

# 银河消费驱动混合型证券投资基金 2016 年 年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 31 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 2017 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经会计师事务所审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	银河消费混合
场内简称	-
基金主代码	519678
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	2011 年 7 月 29 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	45,390,704.85 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	-

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	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%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于受消费驱动的上市公司。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益较高的投资品种，理论上其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

## 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	董伯儒	田青
	联系电话	021-38568888	010-67595096
	电子邮箱	dongboru@galaxyasset.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67595096
传真		021-38568769	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.galaxyasset.com">http://www.galaxyasset.com</a>
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-30,573,552.59	12,543,410.87	20,679,761.49
本期利润	-33,258,147.08	14,728,628.88	17,137,145.04
加权平均基金份额本期利润	-0.6772	0.2357	0.2952
本期基金份额净值增长率	-32.44%	46.24%	23.24%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0837	0.6872	0.4211
期末基金资产净值	63,735,124.23	104,534,794.58	140,322,063.80
期末基金份额净值	1.404	2.078	1.421

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. 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

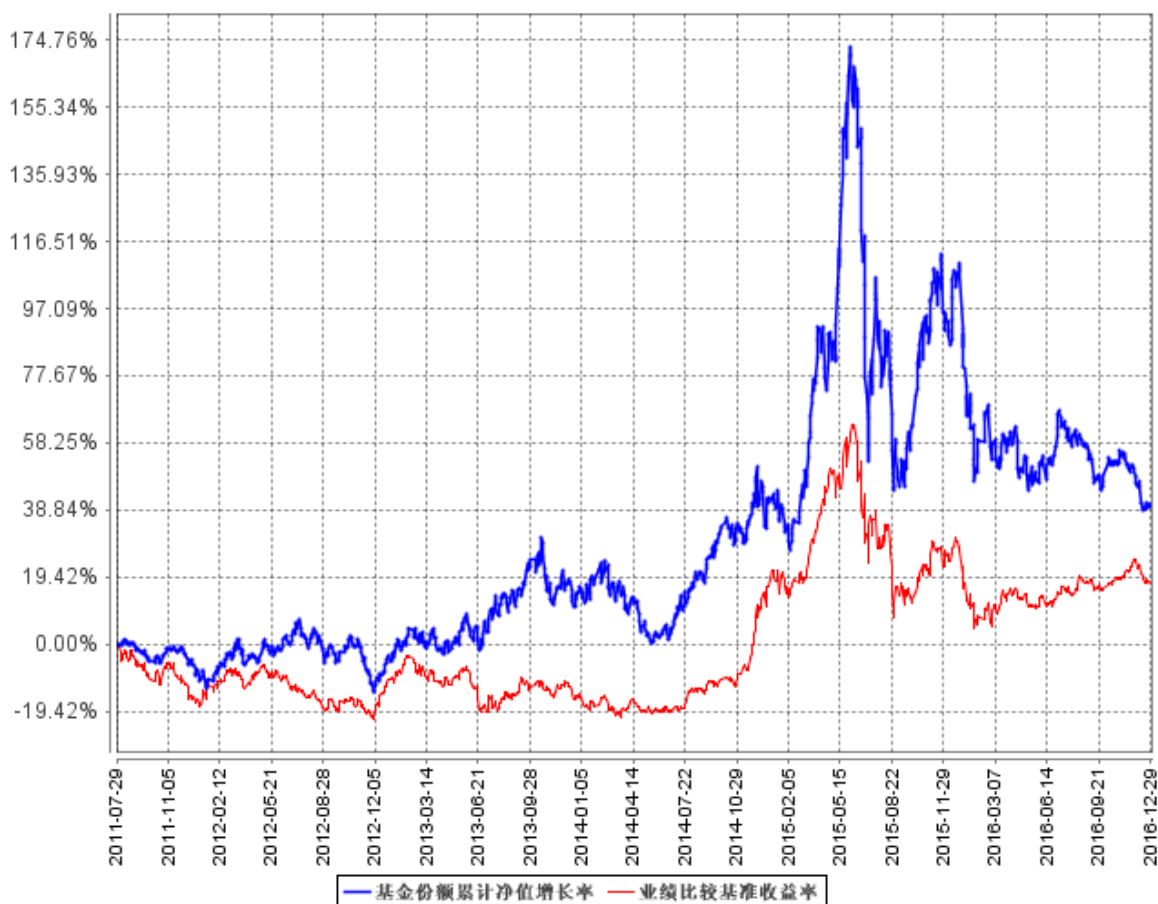
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-5.65%	0.82%	1.34%	0.54%	-6.99%	0.28%
过去六个月	-10.57%	0.93%	4.10%	0.57%	-14.67%	0.36%
过去一年	-32.44%	1.54%	-7.40%	1.05%	-25.04%	0.49%
过去三年	21.77%	2.08%	37.65%	1.34%	-15.88%	0.74%
过去五年	52.11%	1.80%	40.16%	1.22%	11.95%	0.58%
自基金合同生效起至今	40.40%	1.73%	17.91%	1.20%	22.49%	0.53%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

#### 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



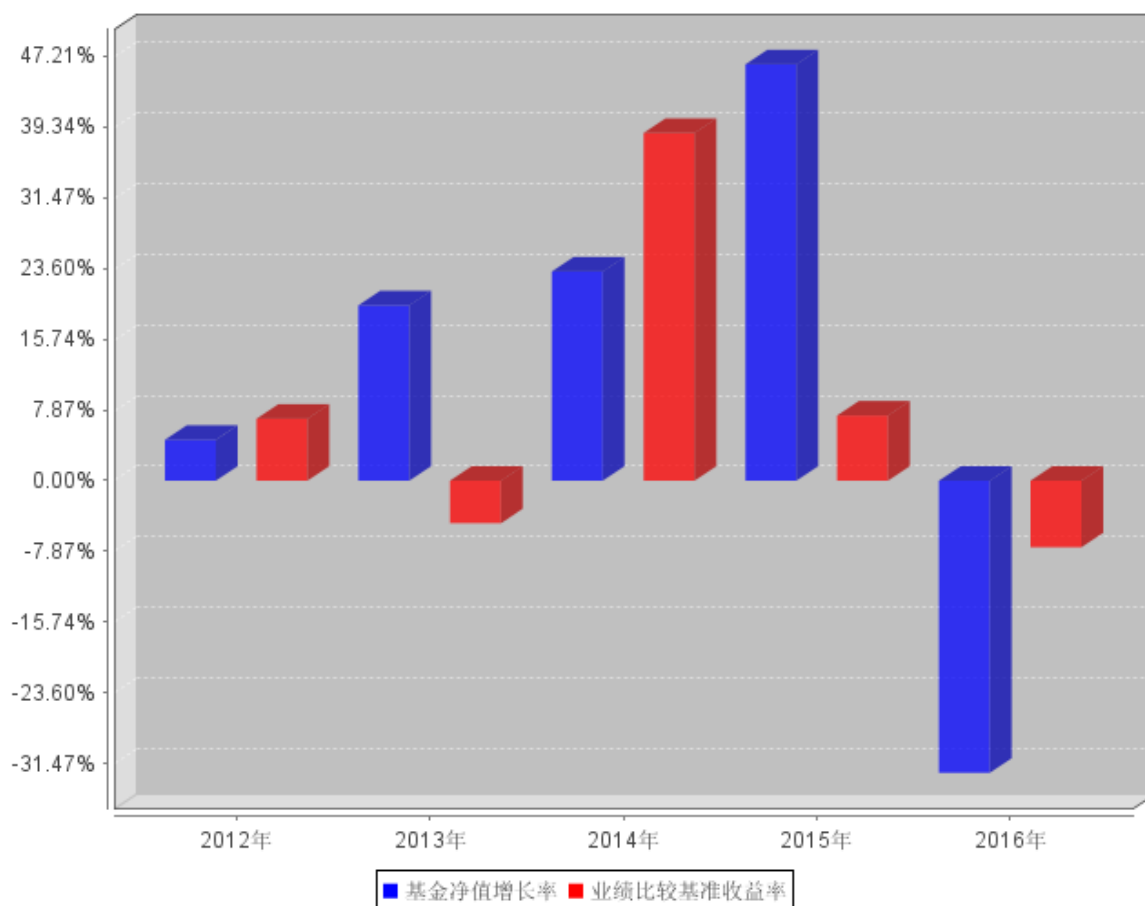
注：1、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例

符合基金合同的有关约定：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%。本基金将不低于 80% 的股票资产投资于受消费驱动的上市公司。

2、截止 2012 年 1 月 29 日建仓期满，本基金各项资产配置符合合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本项目按实际存续期计算，不按整个会计年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2014	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

## § 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（控股股东）、中国石油天然气集团公司、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

目前，截至本报告期，银河基金管理有限公司管理 1 只封闭式与 33 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

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2002 年 08 月 15 日

基金投资目标：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

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

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：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、银河行业优选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：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。

#### 8、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。

#### 9、银河蓝筹精选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：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。

#### 10、银河创新成长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：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。

#### 11、银河强化收益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：2011 年 5 月 31 日

基金投资目标：本基金主要投资于固定收益类品种，在控制风险，保持资产良好流动性的前提下，追求一定的当期收入和基金资产的长期稳健增值。

#### 12、银河消费驱动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 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。

#### 13、银河通利债券型证券投资基金（LOF）

基金运作方式：契约型开放式

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。

#### 14、银河主题策略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：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。

#### 15、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。

#### 16、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

基金投资目标：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%。

17、银河增利债券型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013 年 7 月 17 日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的具有投资价值的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

18、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式(本基金以定期开放的方式运作, 运作周期和自由开放期相结合, 以 1 年为一个运作周期, 每个运作周期共包含为 4 个封闭期和 3 个受限开放期)。

基金合同生效日：2013 年 8 月 9 日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，通过严谨的风险管理与主动管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

19、银河灵活配置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：2014 年 2 月 11 日

基金投资目标：本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，在确保超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值的前提下，力求获取超额收益。

20、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 3 月 14 日

基金投资目标：本基金为股票型指数基金，力求对中证腾讯济安价值 100A 股指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离和跟踪误差的前提下追求跟踪误差的最小化。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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

21、银河美丽优萃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：2014-05-29

基金投资目标：本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的美丽主题相关股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 22、银河润利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：2014-08-06

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，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

#### 23、银河康乐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：2014-11-18

基金投资目标：本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的健康快乐主题相关的股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 24、银河泽利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：2015-04-09

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略（优化的 CPPI 策略），并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

#### 25、银河现代服务主题灵活配置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：2015-04-22

基金投资目标：本基金将充分把握中国经济可持续发展过程中现代服务主题相关行业及子行业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中现代服务主题相关行业及子行业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

#### 26、银河鑫利灵活配置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：2015-04-22

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

#### 27、银河转型增长主题灵活配置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：2015-05-12

基金投资目标：本基金将充分把握我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济战略布局过程中呈现的转型增长主题投资机会，充分利用我公司的研究投资优势，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的红利，在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

#### 28、银河鸿利灵活配置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：2015-06-19

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

#### 29、银河智联主题灵活配置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：2015年12月17日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，追求实现基金资产持续稳定增值的前提下，力求获取超额收益。

#### 30、银河大国智造主题灵活配置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：2016年3月11日

基金投资目标：在实现《中国制造 2025》规划的工业未来发展纲领和顶层设计目标的过程中，本基金将充分把握大国智造主题涵盖领域中相关行业和企业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享大国智造主题涵盖领域中相关行业及子行业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

#### 31、银河旺利灵活配置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：2016 年 5 月 13 日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

### 32、银河君尚灵活配置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：2016 年 8 月 17 日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

### 33、银河君信灵活配置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：2016 年 9 月 7 日

基金投资目标：本基金在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产的持续稳定增值。

### 34、银河君荣灵活配置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：2016 年 9 月 5 日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

## 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		
卢轶乔	银河消费驱动混合型证券投资基金的	2012 年 12 月 21 日	-	8	博士研究生学历，曾就职于建设银行。2008 年 7 月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、银河消费驱动股票型证券投资基金的基金经理助理等职；2015 年 5 月至 2016 年 12 月担任银河转型增长主题灵活配置

	基金经理				混合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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过制定严格的公平交易管理制度、投资管理制度，投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等一系列制度，从授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控和分析评估等各个环节予以落实，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

在投资决策环节，公司实行统一研究平台和统一的授权管理，所有投资组合经理在获取研究成果及投资建议等方面享有均等机会。公司分不同投资组合类别分别建立了投资备选库，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行方面，本基金管理人旗下管理的所有投资组合指令均执行集中交易制度，遵循“时间优先、价格优先”的原则，在满足系统公平交易的条件时自动进入公平交易程序，最大程度上确保公平对待各投资组合。在同日反向交易方面，除法规规定的特殊情况外，公司原则上禁止不同投资组合（完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合除外）之间的同日反向交易。

### 4.3.2 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，由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。

### 4.3.3 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 2016 年下跌了 12.31%，波动区间在 2638-3538 点，深成指下跌了 19.64%，中小板指数和创业板指数分别下跌了 22.89% 和 27.71%。

行业方面，市场风格鲜明，高估值高成长类的计算机、通信、传媒等行业跌幅居前，而白酒、建筑等消费和周期板块涨幅居前。

此前我们对于市场的判断过于乐观，由于受汇率大幅调整影响，市场在年初出现连续大幅下跌，超出我们的预期。在操作层面上，全年指数波动较大，尤其是中小创板块跌幅特别巨大，导致全年基金净值受损较多，仓位上，全年大部分时段保持中性仓位。持仓结构上，除了重点持有包括医药、食品、农业等传统消费板块外，在下半年开始减持了计算机、传媒、通信等高估值板块。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金单位净值增长率为-32.44%，业绩比较基准收益率为-7.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2017 年市场走势将较 16 年更平缓，指数受到的内外影响多少都已经在指数中部分体现。全年结构性行情仍将持续。原因是一方面资金层面虽不在极度宽裕，但在经济维稳的底部思路下，全年货币流动性不会出现大问题。另一方面由于全球汇率波动，尤其是美联储加息预期导致外汇流出的压力已基本体现在汇率和指数中，未来美联储的加息步伐不太会对市场产生过于激烈的冲击。个股结构方面，经济转型个股的极度追捧和抛弃将不再，下一轮科技方向先导个股将开始不断向市场证明其技术的可行性，经济转型方向将出现分化。反映在股票市场上，全年仍具有操作性，真正有业绩有趋势的板块将继续受到追捧。2017 年我们将继续集中持有确定性较好的成长股，用优选成长的积极策略应对市场，通过重点持有稳定增长的行业和个股获取超额收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照新准则、中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及基金合同的约定，制定了健全、有效的估值政策和程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了估值工作决策、监督、审查的专门部门，组成人员包括投资研究部门、监察稽核部门及会计核算部门的工作负责人或资深业务人员，其多数拥有十年以上的证券、风控、估值经验，根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。

同时不断建立起一套完整、有效的估值工作管理规定及程序，对估值相关的各个环节均配有专门的人员实施、把控，并保证环节的各方不存在重大利益冲突。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2011 年 7 月 29 日成立，根据《基金合同》有关规定“本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%”“基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值”。截止 2016 年年底，本基金可供分配利润为 3,799,695.67 元，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关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 审计报告

本报告期内本基金由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具标准无保留意见审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银河消费驱动混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款		19,641,260.40	20,970,999.29
结算备付金		356,319.29	944,090.73
存出保证金		75,210.97	244,466.25
交易性金融资产		47,940,263.07	89,355,386.03
其中: 股票投资		47,940,263.07	89,355,386.03
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		2,761,381.77	-
应收利息		4,135.82	4,421.91
应收股利		-	-
应收申购款		17,297.58	1,636,943.10
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		70,795,868.90	113,156,307.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
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		-	-
应付证券清算款		6,279,096.50	6,660,582.96
应付赎回款		87,347.93	808,635.93
应付管理人报酬		82,242.51	125,114.62
应付托管费		13,707.11	20,852.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		248,040.80	803,387.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		350,309.82	202,938.92
负债合计		7,060,744.67	8,621,512.73
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		45,390,704.85	50,311,548.69
未分配利润		18,344,419.38	54,223,245.89
所有者权益合计		63,735,124.23	104,534,794.58

负债和所有者权益总计		70,795,868.90	113,156,307.31
------------	--	---------------	----------------

注：报告期截止至 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.404 元，基金份额总额 45,390,704.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银河消费驱动混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-29,409,661.75	22,007,605.71
1. 利息收入		137,893.82	142,363.16
其中：存款利息收入		137,893.82	139,349.22
债券利息收入		-	280.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,733.39
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,947,862.78	19,059,905.34
其中：股票投资收益		-27,349,465.24	19,449,789.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-489,484.85
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		401,602.46	99,600.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,684,594.49	2,185,218.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		84,901.70	620,119.20
<b>减：二、费用</b>		3,848,485.33	7,278,976.83
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,150,724.44	1,697,802.86
2. 托管费	7.4.8.2.2	191,787.54	282,967.15
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		2,142,299.96	4,948,460.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		363,673.39	349,746.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-33,258,147.08	14,728,628.88

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-33,258,147.08	14,728,628.88

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河消费驱动混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	50,311,548.69	54,223,245.89	104,534,794.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-33,258,147.08	-33,258,147.08
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）	-4,920,843.84	-2,620,679.43	-7,541,523.27
其中：1. 基金申购款	40,587,576.99	24,577,984.78	65,165,561.77
2. 基金赎回款	-45,508,420.83	-27,198,664.21	-72,707,085.04
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）	45,390,704.85	18,344,419.38	63,735,124.23
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	98,740,882.32	41,581,181.48	140,322,063.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	14,728,628.88	14,728,628.88
三、本期基金份额交易产	-48,429,333.63	-2,086,564.47	-50,515,898.10

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	229,226,985.24	238,651,039.42	467,878,024.66
2. 基金赎回款	-277,656,318.87	-240,737,603.89	-518,393,922.76
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)	50,311,548.69	54,223,245.89	104,534,794.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘立达</u>	<u>刘立达</u>	<u>秦长建</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银河消费驱动混合型证券投资基金(原名银河消费驱动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[2011]710号《关于核准银河消费驱动股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人银河基金管理有限公司向社会公开发行业募集,基金合同于2011年7月29日正式生效,首次设立募集规模为524,132,937.88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。

本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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%。本基金将不低于80%的股票资产投资于受消费驱动的上市公司。

本基金的业绩比较标准是：沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 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

本基金本报告期会计估计变更的说明在 7.4.5.2 会计估计变更的说明中披露，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 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[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。

### 7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管

产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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；

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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

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
中国银河金融控股有限责任公司	基金管理人的第一大股东
中国石油天然气集团公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海城投（集团）有限公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司	同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

#### 7.4.8 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。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	59,580,928.52	4.20%	442,436,215.15	13.55%

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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	54,295.84	4.17%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	403,013.00	13.64%	110,237.55	13.72%

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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,150,724.44	1,697,802.86
其中：支付销售机构的客户维护费	475,265.78	707,998.10

注：2016年末未支付管理费余额 82,242.51 元，

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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	191,787.54	282,967.15

注：2016 年末未支付托管费余额 13,707.11 元。

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 7 月 29 日）持有的基金份额	2,798,992.16	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	2,798,992.16
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	2,798,992.16	2,798,992.16
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.1700%	5.5600%

**7.4.8.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

**7.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	19,641,260.40	123,653.09	20,970,999.29	111,530.30

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 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/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300496	中科创达	2016年10月11日	重大事项停牌	47.09	2017年1月6日	47.49	49,963	2,422,701.35	2,352,757.67	-
000903	云内动力	2016年12月22日	重大事项停牌	8.76	2017年3月23日	9.64	100,000	891,642.75	876,000.00	-

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 7.4.10.1 公允价值

#### 7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 44,711,505.40 元,属于第二层次的余额为人民币 3,228,757.67 元,属于第三层次余额为人民币 0.00 元(于 2015 年 12 月 31 日,第一层次的余额为人民币 86,455,385.03 元,属于第二层次的余额为人民币 2,900,001.00 元,属于第三层次余额为人民币 0.00 元)。

##### 7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	47,940,263.07	67.72
	其中：股票	47,940,263.07	67.72
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,997,579.69	28.25
7	其他各项资产	2,858,026.14	4.04
8	合计	70,795,868.90	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,689,296.00	4.22
C	制造业	34,638,775.20	54.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,749,000.00	2.74
G	交通运输、仓储和邮政业	2,161,600.00	3.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,701,591.87	10.51
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,940,263.07	75.22

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 8.3 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	300294	博雅生物	89,200	5,026,420.00	7.89
2	000568	泸州老窖	150,000	4,950,000.00	7.77
3	300036	超图软件	249,933	4,348,834.20	6.82
4	600887	伊利股份	200,000	3,520,000.00	5.52
5	300078	思创医惠	120,000	3,109,200.00	4.88
6	002572	索菲亚	55,000	2,978,800.00	4.67
7	002510	天汽模	399,936	2,779,555.20	4.36
8	000858	五粮液	80,000	2,758,400.00	4.33
9	600882	广泽股份	250,400	2,689,296.00	4.22
10	002180	艾派克	90,000	2,530,800.00	3.97

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金公司网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000568	泸州老窖	15,811,747.81	15.13
2	300036	超图软件	13,685,805.12	13.09
3	002494	华斯股份	13,439,859.06	12.86
4	002234	民和股份	12,062,719.04	11.54
5	300294	博雅生物	11,288,068.85	10.80
6	601398	工商银行	11,248,000.00	10.76
7	002468	艾迪西	10,763,001.45	10.30
8	002458	益生股份	9,798,614.49	9.37
9	000858	五粮液	9,750,362.00	9.33
10	300166	东方国信	8,769,353.53	8.39
11	603999	读者传媒	8,754,731.00	8.37
12	600146	商赢环球	8,312,859.00	7.95
13	002510	天汽模	8,141,441.80	7.79
14	300078	思创医惠	8,098,182.00	7.75
15	601988	中国银行	8,004,000.00	7.66
16	600975	新五丰	7,843,050.43	7.50
17	000726	鲁泰A	7,657,487.00	7.33
18	000695	滨海能源	7,642,175.58	7.31
19	600519	贵州茅台	7,291,948.80	6.98
20	600155	宝硕股份	7,270,912.69	6.96
21	002780	三夫户外	7,028,000.00	6.72
22	002674	兴业科技	6,963,368.10	6.66
23	000895	双汇发展	6,925,095.04	6.62
24	002656	摩登大道	6,896,464.00	6.60
25	300059	东方财富	6,886,216.00	6.59
26	300458	全志科技	6,798,011.50	6.50
27	600348	阳泉煤业	6,710,377.00	6.42
28	002299	圣农发展	6,447,385.28	6.17
29	002325	洪涛股份	6,102,160.86	5.84
30	603398	邦宝益智	6,024,838.00	5.76



31	600809	山西汾酒	5,920,429.60	5.66
32	000848	承德露露	5,819,349.70	5.57
33	002120	新海股份	5,658,867.00	5.41
34	002425	凯撒文化	5,497,939.10	5.26
35	002308	威创股份	5,281,458.00	5.05
36	601688	华泰证券	5,278,381.50	5.05
37	300409	道氏技术	5,251,690.00	5.02
38	300138	晨光生物	5,155,643.80	4.93
39	002718	友邦吊顶	5,152,892.00	4.93
40	600887	伊利股份	5,117,394.00	4.90
41	601333	广深铁路	5,030,152.84	4.81
42	000821	京山轻机	4,798,104.00	4.59
43	600900	长江电力	4,760,000.00	4.55
44	600559	老白干酒	4,734,979.68	4.53
45	600882	广泽股份	4,672,037.50	4.47
46	002572	索菲亚	4,657,999.80	4.46
47	002081	金螳螂	4,600,308.00	4.40
48	002094	青岛金王	4,455,010.56	4.26
49	600050	中国联通	4,385,275.00	4.20
50	600475	华光股份	4,267,280.00	4.08
51	600199	金种子酒	4,027,578.64	3.85
52	600036	招商银行	4,026,400.00	3.85
53	000778	新兴铸管	3,998,921.34	3.83
54	300302	同有科技	3,984,947.00	3.81
55	002064	华峰氨纶	3,982,825.13	3.81
56	601336	新华保险	3,980,282.00	3.81
57	600418	江淮汽车	3,927,662.00	3.76
58	000911	南宁糖业	3,849,294.00	3.68
59	002245	澳洋顺昌	3,846,750.14	3.68
60	002668	奥马电器	3,838,580.00	3.67
61	603066	音飞储存	3,821,831.00	3.66
62	600258	首旅酒店	3,808,220.00	3.64
63	002242	九阳股份	3,774,154.80	3.61
64	002029	七匹狼	3,771,670.60	3.61
65	002104	恒宝股份	3,769,868.00	3.61
66	600600	青岛啤酒	3,766,278.68	3.60

67	601718	际华集团	3,756,000.00	3.59
68	002020	京新药业	3,740,753.00	3.58
69	000998	隆平高科	3,700,902.48	3.54
70	300451	创业软件	3,676,016.00	3.52
71	300011	鼎汉技术	3,674,000.00	3.51
72	300339	润和软件	3,670,623.00	3.51
73	600048	保利地产	3,650,398.00	3.49
74	600004	白云机场	3,632,831.50	3.48
75	300113	顺网科技	3,590,918.00	3.44
76	600967	北方创业	3,574,340.00	3.42
77	002533	金杯电工	3,571,426.00	3.42
78	000903	云内动力	3,566,571.00	3.41
79	600779	水井坊	3,557,291.80	3.40
80	601288	农业银行	3,540,000.00	3.39
81	603589	口子窖	3,525,759.00	3.37
82	300346	南大光电	3,510,610.39	3.36
83	601595	上海电影	3,496,463.40	3.34
84	300381	溢多利	3,472,969.00	3.32
85	600702	沱牌舍得	3,443,666.00	3.29
86	600068	葛洲坝	3,431,827.00	3.28
87	601099	太平洋	3,415,356.80	3.27
88	002124	天邦股份	3,415,044.09	3.27
89	300147	香雪制药	3,369,856.00	3.22
90	300140	启源装备	3,366,518.00	3.22
91	002098	浔兴股份	3,362,605.02	3.22
92	000042	中洲控股	3,256,420.00	3.12
93	000932	华菱钢铁	3,209,779.00	3.07
94	600467	好当家	3,206,398.00	3.07
95	600976	健民集团	3,177,897.00	3.04
96	000926	福星股份	3,153,773.00	3.02
97	002368	太极股份	3,127,870.00	2.99
98	002180	艾派克	3,126,630.39	2.99
99	300359	全通教育	3,124,510.00	2.99
100	000421	南京公用	3,110,594.00	2.98
101	002352	鼎泰新材	3,040,381.00	2.91
102	002003	伟星股份	3,003,606.24	2.87

103	600306	*ST 商城	2,990,325.54	2.86
104	000716	黑芝麻	2,979,543.95	2.85
105	600104	上汽集团	2,961,299.72	2.83
106	300398	飞凯材料	2,957,999.40	2.83
107	300158	振东制药	2,948,815.39	2.82
108	300290	荣科科技	2,947,766.00	2.82
109	600958	东方证券	2,893,500.00	2.77
110	600061	国投安信	2,846,598.00	2.72
111	300307	慈星股份	2,835,247.42	2.71
112	600185	格力地产	2,834,862.00	2.71
113	002431	棕榈股份	2,827,995.00	2.71
114	600745	中茵股份	2,825,114.00	2.70
115	600661	新南洋	2,800,627.00	2.68
116	600097	开创国际	2,784,719.00	2.66
117	002474	榕基软件	2,765,351.00	2.65
118	002567	唐人神	2,742,830.04	2.62
119	000953	河池化工	2,713,561.28	2.60
120	002667	鞍重股份	2,681,500.00	2.57
121	300196	长海股份	2,677,370.85	2.56
122	300014	亿纬锂能	2,670,345.36	2.55
123	000630	铜陵有色	2,664,000.00	2.55
124	300130	新国都	2,609,765.95	2.50
125	300045	华力创通	2,593,089.00	2.48
126	300073	当升科技	2,588,039.00	2.48
127	600889	南京化纤	2,574,545.00	2.46
128	300326	凯利泰	2,559,769.00	2.45
129	600259	广晟有色	2,551,417.00	2.44
130	300188	美亚柏科	2,530,393.00	2.42
131	002439	启明星辰	2,508,187.00	2.40
132	000338	潍柴动力	2,496,648.00	2.39
133	300236	上海新阳	2,490,898.00	2.38
134	600787	中储股份	2,486,080.00	2.38
135	002196	方正电机	2,467,865.62	2.36
136	300496	中科创达	2,422,701.35	2.32
137	600561	江西长运	2,389,500.00	2.29
138	000807	云铝股份	2,385,105.00	2.28

139	000019	深深宝 A	2,369,164.00	2.27
140	000530	大冷股份	2,361,720.00	2.26
141	002042	华孚色纺	2,319,064.00	2.22
142	002321	华英农业	2,302,034.00	2.20
143	600562	国睿科技	2,227,275.20	2.13
144	002695	煌上煌	2,206,256.00	2.11
145	300340	科恒股份	2,125,000.00	2.03
146	002089	新海宜	2,119,400.00	2.03

注：本项及下项 8.4.2，8.4.3 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。

#### 8.4.2 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	002494	华斯股份	14,190,545.54	13.57
2	601398	工商银行	11,384,000.00	10.89
3	002308	威创股份	11,246,995.24	10.76
4	600559	老白干酒	11,054,390.50	10.57
5	000568	泸州老窖	10,888,831.39	10.42
6	002234	民和股份	10,877,424.09	10.41
7	600975	新五丰	10,114,799.94	9.68
8	000695	滨海能源	9,883,375.17	9.45
9	002468	艾迪西	9,615,076.84	9.20
10	300036	超图软件	8,875,958.00	8.49
11	600146	商赢环球	8,785,894.00	8.40
12	002458	益生股份	8,192,640.45	7.84
13	603999	读者传媒	8,050,663.04	7.70
14	002325	洪涛股份	8,018,324.90	7.67
15	300166	东方国信	7,884,052.73	7.54
16	601988	中国银行	7,702,000.00	7.37
17	300458	全志科技	7,566,393.22	7.24
18	000726	鲁泰 A	7,499,354.11	7.17
19	000858	五粮液	7,362,069.00	7.04
20	300302	同有科技	7,180,786.25	6.87
21	600519	贵州茅台	7,017,061.60	6.71
22	300059	东方财富	6,733,685.95	6.44

23	000895	双汇发展	6,616,623.00	6.33
24	002656	摩登大道	6,524,487.00	6.24
25	600348	阳泉煤业	6,508,219.98	6.23
26	600155	宝硕股份	6,478,050.88	6.20
27	002780	三夫户外	6,476,656.00	6.20
28	600306	*ST 商城	6,180,470.00	5.91
29	600809	山西汾酒	6,179,991.80	5.91
30	002299	圣农发展	6,145,670.00	5.88
31	002425	凯撒文化	6,078,129.40	5.81
32	000848	承德露露	5,924,716.61	5.67
33	300294	博雅生物	5,877,161.00	5.62
34	002510	天汽模	5,605,092.75	5.36
35	603398	邦宝益智	5,519,689.00	5.28
36	002718	友邦吊顶	5,332,945.14	5.10
37	300409	道氏技术	5,313,914.55	5.08
38	002368	太极股份	5,310,656.39	5.08
39	002655	共达电声	5,283,698.00	5.05
40	002094	青岛金王	5,058,940.00	4.84
41	601688	华泰证券	5,041,610.00	4.82
42	600900	长江电力	4,933,907.00	4.72
43	002674	兴业科技	4,905,417.49	4.69
44	601333	广深铁路	4,706,735.00	4.50
45	002081	金螳螂	4,702,955.00	4.50
46	000821	京山轻机	4,687,296.72	4.48
47	300078	思创医惠	4,679,979.21	4.48
48	600475	华光股份	4,466,011.25	4.27
49	300451	创业软件	4,194,764.15	4.01
50	600036	招商银行	4,188,800.00	4.01
51	002029	七匹狼	4,175,680.94	3.99
52	002020	京新药业	4,165,138.00	3.98
53	601595	上海电影	4,043,928.20	3.87
54	002401	中海科技	3,954,045.00	3.78
55	600600	青岛啤酒	3,923,972.00	3.75
56	600418	江淮汽车	3,867,499.30	3.70
57	300020	银江股份	3,859,020.00	3.69
58	601718	际华集团	3,845,153.25	3.68
59	000778	新兴铸管	3,837,980.19	3.67
60	002064	华峰氨纶	3,837,038.05	3.67

61	601288	农业银行	3,816,000.00	3.65
62	300138	晨光生物	3,760,623.18	3.60
63	600702	沱牌舍得	3,703,020.00	3.54
64	600258	首旅酒店	3,686,600.00	3.53
65	300381	溢多利	3,684,581.00	3.52
66	601336	新华保险	3,642,443.17	3.48
67	600004	白云机场	3,638,600.96	3.48
68	300346	南大光电	3,618,202.51	3.46
69	600068	葛洲坝	3,610,206.00	3.45
70	600050	中国联通	3,600,000.00	3.44
71	002124	天邦股份	3,586,722.32	3.43
72	300339	润和软件	3,561,195.67	3.41
73	300011	鼎汉技术	3,549,880.00	3.40
74	000998	隆平高科	3,544,325.24	3.39
75	300113	顺网科技	3,536,573.00	3.38
76	600199	金种子酒	3,491,465.05	3.34
77	600967	北方创业	3,490,492.80	3.34
78	000716	黑芝麻	3,478,436.50	3.33
79	603589	口子窖	3,477,987.05	3.33
80	600779	水井坊	3,473,300.46	3.32
81	002667	鞍重股份	3,470,807.00	3.32
82	002668	奥马电器	3,470,325.00	3.32
83	000932	华菱钢铁	3,458,185.00	3.31
84	000911	南宁糖业	3,425,942.00	3.28
85	002533	金杯电工	3,411,059.00	3.26
86	002242	九阳股份	3,390,736.00	3.24
87	600048	保利地产	3,384,530.00	3.24
88	002695	煌上煌	3,383,847.00	3.24
89	002098	浔兴股份	3,379,421.43	3.23
90	002104	恒宝股份	3,338,245.12	3.19
91	600297	广汇汽车	3,301,126.32	3.16
92	002245	澳洋顺昌	3,284,912.00	3.14
93	600976	健民集团	3,240,383.00	3.10
94	002376	新北洋	3,222,011.96	3.08
95	600467	好当家	3,209,923.02	3.07
96	601099	太平洋	3,140,513.40	3.00
97	600661	新南洋	3,134,268.00	3.00
98	600097	开创国际	3,130,777.00	2.99

99	300359	全通教育	3,120,710.23	2.99
100	300290	荣科科技	3,118,630.40	2.98
101	000953	河池化工	3,103,574.18	2.97
102	000926	福星股份	3,074,759.51	2.94
103	002003	伟星股份	3,049,924.00	2.92
104	000421	南京公用	3,049,236.00	2.92
105	000042	中洲控股	3,041,258.00	2.91
106	300158	振东制药	3,022,945.10	2.89
107	300398	飞凯材料	2,972,995.41	2.84
108	002431	棕榈股份	2,952,000.00	2.82
109	002474	榕基软件	2,901,693.50	2.78
110	002019	亿帆医药	2,854,654.60	2.73
111	300140	启源装备	2,830,090.00	2.71
112	002352	鼎泰新材	2,821,953.00	2.70
113	600745	中茵股份	2,797,061.00	2.68
114	300014	亿纬锂能	2,786,942.00	2.67
115	000019	深深宝A	2,784,333.00	2.66
116	600958	东方证券	2,772,943.60	2.65
117	002120	新海股份	2,754,861.00	2.64
118	600104	上汽集团	2,752,050.00	2.63
119	300073	当升科技	2,751,056.92	2.63
120	300147	香雪制药	2,698,767.83	2.58
121	300307	慈星股份	2,694,592.34	2.58
122	300130	新国都	2,671,480.00	2.56
123	300326	凯利泰	2,625,132.37	2.51
124	000630	铜陵有色	2,600,000.00	2.49
125	600561	江西长运	2,580,355.00	2.47
126	300045	华力创通	2,577,840.00	2.47
127	600259	广晟有色	2,559,875.00	2.45
128	300188	美亚柏科	2,550,231.00	2.44
129	300236	上海新阳	2,539,451.88	2.43
130	300340	科恒股份	2,525,000.00	2.42
131	600061	国投安信	2,498,081.00	2.39
132	600185	格力地产	2,489,630.00	2.38
133	600787	中储股份	2,469,632.00	2.36
134	600172	黄河旋风	2,468,013.63	2.36
135	300196	长海股份	2,467,308.00	2.36
136	002448	中原内配	2,441,012.90	2.34

137	002567	唐人神	2,413,256.35	2.31
138	600242	中昌海运	2,387,069.90	2.28
139	002439	启明星辰	2,368,993.00	2.27
140	600889	南京化纤	2,366,961.50	2.26
141	000903	云内动力	2,347,129.00	2.25
142	000338	潍柴动力	2,337,776.00	2.24
143	002042	华孚色纺	2,334,483.00	2.23
144	002089	新海宜	2,325,736.00	2.22
145	002085	万丰奥威	2,311,282.00	2.21
146	002196	方正电机	2,274,723.96	2.18
147	000426	兴业矿业	2,264,194.00	2.17
148	600562	国睿科技	2,257,126.00	2.16
149	002321	华英农业	2,236,682.00	2.14
150	300088	长信科技	2,150,402.42	2.06
151	600362	江西铜业	2,100,777.00	2.01
152	600735	新华锦	2,090,975.02	2.00

#### 8.4.3 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	703,240,648.87
卖出股票收入（成交）总额	714,621,712.10

#### 8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-



注：本基金本报告期末未持有债券。

## **8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有债券。

## **8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

## **8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## **8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

## **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资。

### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

按照基金契约，本基金未从事股指期货交易。

## **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

### **8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	75,210.97
2	应收证券清算款	2,761,381.77
3	应收股利	-
4	应收利息	4,135.82
5	应收申购款	17,297.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,858,026.14

### 8.12.4 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可转债。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300496	中科创达	2,352,757.67	3.69	重大事项停牌

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
6,368	7,127.94	2,823,753.65	6.22%	42,566,951.20	93.78%

### 9.3 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	618,601.36	1.3628%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年7月29日）基金份额总额	524,132,937.88
本报告期期初基金份额总额	50,311,548.69
本报告期基金总申购份额	40,587,576.99
减:本报告期基金总赎回份额	45,508,420.83
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	45,390,704.85

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：

1、2016 年 2 月 19 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于总经理任职的公告》，由银河基金管理有限公司第四届董事会审议通过，决定聘任刘立达先生担任公司总经理。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

无。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内无涉基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

本基金本期报告内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 6 年的审计服务。

### 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
民生证券	1	358,595,545.90	25.29%	326,789.07	25.10%	-
国信证券	2	234,483,443.48	16.54%	217,520.57	16.71%	-
国金证券	1	167,492,231.44	11.81%	152,635.74	11.72%	-
申银万国	1	155,779,000.44	10.99%	141,961.58	10.90%	-
国海证券	1	143,301,562.53	10.11%	130,591.39	10.03%	-
东方证券	1	127,233,193.75	8.97%	118,491.79	9.10%	-
瑞银证券	1	109,123,668.68	7.70%	101,626.54	7.81%	-
银河证券	2	59,580,928.52	4.20%	54,295.84	4.17%	-
平安证券	1	54,474,255.53	3.84%	50,731.82	3.90%	-
网信证券	1	7,790,040.70	0.55%	7,255.17	0.56%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-

中投证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金本期新增中泰证券 1 个交易单元、长江证券 1 个交易单元、东北证券 1 个交易单元、天风证券 2 个交易单元、渤海证券 1 个交易单元、浙商证券 1 个交易单元、国信证券 1 个交易单元，诚浩证券更名为网信证券。

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。

### 11.7.2 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
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
网信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 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  
2017 年 3 月 31 日