银河银信添利债券型证券投资基金

2013 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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月26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	银河银信添利债券	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	1,238,482,475.48份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	–	
上市日期	–	
下属分级基金的基金简称:	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
下属分级基金的交易代码:	519667	519666
下属分级基金的前端交易代码	–	–
下属分级基金的后端交易代码	–	–
报告期末下属分级基金的份额总额	1,092,481,063.90份	146,001,411.58份

2.2 基金产品说明

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。	
	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
下属分级基金的风险收益特征	–	–

注:为提高银河银信添利债券型证券投资基金(以下简称"本基金")的业绩与业绩比较基准的可比性和增强基金业绩评价的透明性,本公司决定自2013年1月21日起,将本基金的业绩比较基准由"新华巴克莱资本中国全债指数涨跌幅*80%+税后一年期定期存款利率*20%"(原名为新华雷曼中国全债指数涨跌幅*80%+税后一年期定期存款利率*20%,2008年11月7日起新华雷曼中国全债指数更名为新华巴克莱资本中国全债指数),变更为"中证全债指数收益率×80%+税后一年期定期存款利率×20%"。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	朱义明
	联系电话	021-38568881	010-65556899
	电子邮箱	chenyong@galaxyasset.com	zhuyiming@citicbank.com
客户服务电话		400-820-0860	95558
传真		021-38568880	010-65550832

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、北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座

§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

基金级别	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
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)	报告期(2013年1月1日 – 2013年6月30日)
本期已实现收益	21,601,994.07	3,260,922.99
本期利润	23,550,106.87	4,256,247.06
加权平均基金份额本期利润	0.0267	0.0302
本期基金份额净值增长率	3.31%	3.11%
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	0.0273	0.0250
期末基金资产净值	1,122,253,755.88	149,646,304.93
期末基金份额净值	1.0273	1.0250

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、所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(基金于2008年5月23日进行分级)。

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。

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

银河银信添利债券A

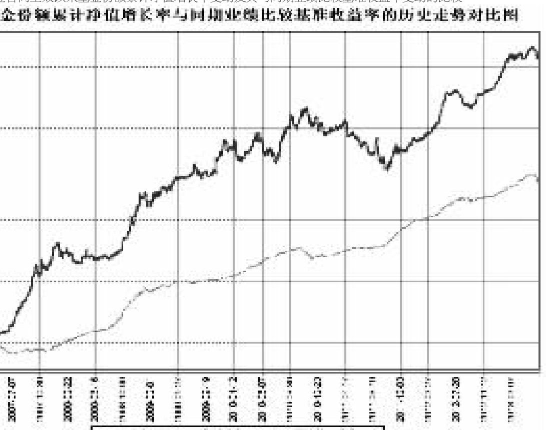
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.52%	0.15%	-0.26%	0.13%	-0.26%	0.02%
过去三个月	0.52%	0.11%	0.94%	0.08%	-0.42%	0.03%
过去六个月	3.31%	0.12%	2.16%	0.06%	1.15%	0.06%
过去一年	4.44%	0.10%	3.32%	0.06%	1.12%	0.04%
过去三年	12.63%	0.18%	10.42%	0.05%	2.21%	0.13%
自基金合同生效起至今	42.85%	0.20%	24.54%	0.05%	18.31%	0.15%

银河银信添利债券B

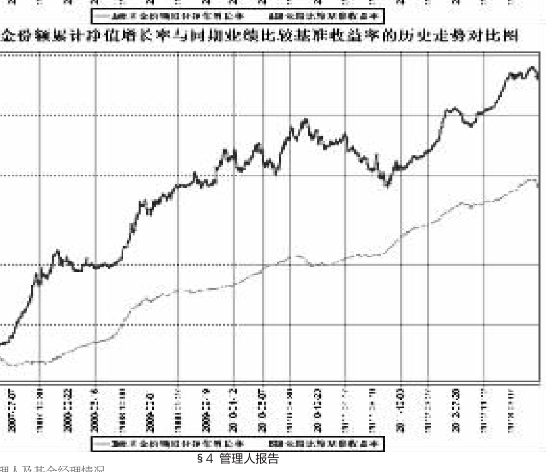
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.55%	0.15%	-0.26%	0.13%	-0.29%	0.02%
过去三个月	0.41%	0.11%	0.94%	0.08%	-0.53%	0.03%
过去六个月	3.11%	0.12%	2.16%	0.06%	0.95%	0.06%
过去一年	4.03%	0.10%	3.32%	0.06%	0.71%	0.04%
过去三年	11.26%	0.18%	10.42%	0.05%	0.84%	0.13%
自基金合同生效起至今	39.92%	0.20%	24.54%	0.05%	15.38%	0.15%

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

A级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



B级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



§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。

6、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。

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		
韩晶	银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理、银河领先债券型证券投资基金的基金经理	2011年8月25日	–	11	中共党员,经济学硕士。曾就职于中国民族证券有限责任公司,期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。2008年6月加入银河基金管理有限公司,从事固定收益产品研究工作,历任债券经理助理、债券经理等职务,2010年1月至2013年3月担任银河收益证券投资基金的基金经理,2012年11月起兼任银河领先债券型证券投资基金的基金经理。

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》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,本报告期内,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 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

银信添利基金报告期内基于对全年经济基本面中性的看法,以及上半年通胀水平可控的形势判断,在去年年底集中增配中长久期信用品种的基础上,今年投资策略向风险偏好的两端倾斜,在激进端重点关注可转债的配置价值与波段操作机会,在保守端以增加短期融资券的配置来平衡组合的久期,控制组合的风险。

从最终的运作效果来看,银信添利基金在投资收益方面较好地享受了信用债中长端品种上半年上涨的行情。为保持组合杠杆、平衡组合久期而增配的短期限品种受六月异常的资金紧张局面的影响,对组合贡献要大幅低于预期。转债投资较好地把握了个别券种主题投资的机会,因市场对经济基本面预期波动较大,基金在对转债品种波段操作方面兼有得失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年上半年,银信添利基金A期内净值增长率为3.31%,银信添利基金B期内净值增长率为3.11%,比较基准为2.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年全球新兴市场或将面临资本持续外流的冲击。从美国房地产市场加速复苏以及消费者信心指数频超预期来看,在目前全球主要经济体中,预期比较明确,增长比较稳定的非美国莫属。而欧元区经济虽然在二季度出现边际改善的情况,但中期看区内各国经济和就业改善的困局仍难以有效解颜。欧元区经济是"短多长空"。日本量化宽松或造成日元持续贬值,这将对我国出口贸易造成压力。中国作为主要新兴经济体,经济增速持续下滑,也重挫全球市场信心,因此在这样一种环境下,全球资本加速回流美国,对赌美联储QE政策的退出,推动美元升值,将成为一种趋势。这对国内未来的资金流动性造成了一定的压力。

我们预期在外部环境的影响下,政府在前期主动风险调控的基础上,或将在下半年出台一些稳定经济的措施。考虑到政府对经济增速容忍度的提高,稳定经济的目标将是避免经济出现大幅下滑的情形,而绝非要刺激经济超常表现。从目前银行表外业务受到监控和总理"激活信贷存量"的表述来看,政府意在金融去杠杆化,限制新增信贷增长,提高信贷质量,扭转资源错配。因此银行短期造血功能受限,社会融资总量将更多依托直接融资手段和其它金融创新手段(资产证券化),社融增速将有所下降,但应能保持在既定目标水平,否则稳定经济预期将成为空谈。

因此我们认为政府出台的措施未来将会体现在以下几方面:一是可能开放放行地方政府较为优质的融资平台发债,确保一些符合国家战略、惠及民生的项目优先开工建设,通过基建投资来托底经济;二是可能会在货币政策方面有所松动,在目前经济增长水平不断下降的条件下,短期面临的通缩风险要大于通胀,货币政策不需要过紧。在合理控制和引导融资投向的基础上,切实降低中小企业的融资成本是激活内需的必要条件。我们认为在目前通胀可控的局势下,不排除央行在遇到资本外流大幅冲击下而采取降准措施应对的可能性。

我们判断下半年债券市场资金面不会再现六月的紧张态势,但在资本外流的影响下,预计三季度融资成本中枢将会回落至3.5-4%的水平,这一水平要高于上半年平均水平。若考虑到新股IPO最终在三季度开闸因素的话,融资平均成本中枢或将保持在4%以上的水平。在债券一级发行市场整顿期过后,企业债发行有望增速,使得市场未来面临一定的供给压力。市场对六月资金紧张的局势仍心有余悸,未来会对资金面的变化较为敏感,在融资成本回升的形势下,市场在下半年整体面临去杠杆的压力。近期信用债"撤销评级"和"下调评级"事件增多,信用风险逐渐显现,在目前利差偏低以及流动性偏紧的环境下,有可能会促使市场风险偏好发生转移。我们并不担心政府债务的违约风险,但年底或将面临的估值风险对市场有很大的压力。

今年经济总体来讲是弱势维持的格局,目前来看年底经济形势转弱的可能性微弱,转债市场系统性上涨机会不大,宜以波段操作为主,围绕个别品种高抛低吸是加强组合收益的有效办法。

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

根据法律法规以及《基金合同》的约定,本基金在满足法律、法规规定的基金分红条件且每份基金份额可分配收益超过0.001元的前提下,本基金每季度至少分配收益一次,每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%。本基金截至2012年12月31日,A类可分配收益为18,132,625.76元,B类可分配收益为3,257,283.65元,2013年1月17日进行利润分配,A类每单位分配收益0.014元,B类每单位分配收益0.012元,超过可分配收益的50%。本基金截至2013年3月31日,A类可分配收益为32,625,840.57元,B类可分配收益为5,038,873.41元,4月17日进行利润分配,A类每单位分配收益0.019元,B类每单位分配收益0.018元,超过可分配收益的50%。

§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

自2007年03月14日银河银信添利债券型证券投资基金成立以来,作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求,对基金管理人银河基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期进行了2次分红,经本托管人复核,符合合同相关要求,不存在损害持有人利益的情况。

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

由银河银信添利债券型证券投资基金管理人银河基金管理有限责任公司编制,并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§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:银河银信添利债券型证券投资基金
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		3,203,736.65	1,944,774.63
结算备付金		17,679,989.05	2,308,561.25
存出保证金		54,311.19	250,000.00
交易性金融资产		1,624,584,337.42	1,284,954,307.40
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		1,624,584,337.42	1,284,954,307.40
资产支持证券投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		–	–
应收证券清算款		–	2,182.51
应收利息		36,835,237.68	17,284,033.94
应收股利		–	–
应收申购款		1,014,624.88	61,630.05
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,683,372,236.87	1,306,805,489.78
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		403,499,980.80	462,958,600.06
应付证券清算款		2,483,710.87	–
应付赎回款		19,029.38	94,734.31
应付管理人报酬		685,540.77	472,264.13
应付托管费		210,935.61	145,312.01
应付销售服务费		50,190.48	48,781.96
应付交易费用		4,780.00	12,078.86
应交税费		3,813,890.54	3,087,110.52
应付利息		279,549.36	256,308.96
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		424,568.25	581,044.65
负债合计		411,472,176.06	467,656,235.46
所有者权益:			
实收基金		1,238,482,475.48	817,759,344.91
未分配利润		33,417,585.33	21,389,909.41
所有者权益合计		1,271,900,060.81	839,149,254.32
负债和所有者权益总计		1,683,372,236.87	1,306,805,489.78

注:报告截止日2013年06月30日,基金份额总额1,238,482,475.48份,其中银河银信添利债券型A基金份额净值1.0273元,基金份额总额1,092,481,063.90份;银河银信添利债券型B基金份额净值1.0250元,基金份额总额146,001,411.58份。

6.2 利润表

会计主体:银河银信添利债券型证券投资基金
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		40,371,661.35	25,091,651.59
1.利息收入		32,345,127.40	8,785,369.59
其中:存款利息收入		164,289.52	52,520.65
债券利息收入		32,173,357.07	8,727,005.23
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		7,480.81	5,843.71
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		5,046,873.54	865,135.50
其中:股票投资收益		–	340,734.64
基金投资收益		–	–
债券投资收益		5,046,873.54	524,400.86
资产支持证券投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		–	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		2,943,436.87	15,380,637.15
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		36,223.54	60,509.35
减:二、费用		12,565,307.42	2,983,048.16
1.管理人报酬		3,385,487.58	1,058,376.51
2.托管费		1,041,688.54	325,654.32
3.销售服务费		288,272.90	322,957.30
4.交易费用		5,591.72	8,885.84
5.利息支出		7,642,367.28	1,077,034.94
其中:卖出回购金融资产支出		7,642,367.28	1,077,034.94
6.其他费用		201,899.40	190,139.25
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		27,806,353.93	22,108,603.43
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		27,806,353.93	22,108,603.43

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银河银信添利债券型证券投资基金
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)	817,759,344.91	21,389,909.41	839,149,254.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	27,806,353.93	27,806,353.93
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)	420,723,130.57	16,068,556.78	436,791,687.35
其中:1.基金申购款	634,565,546.24	22,810,404.12	657,375,950.36
2.基金赎回款	-213,842,415.67	-6,741,847.34	-220,584,263.01
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)	–	-31,847,234.79	-31,847,234.79
五、期末所有者权益(基金净值)	1,238,482,475.48	33,417,585.33	1,271,900,060.81

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)	240,645,560.35	-5,477,886.11	235,167,674.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	22,108,603.43	22,108,603.43
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)	296,216,599.73	4,489,939.17	300,706,538.90
其中:1.基金申购款	404,180,678.34	4,097,103.79	408,277,782.13
2.基金赎回款	-107,964,078.61	392,835.38	-107,571,243.23
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)	536,862,160.08	21,120,656.49	557,982,816.57

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

银河银信添利债券型证券投资基金(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")证监基金字[2007]14号文《关于同意银河银信添利债券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2007年3月14日正式生效,首次设立募集规模为2,450,672,675.34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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《银河基金管理有限公司关于银河银信添利债券型证券投资基金份额分类及费率调整的公告》,本基金于2008年5月23日开始实施分级,分级后本基金设两级基金:A级基金份额和B级基金份额。投资者申购A级基金时收取申购费,投资者申购B级基金时不收取申购费,而从B级基金资产中计提销售服务费。

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、次级债、企业债、可转换公司债券、央行票据、短期融资券、资产支持证券、回购和银行定期存单等,以及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具,债券类资产投资不低于基金资产的80%。为提高基金收益水平,本基金可以参与新股申购,但股票等权益类投资比例不超过基金资产的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,将其纳入到基金的投资范围。

本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率×80%+税后一年期定期存款利率×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。

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06月30日的财务状况以及2013年上半年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

本基金报告期内无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期末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 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司	受基金管理人的第一大股东控制、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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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
中国银河证券股份有限公司	–	–	35,303.00	1.95%

债券交易

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
中国银河证券股份有限公司	6,660,596.83	1.87%	3,133,894.50	2.39%

债券回购交易

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	
	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
中国银河证券股份有限公司	204,000,000.00	1.31%	–	–

6.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本报告期间及上年同期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
中国银河证券股份有限公司	–	–	–	–

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	28.68	100.00%	–	–

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	3,385,487.58	1,058,376.51
其中:支付销售机构的客户维护费	24,543.94	128,781.09

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.65%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.65%/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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的指令于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇节假日、公休假等,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	1,041,688.54	325,654.32

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的指令于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B	合计
银河基金管理有限公司	–	37,998.43	37,998.43
中信银行股份有限公司	–	101,031.39	101,031.39
中国银河证券股份有限公司	–	114,769.32	114,769.32
合计	–	253,799.14	253,799.14

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B	合计
银河基金管理有限公司	–	10,184.79	10,184.79
中信银行股份有限公司	–	131,766.48	131,766.48
中国银河证券股份有限公司	–	130,969.26	130,969.26
合计	–	272,920.53	272,920.53

注:基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金管理人将通过定期的审计和监察稽核监督基金销售服务费的支出和使用情况,确保其用于约定的用途。

根据《银河基金管理有限公司关于银河银信添利债券型证券投资基金份额分类及费率调整的公告》,基金于2008年5月23日始实施分级,分级后本基金设两级基金:A类基金份额和B类基金份额,其中A类基金不再计提销售服务费,B类基金按原来0.40%的年费率继续计提。B级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×0.40%/当年天数
H为每日应支付的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付;由基金托管人根据基金管理人指令于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售人,若遇法定节假日、休息日等,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

注:本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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 2013年1月1日至2013年6月30日	
	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
基金合同生效日(2007年3月14日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
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	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
基金合同生效日(2007年3月14日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	48,846,724.13	–
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	48,846,724.13	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.10%	–

注:1、"本年申购/买入总份额"中包含红利再投、转换入份额。

2、"本年赎回/卖出总份额"中包含转换出份额。

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:本报告期及上年度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 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
中信银行股份有限公司	3,203,736.65	49,254.32	3,099,655.99	29,650.88

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均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

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:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年06月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额分别为人民币390,500,000.00元及12,999,980.80元,均于2013年7月5日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	1,624,584,337.42	96.51
	其中:债券	1,624,584,337.42	96.51
	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	20,883,725.70	1.24
6	其他各项资产	37,904,173.75	2.25
7	合计	1,683,372,236.87	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末买入股票。

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

注:本基金本报告期末卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期末买入、卖出股票。

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	69,856,000.00	5.49
	其中:政策性金融债	69,856,000.00	5.49
4	企业债券	866,478,891.02	68.12
5	企业短期融资券	200,171,000.00	15.74
6	中期票据	343,080,000.00	26.97
7	可转债	144,998,446.40	11.40
8	其他	–	–
9	合计	1,624,584,337.42	127.73

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	124081	12长先导	700,000	72,100,000.00	5.67
2	113003	重工转债	631,120	68,994,038.40	5.42
3	124086	12诸建投	600,000	61,800,000.00	4.86
4	122760	12渝富债	600,000	61,020,000.00	4.80
5	041262036	12淮南矿CP002	600,000	60,252,000.00	4.74

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2

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。

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	54,311.19
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	36,835,237.68
5	应收申购款	1,014,624.88
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	37,904,173.75

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	68,994,038.40	5.42
2	113002	工行转债	18,483,032.40	1.45
3	110020	南山转债	12,000,190.10	0.94
4	110015	石化转债	8,983,800.00	0.71

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。

7.9.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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

份额级别	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
银河银信添利债券A	964	1,133,279.11	1,088,913,124.40	99.67%	3,567,939.50	0.33%
银河银信添利债券B	3,554	41,080.87	58,225,762.67	39.88%	87,775,648.91	60.12%
合计	4,518	274,121.84	1,147,138,887.07	92.62%	91,343,588.41	7.38%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	银河银信添利债券A	6,087.52	0.0006%
	银河银信添利债券B	–	–
	合计	6,087.52	0.0005%

注:1、对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

2、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为0;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

项目	银河银信添利债券A	银河银信添利债券B
基金合同生效日(2007年3月14日)基金份额总额	–	2,450,672,675.34
本报告期期初基金份额总额	679,025,071.86	138,734,273.05
本报告期基金总申购份额	600,887,737.72	33,677,808.52
减:本报告期基金总赎回份额	187,431,745.68	26,410,669.99
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	1,092,481,063.90	146,001,411.58

§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未发生重大人事变动。
二、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

报告期内基金投资策略无改变。

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	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–

注:专用席位的选择标准和程序

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	6,660,596.83	1.87%	204,000,000.00	1.31%	–	–
中信建投	348,968,608.51	98.13%	15,421,400,000.00	98.69%	–	–

§11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

银河基金管理有限公司
2013年8月28日