银河银泰理财分红证券投资基金

2013 第二季度 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河银泰混合
交易代码	150103
前端交易代码	–
后端交易代码	–
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
报告期末基金份额总额	2,423,795,114.47份
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。
投资策略	1.资产配置策略 本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求因素等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产间的投资比例,确定风格资产、行业资产的投资比例布局。 2.股票投资策略 本基金将在投资风险控制计划的指导下,获取股票市场投资的较高收益,本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经评估或预期认为具有可持续发展能力的价值型股票和成长型股票,同时兼顾较高的流动性要求。 3.债券投资策略 根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合判断,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的回报。
业绩比较基准	上证A股指数×40%+中信全债指数×55%+金融同业存款利率×5%。
风险收益特征	本基金属于风险较低的投资品种,风险–收益水平介于债券基金与股票基金之间
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日 – 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	149,755,503.16
2.本期利润	–17,953,098.13
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0072
4.期末基金资产净值	2,517,318,722.74
5.期末基金份额净值	1.0386

注: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。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	–0.95%	1.30%	–4.17%	0.50%	3.22%	0.80%

注:本基金的业绩比较基准为:上证A股指数×40%+中信全债指数×55%+金融同业存款利率×5%,每日进行再平衡过程。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:2004年3月30日本基金成立,根据《银河银泰理财分红证券投资基金基金合同》规定,本基金应自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截止本报告期末,本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张杨	银河银泰理财分红证券投资基金的基金经理	2011年10月10日	–	9	硕士研究生学历,CFA三级证书,曾先后就职于上海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司,从事宏观经济及股票策略研究工作。2008年9月加入银河基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理等职务。

注:1.上表中任职、离任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 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上证指数在2季度持续回落,市场情绪由谨慎转向悲观,从趋势上看,A股创下了自5年的新底,对于整体经济去杠杆的预期得到提升。2季度上证指数下跌12.39%,上证指数波动区间在1849–2334点。深成指下跌15.69%,中小板和创业板分别下跌4.83%和13.65%。

行业方面,2季度整体涨幅较大的是信息服务、电子等行业,钢铁、煤炭等行业表现最差。市场风格延续了1季度,成长类和消费类中小型公司明显优于金融等权重类公司。

对于3季度的市场趋势,我们认为市场将宽幅震荡,其一在于经济向下趋势只是达到一个较弱的反弹,实际上能否稳定存在较大的不确定性,其二在于市场对于政策主动收缩的预期较强,本届宏观管理的动向值得我们关注,如果出现强烈的去杠杆政策,市场不容乐观。我们仍然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。

3季度主要行业配置思路:(1)重点持有食品饮料、医疗保健、化妆品等具备稳定业绩并符合消费升级方向的板块,具体关注医疗器械、营养保健、中药、快速消费品等细分子领域;(2)配置符合政策导向的天然气行业、环保和文化传媒行业等。

投资策略方面,我们2013年2季度末的股票仓位为77%,较季度初有所提升。在行业配置上仍偏向于原有的食品、医药、日用化学等传统消费股,进一步增持了医药、环保、能源机械等。个股方面则依然维持具有长期成长潜力个股的投资比重。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年2季度银泰基金净值收益率为–0.95%,银泰基金业绩比较基准收益率为–4.17%,跑赢业绩基准。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,944,890,423.00	72.94
	其中:股票	1,944,890,423.00	72.94
2	固定收益投资	685,012,160.10	25.69
	其中:债券	685,012,160.10	25.69
	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	23,152,598.97	0.87
6	其他资产	13,363,913.04	0.50
7	合计	2,666,419,095.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	53,292,928.36	2.12
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,275,707,889.13	50.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,037,163.42	4.81
E	建筑业	86,236,261.12	3.43
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	97,291,266.85	3.86
J	金融业	23,475,549.04	0.93
K	房地产业	34,654,532.46	1.38
L	租赁和商务服务业	33,514,290.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	51,334,620.22	2.04
N	水利、环境和公共设施管理业	140,731,801.20	5.59
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	27,614,121.20	1.10
S	综合	–	–
	合计	1,944,890,423.00	77.26

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002353	杰瑞股份	2,531,234	174,655,146.00	6.94
2	000848	承德露露	5,999,900	136,257,729.00	5.41
3	600315	上海家化	2,790,000	125,522,100.00	4.99
4	600292	九龙电力	6,271,543	105,989,076.70	4.21
5	000826	桑德环境	3,083,865	99,516,323.55	3.95
6	600518	康美药业	4,462,123	85,806,625.29	3.41
7	600594	益佰制药	2,694,321	83,281,462.11	3.31
8	600389	江山股份	2,195,894	74,748,231.76	2.97
9	600597	光明乳业	5,393,757	72,761,781.93	2.89
10	000538	云南白药	809,945	68,043,479.45	2.70

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	286,329,753.60	11.37
2	央行票据	249,765,000.00	9.92
3	金融债券	100,195,000.00	3.98
	其中:政策性金融债	100,195,000.00	3.98
4	企业债券	36,063,856.00	1.43
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	10,144,000.00	0.40
7	可转债	2,514,550.50	0.10
8	其他	–	–
9	合计	685,012,160.10	27.21

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010308	03国债(8)	804,600	80,379,540.00	3.19
2	1101032	11央票32	600,000	60,150,000.00	2.39
3	019217	12国债17	500,000	50,105,000.00	1.99
4	019113	11国债13	500,000	50,025,000.00	1.99
5	019303	13国债03	500,000	49,950,000.00	1.98

5.6 报告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

5.7 报告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

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金依据基金合同未进行股指期货投资。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金依据基金合同未进行股指期货投资。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,496,495.73
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	29,776.80
4	应收利息	11,346,640.51
5	应收申购款	491,000.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	13,363,913.04

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券

5.9.5 报告期末前十名股票中在在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600292	九龙电力	105,989,076.70	4.21	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,585,212,473.88
本报告期基金总申购份额	16,023,342.63
减:本报告期基金总赎回份额	177,440,702.04
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	2,423,795,114.47

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立银河银泰理财分红证券投资基金的文件

2.《银河银泰理财分红证券投资基金基金合同》

3.《银河银泰理财分红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.银河银泰理财分红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

7.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦15楼

7.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人营业时间内免费查阅,也可通过本基金管理人网站(http://www.galaxyasset.com)查阅;在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件。

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

银河基金管理有限公司
2013年7月17日

银河行业优选股票型证券投资基金

2013 第二季度 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
报告送出日期:2013年7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河行业股票
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
报告期末基金份额总额	1,411,757,872.60份
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、息券选择策略、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。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日 – 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	82,465,047.59
2.本期利润	121,712,059.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0825
4.期末基金资产净值	1,634,319,782.48
5.期末基金份额净值	1.158

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	7.52%	1.71%	–9.32%	1.16%	16.84%	0.55%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:1、本基金合同于2009年4月24日生效。

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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	–	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。

注:1、上表中任职、离任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 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,同时一季度较为宽松的流动性环境难以维持,从而判断二季度的指数难以再取得正收益。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。考虑到面临供给和解禁压力,整体市场的估值有压力。

因此二季度仓位上较一季度保守,但由于对新兴经济的基本面乐观,故仓位上倾向于这些领域,总体上比市场上股票型基金的平均值略高,从行业配置看,维持并适当增加了新兴经济板块、并下调了周期类配置。本季度个股集中度有所加强,在个股跟踪上更加加强,适当降低了近期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。未来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,继续加强对行业和公司的研究和理解,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年二季度本基金收益率为7.52%,比较基准收益率为–9.32%,大幅跑赢基准。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	其他资产	37,816,505.36	2.30
7	合计	1,642,729,393.12	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	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

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	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

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金不能投资股指期货,因此不存在需要披露的信息.

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

依照基金合同,未对股指期货进行投资

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
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

5.9.4 报告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。

5.9.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,527,154,448.45
本报告期基金总申购份额	140,383,708.62
减:本报告期基金总赎回份额	255,780,284.47
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	1,411,757,872.60

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准设立银河行业优选股票型证券投资基金的文件

2.《银河行业优选股票型证券投资基金基金合同》

3.《银河行业优选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. 银河行业优选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

8.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦15楼

8.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人营业时间内免费查阅,也可通过本基金管理人网站(http://www.galaxyasset.com)查阅;在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件。

银河基金管理有限公司
2013年7月17日

银河银信添利债券型证券投资基金

2013 第二季度 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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2013年7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年07月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河银信添利债券
交易代码	519666
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
报告期末基金份额总额	1,238,482,475.48份
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。
投资策略	通过合理的债券资产配置,综合运用利率预期、收益率曲线和其他动态增强策略特别是新股申购等,获取稳定收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×80%+税后一年期定期存款利率×20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,以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为基金的投资目标,本基金还可以通过参与新股申购提高基金的收益水平,本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和收益水平高于货币市场基金和中短期债券基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	银河银信添利债券A / 银河银信添利债券B
下属两级基金的交易代码	519667 / 519666
下属两级基金的前端交易代码	– / –
下属两级基金的后端交易代码	– / –
报告期末下属两级基金的份额总额	1,092,