

银河行业优选股票型证券投资基金

2012 半年度报告摘要

4.6 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金经理人制订了健全、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小组提供的固定收益品种的估值处理标准。

除了投资总盘外，其他基金基金经理不参与估值政策的决策，但对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值说明。

上述参与估值流程各方之间无有重大利益冲突。

4.7 管理人报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定，基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值。截至本报告期末本基金符合基金合同中分红有关规定，未进行利润分配。

5 托管人报告

1. 报告期内本基金托管人遵守法律法规、恪尽职守、严格履行《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。

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

本托管人根据法律法规、基金合同、托管协议及有关规定，对基金管理人的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回款项支付进行了认真的复核，并对基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关基金估值程序有损害基金份额持有人利益的行为。

3. 托管人对本半年度报告相关财务信息的真实、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信息、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。

6.1 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

Table with columns: 资产, 负债和所有者权益, 附注号, 本期末, 上年度末, 2012年6月30日, 2011年12月31日

注：资产负债表数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.2 利润表

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

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：利润表数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.3 所有者权益变动表

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

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：所有者权益变动表数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4 现金流量表

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

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：现金流量表数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.5 公允价值

1. 公允价值计量结果所属的层次

2. 公允价值计量的方法

3. 公允价值估值程序

4. 公允价值估值程序

5. 公允价值估值程序

6. 公允价值估值程序

7. 公允价值估值程序

8. 公允价值估值程序

9. 公允价值估值程序

10. 公允价值估值程序

11. 公允价值估值程序

12. 公允价值估值程序

13. 公允价值估值程序

14. 公允价值估值程序

15. 公允价值估值程序

16. 公允价值估值程序

17. 公允价值估值程序

18. 公允价值估值程序

19. 公允价值估值程序

20. 公允价值估值程序

21. 公允价值估值程序

22. 公允价值估值程序

23. 公允价值估值程序

24. 公允价值估值程序

25. 公允价值估值程序

26. 公允价值估值程序

27. 公允价值估值程序

28. 公允价值估值程序

29. 公允价值估值程序

30. 公允价值估值程序

31. 公允价值估值程序

32. 公允价值估值程序

33. 公允价值估值程序

34. 公允价值估值程序

35. 公允价值估值程序

36. 公允价值估值程序

37. 公允价值估值程序

38. 公允价值估值程序

39. 公允价值估值程序

40. 公允价值估值程序

41. 公允价值估值程序

42. 公允价值估值程序

43. 公允价值估值程序

44. 公允价值估值程序

6.4.8.1.1 股票交易

Table with columns: 关联方名称, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：股票交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.1.2 权证交易

Table with columns: 关联方名称, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：权证交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.1.3 应付关联方佣金

Table with columns: 关联方名称, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：应付关联方佣金数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.2 关联交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.2.1 基金管理人

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：基金管理人关联交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.2.2 基金托管人

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：基金托管人关联交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.2.3 关联方

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方关联交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.3 关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.4 关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.5 关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.6 关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.7 关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.8 关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.9 关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

6.4.8.10 关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易

Table with columns: 项目, 本期, 上年同期, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年1月1日至2011年6月30日

注：关联方进行银行间同业市场的债券回购/交易数据来源于银河行业优选股票型证券投资基金2012年半年度报告。

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登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

Table with columns: 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(%)

注：本项下“买入”为“买入金额”或“买入股票成本”，“卖出”为“卖出股票收入”或“卖出股票成本”。

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

Table with columns: 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(%)

注：本项下“买入”为“买入金额”或“买入股票成本”，“卖出”为“卖出股票收入”或“卖出股票成本”。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注：本项下“买入”为“买入金额”或“买入股票成本”，“卖出”为“卖出股票收入”或“卖出股票成本”。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

Table with columns: 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(%)

注：本项下“买入”为“买入金额”或“买入股票成本”，“卖出”为“卖出股票收入”或“卖出股票成本”。

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

Table with columns: 序号, 资产支持证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注：本项下“买入”为“买入金额”或“买入股票成本”，“卖出”为“卖出股票收入”或“卖出股票成本”。

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

Table with columns: 序号, 权证名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注：本项下“买入”为“买入金额”或“买入股票成本”，“卖出”为“卖出股票收入”或“卖出股票成本”。

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没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.9.3 报告期内本基金投资的前十名债券没有超出基金合同约定的备选债券库之外的债券。

7.9.4 报告期内本基金投资的前十名资产支持证券没有超出基金合同约定的备选资产支持证券库之外的资产支持证券。

7.9.5 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.6 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.7 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.8 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.9 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.10 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.11 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.12 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.13 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.14 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.15 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.16 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.17 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.18 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.19 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.20 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.21 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.22 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.23 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.24 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.25 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.26 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.27 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.28 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.29 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.30 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.31 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.32 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.33 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.34 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.35 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.36 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.37 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.38 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.39 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.40 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.41 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.42 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

7.9.43 报告期内本基金投资的五名权证没有超出基金合同约定的备选权证库之外的权证。

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据基金合同规定，于2012年8月23日在本公司网站披露了本报告摘要，本报告摘要与本报告全文内容一致，且本报告摘要与本报告全文内容一致。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。