

# 银丰证券投资基金 2016 年年度报告

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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
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.....	21
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
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.....	59

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 .....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	61
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</b>
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银丰证券投资基金
场内简称	-
基金简称	银河银丰封闭
基金主代码	500058
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002 年 8 月 15 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	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2002 年 9 月 10 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型基金，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。
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的精选个股相结合的投资策略。在正常的市场情况下，股票投资比例变动范围是：基金资产的 25%-75%；债券投资比例变动范围是：基金资产的 25%-55%；现金资产比例的变动范围是：基金资产的 0%-20%。
业绩比较基准	上证 A 股指数涨跌幅 * 75% + 同期国债收益率 * 25%。
风险收益特征	本基金为封闭式平衡型基金，在证券投资基金中属风险相对较低品种，其风险与收益特征从长期平均及预期来看介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间，或介于单纯的成长型组合与单纯的价值型组合之间，力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。

### 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
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		许国平	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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. 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层 2. 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号 中国保险大厦

## § 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	53,841,152.54	1,277,502,129.38	296,709,175.27
本期利润	-1,353,953,025.08	2,007,964,580.40	646,048,508.77
加权平均基金份额本期利润	-0.4513	0.6693	0.2153
本期加权平均净值利润率	-37.62%	42.28%	22.21%
本期基金份额净值增长率	-26.63%	59.40%	23.55%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	79,207,705.67	1,038,517,378.22	-238,984,751.16
期末可供分配基金份额利润	0.0264	0.3462	-0.0797
期末基金资产净值	3,079,207,705.67	5,393,160,730.75	3,385,196,150.35

期末基金份额净值	1.026	1.798	1.128
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	381.57%	556.38%	311.79%

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

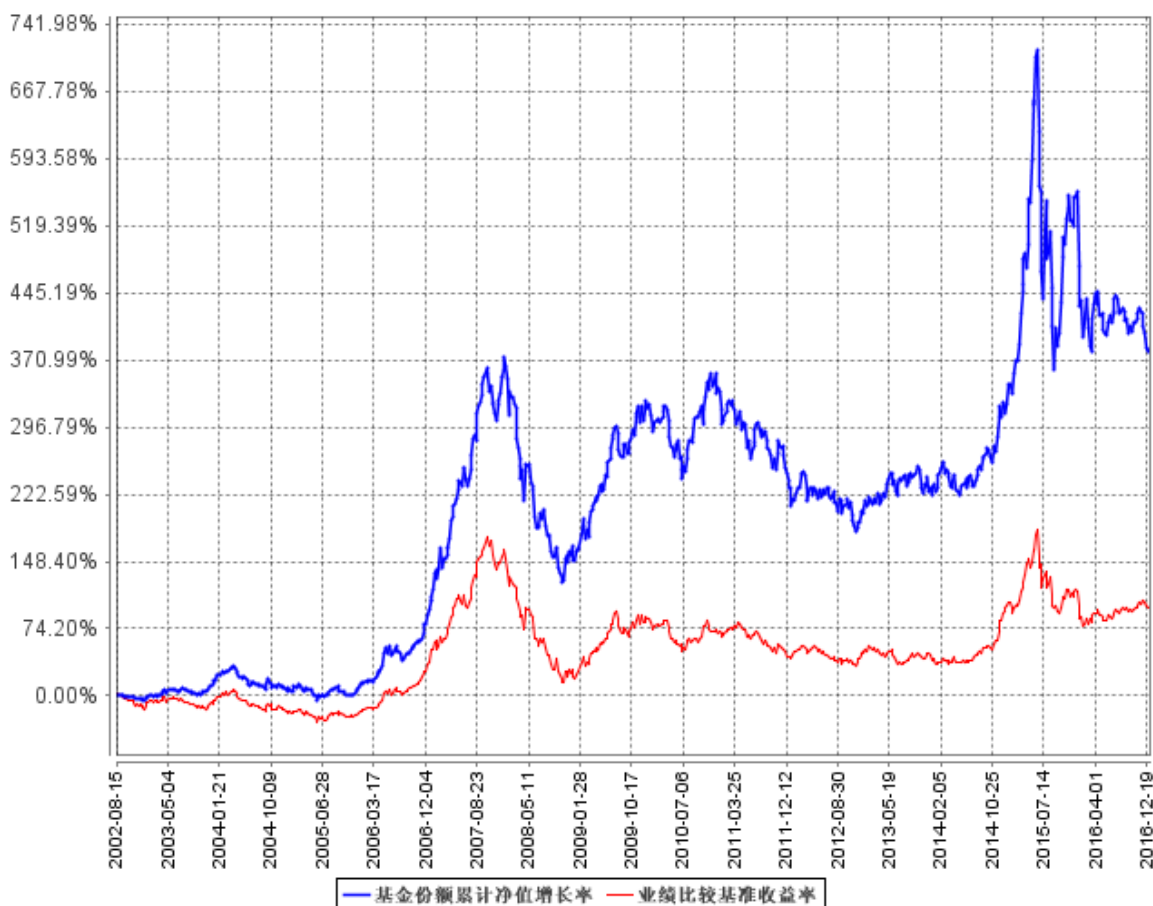
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.11%	1.54%	2.52%	1.15%	-6.63%	0.39%
过去六个月	-7.98%	1.59%	4.86%	1.13%	-12.84%	0.46%
过去一年	-26.63%	3.23%	-8.14%	2.11%	-18.49%	1.12%
过去三年	44.48%	4.04%	40.43%	2.75%	4.05%	1.29%
过去五年	46.41%	3.44%	38.54%	2.39%	7.87%	1.05%
自基金合同生效起至今	381.57%	3.06%	97.71%	2.60%	283.86%	0.46%

注：本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数涨跌幅 \* 75% + 同期国债收益率 \* 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

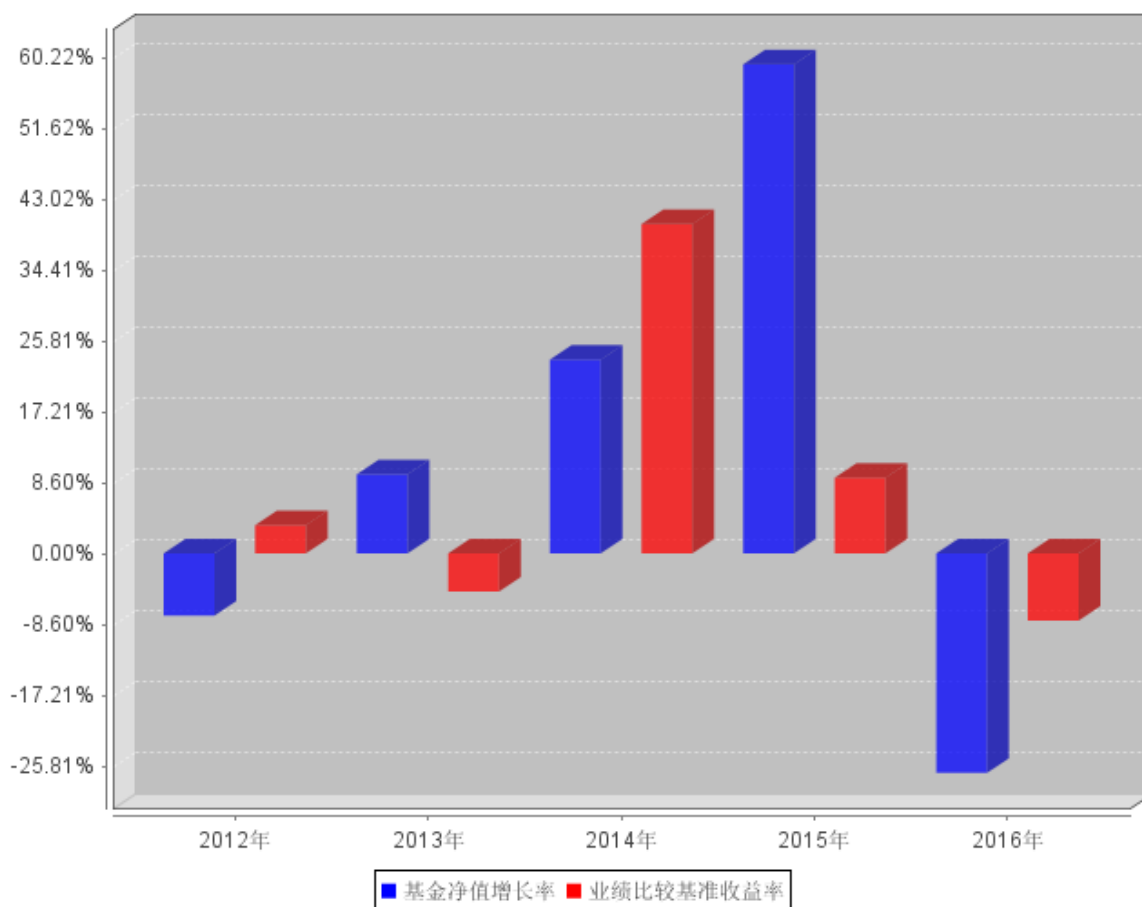


注：2002 年 8 月 15 日本基金成立，根据《银丰证券投资基金基金合同》规定，本基金应自基金合同生效日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截止本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定：（1）股票投资比例变动范围是：基金资产的 25%-75%；（2）债券投资比例变动范围是：基金资产的 25%-55%；（3）现金资产比例的变动范围是：基金资产的 0%-20%。



### 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



### 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
2016	3.20	960,000,000.00	-	960,000,000.00	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	3.20	960,000,000.00	-	960,000,000.00	

## § 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		
神玉飞	银丰证券投资基金的基金经理、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河创新成长混合型证券投资基金的基金经理	2012 年 12 月 21 日	-	8	中共党员，博士研究生学历。2007 年 9 月加入银河基金管理有限公司，曾担任宏观策略研究员、行业研究员、银丰证券投资基金的基金经理助理等职务，期间主要从事宏观策略行业研究和股票投资策略研究工作。2015 年 12 月起担任银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016



					年 2 月起担任银河创新成长混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------

注：1. 上表中任职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

银丰证券投资基金（以下简称“银河银丰封闭”）在本报告期内严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，公平对待所管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

银河银丰封闭在本报告期内未发现异常交易行为。

## 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

2016 年, 美国经济领先于其他发达经济体率先复苏, 实现了次债危机以来的首次加息。2016 年中国政府坚定不移的推动了供给侧改革, 传统的产能过剩的煤炭、钢铁等行业取得了卓越的效果; 叠加 2016 年地产行业的景气和政府对基建投资积极的鼓励支持, 中国经济增速温和回升, 工业企业盈利明显改善。

2016 年权益市场和债券市场冰火两重天走出了截然相反的走势, 全年权益市场虽然涌现出了阶段性投资机会, 但是全年仍然下跌; 债券市场虽然经历了年末的调整, 但是全年来看仍然好于权益市场。2016 年, 上证指数全年下跌 12.31%; 中小板指数和创业指数也分别下跌 22.89% 和 27.71%。分行业来看, 2016 年涨幅前三的行业依次为食品饮料、银行和家电。

本基金管理人在 2016 年虽然基本把握了阶段性的投资机会, 但是本基金管理人全年对市场的认识和判断还是出现了比较大的偏差, 基金运作的效果整体不理想。回顾 2016 年本基金的管理运作, 本基金管理人积极参与了三元锂电池、农业和建筑股的阶段性投资机会, 但是回顾 2016 年本基金管理人操作仍然存在以下方面需要提高: (1) 年初对市场的误判导致开局不利, 在重仓配置深度被套后, 没有及时断臂求生, 从而持续错过市场投资机会; (2) 对今年市场的艰巨性认识不足, 今年虽然市场整体机会较多, 但是在流动性偏紧的背景下, 整体还是熊市, 虽然出现了很多机会, 但是参与的同时如果没有积极去买卖交易, 往往也很难获利; (3) 思想禁锢, 未能与时俱进; 今年政府推动的供给侧改革给市场带来了重大投资机会; (4) 投资标的筛选出现了失误, 未能从治理结构、业绩增长的确定性等方面严格把控投资标的, 从未导致很多去年牛市持有的投资标的未能经得起熊市的检验, 从而对净值造成了比较大的损耗。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年, 本基金净值收益率为-26.63%, 业绩比较基准收益率为-8.14%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年全球经济形势, 本基金管理人判断美国经济仍将领先于发达经济体复苏, 但是川普新政将从经济和政治等层面对全球经济的复苏产生较大的扰动; 近期的先行经济指标显示欧元区正迎来 2008 年以来最稳健的恢复性增长; 日本自身经济的韧性也将促使经济保持一定的竞争力; 资源品景气复苏有望推行新兴市场国家经济回暖。

目前来看，虽然中国经济在地产基建需求复苏和供给侧改革共同推动下表现出了较强的复苏态势，但是展望 2017 年仍然面临川普新政、资产价格高企等不确定因素的挑战，综合来看，本基金管理人判断 2017 年中国经济面临的不确定性风险将对 2016 年良好的局面形成较大的干扰，总体形势谨慎乐观。

本基金管理人判断 2017 年宏观经济基本面和货币政策对资本市场的潜在双重压力将是国内的权益市场和债券市场面临的最大的风险。债券市场经历了 2015 年和 2016 年的大幅上涨后，利率下行空间近乎消失将是最大的风险；权益市场同样面临着 IPO、存量市场解禁和增量资金缺失的风险挑战。

基于对 2017 年股票市场相对谨慎乐观的判断，本基金管理人将采取保守的操作，保持相对较低的权益仓位且灵活操作，重点关注符合经济转型估值合理的成长股、稳定增长高分红的价值股和供给侧改革三大方向的投资机会。在上述基础上，本基金管理人也将密切跟踪研究周期股和消费股；成长股和价值股估值溢价率的变化，力争较好把握上述行业运行的机会与同时力争规避相关风险。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照现代企业制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，认真贯彻了独立董事制度，重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意，保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对

现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》，“基金收益分配比例不得低于基金净收益的 90%”，“基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额”，“基金收益分配采取现金方式，每年至少分配一次”。截至 2015 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 1,038,517,378.22 元。本公司已于 2016 年 4 月 15 日公告银丰证券投资基金 2015 年度分红，权益登记日 2016 年 4 月 20 日，除息日 2016 年 4 月 21 日。每 10 份基金份额派发现金红利 3.20 元。根据《证券投资基金法》有关规定，经本基金管理人计算并经基金托管人中国建设银行股份有限公司确认，利润分配方案符合上述约定。

## § 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，本基金实施利润分配的金额为 960,000,000.00 元。

### 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

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60821717_B08 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银丰证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的银河银丰证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银河基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>

审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银河银丰证券投资基金 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。	
注册会计师的姓名	郭杭翔	薛晓礼
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银丰证券投资基金

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	7.4.7.1	9,547,444.58	4,754,623.77
结算备付金		7,175,366.35	11,261,332.37
存出保证金		864,091.70	1,787,276.46
交易性金融资产	7.4.7.2	2,967,112,473.57	5,371,636,817.12
其中：股票投资		2,183,505,978.57	3,981,185,165.32
基金投资		-	-
债券投资		783,606,495.00	1,390,451,651.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	95,000,000.00	-
应收证券清算款		7,848,594.19	62,555,280.40
应收利息	7.4.7.5	21,133,500.49	47,586,494.23
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,108,681,470.88	5,499,581,824.35
<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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	86,000,000.00
应付证券清算款		17,131,857.91	4,008,116.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,991,781.54	6,667,408.51
应付托管费		665,296.94	1,111,234.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,391,670.36	4,426,399.21
应交税费		2,143,158.46	2,143,158.46
应付利息		-	14,776.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,150,000.00	2,050,000.00
负债合计		29,473,765.21	106,421,093.60
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	79,207,705.67	2,393,160,730.75
所有者权益合计		3,079,207,705.67	5,393,160,730.75
负债和所有者权益总计		3,108,681,470.88	5,499,581,824.35

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.026 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银丰证券投资基金

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>		-1,257,674,477.82	2,132,996,239.70
1.利息收入		39,318,432.45	50,190,242.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	531,971.38	975,026.22
债券利息收入		36,762,808.90	48,868,320.64
买入返售金融资产收入		2,023,652.17	346,895.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		110,801,267.35	1,352,343,546.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	104,280,921.29	1,277,126,182.29
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	-6,762,163.64	62,340,838.27
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	13,282,509.70	12,876,525.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,407,794,177.62	730,462,451.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		96,278,547.26	125,031,659.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	54,331,179.94	71,026,987.11
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,055,196.64	11,837,831.10
3. 交易费用	7.4.7.19	29,468,921.47	33,639,668.65
4. 利息支出		16,852.21	8,006,914.98
其中：卖出回购金融资产支出		16,852.21	8,006,914.98
5. 其他费用	7.4.7.20	3,406,397.00	520,257.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,353,953,025.08	2,007,964,580.40
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,353,953,025.08	2,007,964,580.40

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银丰证券投资基金

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）	3,000,000,000.00	2,393,160,730.75	5,393,160,730.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,353,953,025.08	-1,353,953,025.08
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-



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）	-	-960,000,000.00	-960,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	79,207,705.67	3,079,207,705.67
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）	3,000,000,000.00	385,196,150.35	3,385,196,150.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,007,964,580.40	2,007,964,580.40
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	3,000,000,000.00	2,393,160,730.75	5,393,160,730.75

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：

          刘立达  刘立达  秦长建            
 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

银丰证券投资基金(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[2002]39号文《关于同意设立银丰证券投资基金的批复》的核准，由中国银河投资管理有限公司(原名中国银河证券有限责任公司)、首都机场集团公司、上海城投(集团)有限公司(原名上海市城市建设投资开发总公司)、湖南广播电视产业中心、银河基金管理有限公司于2002年8月15日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发

行规模为 30 亿份基金份额。本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证债字[2002]12 号文审核同意，于 2002 年 9 月 10 日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金只投资于在国内依法公开发行的上市、具有良好流动性的金融工具，主要包括在上海证券交易所和深圳证券交易所挂牌的股票和债券，法律、法规及中国证监会允许的其他金融工具也将纳入本基金投资范围。本基金的投资组合遵循下列比例规定：（1）本基金投资于股票、债券的比例，不得低于基金资产总值的 80%；（2）本基金投资于债券的比例不低于基金资产总值的 25%，不高于基金资产总值的 55%；（3）本基金持有的一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；（4）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；（5）本基金投资于国家债券的比例，不得低于基金资产净值的 20%；（6）遵守法律、法规、中国证监会及本基金契约所规定的其他比例限制。

本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数涨跌幅 $\times$ 75%+同期国债收益率 $\times$ 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。

根据《银丰证券投资基金基金合同》的规定，本基金存续期至 2017 年 8 月 14 日终止。本基金的基金管理人银河基金管理有限公司正计划将本基金于存续期结束前改制为开放式基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金本报告期财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### 7.4.3 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 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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

##### (1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

##### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；基金成立三个月后，若持有的现金的比例超过本基金净值的 20%，超过部分不计提基金管理费；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 基金收益分配比例不得低于基金净收益的 90%;
- (2) 基金收益分配采取现金方式, 每年至少分配一次, 但若本基金成立至基金会计年度结束不足三个月可不进行收益分配, 年度分配在基金会计年度结束后的四个月内完成;
- (3) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后, 才可进行当年收益分配;
- (4) 基金投资亏损, 或者基金当年虽有收益但基金单位净值低于面值, 则不进行收益分配;
- (5) 基金收益分配后基金单位净值不能低于面值;
- (6) 每份基金单位享有同等分配权;
- (7) 法律、法规、中国证监会另有规定的, 从其规定。

#### 7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

### 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

本基金本报告期会计政策变更的说明在 7.4.2 会计报表的编制基础中披露。

#### 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、国家税务总局财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》的规定，对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	9,547,444.58	4,754,623.77
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	9,547,444.58	4,754,623.77

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,213,778,407.95	2,183,505,978.57	-30,272,429.38	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	647,605,720.71	621,075,495.00	-26,530,225.71
	银行间市场	158,879,170.00	162,531,000.00	3,651,830.00
	合计	806,484,890.71	783,606,495.00	-22,878,395.71
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,020,263,298.66	2,967,112,473.57	-53,150,825.09	
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,645,096,804.14	3,981,185,165.32	1,336,088,361.18	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,122,754,990.45	1,132,000,651.80	9,245,661.35
	银行间市场	249,141,670.00	258,451,000.00	9,309,330.00
	合计	1,371,896,660.45	1,390,451,651.80	18,554,991.35
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,016,993,464.59	5,371,636,817.12	1,354,643,352.53	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	95,000,000.00	-
合计	95,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,950.77	43,245.74
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,551.79	5,574.36
应收债券利息	21,122,556.24	47,536,789.40
应收买入返售证券利息	5,013.90	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	427.79	884.73
合计	21,133,500.49	47,586,494.23

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,391,535.36	4,426,399.21
银行间市场应付交易费用	135.00	-

合计	3,391,670.36	4,426,399.21
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00	1,750,000.00
应付赎回费	-	-
预提审计费用	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	300,000.00	200,000.00
合计	2,150,000.00	2,050,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

注：于 2016 年末，本基金的发起人中国银河投资管理有限公司持有 900.00 万份，占比 0.30%；首都机场集团公司持有 300.00 万份，占比 0.10%；上海城投（集团）有限公司持有 150.00 万份，占比 0.05%；湖南电广传媒股份有限公司持有 150.00 万份，占比 0.05%；银河基金管理有限公司持有 300.00 万份，占比 0.10%。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,038,517,378.22	1,354,643,352.53	2,393,160,730.75
本期利润	53,841,152.54	-1,407,794,177.62	-1,353,953,025.08
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-960,000,000.00	-	-960,000,000.00
本期末	132,358,530.76	-53,150,825.09	79,207,705.67

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	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
活期存款利息收入	220,798.04	684,372.66
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	288,304.89	269,251.65
其他	22,868.45	21,401.91
合计	531,971.38	975,026.22

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	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
卖出股票成交总额	9,961,485,747.77	11,584,147,444.28
减：卖出股票成本总额	9,857,204,826.48	10,307,021,261.99
买卖股票差价收入	104,280,921.29	1,277,126,182.29

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,762,163.64	62,340,838.27
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-6,762,163.64	62,340,838.27

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,031,383,285.75	1,340,209,355.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,004,250,695.75	1,253,934,133.68
减：应收利息总额	33,894,753.64	23,934,383.50
买卖债券差价收入	-6,762,163.64	62,340,838.27

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	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
股票投资产生的股利收益	13,282,509.70	12,876,525.47
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	13,282,509.70	12,876,525.47

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-1,407,794,177.62	730,462,451.02
——股票投资	-1,366,360,790.56	748,770,614.29
——债券投资	-41,433,387.06	-18,308,163.27
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-1,407,794,177.62	730,462,451.02

#### 7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	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
交易所市场交易费用	29,468,496.47	33,639,668.65
银行间市场交易费用	425.00	-
合计	29,468,921.47	33,639,668.65

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12
----	-----------------------	------------------------------

	12 月 31 日	月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
上清所数字证书服务费	-	-
其他	2,700.00	2,000.00
账户维护费	40,500.00	31,500.00
银行费用	23,197.00	26,757.46
分红手续费	2,880,000.00	-
合计	3,406,397.00	520,257.46

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除（上述利润分配事项及在）7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 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、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
首都机场集团公司	基金管理人的股东、基金发起人
上海城投（集团）有限公司	基金管理人的股东、基金发起人
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.9.1.1 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	1,298,454,055.74	6.70%	3,527,757,900.59	15.95%



## 7.4.9.1.2 债券交易

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	-	-	65,808,184.80	2.41%

## 7.4.9.1.3 债券回购交易

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	
	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	-	-	590,000,000.00	3.55%

## 7.4.9.1.4 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。

## 7.4.9.1.5 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	1,183,281.86	6.65%	115,212.79	3.40%
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	3,181,532.72	15.88%	172,968.12	3.91%

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。

#### 7.4.9.2 关联方报酬

##### 7.4.9.2.1 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	54,331,179.94	71,026,987.11
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理费。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起两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、休息日等，支付日期顺延。

##### 7.4.9.2.2 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	9,055,196.64	11,837,831.10

注：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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，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，基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### 7.4.9.2.3 销售服务费

### 7.4.9.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用自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（2002年8月15日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	3,000,000.00	3,000,000.00
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	3,000,000.00	3,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1000%	0.1000%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

#### 7.4.9.4.2 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		上年度末	
	2016年12月31日		2015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
首都机场	3,000,000.00	0.1000%	3,000,000.00	0.1000%
上海城投	1,500,000.00	0.0500%	1,500,000.00	0.0500%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方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。

### 7.4.9.5 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	9,547,444.58	220,798.04	4,754,623.77	684,372.66

#### 7.4.9.6 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均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10 利润分配情况

##### 7.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016年4月20日	2016年4月21日	2016年4月21日	3.20	960,000,000.00		-960,000,000.00	
合计	-	-	-	3.20	960,000,000.00		-960,000,000.00	

#### 7.4.11 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.11.1 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

7.4.12.1.1 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
300508	维宏股份	2016年4月12日	2017年4月19日	锁定期股票	20.08	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-

		日	日							
300583	赛托生物	2016年 12月29 日	2017年 1月6 日	新股流 通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	新股流 通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	新股流 通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	新股流 通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年 12月28 日	2017年 1月5 日	新股流 通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年 12月29 日	2017年 1月10 日	新股流 通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
603186	华正新材	2016年 12月26 日	2017年 1月3 日	新股流 通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	新股流 通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年 12月26 日	2017年 1月4 日	新股流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：本基金持有的股票“维宏股份”为网下申购新股中签，中签部分为认购网下老股东的转让部分，自愿设定 12 个月锁定期，锁定期自本次公开发行的股票在上交所上市交易之日起开始计算。

#### 7.4.11.2 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等流通受限股票。

### 7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.11.3.1 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。

#### 7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

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。

### 7.4.11.4 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心,将内部控制和风险管理有机地结合起来,注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系,建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施,通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系,以完善的内部控制程序和控制措施,有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系,主要包括:(1)员工自律;(2)部门主管的检查监督;(3)总经理领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督;(4)董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。

公司设立独立的风险控制专员岗,专门负责对投资管理全过程进行监督,出具监督意见和风险建议;对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督;对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

### 7.4.11.5 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险,信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;同时,公司建立了内部评级体系和交易对手库,在进行银行间同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式,以控制相应的信用风险。

### 7.4.11.6 流动性风险

流动性风险是因市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。本基金

的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金管理人每日对本基金的流动性需求进行测算，并同时通过独立的风控专员定期对基金流动性进行检查，并对潜在的流动性风险进行提示。

#### 7.4.11.7 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.11.7.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 7.4.11.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 201 6 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	9,547,444.58	-	-	-	-	-	9,547,444.58
结 算 备 付 金	7,175,366.35	-	-	-	-	-	7,175,366.35

存出保证金	864,091.70	-	-	-	-	-	864,091.70
交易性金融资产	-	10,015,000.00	146,655,215.00	570,420,880.00	56,515,400.00	2,183,505,978.57	2,967,112,473.57
买入返售金融资产	95,000,000.00	-	-	-	-	-	95,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,848,594.19	7,848,594.19
应收利息	-	-	-	-	-	21,133,500.49	21,133,500.49
资产总计	112,586,902.63	10,015,000.00	146,655,215.00	570,420,880.00	56,515,400.00	2,212,488,073.25	3,108,681,470.88
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	17,131,857.91	17,131,857.91
应	-	-	-	-	-	3,991,781.54	3,991,781.54



付 管 理 人 报 酬							
应 付 托 管 费		-	-	-	-	665,296.94	665,296.94
应 付 交 易 费 用		-	-	-	-	3,391,670.36	3,391,670.36
应 付 税 费		-	-	-	-	2,143,158.46	2,143,158.46
其 他 负 债		-	-	-	-	2,150,000.00	2,150,000.00
负 债 总 计		-	-	-	-	29,473,765.21	29,473,765.21
利 率 敏 感 度 缺 口	112,586,902.63	10,015,000.00	146,655,215.00	570,420,880.00	56,515,400.00	2,183,014,308.04	3,079,207,705.67
上 年 度 末 2015 年 12 月 31	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

目							
资产							
银行存款	4,754,623.77	-	-	-	-	-	4,754,623.77
结算备付金	11,261,332.37	-	-	-	-	-	11,261,332.37
存出保证金	1,787,276.46	-	-	-	-	-	1,787,276.46
交易性金融资产	457,096,704.50	10,022,000.00	238,772,070.00	485,665,749.70	198,895,127.60	3,981,185,165.32	5,371,636,817.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	62,555,280.40	62,555,280.40
应收利息	-	-	-	-	-	47,586,494.23	47,586,494.23
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	474,899,937.10	10,022,000.00	238,772,070.00	485,665,749.70	198,895,127.60	4,091,326,939.95	5,499,581,824.35
负债							

卖出回购金融资产款	86,000,000.00	-	-	-	-	-	86,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,008,116.67	4,008,116.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,667,408.51	6,667,408.51
应付托管费	-	-	-	-	-	1,111,234.75	1,111,234.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,426,399.21	4,426,399.21
应付利息	-	-	-	-	-	14,776.00	14,776.00
应交税费	-	-	-	-	-	2,143,158.46	2,143,158.46
其他负	-	-	-	-	-	2,050,000.00	2,050,000.00

债 负 债 总 计	86,000,000.00	-	-	-	-	20,421,093.60	106,421,093.60
利 率 敏 感 度 缺 口	388,899,937.10	10,022,000.00	238,772,070.00	485,665,749.70	198,895,127.60	4,070,905,846.35	5,393,160,730.75

#### 7.4.11.7.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	5,606,085.87	8,757,251.93
市场利率上升 25 个基点	-5,606,085.87	-8,757,251.93	

#### 7.4.11.7.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.11.7.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产价格的变动，本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.11.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,183,505,978.57	70.91	3,981,185,165.32	73.82
其他	-	-	-	-
合计	2,183,505,978.57	70.91	3,981,185,165.32	73.82

#### 7.4.11.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为上证 A 股指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定上证 A 股指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、测算时期为 3 个月，对于交易少于 3 个月的资产，默认其波动与指数同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	上证 A 股指数上升 5%	141,065,268.65	229,525,550.83
	上证 A 股指数下降 5%	-141,065,268.65	-229,525,550.83

#### 7.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1.2.1

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 2,279,487,269.07 元，属于第二层次的余额为人民币 687,625,204.50 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 3,268,860,361.47 元，属于第二层次的余额为人民币 2,102,776,455.65 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

##### 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（包括涨跌停时的交易不活跃）、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。

### 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	2,183,505,978.57	70.24
	其中：股票	2,183,505,978.57	70.24
2	固定收益投资	783,606,495.00	25.21
	其中：债券	783,606,495.00	25.21
	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	95,000,000.00	3.06
	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	16,722,810.93	0.54
7	其他各项资产	29,846,186.38	0.96
8	合计	3,108,681,470.88	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	204,595,000.00	6.64
B	采矿业	101,832,448.29	3.31
C	制造业	1,451,740,809.05	47.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00

E	建筑业	31,191,592.23	1.01
F	批发和零售业	83,427,722.55	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	170,861,628.25	5.55
J	金融业	106,780.00	0.00
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	24,780,904.38	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,955,455.20	0.39
R	文化、体育和娱乐业	102,966,262.28	3.34
S	综合	-	-
	合计	2,183,505,978.57	70.91

### 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所有股票投资明细

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	002026	山东威达	17,553,901	202,747,556.55	6.58
2	002458	益生股份	3,800,000	130,720,000.00	4.25
3	002013	中航机电	6,499,996	118,884,926.84	3.86
4	002372	伟星新材	7,299,268	112,627,705.24	3.66
5	002120	新海股份	1,999,842	100,792,036.80	3.27
6	002475	立讯精密	4,549,892	94,410,259.00	3.07
7	000333	美的集团	3,299,948	92,959,535.16	3.02
8	600038	中直股份	1,849,992	89,576,612.64	2.91
9	002405	四维图新	4,500,000	87,075,000.00	2.83
10	603368	柳州医药	1,034,955	83,427,722.55	2.71

11	603658	安图生物	1,499,957	83,382,609.63	2.71
12	300061	康耐特	3,499,924	80,603,249.72	2.62
13	600990	四创电子	1,099,983	79,968,764.10	2.60
14	002746	仙坛股份	1,500,000	73,875,000.00	2.40
15	002101	广东鸿图	2,999,903	69,747,744.75	2.27
16	600028	中国石化	11,399,940	61,673,675.40	2.00
17	300017	网宿科技	1,150,000	61,651,500.00	2.00
18	002353	杰瑞股份	2,849,981	57,854,614.30	1.88
19	601595	上海电影	1,374,994	54,477,262.28	1.77
20	000910	大亚圣象	2,799,905	53,478,185.50	1.74
21	600977	中国电影	2,100,000	48,489,000.00	1.57
22	000538	云南白药	599,835	45,677,435.25	1.48
23	002718	友邦吊顶	599,930	45,240,721.30	1.47
24	600547	山东黄金	1,099,939	40,158,772.89	1.30
25	002050	三花智控	3,300,000	36,432,000.00	1.18
26	601238	广汽集团	1,349,970	31,278,804.90	1.02
27	002717	岭南园林	1,200,000	31,176,000.00	1.01
28	300403	地尔汉宇	450,000	28,021,500.00	0.91
29	300190	维尔利	1,399,974	22,525,581.66	0.73
30	300033	同花顺	299,971	20,632,005.38	0.67
31	300308	中际装备	541,700	12,892,460.00	0.42
32	300015	爱尔眼科	399,848	11,955,455.20	0.39
33	603718	海利生物	600,000	10,692,000.00	0.35
34	603355	莱克电气	80,000	3,693,600.00	0.12
35	000888	峨眉山A	188,888	2,255,322.72	0.07
36	300508	维宏股份	10,383	1,261,430.67	0.04
37	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
38	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
39	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
40	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
41	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
42	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
43	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
44	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
45	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
46	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
47	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
48	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
49	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00



50	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
51	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
52	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
53	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
54	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
55	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
56	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
57	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
58	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
59	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
60	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
61	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

## 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	300033	同花顺	176,968,725.46	3.28
2	002458	益生股份	167,836,533.29	3.11
3	002026	山东威达	160,649,077.30	2.98
4	002780	三夫户外	154,027,967.68	2.86
5	002234	民和股份	152,213,866.38	2.82
6	600547	山东黄金	138,962,367.57	2.58
7	002013	中航机电	135,608,193.05	2.51
8	002508	老板电器	123,940,710.81	2.30
9	000728	国元证券	121,894,534.17	2.26
10	600519	贵州茅台	118,760,650.98	2.20
11	002299	圣农发展	114,891,693.25	2.13
12	601688	华泰证券	112,976,333.24	2.09
13	002120	新海股份	112,666,779.64	2.09
14	300327	中颖电子	107,741,611.33	2.00
15	600155	宝硕股份	106,435,299.47	1.97
16	002468	艾迪西	104,981,801.79	1.95
17	002475	立讯精密	98,957,220.79	1.83
18	000333	美的集团	97,617,934.07	1.81

19	002280	联络互动	97,054,982.27	1.80
20	600977	中国电影	94,446,733.85	1.75

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	300059	东方财富	319,276,765.23	5.92
2	300036	超图软件	176,215,627.20	3.27
3	002717	岭南园林	167,337,004.23	3.10
4	600172	黄河旋风	157,388,539.93	2.92
5	002280	联络互动	148,977,863.11	2.76
6	002577	雷柏科技	139,557,667.97	2.59
7	002508	老板电器	135,710,942.37	2.52
8	002426	胜利精密	133,746,410.71	2.48
9	300033	同花顺	132,109,711.96	2.45
10	600754	锦江股份	129,947,662.21	2.41
11	600836	界龙实业	128,830,596.47	2.39
12	000728	国元证券	128,205,911.60	2.38
13	002234	民和股份	127,777,640.23	2.37
14	002299	圣农发展	123,773,897.35	2.30
15	300431	暴风集团	123,397,297.19	2.29
16	300367	东方网力	123,078,898.25	2.28
17	601688	华泰证券	117,988,884.08	2.19
18	300011	鼎汉技术	116,290,687.32	2.16
19	600155	宝硕股份	115,556,969.51	2.14
20	600519	贵州茅台	114,500,278.74	2.12
21	600120	浙江东方	112,408,859.19	2.08
22	002402	和而泰	110,226,629.97	2.04
23	600235	民丰特纸	110,050,690.47	2.04

#### 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	9,425,886,430.29
卖出股票收入（成交）总额	9,961,485,747.77

**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	287,514,215.00	9.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	398,370,280.00	12.94
	其中：政策性金融债	398,370,280.00	12.94
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）	97,722,000.00	3.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	783,606,495.00	25.45

**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**

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	018002	国开 1302	2,208,000	230,978,880.00	7.50
2	010107	21 国债(7)	1,780,000	187,345,000.00	6.08
3	110031	航信转债	900,000	97,722,000.00	3.17
4	130412	13 农发 12	500,000	50,325,000.00	1.63
5	019313	13 国债 13	500,000	50,315,000.00	1.63

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**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持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**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**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**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：本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

报告期内本基金投资的前十名证券中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。

**8.12.2**

基金投资的前十名股票未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	864,091.70
2	应收证券清算款	7,848,594.19
3	应收股利	-
4	应收利息	21,133,500.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,846,186.38

**8.12.4 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	110031	航信转债	97,722,000.00	3.17

**8.12.5 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。

**§ 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
35,543	84,404.81	1,602,776,148.00	53.43%	1,397,223,852.00	46.57%

**9.2 期末上市基金前十名持有人**

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	泰康人寿保险股份有限公司 —分红—个人分红—019L— FH002 沪	306,272,775.00	10.21%
2	泰康人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品— 019L—CT001 沪	103,722,537.00	3.46%
3	中国太平洋人寿保险股份有 限公司—传统—普通保险产 品	79,133,754.00	2.64%
4	伦敦市投资管理有限公司— 客户资金	68,858,048.00	2.30%
5	阳光人寿保险股份有限公司 —万能保险产品	58,439,880.00	1.95%
6	建信人寿保险有限公司—普 通	56,518,221.00	1.88%
7	中国人寿资产管理有限公司	56,293,330.00	1.88%

8	中国证券金融股份有限公司 转融通担保证券账户	55,300,608.00	1.84%
9	泰康人寿保险股份有限公司 —万能一个险万能	50,443,305.00	1.68%
10	阳光人寿保险股份有限公司 —传统保险产品	49,163,539.00	1.64%

## § 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：

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。

2、2016年7月27日在法定报刊上刊登了《银河蓝筹精选混合型证券投资基金变更基金经理的公告》，王海华不再担任本基金的基金经理，增聘袁曦担任本基金的基金经理。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

无。

### 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的报酬为 100,000.00 元人民币。目前该

会计师事务所已向本基金提供 8 年的审计服务。

## 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	
天风证券		23,423,423,375.09	17.67%	3,119,762.02	17.54%	新增
国信证券		23,026,252,003.07	15.62%	2,769,573.33	15.57%	新增 1
中金公司		11,850,360,437.52	9.55%	1,723,236.17	9.69%	-
华创证券		11,451,085,323.88	7.49%	1,351,394.67	7.60%	-
中泰证券		11,391,586,338.58	7.18%	1,268,153.19	7.13%	新增
银河证券		41,298,454,055.74	6.70%	1,183,281.86	6.65%	-
东北证券		31,285,108,125.15	6.63%	1,183,596.94	6.65%	新增 1
国金证券	1	927,387,706.19	4.79%	845,128.20	4.75%	-
海通证券	1	771,187,120.96	3.98%	718,204.77	4.04%	-
安信证券	3	754,769,609.90	3.89%	691,953.99	3.89%	-
浙商证券	2	714,357,811.05	3.69%	661,117.72	3.72%	新增 1
渤海证券	1	569,838,393.25	2.94%	519,294.42	2.92%	新增 1
东兴证券	1	463,129,566.29	2.39%	422,050.72	2.37%	-
中信建投	2	440,364,858.98	2.27%	401,304.20	2.26%	-
兴业证券	2	410,418,189.89	2.12%	375,628.55	2.11%	-
广发证券	1	338,490,821.74	1.75%	308,466.49	1.73%	-
网信证券	1	262,929,062.90	1.36%	244,866.26	1.38%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	新增
申银万国	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

东吴证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
汉唐证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金本期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。

### 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
天风证券	-	-	431,000,000.00	2.04%	-	-



国信证券	16,697,554.60	1.98%	825,000,000.00	3.90%	-	-
中金公司	78,822,174.00	9.33%	8,622,000,000.00	40.78%	-	-
华创证券	161,173,191.30	19.08%	4,257,000,000.00	20.14%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	9,161,497.00	1.08%	276,000,000.00	1.31%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	42,230,014.40	5.00%	823,900,000.00	3.90%	-	-
安信证券	-	-	558,000,000.00	2.64%	-	-
浙商证券	167,250,905.70	19.80%	3,738,000,000.00	17.68%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	20,000,000.00	0.09%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
网信证券	369,189,258.14	43.72%	1,590,000,000.00	7.52%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
汉唐证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016年1月9日

	基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	券时报》、《上海证券报》、公司网站	
2	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 12 日
3	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 14 日
4	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 15 日
5	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 19 日
6	银丰证券投资基金 2015 年 4 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 1 月 22 日
7	关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 23 日
8	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 1 月 29 日
9	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 2 日
10	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2016 年 2 月 6 日

	估值方法的提示性公告	报》、公司网站	
11	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 16 日
12	银河基金管理有限公司关于总经理任职的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 19 日
13	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票估值调整的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 23 日
14	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 3 月 10 日
15	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 3 月 11 日
16	银丰证券投资基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 3 月 25 日
17	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 3 月 29 日
18	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 4 月 13 日
19	银丰证券投资基金 2015 年度分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 4 月 15 日

20	银丰证券投资基金 2016 年 1 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2016 年 4 月 21 日
21	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 14 日
22	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 17 日
23	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 18 日
24	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 6 月 22 日
25	银丰证券投资基金 2016 年 2 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2016 年 7 月 19 日
26	银丰证券投资基金 2016 年半年报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2016 年 8 月 25 日
27	银丰证券投资基金 2016 年 3 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2016 年 10 月 26 日
28	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016 年 11 月 11 日

	基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	券时报》、《上海证券报》、公司网站	
29	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 11 月 18 日
30	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 12 月 19 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河银丰证券投资基金的文件
- 2、《银河银丰证券投资基金基金合同》
- 3、《银河银丰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、银河银丰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

### 12.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 楼

### 12.3 查阅方式

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

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司  
2017 年 3 月 31 日