2012年1月1日 至 2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	1,183,927,908.80	500,103,935.80	1,684,031,844.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-311,609,913.38	-311,609,913.38
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)	993,966,574.53	224,207,522.27	1,218,174,096.80
其中:1.基金申购款	1,841,794,002.44	340,203,727.83	2,181,997,730.27
2.基金赎回款	-847,827,427.91	-115,996,205.56	-963,823,633.47
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)	-	-292,454,687.76	-292,454,687.76
五、期末所有者权益(基金净值)	2,177,894,483.33	120,246,856.93	2,298,141,340.26

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______　　　　______陈勇______　　　　____董伯儒____
基金管理公司负责人　　　　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2012年6月30日的财务状况以及自2012年1月1日至2012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、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

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	同受基金管理人控股股东控制、基金代销机构
银河金融控股有限责任公司	基金管理人的第一大股东

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	1,252,595,291.44	27.25%	2,725,239,968.56	33.71%

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
-	-	-	-	-

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
-	-	-	-	-

6.4.8.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
-	-	-	-	-

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 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%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	2,237,912.30	33.45%	826,635.31	31.03%

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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,035,437.11	16,880,612.20
其中:支付销售机构的客户维护费	1,198,276.36	2,013,718.16

注:1.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×1.50%/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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,339,239.46	2,813,435.35

注:1. 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×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

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、休息日或不可抗力,支付日期顺延。

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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	119,952,000.00	8,200.23	-	-

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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	0.53%	0.46%

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
银河金融控股有限责任公司	10,947,992.70	0.58%	10,947,992.70	0.53%

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	83,597,948.42	605,642.05	181,239,304.42	1,175,461.52

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(2012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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603000	人民网	2012年4月20日	2012年7月27日	新股流通受限	20.00	41.03	133,245	2,664,900.00	5,467,042.35	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:截至本报告期末,本基金未持有暂时停牌的流通受限证券。

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2012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2012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	1,627,538,578.24	87.08
	其中:股票	1,627,538,578.24	87.08
2	固定收益投资	100,160,000.00	5.36
	其中:债券	100,160,000.00	5.36
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,275.00	2.68
	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	86,654,215.14	4.64
6	其他各项资产	4,594,633.44	0.25
7	合计	1,868,947,701.82	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	8,915,017.83	0.48
B	采掘业	-	-
C	制造业	662,395,342.37	35.64
C0	食品、饮料	159,599,467.20	8.59
C1	纺织、服装、皮毛	8,098,000.00	0.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	42,519,335.27	2.29
C5	电子	126,733,354.88	6.82
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	245,490,350.48	13.21
C8	医药、生物制品	79,954,834.54	4.30
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	38,700,509.55	2.08
E	建筑业	56,810,000.00	3.06
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	624,967,936.81	33.62
H	批发和零售贸易	44,980,000.00	2.42
I	金融、保险业	107,056,000.00	5.76
J	房地产业	11,770,173.90	0.63
K	社会服务业	66,476,555.43	3.58
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,467,042.35	0.29
	合计	1,627,538,578.24	87.56

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	600570	恒生电子	10,500,021	144,060,288.12	7.75
2	000063	中兴通讯	10,000,000	139,600,000.00	7.51
3	300253	卫宁软件	4,600,000	100,694,000.00	5.42
4	600809	山西汾酒	2,499,972	94,223,944.68	5.07
5	601318	中国平安	2,000,000	91,480,000.00	4.92
6	600741	华域汽车	8,000,000	71,760,000.00	3.86
7	601669	中国水电	13,000,000	56,810,000.00	3.06
8	002152	广电运通	3,300,091	54,451,501.50	2.93
9	300075	数字政通	2,000,041	46,000,943.00	2.47
10	600011	华能国际	6,000,079	38,700,509.55	2.08

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	601318	中国平安	127,626,064.93	6.41
2	600809	山西汾酒	89,056,471.25	4.47
3	600570	恒生电子	84,592,844.94	4.25
4	000063	中兴通讯	83,768,020.89	4.20
5	600518	康美药业	74,398,962.30	3.73
6	600519	贵州茅台	61,879,917.73	3.11
7	000069	华侨城A	61,371,322.67	3.08
8	600694	大商股份	59,142,574.21	2.97
9	601166	兴业银行	53,984,731.39	2.71
10	601628	中国人寿	44,372,687.64	2.23
11	600741	华域汽车	44,299,087.15	2.22
12	600079	人福医药	44,161,580.34	2.22
13	300075	数字政通	43,437,183.09	2.18
14	601669	中国水电	39,773,653.70	2.00
15	600011	华能国际	37,065,578.64	1.86
16	300253	卫宁软件	35,685,041.15	1.79
17	002024	苏宁电器	32,531,975.85	1.63
18	600219	南山铝业	32,297,810.59	1.62
19	300059	东方财富	32,186,941.79	1.62
20	000651	格力电器	31,510,640.01	1.58

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	000596	古井贡酒	96,512,159.21	4.84
2	000063	中兴通讯	91,208,231.63	4.58
3	000568	泸州老窖	88,067,000.13	4.42
4	300048	合康变频	86,245,370.12	4.33
5	002400	省广股份	72,883,044.78	3.66
6	600694	大商股份	62,523,706.07	3.14
7	600079	人福医药	62,322,122.64	3.13
8	600518	康美药业	61,957,554.53	3.11
9	002123	荣信股份	61,169,559.66	3.07
10	000423	东阿阿胶	59,766,412.50	3.00
11	002025	航天电器	56,000,682.03	2.81
12	300146	汤臣倍健	54,083,591.44	2.71
13	002230	科大讯飞	52,596,729.40	2.64
14	601318	中国平安	51,737,009.76	2.60
15	601628	中国人寿	47,511,647.33	2.38
16	600741	华域汽车	43,335,122.02	2.17
17	300059	东方财富	43,272,105.39	2.17
18	002055	得润电子	40,630,015.50	2.04
19	002115	三维通信	36,153,672.17	1.81
20	300174	元力股份	34,736,756.38	1.74

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	2,235,312,472.89
卖出股票收入(成交)总额	2,363,756,224.87

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	100,160,000.00	5.39
	其中:政策性金融债	100,160,000.00	5.39
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	100,160,000.00	5.39

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

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	110239	11国开39	600,000	60,012,000.00	3.23
2	120405	12农发05	200,000	20,094,000.00	1.08
3	110249	11国开49	200,000	20,054,000.00	1.08

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 投资组合报告附注

7.9.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.9.2

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。

7.9.3 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	700,577.43
2	应收证券清算款	1,556,050.35
3	应收股利	323,977.37
4	应收利息	1,525,207.30
5	应收申购款	488,820.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,594,633.44

7.9.4 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。

7.9.5 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
63,101	29,659.01	493,717,940.74	26.38%	1,377,795,559.77	73.62%

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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	360,273.87	0.02%

注:截止2012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	2,082,741,796.22
本报告期基金总申购份额	116,081,715.54
减:本报告期基金总赎回份额	327,310,011.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,871,513,500.51

§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无重大人事变动。
二、报告期内基金托管人发生如下重大变动:
报告期内基金托管人无重大人事变动。

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	
银河证券	2	1,252,595,291.44	27.25%	1,034,901.77	27.07%	-
兴业证券	2	758,541,083.21	16.50%	649,205.47	16.98%	-
申银万国	1	686,482,963.81	14.94%	561,306.01	14.68%	-
中信证券	1	399,907,554.93	8.70%	339,920.54	8.89%	-
东兴证券	1	337,604,792.31	7.34%	274,305.99	7.17%	-
广发证券	1	308,349,062.21	6.71%	254,605.05	6.66%	-
国信证券	1	301,934,777.86	6.57%	256,644.14	6.71%	-
安信证券	3	221,098,083.58	4.81%	179,643.49	4.70%	-
国金证券	1	182,993,422.04	3.98%	148,682.96	3.89%	-
民生证券	1	95,991,321.71	2.09%	81,353.25	2.13%	-
国泰君安	2	40,021,980.99	0.87%	34,018.49	0.89%	-
中银国际	2	10,883,463.67	0.24%	8,842.87	0.23%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注:1.本期新增兴业证券,国金证券,国海证券,海通证券,宏源证券各一个交易单元。

2.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
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

银河基金管理有限公司
2012年8月23日