

# 银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资 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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2016 年 3 月 11 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.....	6
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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	19
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
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	61

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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
9.3 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 .....	63
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>63</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8 其他重大事件 .....	67
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>74</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	74
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银河智造混合
场内简称	-
基金主代码	519642
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	2016年3月11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	107,568,797.16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	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。
投资策略	本基金为权益类资产主要投资于大国智造主题相关行业及其子行业的混合型基金，在投资中将对基金的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础，进而结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，注重股票资产在大国智造主题相关行业及其子行业的配置，并考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产波动的风险。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准是：中证装备产业指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30% 中证装备产业指数成分股的涵盖与本基金定义的大国智造主题比较相符，且中证装备产业指数市场认可度较高；上证国债指数，市场认同度较高、指数编制方法较为科学，因此选择基准采用中证装备产业指数和上证国债指数组合作为本基金的业绩比较基准比较适合。

风险收益特征	<p>本基金投资策略所特有的风险</p> <p>(1) 本基金投资范围包含包括信用债券, 因此基金资产中一旦出现信用违约事件, 基金净值将产生一定波动, 投资绩效将会受到影响。(2) 本基金动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征, 追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长, 但策略分析研判结果可能与宏观经济的实际走向、上市公司的实际发展情况、股票市场或个股的实际表现存在偏差, 进而影响基金业绩。</p>
--------	---

### 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
	联系电话	021-38568888
	电子邮箱	dongboru@galaxyasset.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	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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3月11日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	7,835,958.50
本期利润	5,108,567.42
加权平均基金份额本期利润	0.0243
本期加权平均净值利润率	2.40%
本期基金份额净值增长率	-2.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	-2,188,438.32
期末可供分配基金份额利润	-0.0203
期末基金资产净值	105,380,358.84
期末基金份额净值	0.980
3.1.3 累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	-2.00%

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、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、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。

4、基金合同生效日为 2016 年 3 月 11 日。

#### 3.2 基金净值表现

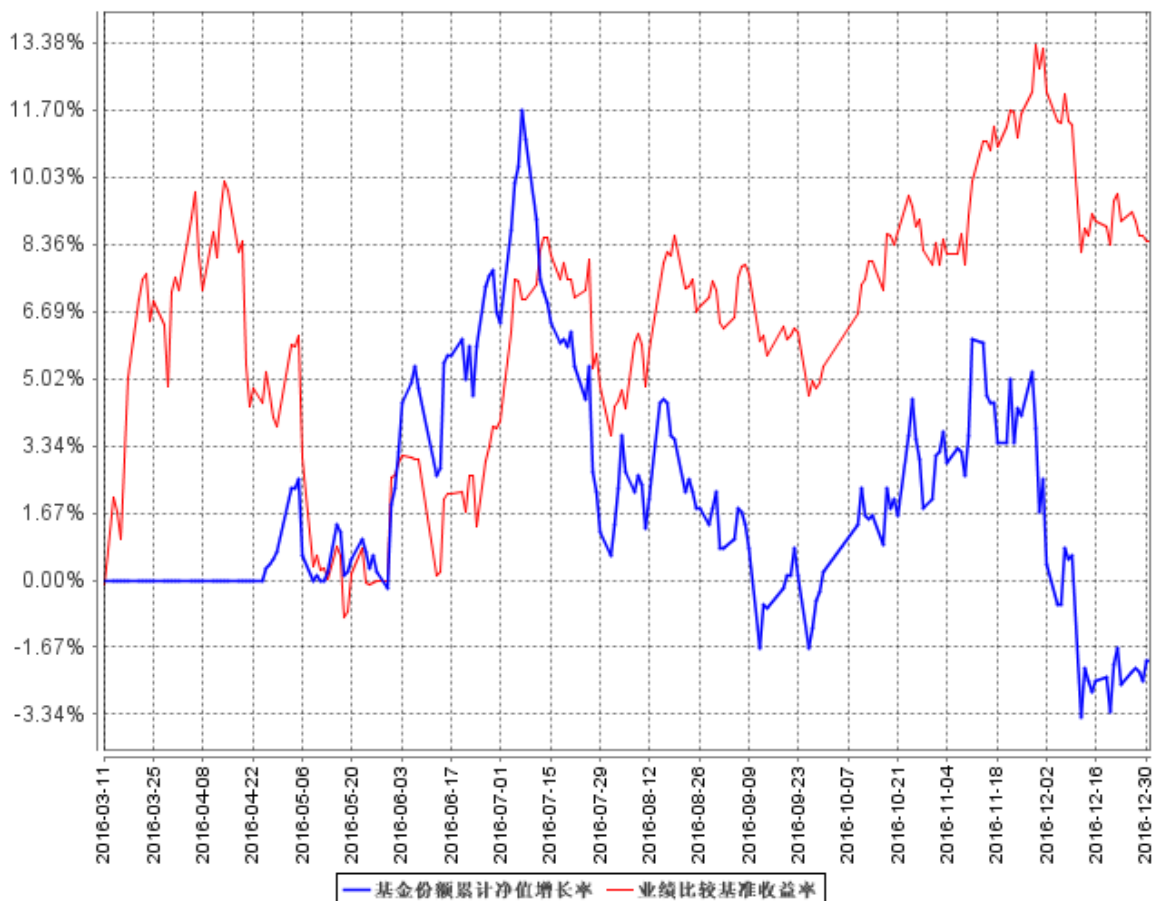
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.20%	1.05%	2.96%	0.66%	-5.16%	0.39%
过去六个月	-8.15%	0.98%	4.49%	0.70%	-12.64%	0.28%
自基金合同生效起至今	-2.00%	0.88%	8.44%	0.88%	-10.44%	0.00%

注：本基金业绩比较基准为：中证装备产业指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。

### 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

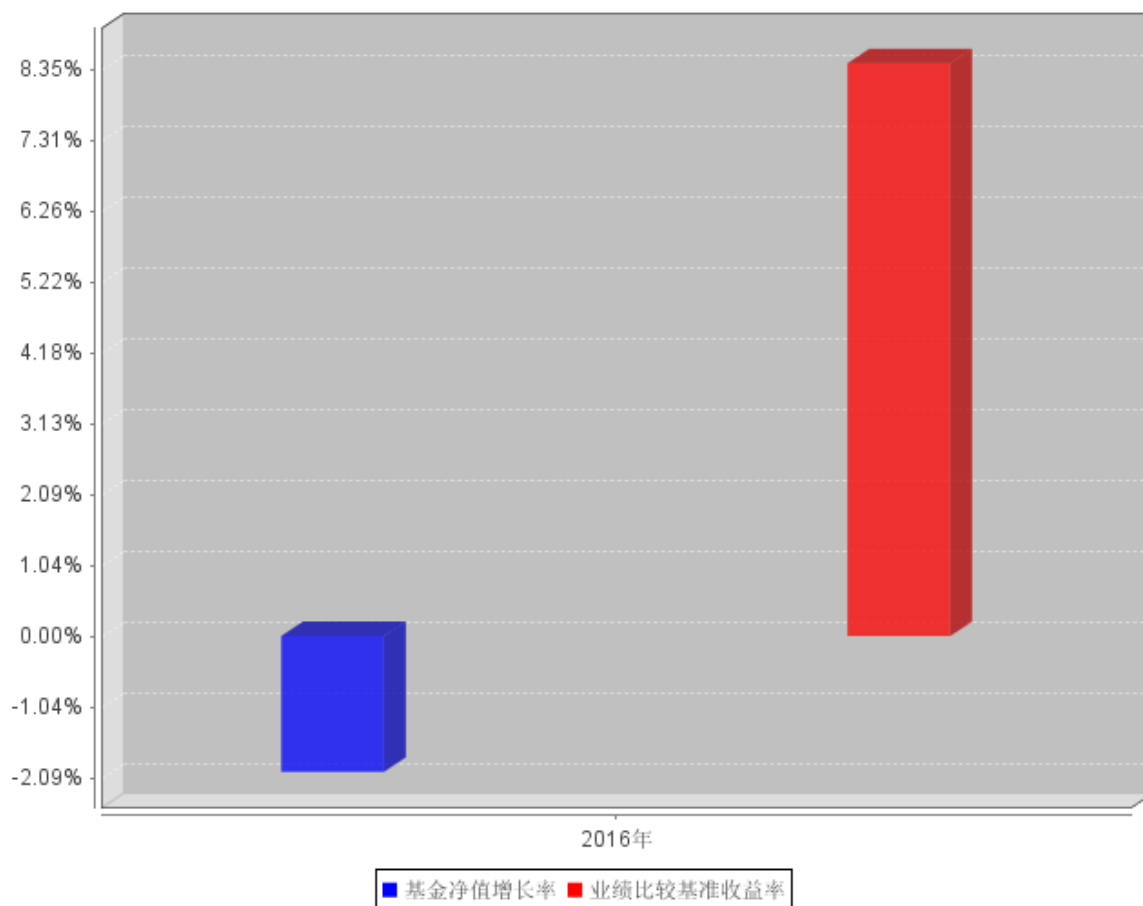
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





### 3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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、本基金合同生效期为 2016 年 3 月 11 日，截止报告期末不满 1 年；根据《银河基金大国智造混合型证券投资基金合同》规定，本基金应自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截止本报告期末，建仓已完成。

2、本项目按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金合同生效日为 2016 年 3 月 11 日，未进行利润分配。

## § 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		
张杨	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银	2016 年 3 月 11 日	-	12	硕士研究生学历，CFA 三级证书，曾先后就职于上海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司，从事宏观经济及股票策略研究工作。2008 年 9 月加入银河基



	河银泰理财分红证券投资基金的基金经理、银河美丽优萃混合型证券投资基金的基金经理、银河主题策略混合型证券投资基金的基金经理			金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理等职务。2011年10月起担任银河银泰理财分红证券投资基金的基金经理，2014年5月起担任银河美丽优萃混合型证券投资基金的基金经理，2014年11月至2016年3月担任银河康乐股票型证券投资基金的基金经理，2016年2月起担任银河主题策略混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、上表中任职日期为该基金基金合同生效之日。

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，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。

## 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 年年初指数熔断后出现持续上涨和区间震荡，上证指数全年下跌 12.31%，创业板指数全年下跌 27.71%，市场没有整体性机会，市场表现出一定熊市特征，处于在长期去估值泡沫的过程中。从行业表现排名来看，居前的是食品饮料，钢铁，采掘等，居后的计算机，传媒等。

操作层面上，银河大国智造主要投资方向是符合基金合同规定的符合中国经济转型的行业和个股，如半导体、医药等。此外，银河大国智造也积极参与了低估值行业，如金融、汽车等。由于市场波动性较大，银河大国智造也采取了相对灵活的交易策略。

对于 2017 年的市场趋势，首先，市场本身仍需要通过空间和时间的调整来消化这一定价过高的问题。其次，我们需要在市场进入底部区域后积极布局下一个新周期的投资机会。新周期的表

现为政府主动管理行为下的供给侧改革和创新经济的需求拉动效应。我们相信中国经济内生的增长动力以及存在着诸多结构性机会。

2016 年的主要行业配置思路：首先是重点投资符合中国经济大方向的结构性机会：消费升级和工业化升级受益的行业，其次，具有国际化估值优势的低估值蓝筹：银行、基建等，第三，行业景气向上行业：化工、钢铁、采掘和有色等中上游行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年，银河大国智造基金期内的净值表现为-2.00%，业绩比较基准为 8.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济整体处在调整期，去除原有经济运行存在的问题和寻求新的转型方向同时进行。本轮经济调整已经历时四年多，在积极的政策供给压缩的引导下，经济中出现一些库存见底反弹的积极因素，从 2016 年下半年开始的补库存直接体现在中上游原料和产成品价格底部迅速反弹，这一趋势仍在 2017 年上半年将持续，此外，虽然地产投资在严厉的调控政策出台之后，虽然增速会伴随销量回落而下滑，但受制于滞后效应和补库因素，短期负面冲击不会太大。下半年我们将关注经济上的一些挑战，中性偏紧的货币政策和赤字率目标或制约财政政策空间，从而影响基建投资，此外可能发生的中美贸易摩擦对中国出口会形成负面影响。2017 年我们也更加关注利率上行风险，尽管目前通胀水平并不支撑利率大幅走高，但国内货币政策导向和美联储加息路径会继续扰动市场的利率预期。总体而言，我们对上半年中国经济继续保持乐观，下半年则会多观察一些风险点。

展望 2017 年的 A 股市场，我们保持谨慎乐观。上半年宏观经济的脉冲式复苏仍在延续，企业尚处于新一轮的盈利弱改善周期，因此影响股价的分子端不悲观；而在分母端，无风险利率虽然受制于中性偏紧的货币政策导向，但市场已有所反应；伴随着中国经济改革加快推进，市场信心有望逐步恢复，风险偏好有望逐步回升。行业层面来看，我们认为受益于宏观经济复苏和供给侧改革驱动的部分周期行业近期仍有相对收益，消费升级则可能是贯穿全年的主题，包括汽车产业链、医药和食品饮料等。

#### 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、定期检查和不定期的检查相结合的方式，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

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，基金会计部按照管理层批准后的估值政策进行估值。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》于 2016 年 3 月 11 日生效，根据《基金合同》有关约定，“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。”截至本报告期末本基金可供分配利润为-2,188,438.32 元，未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 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

#### 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_B31 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	银河大国智造主题灵活配置混合型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大国智造主题灵活配置混合型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 03 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（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，公允反映了银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 03 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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(特殊普通合伙)
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：银河大国智造主题灵活配置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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	16,883,050.63
结算备付金		1,299,602.53

存出保证金		260,712.99
交易性金融资产	7.4.7.2	86,377,655.38
其中：股票投资		86,377,655.38
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,619,696.53
应收利息	7.4.7.5	3,575.36
应收股利		-
应收申购款		944.86
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		106,445,238.28
<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>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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		5,776.53
应付管理人报酬		135,869.92
应付托管费		22,644.99
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	630,566.23
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	270,021.77
负债合计		1,064,879.44
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	107,568,797.16
未分配利润	7.4.7.10	-2,188,438.32
所有者权益合计		105,380,358.84
负债和所有者权益总计		106,445,238.28

注：(1) 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.980 元，基金份额总额 107,568,797.16 份。

(2) 本基金合同于 2016 年 03 月 11 日生效。

## 7.2 利润表

会计主体：银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 3 月 11 日(基金合同 生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		12,294,738.50
1. 利息收入		1,470,081.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	498,059.96
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		972,021.06
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,248,898.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,601,022.45
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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	647,876.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,727,391.08
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	1,303,150.06
<b>减：二、费用</b>		7,186,171.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,571,904.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	428,650.78
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,901,252.91
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	284,362.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,108,567.42
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,108,567.42



### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 11 日(基金合同生效日)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）	472,291,169.74	-	472,291,169.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,108,567.42	5,108,567.42
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）	-364,722,372.58	-7,297,005.74	-372,019,378.32
其中：1. 基金申购款	36,579,576.76	1,171,297.45	37,750,874.21
2. 基金赎回款	-401,301,949.34	-8,468,303.19	-409,770,252.53
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）	107,568,797.16	-2,188,438.32	105,380,358.84

注：（1）报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.980 元，基金份额总额 107,568,797.16 份。

（2）本基金合同于 2016 年 03 月 11 日生效。

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

基金管理人负责人

刘立达

主管会计工作负责人

秦长建

会计机构负责人

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]2063号《关于准予银河大国智造主题灵

活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由银河基金管理有限公司作为管理人自 2016 年 1 月 28 日到 2016 年 3 月 4 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2016）验字第 60821717\_B04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 3 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 472,119,021.90 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 172,147.84 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 472,291,169.74 元，折合 472,291,169.74 份基金份额。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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货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相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于本基金定义的大国智造主题相关股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中证装备产业指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。

#### 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 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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、《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。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

#### 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；

##### (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

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

卖出股票于交易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交易日结转；

##### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易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；

卖出债券于交易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

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

卖出权证于交易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交易日结转；

### (4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于交易日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于交易日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于交易日结转；

### (5) 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；

### (6) 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。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，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

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。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，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。

### 7.4.4.7 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。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转

入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 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) 权证投资收益/(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) 股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 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；

(10) 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；

(11)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。

#### 7.4.4.10 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%年费率逐日计提；
- (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)卖出回购金融资产支出，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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 每一基金份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

### 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。

### 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。

#### 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。

#### 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 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	16,883,050.63	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	16,883,050.63	-

##### 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	89,105,046.46	86,377,655.38	-2,727,391.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	89,105,046.46	86,377,655.38	-2,727,391.08

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**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
应收活期存款利息	2,802.94
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	643.39
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	129.03
合计	3,575.36

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

**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
交易所市场应付交易费用	630,566.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	630,566.23

**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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21.77
预提审计费用	50,000.00
预提信息披露费	220,000.00
合计	270,021.77

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	472,291,169.74	472,291,169.74
本期申购	36,579,576.76	36,579,576.76
本期赎回(以“-”号填列)	-401,301,949.34	-401,301,949.34
- 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	107,568,797.16	107,568,797.16

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2016 年 03 月 11 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 472,119,021.90 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 172,147.84 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 472,291,169.74 元，折合 472,291,169.74 份基金份额。

## 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	7,835,958.50	-2,727,391.08	5,108,567.42
本期基金份额交易产生的变动数	-5,138,379.54	-2,158,626.20	-7,297,005.74
其中：基金申购款	1,386,675.26	-215,377.81	1,171,297.45
基金赎回款	-6,525,054.80	-1,943,248.39	-8,468,303.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,697,578.96	-4,886,017.28	-2,188,438.32

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
	活期存款利息收入
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	39,013.41
其他	2,219.44
合计	498,059.96

#### 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3月11日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
卖出股票成交总额	1,266,158,861.75
减：卖出股票成本总额	1,254,557,839.30
买卖股票差价收入	11,601,022.45

#### 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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益—买卖差价收入。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期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：本基金未进行贵金属投资。

##### 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：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**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3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	647,876.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	647,876.05

**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3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,727,391.08
——股票投资	-2,727,391.08
——债券投资	-
——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	-2,727,391.08

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	1,299,633.52
其他	48.48
转换费收入	3,468.06
合计	1,303,150.06

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	3,898,252.91
银行间市场交易费用	3,000.00
合计	3,901,252.91

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	220,000.00
资金汇划费	9,862.91
帐户维护费	4,500.00
合计	284,362.91

**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 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

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系没有发生变化。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	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	1,066,236,844.00	40.87%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016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
中国银河证券股份有限公司	3,475,800,000.00	100.00%

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.5 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3月11日(基金合同生效日)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	972,602.26	40.51%	-	-
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

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,571,904.48
其中：支付销售机构的客户维护费	996,881.37

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	428,650.78	

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

基金托管费每日计提，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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。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。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

注：无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金报告期末与关联方进行银行间同业债券（含回购）交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.4.2 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：报告期末不存在除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**7.4.10.5 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3月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	16,883,050.63	456,827.11

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末进行利润分配。

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

##### 7.4.12.1 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
603660	苏州科达	2016年11月21日	2017年12月1日	锁定期股票	8.03	32.22	13,870	111,376.10	446,891.40	-
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	12,531	50,124.00	50,124.00	-
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	-
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	1,336	28,456.80	28,456.80	-
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	938	13,722.94	13,722.94	-
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	-
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	937	9,782.28	9,782.28	-
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	-
603228	景旺	2016年	2017年	新股流	23.16	23.16	395	9,148.20	9,148.20	-

	电子	12月28日	1月6日	通受限						
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	1,261	7,326.41	7,326.41	-

注：本基金持有“苏州科达”为网下申购新股中签，中签部分为认购网下老股份的转让部分，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。

#### 7.4.12.2 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
000411	英特集团	2016年12月27日	重大事项停牌	22.10	2017年1月11日	24.31	106,600	2,348,759.00	2,355,860.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

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。

#### **7.4.13.1 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造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。

#### **7.4.13.2 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。

#### **7.4.13.3 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	16,883,050.63	-	-	-	-	-	16,883,050.63
结算备付金	1,299,602.53	-	-	-	-	-	1,299,602.53
存出保证金	260,712.99	-	-	-	-	-	260,712.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	86,377,655.38	86,377,655.38
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,619,696.53	1,619,696.53
应收利息	-	-	-	-	-	3,575.36	3,575.36
应收申购款	-	-	-	-	-	944.86	944.86
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,443,366.15	-	-	-	-	88,001,872.13	106,445,238.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,776.53	5,776.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	135,869.92	135,869.92
应付托管费	-	-	-	-	-	22,644.99	22,644.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	630,566.23	630,566.23
其他负债	-	-	-	-	-	270,021.77	270,021.77
负债总计	-	-	-	-	-	1,064,879.44	1,064,879.44
利率敏感度缺口	18,443,366.15	-	-	-	-	-86,936,992.69	105,380,358.84
上年度末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2015 年 12 月 31 日			-1 年				
资产							
负债							

注：上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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金期末未持有债券资产，基金资产受市场利率的波动影响较小。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。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。

##### 7.4.13.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	86,377,655.38	81.97
其他	-	-
合计	86,377,655.38	81.97

##### 7.4.13.4.3.2 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中证 800 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定上中证 800 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）



	中证 800 指数上升 5%	5,604,224.41	-
	中证 800 指数下降 5%	-5,604,224.41	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 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。

##### 1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 4.14.1.2.1 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级的余额为人民币 83,387,124.81 元，属于第二层级的余额为人民币 2,990,530.57 元，属于第三层级余额为人民币 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、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级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	86,377,655.38	81.15
	其中：股票	86,377,655.38	81.15
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	18,182,653.16	17.08
7	其他各项资产	1,884,929.74	1.77
8	合计	106,445,238.28	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	5,976,900.00	5.67
C	制造业	67,073,568.94	63.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.04
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	2,355,860.00	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	7,326.41	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,867,879.14	3.67
J	金融业	7,042,611.00	6.68
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	86,377,655.38	81.97
--	----	---------------	-------

### 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	600667	太极实业	943,632	7,275,402.72	6.90
2	600155	宝硕股份	467,100	6,992,487.00	6.64
3	600104	上汽集团	222,961	5,228,435.45	4.96
4	600409	三友化工	500,000	4,695,000.00	4.46
5	000426	兴业矿业	500,000	4,360,000.00	4.14
6	600596	新安股份	416,094	4,260,802.56	4.04
7	600038	中直股份	79,997	3,873,454.74	3.68
8	600519	贵州茅台	11,493	3,840,385.95	3.64
9	600476	湘邮科技	120,000	3,789,600.00	3.60
10	300316	晶盛机电	305,200	3,656,296.00	3.47
11	600362	江西铜业	200,000	3,346,000.00	3.18
12	000683	远兴能源	1,000,000	3,180,000.00	3.02
13	600141	兴发集团	200,000	3,042,000.00	2.89
14	000063	中兴通讯	189,000	3,014,550.00	2.86
15	600096	云天化	300,000	2,847,000.00	2.70
16	002101	广东鸿图	120,000	2,790,000.00	2.65
17	000596	古井贡酒	60,000	2,730,000.00	2.59
18	600584	长电科技	150,000	2,647,500.00	2.51
19	002250	联化科技	150,000	2,427,000.00	2.30
20	000411	英特集团	106,600	2,355,860.00	2.24
21	002262	恩华药业	100,000	2,090,000.00	1.98
22	002120	新海股份	37,000	1,864,800.00	1.77
23	002037	久联发展	103,115	1,765,328.80	1.68
24	002078	太阳纸业	245,500	1,639,940.00	1.56
25	600497	驰宏锌锗	230,000	1,616,900.00	1.53
26	603660	苏州科达	13,870	446,891.40	0.42
27	600996	贵广网络	4,166	78,279.14	0.07
28	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.07

29	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.05
30	601375	中原证券	12,531	50,124.00	0.05
31	603218	日月股份	1,082	45,065.30	0.04
32	603298	杭叉集团	1,820	44,189.60	0.04
33	603058	永吉股份	3,675	40,535.25	0.04
34	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.04
35	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.03
36	603877	太平鸟	1,336	28,456.80	0.03
37	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.02
38	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
39	603266	天龙股份	938	13,722.94	0.01
40	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
41	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.01
42	603035	常熟汽饰	937	9,782.28	0.01
43	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.01
44	603228	景旺电子	395	9,148.20	0.01
45	603239	浙江仙通	244	7,673.80	0.01
46	603032	德新交运	1,261	7,326.41	0.01

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	49,346,813.79	46.83
2	300033	同花顺	31,505,755.35	29.90
3	600061	国投安信	29,593,039.70	28.08
4	000421	南京公用	27,705,025.24	26.29
5	600570	恒生电子	27,352,358.56	25.96
6	600547	山东黄金	26,137,065.76	24.80
7	002458	益生股份	24,817,983.48	23.55
8	000411	英特集团	24,198,799.54	22.96
9	601555	东吴证券	23,956,167.66	22.73
10	002183	怡亚通	22,924,475.40	21.75
11	600584	长电科技	22,510,635.48	21.36
12	600519	贵州茅台	22,006,086.34	20.88

13	000426	兴业矿业	21,361,439.19	20.27
14	600155	宝硕股份	21,360,772.83	20.27
15	600887	伊利股份	20,857,591.91	19.79
16	300104	乐视网	20,471,459.42	19.43
17	000858	五粮液	19,381,542.86	18.39
18	002299	圣农发展	18,929,809.62	17.96
19	002245	澳洋顺昌	18,867,236.95	17.90
20	601688	华泰证券	18,832,966.42	17.87
21	000002	万科A	18,241,091.38	17.31
22	000603	盛达矿业	17,076,923.84	16.21
23	600643	爱建集团	16,801,877.29	15.94
24	600016	民生银行	16,264,317.00	15.43
25	600476	湘邮科技	14,892,096.92	14.13
26	002371	七星电子	14,864,392.62	14.11
27	600362	江西铜业	14,862,385.00	14.10
28	600882	广泽股份	14,167,877.05	13.44
29	300054	鼎龙股份	13,538,457.75	12.85
30	002074	国轩高科	13,378,619.00	12.70
31	600446	金证股份	13,296,230.25	12.62
32	002572	索菲亚	11,869,927.00	11.26
33	600667	太极实业	11,778,652.66	11.18
34	300322	硕贝德	11,543,732.56	10.95
35	601118	海南橡胶	11,004,421.65	10.44
36	000596	古井贡酒	10,978,344.96	10.42
37	600048	保利地产	10,783,687.00	10.23
38	600188	兖州煤业	10,464,923.00	9.93
39	000333	美的集团	10,379,888.08	9.85
40	000878	云南铜业	9,763,578.00	9.27
41	002173	*ST 创疗	9,544,618.00	9.06
42	601166	兴业银行	9,369,439.32	8.89
43	600596	新安股份	9,319,747.80	8.84
44	601225	陕西煤业	9,123,196.00	8.66
45	601699	潞安环能	8,970,690.89	8.51
46	000049	德赛电池	8,927,346.39	8.47
47	000938	紫光股份	8,842,769.10	8.39
48	603899	晨光文具	8,834,097.92	8.38

49	603008	喜临门	8,685,466.84	8.24
50	000606	*ST 易桥	8,568,480.00	8.13
51	600891	秋林集团	8,566,903.49	8.13
52	600837	海通证券	8,495,754.20	8.06
53	300236	上海新阳	8,456,863.30	8.03
54	600702	沱牌舍得	8,377,361.00	7.95
55	002675	东诚药业	8,265,936.40	7.84
56	600079	人福医药	8,125,954.58	7.71
57	600521	华海药业	8,096,567.26	7.68
58	002076	雪莱特	8,029,525.00	7.62
59	000568	泸州老窖	7,675,129.98	7.28
60	000839	中信国安	7,552,455.00	7.17
61	002042	华孚色纺	7,452,120.00	7.07
62	600259	广晟有色	7,229,201.00	6.86
63	600436	片仔癀	7,228,672.39	6.86
64	002664	信质电机	7,200,149.51	6.83
65	300316	晶盛机电	6,981,370.40	6.62
66	000783	长江证券	6,759,511.00	6.41
67	002250	联化科技	6,705,351.00	6.36
68	002533	金杯电工	6,591,190.00	6.25
69	300340	科恒股份	6,571,418.00	6.24
70	300479	神思电子	6,357,756.00	6.03
71	000848	承德露露	6,292,240.78	5.97
72	000728	国元证券	6,113,264.30	5.80
73	002285	世联行	5,834,755.00	5.54
74	603108	润达医疗	5,763,746.10	5.47
75	000028	国药一致	5,757,749.20	5.46
76	300327	中颖电子	5,749,102.80	5.46
77	600104	上汽集团	5,708,707.01	5.42
78	600219	南山铝业	5,708,545.00	5.42
79	600500	中化国际	5,627,708.82	5.34
80	601099	太平洋	5,502,000.00	5.22
81	601336	新华保险	5,497,888.96	5.22
82	002078	太阳纸业	5,432,575.00	5.16
83	600328	兰太实业	5,389,702.00	5.11
84	300458	全志科技	5,354,033.00	5.08

85	300263	隆华节能	5,257,439.00	4.99
86	300398	飞凯材料	5,170,774.00	4.91
87	601009	南京银行	5,054,069.90	4.80
88	000581	威孚高科	5,053,537.00	4.80
89	002037	久联发展	5,003,957.59	4.75
90	300302	同有科技	4,855,677.00	4.61
91	603898	好莱客	4,854,217.00	4.61
92	002494	华斯股份	4,816,401.00	4.57
93	601800	中国交建	4,798,235.00	4.55
94	000630	铜陵有色	4,703,500.00	4.46
95	000776	广发证券	4,592,500.00	4.36
96	600511	国药股份	4,569,451.85	4.34
97	300140	启源装备	4,567,522.25	4.33
98	600409	三友化工	4,505,204.00	4.28
99	601390	中国中铁	4,494,000.00	4.26
100	601628	中国人寿	4,487,112.34	4.26
101	300500	苏州设计	4,449,780.00	4.22
102	600373	中文传媒	4,437,742.00	4.21
103	000553	沙隆达 A	4,310,427.00	4.09
104	600386	北巴传媒	4,251,306.00	4.03
105	300207	欣旺达	4,228,702.00	4.01
106	002120	新海股份	4,206,863.00	3.99
107	000732	泰禾集团	4,195,147.10	3.98
108	002353	杰瑞股份	4,077,560.00	3.87
109	002077	大港股份	4,076,926.00	3.87
110	300065	海兰信	4,029,256.00	3.82
111	601998	中信银行	3,960,000.00	3.76
112	600198	大唐电信	3,917,542.00	3.72
113	600330	天通股份	3,898,158.50	3.70
114	600038	中直股份	3,794,744.49	3.60
115	300045	华力创通	3,753,319.00	3.56
116	600497	驰宏锌锗	3,722,500.00	3.53
117	002007	华兰生物	3,700,699.00	3.51
118	600028	中国石化	3,626,954.00	3.44
119	601318	中国平安	3,612,730.00	3.43
120	600999	招商证券	3,596,000.00	3.41

121	002185	华天科技	3,505,197.00	3.33
122	300351	永贵电器	3,337,082.00	3.17
123	600166	福田汽车	3,319,768.00	3.15
124	600118	中国卫星	3,319,599.00	3.15
125	000910	大亚圣象	3,233,841.70	3.07
126	300098	高新兴	3,189,057.16	3.03
127	600141	兴发集团	3,182,911.00	3.02
128	601601	中国太保	3,158,000.00	3.00
129	002223	鱼跃医疗	3,152,063.00	2.99
130	601377	兴业证券	3,125,130.00	2.97
131	000063	中兴通讯	3,088,096.30	2.93
132	000625	长安汽车	3,082,836.80	2.93
133	000683	远兴能源	3,070,000.00	2.91
134	601668	中国建筑	2,960,696.00	2.81
135	002101	广东鸿图	2,909,264.20	2.76
136	600096	云天化	2,886,174.00	2.74
137	601012	隆基股份	2,879,888.00	2.73
138	000034	神州数码	2,849,784.00	2.70
139	600657	信达地产	2,770,807.98	2.63
140	600820	隧道股份	2,620,000.00	2.49
141	000756	新华制药	2,546,661.58	2.42
142	300381	溢多利	2,510,238.28	2.38
143	002043	兔宝宝	2,466,000.00	2.34
144	600801	华新水泥	2,354,948.34	2.23
145	600998	九州通	2,343,843.00	2.22
146	002667	鞍重股份	2,309,150.00	2.19
147	000039	中集集团	2,172,022.00	2.06
148	002172	澳洋科技	2,108,002.00	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	49,030,521.70	46.53



2	300033	同花顺	31,568,594.82	29.96
3	600061	国投安信	28,780,629.50	27.31
4	600570	恒生电子	28,483,514.77	27.03
5	600547	山东黄金	27,162,529.46	25.78
6	000421	南京公用	26,566,817.80	25.21
7	002458	益生股份	25,957,370.69	24.63
8	601555	东吴证券	24,300,772.92	23.06
9	002183	怡亚通	23,066,271.08	21.89
10	000411	英特集团	21,237,614.03	20.15
11	600887	伊利股份	20,816,416.29	19.75
12	002245	澳洋顺昌	20,453,709.72	19.41
13	000858	五粮液	20,146,099.98	19.12
14	300104	乐视网	19,673,056.00	18.67
15	600584	长电科技	19,404,397.56	18.41
16	002299	圣农发展	18,825,496.62	17.86
17	601688	华泰证券	18,229,117.00	17.30
18	600519	贵州茅台	18,074,990.86	17.15
19	000002	万科A	17,796,748.66	16.89
20	000603	盛达矿业	17,570,862.25	16.67
21	600643	爱建集团	17,302,041.28	16.42
22	000426	兴业矿业	16,195,457.20	15.37
23	600882	广泽股份	15,898,674.51	15.09
24	600016	民生银行	15,892,604.00	15.08
25	600155	宝硕股份	15,728,173.46	14.93
26	002371	七星电子	15,104,208.63	14.33
27	600446	金证股份	13,952,900.10	13.24
28	002074	国轩高科	13,535,992.00	12.84
29	300322	硕贝德	12,777,646.25	12.13
30	300054	鼎龙股份	12,715,047.42	12.07
31	002572	索菲亚	12,034,420.00	11.42
32	600362	江西铜业	11,283,912.00	10.71
33	601118	海南橡胶	11,250,104.00	10.68
34	600476	湘邮科技	11,125,428.85	10.56
35	000333	美的集团	10,879,548.71	10.32
36	600188	兖州煤业	10,838,263.00	10.28
37	600048	保利地产	10,400,487.00	9.87
38	601225	陕西煤业	9,792,495.00	9.29
39	600891	秋林集团	9,686,889.70	9.19

40	000049	德赛电池	9,473,988.00	8.99
41	000878	云南铜业	9,426,995.00	8.95
42	300236	上海新阳	9,309,833.00	8.83
43	601166	兴业银行	9,296,417.79	8.82
44	002675	东诚药业	9,189,436.60	8.72
45	600702	沱牌舍得	9,126,340.40	8.66
46	002173	*ST 创疗	9,118,116.00	8.65
47	000938	紫光股份	9,051,757.00	8.59
48	000596	古井贡酒	8,917,385.91	8.46
49	601699	潞安环能	8,817,269.45	8.37
50	000606	*ST 易桥	8,799,606.00	8.35
51	002076	雪莱特	8,442,805.62	8.01
52	603008	喜临门	8,406,993.46	7.98
53	600837	海通证券	8,227,358.55	7.81
54	603899	晨光文具	8,180,363.12	7.76
55	600521	华海药业	8,099,905.42	7.69
56	600079	人福医药	7,997,799.97	7.59
57	000568	泸州老窖	7,798,712.08	7.40
58	000839	中信国安	7,315,908.00	6.94
59	600436	片仔癀	7,308,414.00	6.94
60	002664	信质电机	7,039,647.60	6.68
61	000783	长江证券	6,915,461.36	6.56
62	002533	金杯电工	6,675,000.00	6.33
63	300340	科恒股份	6,649,654.00	6.31
64	002042	华孚色纺	6,604,875.16	6.27
65	300479	神思电子	6,583,485.76	6.25
66	600259	广晟有色	6,506,239.00	6.17
67	000848	承德露露	6,365,826.10	6.04
68	000728	国元证券	6,287,641.68	5.97
69	600500	中化国际	6,086,464.00	5.78
70	300327	中颖电子	5,790,361.00	5.49
71	300458	全志科技	5,740,060.05	5.45
72	600219	南山铝业	5,663,311.45	5.37
73	603108	润达医疗	5,603,800.60	5.32
74	000028	国药一致	5,533,999.70	5.25
75	002285	世联行	5,458,646.00	5.18
76	601099	太平洋	5,428,500.00	5.15
77	601336	新华保险	5,384,716.00	5.11

78	300302	同有科技	5,145,460.00	4.88
79	600596	新安股份	5,134,561.50	4.87
80	601009	南京银行	5,055,293.20	4.80
81	603898	好莱客	5,019,749.00	4.76
82	000581	威孚高科	4,995,239.46	4.74
83	600328	兰太实业	4,960,712.81	4.71
84	300263	隆华节能	4,927,579.31	4.68
85	300398	飞凯材料	4,839,830.00	4.59
86	000630	铜陵有色	4,815,000.00	4.57
87	601800	中国交建	4,729,771.00	4.49
88	600373	中文传媒	4,549,798.08	4.32
89	601390	中国中铁	4,532,326.70	4.30
90	002494	华斯股份	4,475,053.00	4.25
91	600511	国药股份	4,436,688.74	4.21
92	300500	苏州设计	4,399,416.00	4.17
93	002078	太阳纸业	4,388,630.00	4.16
94	300065	海兰信	4,361,373.75	4.14
95	300207	欣旺达	4,345,023.22	4.12
96	002250	联化科技	4,344,127.00	4.12
97	601628	中国人寿	4,278,086.00	4.06
98	002353	杰瑞股份	4,231,854.00	4.02
99	600667	太极实业	4,225,562.79	4.01
100	000553	沙隆达 A	4,225,274.00	4.01
101	000776	广发证券	4,180,708.08	3.97
102	000732	泰禾集团	4,142,585.07	3.93
103	600330	天通股份	4,042,822.00	3.84
104	300140	启源装备	3,974,094.00	3.77
105	600198	大唐电信	3,904,536.00	3.71
106	300045	华力创通	3,901,145.00	3.70
107	002077	大港股份	3,886,921.64	3.69
108	601998	中信银行	3,873,100.00	3.68
109	600386	北巴传媒	3,805,442.00	3.61
110	600999	招商证券	3,653,993.00	3.47
111	002007	华兰生物	3,626,171.00	3.44
112	601318	中国平安	3,598,000.00	3.41
113	600028	中国石化	3,594,382.00	3.41
114	000910	大亚圣象	3,515,906.00	3.34
115	002185	华天科技	3,327,951.97	3.16

116	600166	福田汽车	3,220,817.00	3.06
117	002223	鱼跃医疗	3,200,503.00	3.04
118	002037	久联发展	3,178,568.97	3.02
119	600118	中国卫星	3,172,878.22	3.01
120	300316	晶盛机电	3,107,131.00	2.95
121	601601	中国太保	3,089,622.00	2.93
122	601377	兴业证券	3,067,726.00	2.91
123	000625	长安汽车	3,067,702.78	2.91
124	300351	永贵电器	2,997,293.00	2.84
125	601012	隆基股份	2,931,798.00	2.78
126	000034	神州数码	2,913,659.58	2.76
127	002043	兔宝宝	2,873,595.20	2.73
128	601668	中国建筑	2,872,800.00	2.73
129	300098	高新兴	2,849,537.00	2.70
130	600820	隧道股份	2,795,000.00	2.65
131	600657	信达地产	2,762,485.94	2.62
132	300381	溢多利	2,591,442.65	2.46
133	002120	新海股份	2,484,238.00	2.36
134	600998	九州通	2,401,912.00	2.28
135	000756	新华制药	2,391,245.00	2.27
136	600801	华新水泥	2,327,686.00	2.21
137	002667	鞍重股份	2,320,050.00	2.20
138	300153	科泰电源	2,300,000.00	2.18
139	002583	海能达	2,206,831.22	2.09
140	002172	澳洋科技	2,131,189.64	2.02
141	000039	中集集团	2,109,356.00	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	1,343,662,885.76
卖出股票收入（成交）总额	1,266,158,861.75

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

注：本基金未投资国债期货。

## 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的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	260,712.99
2	应收证券清算款	1,619,696.53
3	应收股利	-
4	应收利息	3,575.36
5	应收申购款	944.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,884,929.74

### 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处于转股期的可转换债券。

### 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未存在流通受限的股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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
1,543	69,714.06	10,495,184.50	9.76%	97,073,612.66	90.24%

### 9.2 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	1,800,490.56	1.6738%

**9.3 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2016年3月11日）基金份额总额	472,291,169.74
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	36,579,576.76
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	401,301,949.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	107,568,797.16

**§ 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

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 50,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 1 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	
银河证券	2	1,066,236,844.00	40.87%	972,602.26	40.51%	-
兴业证券	2	631,257,712.01	24.20%	586,001.84	24.41%	-
国信证券	1	287,983,548.88	11.04%	268,197.49	11.17%	-
华创证券	1	212,133,884.41	8.13%	197,559.77	8.23%	-
中信建投	2	185,043,124.78	7.09%	168,630.33	7.02%	-
东方证券	1	89,905,505.33	3.45%	83,729.29	3.49%	-
东北证券	3	77,489,550.22	2.97%	70,616.43	2.94%	-
东兴证券	1	58,542,239.38	2.24%	53,349.62	2.22%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-



申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
网信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 3 月 11 日，本基金所使用的交易单元为本报告期内新增席位。

#### 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
银河证券	-	-	3,475,800,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
网信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年1月25日
2	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年1月25日
3	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年1月25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29日
5	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金关于新增中信建投证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年2月1日
6	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
7	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6日
8	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金关于新增东北证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年2月15日
9	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016年2月16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	
10	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
11	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
12	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金关于新增上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年2月26日
13	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
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11日
15	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金合同生效公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年3月12日
16	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
17	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆金所资产管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年4月1日
18	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016年4月1日

	部分基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	券时报》、《上海证券报》、公司网站	
19	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为代销机构并转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016年4月11日
20	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
21	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年4月20日
22	银河基金管理有限公司关于银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金开通直销平台基金转换和补差费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年4月22日
23	银河基金管理有限公司关于旗下基金网上交易申购和定期定额费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年4月22日
24	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016年4月22日
25	关于银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金开通交通银行股份有限公司等代销机构定投业务及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年4月25日
26	银河基金管理有限公司关于网上	《中国证券报》、《证	2016年5月5日

	交易系统关闭支付宝基金支付业务的公告	券时报》、《上海证券报》、公司网站	
27	银河基金管理有限公司关于淘宝店关闭基金申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年5月5日
28	银河基金管理有限公司关于旗下基金参加上海天天基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年5月6日
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5月14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5月17日
31	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
32	银河基金管理有限公司关于网上交易开通基金赎回极速回倍利宝业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016年5月30日
33	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
34	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年6月30日
35	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016年7月6日

	部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	
36	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金 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
37	关于旗下部分基金新增第一创业证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 8 月 4 日
38	关于旗下部分基金在第一创业证券股份有限公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 8 月 4 日
39	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在第一创业证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 8 月 4 日
40	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 8 月 12 日
41	银河基金管理有限公司关于旗下基金在京东电子商务平台进行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 8 月 19 日
42	关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为代销机构并开通转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 8 月 22 日
43	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016 年 8 月 22 日

	部分基金新增厦门市鑫鼎盛控股有限公司为代销机构及费率优惠的公告	券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	
44	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金 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
45	银河基金管理有限公司关于与中国工商银行合作开通基金网上直销业务并实行费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 8 月 29 日
46	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 9 月 20 日
47	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京懒猫金融信息服务有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 9 月 23 日
48	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增武汉市伯嘉基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 9 月 23 日
49	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京广源达信投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 9 月 30 日
50	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海浦东发展银行股份有限公司开通转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 10 月 12 日



51	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 10 月 13 日
52	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新摘要）	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 10 月 24 日
53	关于旗下部分基金新增中国民族证券有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 10 月 25 日
54	银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金 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
55	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 11 日
56	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州科地瑞富基金销售公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 11 月 11 日
57	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
58	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 11 月 28 日
59	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2016 年 11 月 29 日

	部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	
60	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
61	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 12 月 19 日
62	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 12 月 23 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河智造混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河智造混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河智造混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
- 5、银河智造混合型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 楼

### 13.3 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