

**银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资
基金
2017年半年度报告**

2017年 6月 30日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017年 8月 29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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中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 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况 | 6 |
| 2.2 基金产品说明 | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 7 |
| 2.4 信息披露方式 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 9 |
| 3.2 基金净值表现 | 9 |
| 3.3 其他指标 | 10 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 20 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 20 |
| 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 | 21 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 22 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 22 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 22 |
| 4.8 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 | 23 |
| §5 托管人报告 | 24 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 24 |
| 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 | 24 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 24 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 25 |
| 6.1 资产负债表 | 25 |
| 6.2 利润表 | 26 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 27 |
| 6.4 报表附注..... | 28 |
| §7 投资组合报告..... | 47 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 47 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 47 |
| 7.3 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..... | 48 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 54 |
| 7.6 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..... | 54 |
| 7.7 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..... | 54 |
| 7.8 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..... | 54 |
| 7.9 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..... | 55 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 55 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 55 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 55 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 57 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 57 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 57 |
| 8.3 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..... | 57 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 58 |
| §10 重大事件揭示..... | 59 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 59 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 59 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 59 |
| 10.8 其他重大事件..... | 62 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 64 |

| | |
|---|----|
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 64 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 64 |
| §12 备查文件目录..... | 65 |
| 12.1 备查文件目录..... | 65 |
| 12.2 存放地点..... | 65 |
| 12.3 查阅方式..... | 65 |

§ 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 | 83,571,389.52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 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-38568888 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | dongboru@galaxyasset.com | tianqing1.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》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.galaxyasset.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 1 上海市世纪大道 1568号中建大厦 15楼 2 北京市西城区闹市口大街 1号院 1号楼 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|-----------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2017年 1月 1日 - 2017年 6月 30日) |
|---------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益 | 1,993,179.22 |
| 本期利润 | 11,201,463.11 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1168 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.31% |
| 本期基金份额净值增长率 | 11.73% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2017年 6月 30日) |
| 期末可供分配利润 | 3,539,870.50 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0424 |
| 期末基金资产净值 | 91,547,514.80 |
| 期末基金份额净值 | 1.095 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2017年 6月 30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 9.50% |

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

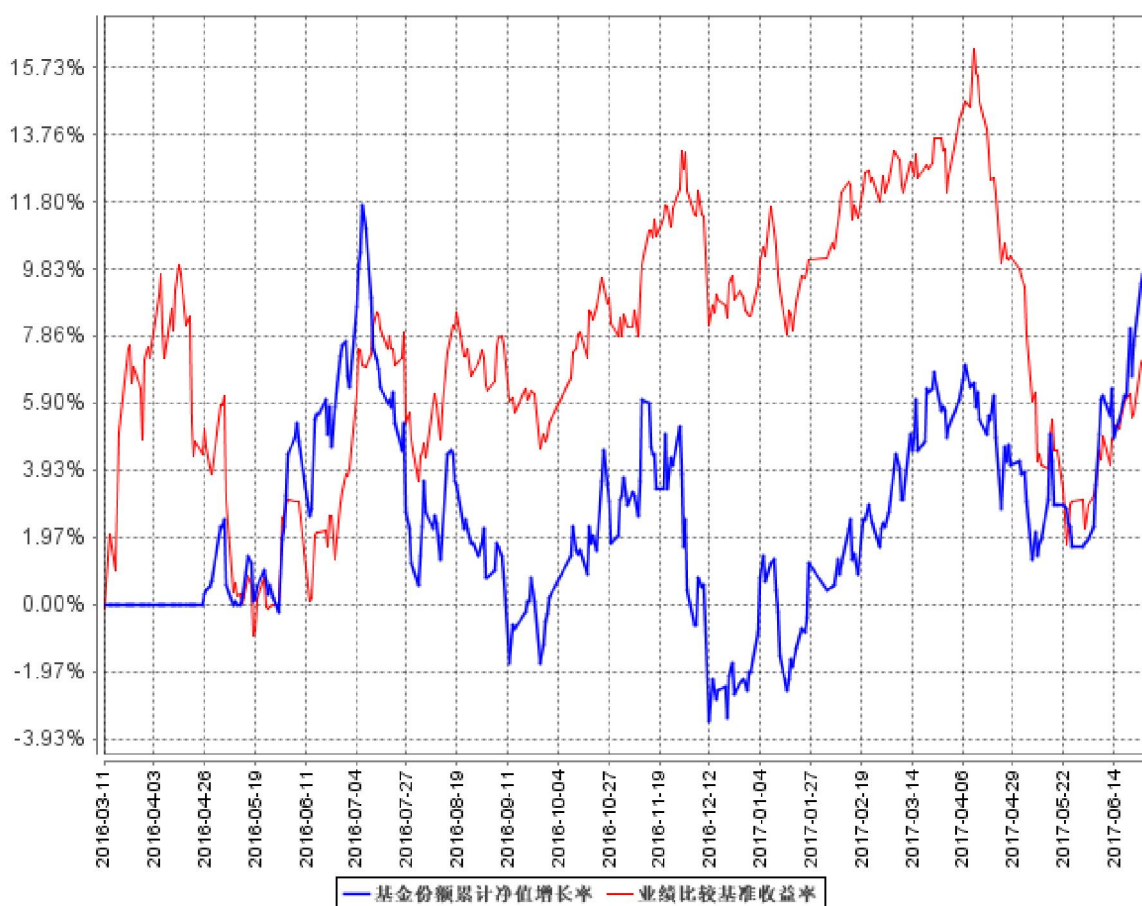
| 阶段 | 份额净值增长率 | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | - | - |
|-------|---------|------------|-----------|--------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 7.67% | 0.88% | 3.82% | 0.56% | 3.85% | 0.32% |
| 过去三个月 | 4.09% | 0.86% | -4.91% | 0.74% | 9.00% | 0.12% |
| 过去六个月 | 11.73% | 0.81% | -1.30% | 0.64% | 13.03% | 0.17% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | 2.62% | 0.90% | 3.13% | 0.67% | -0.51% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.50% | 0.85% | 7.03% | 0.80% | 2.47% | 0.05% |

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



3.3 其他指标

注：无。

§ 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，截止本报告期，银河基金管理有限公司管理 1 只封闭式与 43 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。

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2003 年 08 月 04 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 03 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 03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 银河竞争优势成长股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2008年 05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 银河行业优选股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009年 04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 银河蓝筹精选股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010年 07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 银河创新成长股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010年 12月 29日

基金投资目标：本基金投资于具有良好成长性的创新类上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

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：2014年 06月 09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 银河消费驱动股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011年 07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：上市契约型开放式（LOF）

基金合同生效日：2012年 04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 银河主题策略股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012年 09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 03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 07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 08月 09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 02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 银河定投宝中证腾安价值 100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 03月 14日

基金投资目标：本基金为股票型指数基金，力求对中证腾安价值 100 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年 05月 29日

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年 08月 06日

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略，并引入保证人，在保证本金安全的基础上，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年 11月 18日

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 银河丰利纯债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：2015年 04月 08日

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略（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年 04月 22日

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年 04月 22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。

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年 5月 12日

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年 6月 19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。

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。

35 银河君耀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 11月 18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。

36 银河君盛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 12月 9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。

37 银河君怡纯债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：2016年 12月 27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。

38 银河君润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 12月 27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。

39 银河睿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 12月 29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。

40 银河君腾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：2017年 3月 2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。

41 银河君欣纯债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：2017年 3月 2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。

42 银河犇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：2017年 3月 10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。

43 银河君辉纯债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：2017年 4月 20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。

44 银河量化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：2017年 4月 27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 | 基金经 | 2016年 3月 11 | - | 13 | 硕士研究生学历，CFA, 13 |

| | | | | |
|--|---|---|--|---|
| | 理 | 日 | | <p>年证券从业经历，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月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理等职务，现任股票投资部总监助理、基金经理。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，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，2016年3月起担任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。</p> |
|--|---|---|--|---|

注：1 上表中任职日期为该基金合同生效之日；

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年上半年市场波动较大，1季度市场震荡上行，2季度市场再度折返向下，但整体出现较多投资机会，其中上证指数上涨 2.86%，创业板指数下跌 7.34%，上半年市场围绕经济预期增长波动较大，1季度经济数据良好，但市场预期后期将逐级回落，周期类行业也随之下跌，实际上经济以及各周期行业表现超出市场预期。市场整体表现出偏爱确定性投资的趋势，对于各行业龙头也给予了一定的估值溢价。2016年全年全部 A股涨跌幅的算数平均值是 -10%左右，而 2017年市场所有个股的平均跌幅已经达到了 -12% 而 2017年全部 A股涨跌幅的中位数也已经达到了 15%的跌幅，与 2016年相同。因此，如果剔除大票对指数权重的影响，2017年前 5个月市场个股的平均跌幅已经超过了 2016年全年的水平。上半年表现较好的行业为家电、食品盈利、非银等，有较大跌幅的是传媒、计算机等高估值行业。

政府主导的去资产泡沫带来多个资产市场的负向联动，市场风险偏好在上半年大为降低，在此阶段，本基金较少参与到主题投资，但值得反思的是对表现突出的家电、食品饮料行业配置不

足，在部分估值和成长较匹配的电子、建材等行业获取了一定收益。

操作层面上，上半年大国的仓位换手率有所下降，其间仓位波动较大，处在同类型基金的平均水平。结构变化上主要增持了电子、金融行业个股，减持了轻工、化工行业个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.095元；本报告期基金份额净值增长率为 11.73%，业绩比较基准收益率为 -1.30%

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年下半年 整体中国经济已渐入稳定阶段 ,供给侧改革初见成效 ,在整体经济情况向好的背景下 ,政府对于改革更为关注着力 ,我们应重点研究政府在经济稳定阶段下各种政策导向。此外，下半年流动性情况比上半年改善，通胀水平也不会有大的波动。从外围环境来看，美国经济相对放缓，欧洲等其他经济体处于复苏状态，人民币汇率年内压力减轻。从市场趋势来看，上半年市场表现良好，但市场整体向上的动力也未出现，不能过高提升预期收益率，市场整体继续以区间震荡和结构性机会为主，我们相对看好景气度朝上的行业：消费、有色、电子等，以及关注新兴产业带来的交易性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、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。

4.7 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 2017年 6月 30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%。”截至本报告期末本基金可供分配利润为 3,539,870.50元，本基金 2017

上半年度未进行利润分配。

4.8 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年 6月 30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017年 6月 30日 | 上年度末 2016年 12月 31日 |
|-----------------|------------|-----------------------------|-------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 5,115,675.47 | 16,883,050.63 |
| 结算备付金 | | 470,922.50 | 1,299,602.53 |
| 存出保证金 | | 136,941.47 | 260,712.99 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 86,989,816.51 | 86,377,655.38 |
| 其中：股票投资 | | 86,989,816.51 | 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 1,619,696.53 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,079.70 | 3,575.36 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 424.97 | 944.86 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 92,715,860.62 | 106,445,238.28 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017年 6月 30日 | 上年度末 2016年 12月 31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 464,788.98 | 5,776.53 |
| 应付管理人报酬 | | 113,226.88 | 135,869.92 |
| 应付托管费 | | 18,871.18 | 22,644.99 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 346,719.51 | 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 | 6.4.7.8 | 224,739.27 | 270,021.77 |
| 负债合计 | | 1,168,345.82 | 1,064,879.44 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 83,571,389.52 | 107,568,797.16 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 7,976,125.28 | -2,188,438.32 |
| 所有者权益合计 | | 91,547,514.80 | 105,380,358.84 |
| 负债和所有者权益总计 | | 92,715,860.62 | 106,445,238.28 |

注：报告截止日 2017年 06月 30日，基金份额净值净值 1.095元，基金份额总额 83,571,389.52 份。

6.2 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：2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | 上年度可比期间 2016年 3月 11日 (基 金合同生效日) 至 2016年 6月 30日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------|---|
| 一、收入 | | 13,573,348.16 | 18,589,689.04 |
| 1.利息收入 | | 154,772.56 | 1,341,957.09 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 61,433.82 | 369,936.03 |
| 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 | | 93,338.74 | 972,021.06 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 4,173,571.04 | 9,344,826.08 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 3,796,397.11 | 9,100,033.73 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 377,173.93 | 244,792.35 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 9,208,283.89 | 6,826,773.77 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.18 | 36,720.67 | 1,076,132.10 |
| 减：二、费用 | | 2,371,885.05 | 3,480,419.82 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 737,658.33 | 1,514,983.98 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 122,943.06 | 252,497.34 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4.交易费用 | 6.4.7.19 | 1,333,680.44 | 1,605,913.33 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.其他费用 | 6.4.7.20 | 177,603.22 | 107,025.17 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 11,201,463.11 | 15,109,269.22 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 11,201,463.11 | 15,109,269.22 |

6.3 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：2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | | |
|--|---------------------------------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 107,568,797.16 | -2,188,438.32 | 105,380,358.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 11,201,463.11 | 11,201,463.11 |
| 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) | -23,997,407.64 | -1,036,899.51 | -25,034,307.15 |
| 其中：1.基金申购款 | 8,266,801.09 | 380,622.51 | 8,647,423.60 |
| 2.基金赎回款 | -32,264,208.73 | -1,417,522.02 | -33,681,730.75 |
| 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) | 83,571,389.52 | 7,976,125.28 | 91,547,514.80 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016年 3月 11日 (基金合同生效日) 至 2016年 6月 30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 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) | - | 15,109,269.22 | 15,109,269.22 |
| 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) | -292,130,651.73 | -3,093,533.36 | -295,224,185.09 |
| 其中：1.基金申购款 | 8,025,778.42 | 223,631.73 | 8,249,410.15 |
| 2.基金赎回款 | -300,156,430.15 | -3,317,165.09 | -303,473,595.24 |
| 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) | 180,160,518.01 | 12,015,735.86 | 192,176,253.87 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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发行募集,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日正式生效。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，基金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%

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税 [2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2 增值税

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，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]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018年 1月 1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018年 1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。

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 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 5,115,675.47 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 5,115,675.47 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | | |
|-------------|------------------------|---------------|--------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 80,508,923.70 | 86,989,816.51 | 6,480,892.81 |
| 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 | 80,508,923.70 | 86,989,816.51 | 6,480,892.81 |

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本报告期末持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 |
|------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,806.10 |
| 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 | 211.90 |
| 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 | 61.70 |
| 合计 | 2,079.70 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 |
|-------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 346,719.51 |
| 银行间市场应付交易费用 | |
| 合计 | 346,719.51 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,095.36 |
| 预提费用 | 223,643.91 |
| 合计 | 224,739.27 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | |
|---------------|---------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 107,568,797.16 | 107,568,797.16 |
| 本期申购 | 8,266,801.09 | 8,266,801.09 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -32,264,208.73 | -32,264,208.73 |
| - 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 | 83,571,389.52 | 83,571,389.52 |

6.4.7.10 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 | 2,697,578.96 | -4,886,017.28 | -2,188,438.32 |
| 本期利润 | 1,993,179.22 | 9,208,283.89 | 11,201,463.11 |
| 本期基金份额交易 | -1,150,887.68 | 113,988.17 | -1,036,899.51 |

| | | | |
|----------|---------------|--------------|---------------|
| 产生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 515,346.17 | -134,723.66 | 380,622.51 |
| 基金赎回款 | -1,666,233.85 | 248,711.83 | -1,417,522.02 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,539,870.50 | 4,436,254.78 | 7,976,125.28 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 |
| 活期存款利息收入 | 51,440.91 |
| 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 | 7,325.88 |
| 其他 | 2,667.03 |
| 合计 | 61,433.82 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 |
| 卖出股票成交总额 | 446,491,689.17 |
| 减：卖出股票成本总额 | 442,695,292.06 |
| 买卖股票差价收入 | 3,796,397.11 |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期末投资债券。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金未进行贵金属投资。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.14.3 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——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 377,173.93 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 377,173.93 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 |
| 1 交易性金融资产 | 9,208,283.89 |
| ——股票投资 | 9,208,283.89 |
| ——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 | 9,208,283.89 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 |
| 基金赎回费收入 | 36,169.66 |
| 转换费收入 | 551.07 |
| 合计 | 36,720.73 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,333,680.44 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 1,333,680.44 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 |
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 138,848.72 |
| 帐户维护费 | 9,000.00 |
| 资金汇划费 | 4,959.31 |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 177,603.22 |
|----|------------|

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|-----------------------|
| 中国银河证券股份有限公司（“银河证券”） | 同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构 |
| 建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 银河基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | | 上年度可比期间 2016年 3月 11日 (基金合同生效日) 至 2016年 6月 30日 | |
|-------|---------------------------------|------------------|---|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |

| | | | | |
|------------------|---|---|----------------|--------|
| 中国银河证券股份有 限公司 | - | - | 800,509,151.32 | 71.76% |
|------------------|---|---|----------------|--------|

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | | 上年度可比期间 2016年 3月 11日 (基金合同生效日) 至 2016年 6月 30日 | |
|---------|---------------------------------|--------------------|---|------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比例 |
| 中国银河证券股 | - | - | 3,475,800,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | | | |
|------------------|--|----------------|------------|------------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量 的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 中国银河证券股 份有限公司 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2016年 3月 11日 (基金合同生效日) 至 2016年 6月 30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总 量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 中国银河证券股 份有限公司 | 730,444.38 | 71.35% | 730,444.38 | 71.35% |

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | 上年度可比期间 2016年 3月 11日 (基金合同生效日) 至 2016年 6月 30日 |
|-----------------|------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 737,658.33 | 1,514,983.98 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 344,633.49 | 487,619.22 |

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：

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$

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款指令。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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | 上年度可比期间 2016年 3月 11日 (基金合同生效日) 至 2016年 6月 30日 |
|----------------|---------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 122,943.06 | 252,497.34 |

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：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

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款指令。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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2017年 1月 1日至 2017年 6月 30日 | | 上年度可比期间 2016年 3月 11日 (基金合同生效日)至 2016年 6月 30日 | |
|--------------|---------------------------------|-----------|--|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 5,115,675.47 | 51,440.91 | 31,485,905.70 | 343,346.87 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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 | 8.03 | 40.95 | 13,870 | 111,376.10 | 567,976.50 | |
| 002860 | 星帅尔 | 2017年3月31日 | 2018年4月12日 | 锁定期 | 19.81 | 48.90 | 7,980 | 158,083.80 | 390,222.00 | |

6.4.12.2 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 |
|--------|------|------------|------|--------|-----------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600643 | 爱建集团 | 2017年4月14日 | 重大事项 | 16.31 | 2017年8月2日 | 16.48 | 200,000 | 2,908,514.90 | 3,262,000.00 | |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.12.4 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。

6.4.12.5 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。

6.4.12.6 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。

6.4.12.6.1 利率风险

6.4.12.6.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017年 6月 30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 | 5,115,675.47 | | | | | | 5,115,675.47 |
| 结算备付金 | 470,922.50 | | | | | | 470,922.50 |
| 存出保证金 | 136,941.47 | | | | | | 136,941.47 |
| 交易性金融资产 | | | | | | 86,989,816.51 | 86,989,816.51 |
| 应收利息 | | | | | | 2,079.70 | 2,079.70 |
| 应收申购款 | | | | | | 424.97 | 424.97 |
| 资产总计 | 5,723,539.44 | | | | | 86,992,321.18 | 92,715,860.62 |
| 负债 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-----------------------|---------------|-------|------------|------|------|---------------|----------------|
| 应付赎回款 | | | | | | 464,788.98 | 464,788.98 |
| 应付管理人报酬 | | | | | | 113,226.88 | 113,226.88 |
| 应付托管费 | | | | | | 18,871.18 | 18,871.18 |
| 应付交易费用 | | | | | | 346,719.51 | 346,719.51 |
| 其他负债 | | | | | | 224,739.27 | 224,739.27 |
| 负债总计 | | | | | | 1,168,345.82 | 1,168,345.82 |
| 利率敏感度缺口 | 5,723,539.44 | | | | | 85,823,975.36 | 91,547,514.80 |
| 上年度末 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 |

6.4.12.6.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017年 6月 30日未持有债券资产，基金资产受市场利率的波动影响较小。

6.4.12.6.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.6.3 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。

6.4.12.6.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 | | 上年度末 2016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 | 86,989,816.51 | 95.02 | 86,377,655.38 | 81.97 |
| 交易性金融资产 - 基金投资 | | | | |
| 交易性金融资产 - 债券投资 | | | | |
| 交易性金融资产 - 贵金属投资 | | | | |
| 衍生金融资产 - 权证投资 | | | | |
| 其他 | | | | |
| 合计 | 86,989,816.51 | 95.02 | 86,377,655.38 | 81.97 |

6.4.12.6.3.2 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（ 2017年 6月 30日 ） | 上年度末（ 2016年 12月 31日 ） |
| | 中证 800指数上升 5% | 5,140,599.74 | 5,604,224.41 |
| | 中证 800指数下降 5% | -5,140,599.74 | -5,604,224.41 |

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1.1 公允价值

1.1.1 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。

1.1.2 以公允价值计量的金融工具

1.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017年 6月 30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 83,727,816.51元，属于第二层次的余额为人民币 3,262,000.00元，属于第三层次余额为人民币 0.00元。

1.1.2.2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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

1.1.2.3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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 86,989,816.51 | 93.82 |
| | 其中：股票 | 86,989,816.51 | 93.82 |
| 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 | 5,586,597.97 | 6.03 |
| 7 | 其他各项资产 | 139,446.14 | 0.15 |
| 8 | 合计 | 92,715,860.62 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 4,890,156.92 | 5.34 |
| C | 制造业 | 65,503,059.59 | 71.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 3,176,800.00 | 3.47 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 9,529,000.00 | 10.41 |
| K | 房地产业 | 671,600.00 | 0.73 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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 | 3,219,200.00 | 3.52 |
| 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 | 86,989,816.51 | 95.02 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股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。

7.3 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 | 002008 | 大族激光 | 164,700 | 5,705,208.00 | 6.23 |
| 2 | 000426 | 兴业矿业 | 542,146 | 4,890,156.92 | 5.34 |
| 3 | 000568 | 泸州老窖 | 92,000 | 4,653,360.00 | 5.08 |
| 4 | 002271 | 东方雨虹 | 100,000 | 3,710,000.00 | 4.05 |
| 5 | 002035 | 华帝股份 | 147,486 | 3,569,161.20 | 3.90 |
| 6 | 600809 | 山西汾酒 | 100,000 | 3,469,000.00 | 3.79 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 200,000 | 3,372,000.00 | 3.68 |
| 8 | 600643 | 爱建集团 | 200,000 | 3,262,000.00 | 3.56 |
| 9 | 002460 | 赣锋锂业 | 70,000 | 3,237,500.00 | 3.54 |
| 10 | 000910 | 大亚圣象 | 129,952 | 3,228,007.68 | 3.53 |
| 11 | 000069 | 华侨城 A | 320,000 | 3,219,200.00 | 3.52 |
| 12 | 002050 | 三花智控 | 194,900 | 3,180,768.00 | 3.47 |
| 13 | 601607 | 上海医药 | 110,000 | 3,176,800.00 | 3.47 |
| 14 | 000895 | 双汇发展 | 132,300 | 3,142,125.00 | 3.43 |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 105,500 | 3,084,820.00 | 3.37 |
| 16 | 300115 | 长盈精密 | 102,000 | 2,976,360.00 | 3.25 |
| 17 | 002236 | 大华股份 | 130,000 | 2,965,300.00 | 3.24 |
| 18 | 002142 | 宁波银行 | 150,000 | 2,895,000.00 | 3.16 |
| 19 | 002032 | 苏泊尔 | 70,000 | 2,873,500.00 | 3.14 |
| 20 | 000338 | 潍柴动力 | 210,000 | 2,772,000.00 | 3.03 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 21 | 600298 | 安琪酵母 | 98,000 | 2,535,260.00 | 2.77 |
| 22 | 002262 | 恩华药业 | 150,000 | 2,269,500.00 | 2.48 |
| 23 | 000418 | 小天鹅 A | 45,000 | 2,105,550.00 | 2.30 |
| 24 | 002043 | 兔宝宝 | 150,000 | 2,076,000.00 | 2.27 |
| 25 | 600885 | 宏发股份 | 50,157 | 2,000,762.73 | 2.19 |
| 26 | 603989 | 艾华集团 | 46,642 | 1,830,232.08 | 2.00 |
| 27 | 603898 | 好莱客 | 45,000 | 1,572,750.00 | 1.72 |
| 28 | 600420 | 现代制药 | 65,000 | 1,019,850.00 | 1.11 |
| 29 | 600340 | 华夏幸福 | 20,000 | 671,600.00 | 0.73 |
| 30 | 603660 | 苏州科达 | 13,870 | 567,976.50 | 0.62 |
| 31 | 002365 | 永安药业 | 17,000 | 514,420.00 | 0.56 |
| 32 | 002860 | 星帅尔 | 7,980 | 390,222.00 | 0.43 |
| 33 | 300580 | 贝斯特 | 2,364 | 53,426.40 | 0.06 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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 | 300316 | 晶盛机电 | 15,164,022.00 | 14.39 |
| 2 | 600362 | 江西铜业 | 11,742,547.24 | 11.14 |
| 3 | 000878 | 云南铜业 | 11,343,459.69 | 10.76 |
| 4 | 000568 | 泸州老窖 | 10,933,469.55 | 10.38 |
| 5 | 002035 | 华帝股份 | 10,889,148.10 | 10.33 |
| 6 | 002008 | 大族激光 | 10,480,922.52 | 9.95 |
| 7 | 002273 | 水晶光电 | 10,338,185.86 | 9.81 |
| 8 | 002460 | 赣锋锂业 | 10,268,598.48 | 9.74 |
| 9 | 600643 | 爱建集团 | 10,242,336.90 | 9.72 |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 9,715,716.58 | 9.22 |
| 11 | 300078 | 思创医惠 | 9,581,229.00 | 9.09 |
| 12 | 000603 | 盛达矿业 | 8,052,626.92 | 7.64 |
| 13 | 002410 | 广联达 | 7,635,796.00 | 7.25 |
| 14 | 002475 | 立讯精密 | 7,592,502.84 | 7.20 |
| 15 | 600110 | 诺德股份 | 7,383,016.54 | 7.01 |
| 16 | 600183 | 生益科技 | 7,201,766.00 | 6.83 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 002466 | 天齐锂业 | 6,734,969.00 | 6.39 |
| 18 | 000651 | 格力电器 | 6,525,319.00 | 6.19 |
| 19 | 601600 | 中国铝业 | 6,436,000.00 | 6.11 |
| 20 | 300207 | 欣旺达 | 6,267,488.00 | 5.95 |
| 21 | 600340 | 华夏幸福 | 6,136,981.00 | 5.82 |
| 22 | 600885 | 宏发股份 | 5,778,615.58 | 5.48 |
| 23 | 603008 | 喜临门 | 5,711,732.85 | 5.42 |
| 24 | 000596 | 古井贡酒 | 5,673,076.00 | 5.38 |
| 25 | 000426 | 兴业矿业 | 5,557,665.00 | 5.27 |
| 26 | 300033 | 同花顺 | 5,526,655.72 | 5.24 |
| 27 | 002043 | 兔宝宝 | 5,064,146.00 | 4.81 |
| 28 | 001979 | 招商蛇口 | 4,906,620.00 | 4.66 |
| 29 | 600703 | 三安光电 | 4,834,466.82 | 4.59 |
| 30 | 601118 | 海南橡胶 | 4,791,727.00 | 4.55 |
| 31 | 000937 | 冀中能源 | 4,722,660.50 | 4.48 |
| 32 | 600667 | 太极实业 | 4,564,154.00 | 4.33 |
| 33 | 002241 | 歌尔股份 | 4,486,242.00 | 4.26 |
| 34 | 601009 | 南京银行 | 4,481,072.00 | 4.25 |
| 35 | 600779 | 水井坊 | 4,080,302.68 | 3.87 |
| 36 | 603589 | 口子窖 | 4,075,664.00 | 3.87 |
| 37 | 002236 | 大华股份 | 4,065,596.00 | 3.86 |
| 38 | 600884 | 杉杉股份 | 4,061,873.00 | 3.85 |
| 39 | 300477 | 合纵科技 | 4,040,928.00 | 3.83 |
| 40 | 603898 | 好莱客 | 4,020,863.86 | 3.82 |
| 41 | 000910 | 大亚圣象 | 3,986,875.72 | 3.78 |
| 42 | 601998 | 中信银行 | 3,930,090.85 | 3.73 |
| 43 | 300310 | 宜通世纪 | 3,929,028.00 | 3.73 |
| 44 | 600861 | 北京城乡 | 3,902,623.00 | 3.70 |
| 45 | 002281 | 光迅科技 | 3,882,941.00 | 3.68 |
| 46 | 601628 | 中国人寿 | 3,853,448.74 | 3.66 |
| 47 | 600809 | 山西汾酒 | 3,711,401.00 | 3.52 |
| 48 | 300073 | 当升科技 | 3,680,535.00 | 3.49 |
| 49 | 600436 | 片仔癀 | 3,619,262.34 | 3.43 |
| 50 | 000333 | 美的集团 | 3,445,966.00 | 3.27 |
| 51 | 300258 | 精锻科技 | 3,371,079.10 | 3.20 |
| 52 | 601166 | 兴业银行 | 3,271,500.00 | 3.10 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 53 | 600547 | 山东黄金 | 3,187,866.00 | 3.03 |
| 54 | 000069 | 华侨城 A | 3,150,600.00 | 2.99 |
| 55 | 000513 | 丽珠集团 | 3,072,871.72 | 2.92 |
| 56 | 000895 | 双汇发展 | 3,053,911.13 | 2.90 |
| 57 | 601111 | 中国国航 | 3,047,769.66 | 2.89 |
| 58 | 000975 | 银泰资源 | 2,956,287.95 | 2.81 |
| 59 | 002271 | 东方雨虹 | 2,954,342.00 | 2.80 |
| 60 | 300115 | 长盈精密 | 2,952,788.00 | 2.80 |
| 61 | 600497 | 驰宏锌锗 | 2,940,678.00 | 2.79 |
| 62 | 600197 | 伊力特 | 2,939,555.00 | 2.79 |
| 63 | 601607 | 上海医药 | 2,870,479.00 | 2.72 |
| 64 | 601800 | 中国交建 | 2,860,482.00 | 2.71 |
| 65 | 000338 | 潍柴动力 | 2,710,093.00 | 2.57 |
| 66 | 600887 | 伊利股份 | 2,694,750.00 | 2.56 |
| 67 | 600109 | 国金证券 | 2,680,664.00 | 2.54 |
| 68 | 603626 | 科森科技 | 2,668,601.00 | 2.53 |
| 69 | 600196 | 复星医药 | 2,628,848.00 | 2.49 |
| 70 | 000656 | 金科股份 | 2,614,400.00 | 2.48 |
| 71 | 002185 | 华天科技 | 2,587,415.00 | 2.46 |
| 72 | 002032 | 苏泊尔 | 2,576,777.10 | 2.45 |
| 73 | 601555 | 东吴证券 | 2,568,831.00 | 2.44 |
| 74 | 600479 | 千金药业 | 2,534,251.00 | 2.40 |
| 75 | 002050 | 三花智控 | 2,525,383.00 | 2.40 |
| 76 | 002635 | 安洁科技 | 2,518,191.00 | 2.39 |
| 77 | 600428 | 中远海特 | 2,513,000.00 | 2.38 |
| 78 | 600332 | 白云山 | 2,487,798.00 | 2.36 |
| 79 | 600298 | 安琪酵母 | 2,485,660.00 | 2.36 |
| 80 | 600718 | 东软集团 | 2,365,305.00 | 2.24 |
| 81 | 000639 | 西王食品 | 2,304,764.00 | 2.19 |
| 82 | 002262 | 恩华药业 | 2,178,231.00 | 2.07 |
| 83 | 000404 | 华意压缩 | 2,175,583.00 | 2.06 |
| 84 | 002714 | 牧原股份 | 2,149,779.00 | 2.04 |
| 85 | 000418 | 小天鹅 A | 2,124,241.00 | 2.02 |

注：本项及下项 7.4.2 7.4.3 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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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 | 300316 | 晶盛机电 | 19,033,502.40 | 18.06 |
| 2 | 600362 | 江西铜业 | 15,640,898.05 | 14.84 |
| 3 | 000878 | 云南铜业 | 11,965,685.76 | 11.35 |
| 4 | 600667 | 太极实业 | 11,078,772.56 | 10.51 |
| 5 | 002273 | 水晶光电 | 10,241,876.28 | 9.72 |
| 6 | 300078 | 思创医惠 | 9,330,347.88 | 8.85 |
| 7 | 000596 | 古井贡酒 | 8,826,091.17 | 8.38 |
| 8 | 600155 | 宝硕股份 | 8,149,775.00 | 7.73 |
| 9 | 000603 | 盛达矿业 | 8,025,680.00 | 7.62 |
| 10 | 600110 | 诺德股份 | 7,753,011.18 | 7.36 |
| 11 | 002035 | 华帝股份 | 7,638,016.05 | 7.25 |
| 12 | 002410 | 广联达 | 7,515,858.71 | 7.13 |
| 13 | 600643 | 爱建集团 | 7,505,715.12 | 7.12 |
| 14 | 600183 | 生益科技 | 7,161,085.00 | 6.80 |
| 15 | 002142 | 宁波银行 | 7,101,582.73 | 6.74 |
| 16 | 002466 | 天齐锂业 | 6,932,114.88 | 6.58 |
| 17 | 002460 | 赣锋锂业 | 6,724,302.00 | 6.38 |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 6,668,577.70 | 6.33 |
| 19 | 000651 | 格力电器 | 6,659,840.14 | 6.32 |
| 20 | 300207 | 欣旺达 | 6,554,524.57 | 6.22 |
| 21 | 002008 | 大族激光 | 6,371,446.97 | 6.05 |
| 22 | 601600 | 中国铝业 | 6,341,000.00 | 6.02 |
| 23 | 600104 | 上汽集团 | 5,737,928.94 | 5.44 |
| 24 | 600519 | 贵州茅台 | 5,593,559.24 | 5.31 |
| 25 | 600596 | 新安股份 | 5,568,779.72 | 5.28 |
| 26 | 300033 | 同花顺 | 5,486,008.30 | 5.21 |
| 27 | 000426 | 兴业矿业 | 5,320,237.70 | 5.05 |
| 28 | 002241 | 歌尔股份 | 5,110,105.83 | 4.85 |
| 29 | 002475 | 立讯精密 | 5,063,399.89 | 4.80 |
| 30 | 603008 | 喜临门 | 4,954,707.32 | 4.70 |
| 31 | 600409 | 三友化工 | 4,912,986.76 | 4.66 |
| 32 | 600497 | 驰宏锌锗 | 4,906,345.00 | 4.66 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 33 | 601009 | 南京银行 | 4,822,500.00 | 4.58 |
| 34 | 601118 | 海南橡胶 | 4,814,387.00 | 4.57 |
| 35 | 600703 | 三安光电 | 4,812,491.96 | 4.57 |
| 36 | 000937 | 冀中能源 | 4,803,815.00 | 4.56 |
| 37 | 001979 | 招商蛇口 | 4,574,720.00 | 4.34 |
| 38 | 600340 | 华夏幸福 | 4,330,993.00 | 4.11 |
| 39 | 603589 | 口子窖 | 4,329,221.00 | 4.11 |
| 40 | 000333 | 美的集团 | 4,274,117.83 | 4.06 |
| 41 | 600038 | 中直股份 | 4,236,641.12 | 4.02 |
| 42 | 300477 | 合纵科技 | 4,228,840.00 | 4.01 |
| 43 | 300310 | 宜通世纪 | 4,139,501.31 | 3.93 |
| 44 | 601998 | 中信银行 | 4,117,372.73 | 3.91 |
| 45 | 600779 | 水井坊 | 4,104,616.54 | 3.90 |
| 46 | 600861 | 北京城乡 | 3,980,915.00 | 3.78 |
| 47 | 300073 | 当升科技 | 3,794,362.68 | 3.60 |
| 48 | 601628 | 中国人寿 | 3,793,201.74 | 3.60 |
| 49 | 600884 | 杉杉股份 | 3,772,714.00 | 3.58 |
| 50 | 002281 | 光迅科技 | 3,738,777.00 | 3.55 |
| 51 | 600476 | 湘邮科技 | 3,637,708.00 | 3.45 |
| 52 | 600436 | 片仔癀 | 3,553,757.68 | 3.37 |
| 53 | 600885 | 宏发股份 | 3,549,800.00 | 3.37 |
| 54 | 002078 | 太阳纸业 | 3,455,810.00 | 3.28 |
| 55 | 300258 | 精锻科技 | 3,369,326.50 | 3.20 |
| 56 | 000683 | 远兴能源 | 3,210,000.00 | 3.05 |
| 57 | 002043 | 兔宝宝 | 3,167,405.00 | 3.01 |
| 58 | 000513 | 丽珠集团 | 3,163,835.79 | 3.00 |
| 59 | 600547 | 山东黄金 | 3,111,221.00 | 2.95 |
| 60 | 600197 | 伊力特 | 3,026,650.00 | 2.87 |
| 61 | 601111 | 中国国航 | 2,909,243.40 | 2.76 |
| 62 | 600584 | 长电科技 | 2,870,721.00 | 2.72 |
| 63 | 000063 | 中兴通讯 | 2,854,124.48 | 2.71 |
| 64 | 600096 | 云天化 | 2,843,811.00 | 2.70 |
| 65 | 002101 | 广东鸿图 | 2,810,337.28 | 2.67 |
| 66 | 601800 | 中国交建 | 2,740,482.10 | 2.60 |
| 67 | 000411 | 英特集团 | 2,735,597.00 | 2.60 |
| 68 | 000975 | 银泰资源 | 2,710,971.00 | 2.57 |
| 69 | 600887 | 伊利股份 | 2,706,000.00 | 2.57 |
| 70 | 002185 | 华天科技 | 2,673,302.00 | 2.54 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 71 | 600109 | 国金证券 | 2,640,000.00 | 2.51 |
| 72 | 600332 | 白云山 | 2,602,729.00 | 2.47 |
| 73 | 600141 | 兴发集团 | 2,602,594.00 | 2.47 |
| 74 | 000656 | 金科股份 | 2,593,325.00 | 2.46 |
| 75 | 601555 | 东吴证券 | 2,556,185.00 | 2.43 |
| 76 | 603626 | 科森科技 | 2,522,888.00 | 2.39 |
| 77 | 600479 | 千金药业 | 2,489,042.00 | 2.36 |
| 78 | 600718 | 东软集团 | 2,487,291.40 | 2.36 |
| 79 | 600196 | 复星医药 | 2,479,366.00 | 2.35 |
| 80 | 600428 | 中远海特 | 2,468,372.00 | 2.34 |
| 81 | 002250 | 联化科技 | 2,460,797.16 | 2.34 |
| 82 | 002635 | 安洁科技 | 2,381,309.00 | 2.26 |
| 83 | 000639 | 西王食品 | 2,190,107.00 | 2.08 |

7.4.3 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 | 434,099,169.30 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 446,491,689.17 |

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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 | 136,941.47 |
| 2 | 应收证券清算款 | |
| 3 | 应收股利 | |
| 4 | 应收利息 | 2,079.70 |
| 5 | 应收申购款 | 424.97 |
| 6 | 其他应收款 | |
| 7 | 待摊费用 | |
| 8 | 其他 | |
| 9 | 合计 | 139,446.14 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1 | 600643 | 爱建集团 | 3,262,000.00 | 3.56 | 重大事项 |

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 1,201 | 69,584.84 | 10,000,000.00 | 11.97% | 73,571,389.52 | 88.03% |

8.2 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 | 1,758,191.38 | 2.1038% |

8.3 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 |

§ 9 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 | 107,568,797.16 |
| 本报告期基金总申购份额 | 8,266,801.09 |
| 减 本报告期基金总赎回份额 | 32,264,208.73 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 83,571,389.52 |

§ 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

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

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|-------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | 例 | | |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|
| 中信建投 | 2 | 504,575,615.66 | 57.36% | 459,819.70 | 56.83% |
| 东吴证券 | 1 | 242,420,074.26 | 27.56% | 225,765.59 | 27.90% |
| 兴业证券 | 2 | 132,679,693.08 | 15.08% | 123,564.43 | 15.27% |
| 中银国际 | 1 | | | | |
| 浙商证券 | 2 | | | | |
| 瑞银证券 | 1 | | | | |
| 国金证券 | 1 | | | | |
| 海通证券 | 1 | | | | |
| 国泰君安 | 2 | | | | |
| 宏源证券 | 1 | | | | |
| 民生证券 | 1 | | | | |
| 华信证券 | 1 | | | | |
| 华创证券 | 1 | | | | |
| 渤海证券 | 1 | | | | |
| 安信证券 | 3 | | | | |
| 光大证券 | 1 | | | | |
| 东兴证券 | 1 | | | | |
| 东方证券 | 1 | | | | |
| 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 | | | | |
| 天风证券 | 2 | | | | |
| 东北证券 | 3 | | | | |
| 中投证券 | 2 | | | | |
| 银河证券 | 2 | | | | |
| 国信证券 | 2 | | | | |

注：本期新增光大证券 1 个交易单元。

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 |
| 中信建投 | | | | | | |
| 东吴证券 | | | 256,000,000.00 | 100.00% | | |
| 兴业证券 | | | | | | |
| 中银国际 | | | | | | |
| 浙商证券 | | | | | | |
| 瑞银证券 | | | | | | |
| 国金证券 | | | | | | |
| 海通证券 | | | | | | |
| 国泰君安 | | | | | | |
| 宏源证券 | | | | | | |
| 民生证券 | | | | | | |
| 华信证券 | | | | | | |
| 华创证券 | | | | | | |
| 渤海证券 | | | | | | |
| 安信证券 | | | | | | |

| | | | | | | |
|------|--|--|--|--|--|--|
| 光大证券 | | | | | | |
| 东兴证券 | | | | | | |
| 东方证券 | | | | | | |
| 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 | | | | | | |
| 天风证券 | | | | | | |
| 东北证券 | | | | | | |
| 中投证券 | | | | | | |
| 银河证券 | | | | | | |
| 国信证券 | | | | | | |

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部分基金在安信证券开通基金定投业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 1月 4日 |
| 2 | 银河基金管理有限公司关于变更注册地址名称的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 1月 6日 |
| 3 | 银河基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京肯特瑞财富投资管理有限公司基金定投业务最少定投金额的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 1月 11日 |
| 4 | 银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 1月 20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 2月 18日 |
| 6 | 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 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券 | 2017年 2月 23日 |

| | | | |
|----|--|--|--------------|
| | 银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 报》、《证券日报》、 公司网站 | |
| 7 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增凤凰金信（银川）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 | 2017年 2月 27日 |
| 8 | 银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站 | 2017年 3月 31日 |
| 9 | 关于旗下部分基金新增南京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》、《证券日报》、 公司网站 | 2017年 4月 18日 |
| 10 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理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》、《证券日报》、 公司网站 | 2017年 4月 19日 |
| 11 | 银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站 | 2017年 4月 21日 |
| 12 | 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 | 2017年 4月 24日 |
| 13 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中民财富管理（上海）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 | 2017年 4月 28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 | 2017年 6月 1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 | 2017年 6月 15日 |
| 16 | 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》、 公司网站 | 2017年 6月 30日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 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大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金的文件
- 2 《银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金合同》
- 3 《银河大国智造主题灵活配置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 银河大国智造主题灵活配置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

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 8月 29日