

银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 25 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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。

本报告财务资料已经审计，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 6 月 19 日起至 12 月 31 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	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
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.....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	23
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.....	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 审计报告	24
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
§7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56

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	57
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	57
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	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	58
§9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§10 开放式基金份额变动.....	60
§11 重大事件揭示.....	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§13 备查文件目录.....	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金		
基金简称	银河鸿利混合		
场内简称	-		
基金主代码	519640		
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	2015 年 6 月 19 日		
基金管理人	银河基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,010,888,001.82 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	-		
下属分级基金的基金简称	银河鸿利混合 A	银河鸿利混合 C	银河鸿利混合 I
下属分级基金的场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	519640	519641	519647
报告期末下属分级基金份额总额	187,856,605.95 份	23,031,395.87 份	2,800,000,000.00 份

2.2 基金产品说明

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。		
投资策略	<p>本基金通过合理稳健的资产配置策略，将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置，同时采取积极主动的股票投资和债券投资策略，把握中国经济增长和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。</p> <p>本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略、股指期货和国债期货投资策略、权证投资策略等。</p>		
业绩比较基准	中国人民银行公布的 3 年期定期存款利率(税后)+1%		
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	-	-	-

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	董伯儒	方韡
	联系电话	021-38568888	010-89936330
	电子邮箱	dongboru@galaxyasset.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-820-0860	95558
传真		021-38568769	010-85230024
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1568 号 15 层	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
邮政编码		200122	100010
法定代表人		许国平	常振明

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	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	1、上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼 2、北京市东城区朝阳门北大街 9 号

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责任公司	北京市西城区金融街 27 号投资广场 23 层

§ 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	2015 年 6 月 19 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日		
	银河鸿利混合 A	银河鸿利混合 C	银河鸿利混合 I
本期已实现收益	2,951,319.72	261,069.00	4,153,610.89

本期利润	1,499,747.06	178,839.08	9,009,960.54
加权平均基金份额本期利润	0.0044	0.0051	0.0032
本期加权平均净值利润率	0.44%	0.51%	0.32%
本期基金份额净值增长率	1.20%	1.00%	0.03%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		
期末可供分配利润	1,406,262.72	123,773.28	4,153,610.89
期末可供分配基金份额利润	0.0075	0.0054	0.0015
期末基金资产净值	190,086,911.68	23,255,683.23	2,809,009,960.54
期末基金份额净值	1.012	1.010	1.003
3.1.3 累计期末指标	2015 年末		
基金份额累计净值增长率	1.20%	1.00%	0.03%

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金自 2015 年 11 月 18 日起，增加银河鸿利混合 I 类基金份额类别，详情参阅相关公告。

5、基金合同在当期生效。

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

银河鸿利混合 A

阶段	净值增长率①	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	2.22%	0.09%	0.95%	0.01%	1.27%	0.08%
过去六个月	1.20%	0.14%	2.00%	0.01%	-0.80%	0.13%
自基金合同生效起至今	1.20%	0.14%	2.15%	0.01%	-0.95%	0.13%

银河鸿利混合 C

阶段	净值增长率①	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	2.02%	0.08%	0.95%	0.01%	1.07%	0.07%
过去六个月	1.00%	0.13%	2.00%	0.01%	-1.00%	0.12%
自基金合	1.00%	0.13%	2.15%	0.01%	-1.15%	0.12%

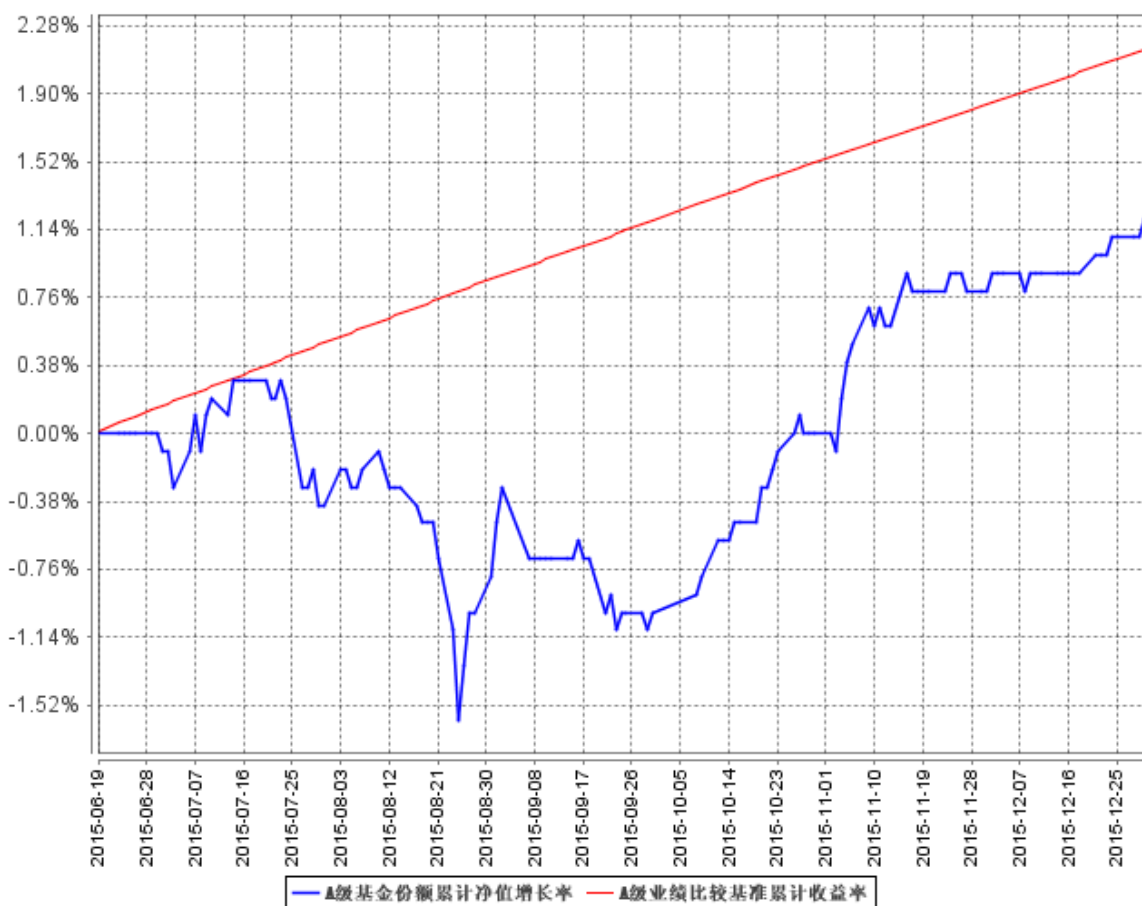
同生效起至今						
--------	--	--	--	--	--	--

银河鸿利混合 I

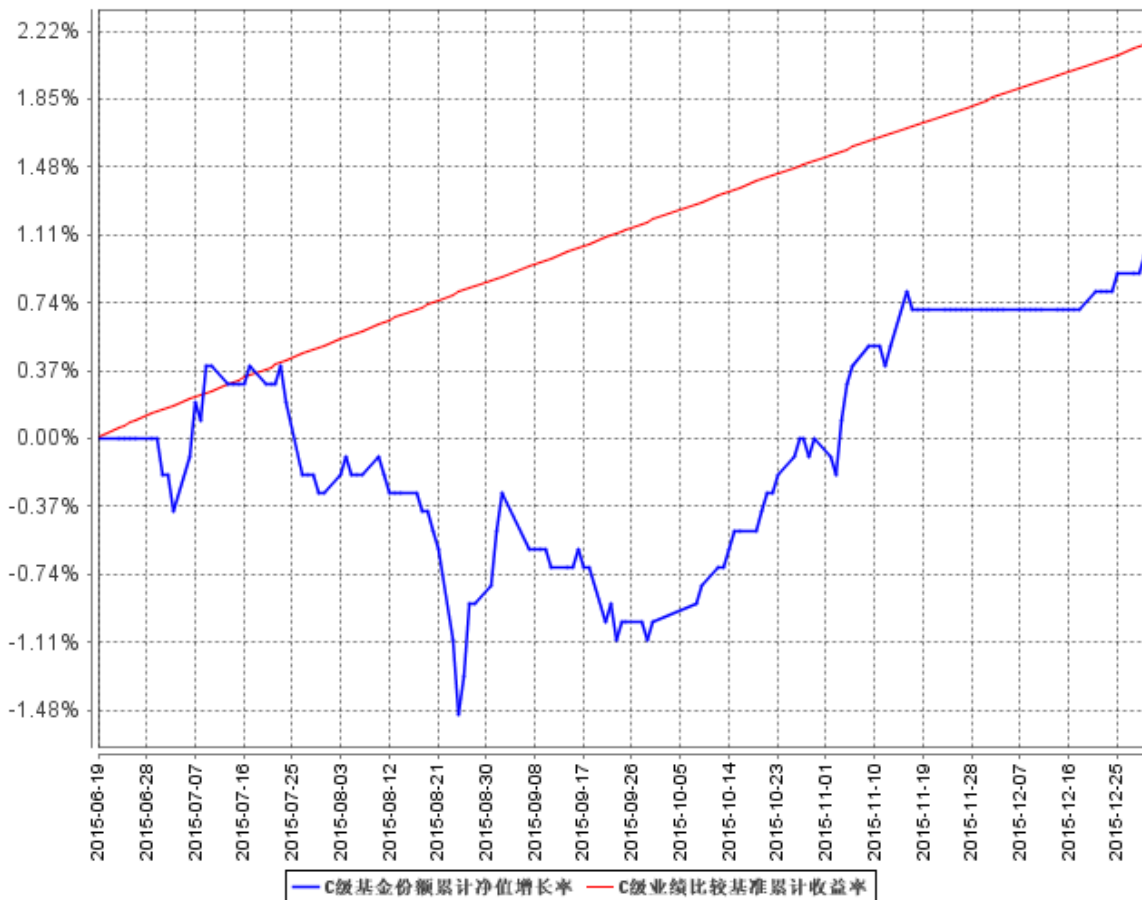
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.30%	0.03%	0.45%	0.01%	-0.15%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.30%	0.03%	0.45%	0.01%	-0.15%	0.02%

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

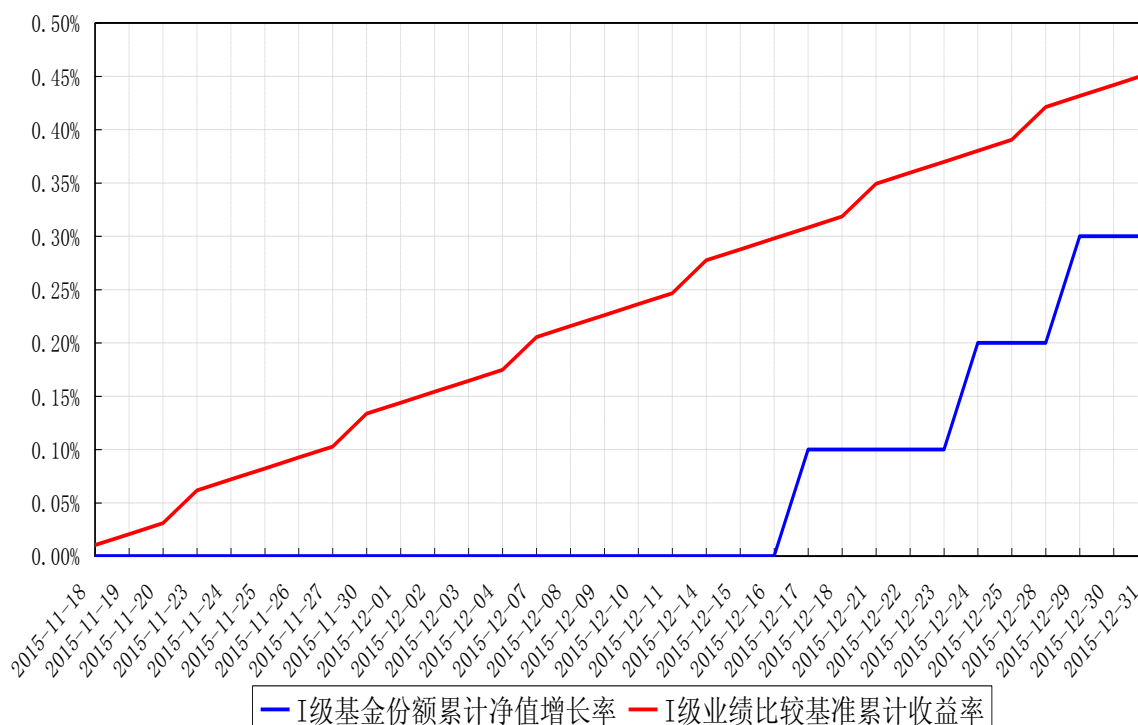
A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级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



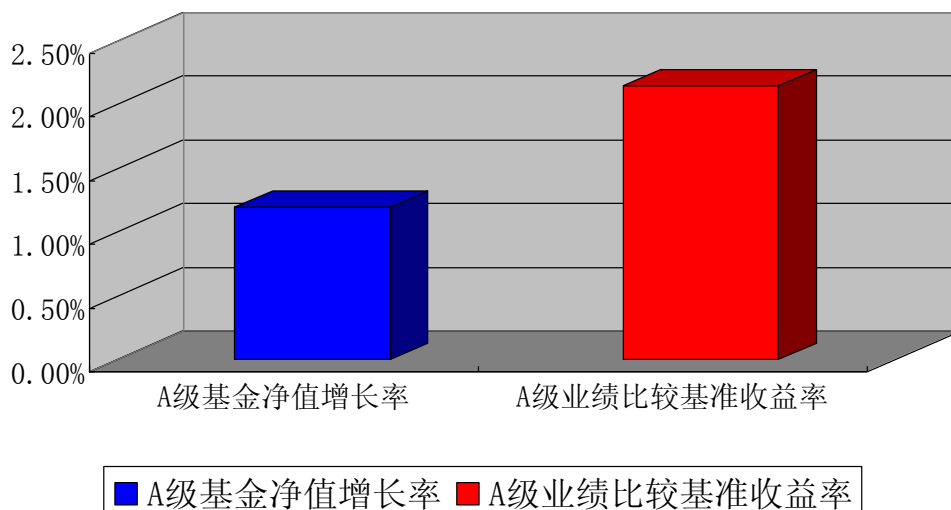
I级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



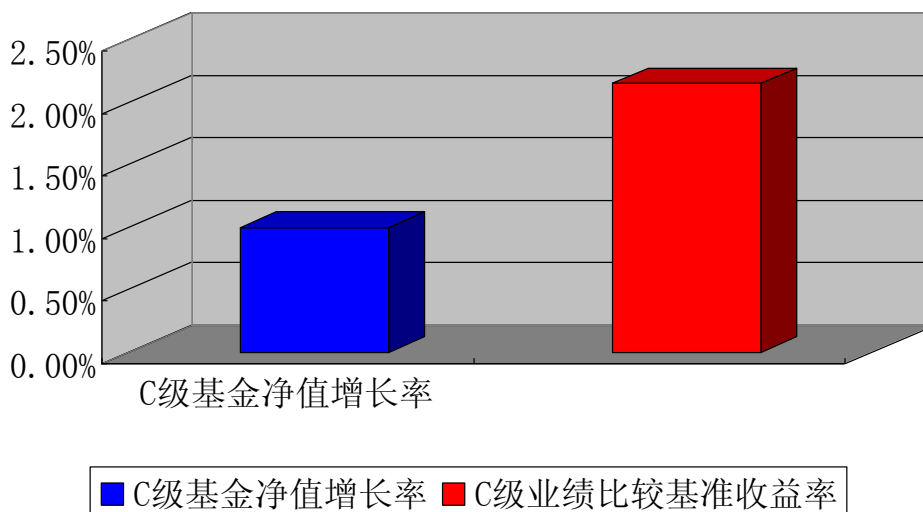
- 注：1、本基金合同于 2015 年 6 月 19 日生效，截至报告日基金合同生效未满一年。
- 2、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%；债券资产投资占基金资产的比例不低于 5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。
- 3、截止至 2015 年 12 月 18 日建仓期满，本基金各项资产配置比例符合合同约定。
- 4、本基金自 2015 年 11 月 18 日起，增加银河鸿利混合 I 类基金份额类别。

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

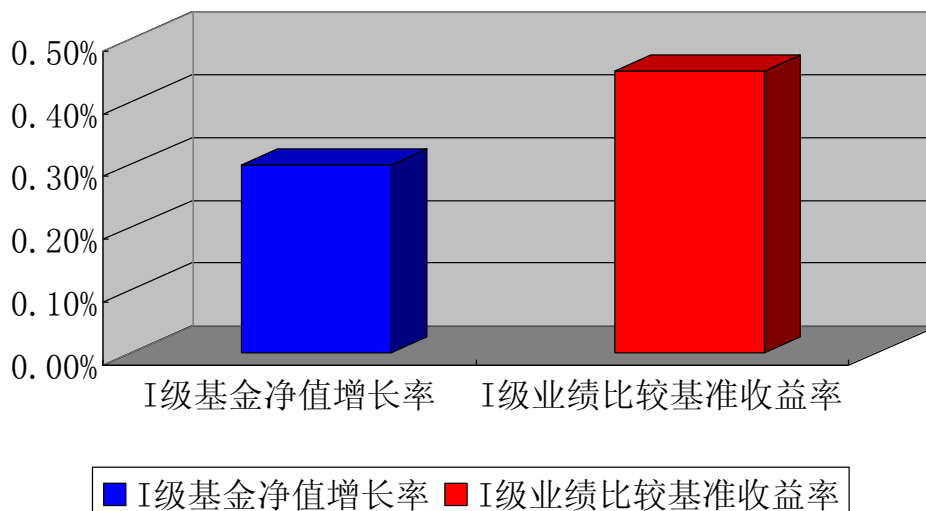
A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



I级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金合同于 2015 年 6 月 19 日生效，截至报告日基金合同生效未满一年。

2、本项目按实际存续期计算，不按整个会计年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司设立于 2002 年 6 月 14 日，公司的股东分别为中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团公司、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

目前，除本基金外，银河基金管理有限公司另管理 1 只封闭式基金与 26 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

类型：契约型封闭式

成立日：2002 年 8 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 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条件

件下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

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		
韩晶	银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理、银河收益证券投资基金的基金经理、银河领先债券型证券投资基金的基金经理、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监助理	2015年6月19日	-	14	中共党员，经济学硕士。曾就职于中国民族证券有限责任公司，期间从事交易清算、产品设计、投资管理工作。2008年6月加入银河基金管理有限公司，从事固定收益产品研究工作，历任债券经理助理、债券经理等职务，2010年1月至2013年3月担任银河收益证券投资基金的基金经理；2011年8月起担任银河银信添利债券型证

					券投资基金的基金经理；2012年11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理；2014年7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理；2015年4月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任固定收益部总监助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上表中任职日期为基金合同生效日。

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遵规守信情况的说明

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》及其各项管理办法、《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，努力实现基金持有人的利益，无损害基金持有人利益的行为，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健的风险回报。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司旗下管理的所有投资组合严格执行相关法律法规及公司制度，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保公平对待不同投资组合。同时，公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析。

针对同向交易部分，本报告期内，公司对旗下管理的所有投资组合（完全复制的指数基金除外），连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公开竞价交易的证券进行了价差分析，并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

针对反向交易部分，公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。本报告期内，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况（完全复制的指数基金除外）。

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易，由各投资组合经理均严格按照制度规定，事前确定好申购价格和数量，按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

银河鸿利基金管理人认为 2015 国内经济在保持就业稳定的基础上，增速将适度下降在房地产调整的大周期，投资仍面临较大的压力，维稳仍需政府项目发力。央行将维持相对宽松的货币政策，整个市场的资金面将较为充裕。在此基础上，提高财政赤字，加大财政投入以解决货币政策所不能完成的调结构的作用。我们判断经济基本面和降准、降息是影响债券市场的主导因素，而信贷、国债、地方政府债券规模的释放对债券市场所产生的负面影响则属于次要因素。我们对城投债券的判断较为乐观，我们认为地方政府债务置换对以企业债形式发行的城投债券构成实质的利好，在信用风险日益加大的市场环境中，城投品种仍然是难得的避风港。我们也较早地判断地方政府债务置换不会成为供给端的洪水猛兽，定向置换平台贷款是最有可能的消化方式。另外经测算，参与新股一级市场发行，年化收益水平较为可观，因此基金拟积极参与新股申购，风险资产股票配置则保持在较低的水平。

整个报告期，债券市场在经济基本面孱弱、通胀水平较低和货币政策持续放松的背景下，出现了大幅度的上涨。但是，过程也非一帆风顺，长端利率是在股灾之后才开始中枢下行，整个上半年甚至受打新收益等低风险、高收益品种的影响，利率债还出现了一定幅度的收益率上行。银河鸿利基金 6 月底成立后权益配置以银行股票为主，利率以长端为主，年末基金规模迅速增长，基金积极参与新股申购的同时围绕短端信用品种增配了债券仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

银河鸿利混合 A 基金净值增长 1.20%，A 类比较基准为 2.15%，银河鸿利混合 C 基金净值增长 1.00%，C 类比较基准为 2.15%，银河鸿利混合 I 基金净值增长 0.30%，I 类比较基准为 0.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金管理人判断明年国内经济增速继续回落的可能性较大，“三期叠加”的背景抑制了过往在政策刺激下需求周期性暴发的可能性，经济仍将面临需求不足和通缩的风险。政府经济工作会议再次强调“供给侧改革”的作用，虽然我们可以预期供给侧改革不会是“休克式的”、“断崖式的”，需求端也会采取相应的措施来平衡，但是改革方向是为了市场出清，市场出清阶段一定会给经济带来阵痛。我们预期后续反腐压力或许减轻，这有利于地方政府端的投资启动，会对经济企稳带

来希望，但我们也看到 PPP 模式、城市管廊建设目前还存在一些落地的困难，资金是一方面、相关利益方的协调则是更为重要的一面。随着地方政府债务置换和专项金融债的顺利推进，未来地方政府信贷、直接融资都有可能重新放量，这有利于解决资金的问题。项目落地模式则需要进一步加强政策的引导和示范。

明年的货币政策、财政政策都将保持相对的宽松和积极，预计全年流动性总量保持宽松，短端资金利率将绝大部分时间里维持在央行打造的利率走廊之内。我们谨慎看待目前债券市场长端收益率水平，目前收益率水平已经包含了对未来持续降准、降息的乐观预期，但因人民币汇率存在贬值压力，这些预期是否长时间落空存在不确定性。我们更倾向于认为债券市场收益率有望保持平稳之势，某些时点上可能会受到汇率调整、股市反弹及利率供给的压力等因素的影响，但并不会大幅改变市场收益率的水平。中短期债券投资利率风险有限，主要的风险还是来自于信用风险。

目前在经济减速、需求不足的大背景下，企业盈利能力普遍降低，前期扩张的债务杠杆此时更使得企业感受到利息负担沉重。虽然整个市场资金宽裕，但信用违约事件的不断发生将引导主流配置需求向更为安全的资产上倾斜。未来的债券投资将必须更多地依靠信用风险的识别能力，短期内债券主流配置资产会向高资质的企业倾斜。

因为债券市场收益率水平较低，明年权益市场相对价值有所体现。但经历 2015 年“过山车”般的行情之后，与经济基本面持续背离的上涨可能性较小，权益市场更多要从波段中寻找获利的机会，并且控制风险是大前提。相比高估值成长股我们更看好估值合理的价值股。新股收益因新规不再冻结资金，将吸引大量产品参与一级市场申购，中签率降低将导致年化收益率大幅下降。

转债品种在转债市场有效扩容之后，估值趋于合理，才会具备更好的配置价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动，

使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

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

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2015 年 6 月 19 日成立，根据《基金合同》有关规定，“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”。截止 2015 年 12 月 31 日 A 类可供分配利润为 1,406,262.72 元，C 类可供分配利润为 123,773.28 元，I 类可供分配利润为 4,153,610.89 元，本年度未进行利润分配。

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

自 2015 年 6 月 19 日银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金成立以来,作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求,对基金管理人银河基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

由银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金管理人银河基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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(2016)审字第 60821717_B29 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	银河鸿利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鸿利灵活配置混合型证券投资基金财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2015 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，公允反映了银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 19 日（基金合同生效日）至 2015 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 濮晓达
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	2016 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	7,045,295.56
结算备付金		62,014,027.45
存出保证金		36,474.72
交易性金融资产	7.4.7.2	1,152,675,608.04
其中：股票投资		44,576,992.84
基金投资		-

债券投资		1, 108, 098, 615. 20
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	1, 740, 000, 760. 00
应收证券清算款		43, 056, 503. 02
应收利息	7.4.7.5	26, 030, 752. 58
应收股利		-
应收申购款		8, 597. 26
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		3, 030, 868, 018. 63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负 债:		
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		4, 452, 822. 48
应付管理人报酬		3, 083, 407. 36
应付托管费		642, 376. 55
应付销售服务费		131, 553. 22
应付交易费用	7.4.7.7	25, 303. 57
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	180, 000. 00
负债合计		8, 515, 463. 18
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	3, 010, 888, 001. 82
未分配利润	7.4.7.10	11, 464, 553. 63
所有者权益合计		3, 022, 352, 555. 45
负债和所有者权益总计		3, 030, 868, 018. 63

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额总额 3, 010, 888, 001. 82 份，其中 A 类基金份额净值 1. 012 元，份额总额 187, 856, 605. 95 份；C 类基金份额净值 1. 010 元，份额总额 23, 031, 395. 87 份；I 类基金份额净值 1. 003 元，份额总额 2, 800, 000, 000. 00 份。

2、本基金合同于 2015 年 6 月 19 日生效。

7.2 利润表

会计主体：银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 6 月 19 日(基金合同 生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		19,108,997.34
1. 利息收入		11,115,558.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,511,122.78
债券利息收入		6,178,468.30
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,425,967.86
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,115,657.79
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,818,638.42
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,875,880.63
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	172,900.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,322,547.07
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	2,555,233.54
减：二、费用		8,420,450.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,359,200.58
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,324,833.40
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	276,711.50
4. 交易费用	7.4.7.19	92,164.58
5. 利息支出		110,094.16
其中：卖出回购金融资产支出		110,094.16
6. 其他费用	7.4.7.20	257,446.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,688,546.68
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,688,546.68

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	631,454,386.94	-	631,454,386.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,688,546.68	10,688,546.68
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）	2,379,433,614.88	776,006.95	2,380,209,621.83
其中：1. 基金申购款	2,914,560,447.73	-97,956.48	2,914,462,491.25
2. 基金赎回款	-535,126,832.85	873,963.43	-534,252,869.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,010,888,001.82	11,464,553.63	3,022,352,555.45

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：

_____	_____	_____
陈勇	陈勇	秦长建
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银河鸿利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]1074号《关于准予银河鸿利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2015年6月9日到2015年6月12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(2015)验字第60821717_B09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2015年6月19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631,357,459.49元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币96,927.45元，以上实收基金(本息)合计为人民币631,454,386.94元，折合631,454,386.94

份基金份额，其中 A 类份额 557,970,796.89 份，C 类份额 73,483,590.05 份。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，基金托管人为中信银行股份有限公司。本基金自 2015 年 11 月 16 日起增加 I 类基金份额，自增加 I 类基金份额类别后，本基金分设 A 类、C 类和 I 类三类基金份额。对于 A 类基金份额，投资者申购时需缴纳申购费；对于 C 类基金份额，投资者申购时无需缴纳申购费，而从 C 类基金资产中收取销售服务费；对于 I 类基金份额，投资者仅可通过管理人指定的特定销售渠道申购，且首笔申购资金不低于人民币 1,000.00 万元，投资者申购时无需缴纳申购费，而从 I 类基金资产中收取销售服务费。

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、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%；债券资产投资占基金资产的比例不低于 5%。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：中国人民银行公布的三年期定期存款利率（税后）+1%。

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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 19 日（基金合同生效日）至 2015 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 2015 年 6 月 19 日（基金合同生效日）至 2015 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

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(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

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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 1.20%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) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日基金份额基金资产净值的 0.60%年费率逐日计提，I 类基金份额的销售服务费按前一日基金份额基金资产净值的 0.05%年费率逐日计提；

(4) 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；

(5) 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) 基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的两类基金份

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) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类及 I 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别的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 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

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、国家税务总局财税字[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、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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；

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 2015 年 12 月 31 日
活期存款	7,045,295.56
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	7,045,295.56
-----	--------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,502,978.04	44,576,992.84	2,074,014.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	202,609,835.56	203,657,615.20
	银行间市场	904,240,247.37	904,441,000.00
	合计	1,106,850,082.93	1,108,098,615.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,149,353,060.97	1,152,675,608.04	3,322,547.07

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

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	1,500,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	240,000,760.00	-
合计	1,740,000,760.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末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 2015年12月31日

应收活期存款利息	104,490.88
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	30,696.93
应收债券利息	25,269,805.13
应收买入返售证券利息	625,741.60
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.04
合计	26,030,752.58

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 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	19,548.77
银行间市场应付交易费用	5,754.80
合计	25,303.57

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	60,000.00
预提信息披露费	120,000.00
合计	180,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银河鸿利混合 A		
项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	557,970,796.89	557,970,796.89

本期申购	111,699,957.28	111,699,957.28
本期赎回(以“-”号填列)	-481,814,148.22	-481,814,148.22
- 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	187,856,605.95	187,856,605.95

金额单位：人民币元

银河鸿利混合 C		
项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	73,483,590.05	73,483,590.05
本期申购	2,860,490.45	2,860,490.45
本期赎回(以“-”号填列)	-53,312,684.63	-53,312,684.63
- 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	23,031,395.87	23,031,395.87

金额单位：人民币元

银河鸿利混合 I		
项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	2,800,000,000.00	2,800,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,800,000,000.00	2,800,000,000.00

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2015年6月19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631,357,459.49元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币96,927.45元,以上实收基金(本息)合计为人民币631,454,386.94元,折合631,454,386.94份基金份额,其中A类557,970,796.89份,C类73,483,590.05份。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

银河鸿利混合 A			
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	2,951,319.72	-1,451,572.66	1,499,747.06
本期基金份额交易产生的变动数	-1,545,057.00	2,275,615.67	730,558.67
其中：基金申购款	20,225.81	-127,208.05	-106,982.24
基金赎回款	-1,565,282.81	2,402,823.72	837,540.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,406,262.72	824,043.01	2,230,305.73

单位：人民币元

银河鸿利混合 C			
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	261,069.00	-82,229.92	178,839.08
本期基金份额交易产生的变动数	-137,295.72	182,744.00	45,448.28
其中：基金申购款	9,481.91	-456.15	9,025.76
基金赎回款	-146,777.63	183,200.15	36,422.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	123,773.28	100,514.08	224,287.36

单位：人民币元

银河鸿利混合 I			
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	4,153,610.89	4,856,349.65	9,009,960.54
本期基金份额交易产生的变动数			
其中：基金申购款			
基金赎回款			
本期已分配利润			
本期末	4,153,610.89	4,856,349.65	9,009,960.54

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日

活期存款利息收入	1,344,012.99
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	166,286.32
其他	823.47
合计	1,511,122.78

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 2015年6月19日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
卖出股票成交总额	16,010,806.92
减：卖出股票成本总额	12,192,168.50
买卖股票差价收入	3,818,638.42

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至 2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,875,880.63
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,875,880.63

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至 2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	210,265,601.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	204,428,572.86
减：应收利息总额	7,712,909.63
买卖债券差价收入	-1,875,880.63

7.4.7.13.3 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：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——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——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——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 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	172,900.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	172,900.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日

1. 交易性金融资产	3,322,547.07
——股票投资	2,074,014.80
——债券投资	1,248,532.27
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,322,547.07

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	2,480,802.57
转换费收入 519641	3,656.78
其他	3,594.63
转换费收入 519640	67,179.56
合计	2,555,233.54

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	85,689.58
银行间市场交易费用	6,475.00
合计	92,164.58

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	180,000.00
银行费用	15,946.44

帐户维护费	1,500.00
合计	257,446.44

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，本基金无需要说明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
中信银行股份有限公司	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、保证人
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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 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 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015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	26,487,743.99	39.28%

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日
-------	---------------------------------------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	11,752,114.94	3.55%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	14,000,000.00	0.03%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中国银河证券 股份有限公司	23,749.18	38.72%	8,616.59	44.08%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券
结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供
的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 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 2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,359,200.58
其中：支付销售机构的客户维护费	849,207.49

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.2%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人在收到计算结果当日完成复核，并于当日从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,324,833.40

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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，基金管理人应于次月首日起三个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并作出划付指令，基金托管人复核后于当日从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2015 年 6 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	银河鸿利混合 A	银河鸿利混合 C	银河鸿利混合 I	合计
银河管理公司	-	2,687.00	165,019.82	167,706.82
中信银行	-	85,531.03	-	85,531.03
银河证券	-	13,699.98	-	13,699.98
合计	-	101,918.01	165,019.82	266,937.83

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.6%，I 类基金份额的销售服务费年费率为 0.05%。销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。C/I 类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C/I 类基金份额销售服务费

E 为前一日的 C/I 类基金份额的基金资产净值

销售服务费自基金合同生效之日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至支付法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（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：本基金的基金管理人本报告期末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：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。

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 2015 年 6 月 19 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	7,045,295.56	1,344,012.99

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（2015 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	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估	备注	

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	值总额	
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
136104	15 市北债	2015年12月22日	2016年1月6日	认购新发证券	100.00	100.00	25,000	2,500,000.00	2,500,000.00	-
123001	蓝标转债	2015年12月21日	2016年1月8日	认购新发证券	100.00	100.00	2,175	217,500.00	217,500.00	-
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	认购新发证券	100.00	100.00	6,520	652,000.00	652,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末暂时停牌等流通受限股票。

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 2015 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 2015 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

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。

7.4.13.2 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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	7,045,295.56	-	-	-	-	-	7,045,295.56
结算备付金	62,014,027.45	-	-	-	-	-	62,014,027.45
存出保证金	36,474.72	-	-	-	-	-	36,474.72
交易性金融资产	949,860,571.40	61,787,056.00	21,005,500.00	4,939,711.20	70,505,776.60	44,576,992.84	1,152,675,608.04
买入返售金融资产	1,740,000,760.00	-	-	-	-	-	1,740,000,760.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	43,056,503.02	43,056,503.02
应收利息	-	-	-	-	-	26,030,752.58	26,030,752.58
应收申购款	110.00	-	-	-	-	8,487.26	8,597.26
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,758,957,239.13	61,787,056.00	21,005,500.00	4,939,711.20	70,505,776.60	113,672,735.70	3,030,868,018.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,452,822.48	4,452,822.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,083,407.36	3,083,407.36
应付托管费	-	-	-	-	-	642,376.55	642,376.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	131,553.22	131,553.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,303.57	25,303.57

其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	8,515,463.18	8,515,463.18
利率敏感度缺口	2,758,957,239.13	61,787,056.00	21,005,500.00	4,939,711.20	70,505,776.60	105,157,272.52	3,022,352,555.45

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	975,323.51	-
	市场利率上升 25 个基点	-975,323.51	

7.4.13.4.2 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。

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 2015 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	44,576,992.84	1.47
衍生金融资产—权证投资	-	-

其他	-	-
合计	44,576,992.84	1.47

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	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（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	1,967,100.25	-
	沪深 300 指数下降 5%	-1,967,100.25	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 46,969,104.04 元，属于第二层次的余额为人民币 1,105,706,504.00 元，无属于第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2 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、可转换债券、资产支持证券和私募债券，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、可转换债券、资产支持证券和私募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、可转换债券、资产支持证券和私募债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	44,576,992.84	1.47
	其中：股票	44,576,992.84	1.47
2	固定收益投资	1,108,098,615.20	36.56
	其中：债券	1,108,098,615.20	36.56
	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	1,740,000,760.00	57.41
	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	69,059,323.01	2.28
7	其他各项资产	69,132,327.58	2.28
8	合计	3,030,868,018.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	10,304,850.93	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,571,551.95	0.05
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,365,720.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,588,208.18	0.09
J	金融业	15,908,592.34	0.53
K	房地产业	5,196,765.00	0.17
L	租赁和商务服务业	4,419,000.00	0.15

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	44,576,992.84	1.47

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	000001	平安银行	499,966	5,994,592.34	0.20
2	000514	渝开发	451,500	5,196,765.00	0.17
3	601988	中国银行	1,200,000	4,812,000.00	0.16
4	603766	隆鑫通用	200,000	4,746,000.00	0.16
5	300058	蓝色光标	300,000	4,419,000.00	0.15
6	600279	重庆港九	268,000	4,365,720.00	0.14
7	601328	交通银行	650,000	4,186,000.00	0.14
8	002236	大华股份	100,000	3,690,000.00	0.12
9	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04
10	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03
11	601398	工商银行	200,000	916,000.00	0.03
12	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.03
13	300495	美尚生态	6,375	569,223.75	0.02
14	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.02
15	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.01
16	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.01
17	002786	银宝山新	9,630	263,476.80	0.01
18	300497	富祥股份	5,523	237,654.69	0.01
19	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.01
20	603778	N 乾景	7,140	195,136.20	0.01
21	002787	N 华源	10,011	163,880.07	0.01
22	300494	N 盛天	6,251	162,901.06	0.01
23	603299	N 井神	23,499	124,779.69	0.00

24	300490	N 华自	7,127	93,292.43	0.00
25	300491	N 通合	6,015	90,766.35	0.00
26	002777	N 久远	4,264	70,356.00	0.00
27	002785	万里石	12,000	70,080.00	0.00
28	002778	高科石化	5,600	47,600.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	601988	中国银行	9,991,991.00	0.33
2	000001	平安银行	9,767,913.62	0.32
3	601328	交通银行	5,311,381.00	0.18
4	601398	工商银行	5,275,000.00	0.17
5	300058	蓝色光标	4,974,610.79	0.16
6	000514	渝开发	4,969,989.00	0.16
7	600279	重庆港九	4,298,417.92	0.14
8	603766	隆鑫通用	3,611,653.63	0.12
9	002236	大华股份	3,212,983.00	0.11
10	603508	思维列控	490,143.80	0.02
11	002781	奇信股份	287,496.00	0.01
12	603800	道森股份	211,816.80	0.01
13	300495	美尚生态	202,852.50	0.01
14	002783	凯龙股份	176,037.84	0.01
15	603996	中新科技	175,989.08	0.01
16	603999	读者传媒	163,286.01	0.01
17	300496	中科创达	152,651.20	0.01
18	603778	N 乾景	135,517.20	0.00
19	002787	N 华源	113,825.07	0.00
20	300494	N 盛天	113,143.10	0.00

注：买入金额不包括相关交易费用。

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	601988	中国银行	4,932,000.00	0.16
2	601398	工商银行	3,688,000.00	0.12
3	000001	平安银行	2,290,000.00	0.08
4	603800	道森股份	1,159,092.48	0.04
5	603999	读者传媒	982,724.40	0.03
6	002783	凯龙股份	890,010.00	0.03
7	603936	博敏电子	614,931.20	0.02
8	603398	邦宝益智	564,583.00	0.02
9	603696	安记食品	507,228.26	0.02
10	002779	中坚科技	382,237.58	0.01

注：卖出金额不包括相关交易费用。

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	54,695,146.54
卖出股票收入（成交）总额	16,010,806.92

注：买入股票成本及卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	70,505,776.60	2.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	145,761,571.40	4.82
	其中：政策性金融债	145,761,571.40	4.82
4	企业债券	14,117,056.00	0.47
5	企业短期融资券	874,405,000.00	28.93
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,309,211.20	0.11
8	其他	-	-
9	合计	1,108,098,615.20	36.66

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	------	---------------

1	011599320	15 穗地铁 SCP002	2,000,000	200,860,000.00	6.65
2	018001	国开 1301	1,157,140	115,725,571.40	3.83
3	011519003	15 国电 SCP003	1,000,000	100,680,000.00	3.33
4	011598117	15 中电信 SCP005	1,000,000	100,000,000.00	3.31
5	011517005	15 华电 SCP005	800,000	80,552,000.00	2.67

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：本基金暂时不参与股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂时不参与股指期货的投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂时不参与国债期货的投资。

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：本基金暂时不参与国债期货的投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金暂时不参与国债期货的投资。

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	36,474.72
2	应收证券清算款	43,056,503.02
3	应收股利	-
4	应收利息	26,030,752.58
5	应收申购款	8,597.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,132,327.58

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：本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

	持有人 户数	户均持有的基金份 额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

别	(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
银河鸿 利混合 A	2,543	73,872.04	0.00	0.00%	187,856,605.95	100.00%
银河鸿 利混合 C	967	23,817.37	0.00	0.00%	23,031,395.87	100.00%
银河鸿 利混合 I	1	2,800,000,000.00	2,800,000,000.00	100.00%	0.00	0.00%
合计	3,511	857,558.53	2,800,000,000.00	93.00%	210,888,001.82	7.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	银河鸿利混合 A	0.00	0.0000%
	银河鸿利混合 C	0.00	0.0000%
	银河鸿利混合 I	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

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	份额级别	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	银河鸿利混合 A	0
	银河鸿利混合 C	0
	银河鸿利混合 I	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	银河鸿利混合 A	0
	银河鸿利混合 C	0
	银河鸿利混合 I	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河鸿利混合 A	银河鸿利混合 C	银河鸿利混合 I
基金合同生效日（2015 年 6 月 19 日）基金份额总额	557,970,796.89	73,483,590.05	-
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	111,699,957.28	2,860,490.45	2,800,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	481,814,148.22	53,312,684.63	-
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）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	187,856,605.95	23,031,395.87	2,800,000,000.00

§ 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、2015 年 8 月 21 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离职及副总经理代行总经理职务的公告》，尤象都先生不再担任本公司总经理，由副总经理陈勇先生代为履行总经理职务。

二、报告期内基金托管人未发生重大人事变动

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

报告期内基金未改聘会计师事务所，本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000.00 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	
中信建投	1	40,937,002.89	60.72%	37,591.37	61.28%	新增
银河证券	1	26,487,743.99	39.28%	23,749.18	38.72%	新增
西南证券	1	-	-	-	-	新增
方正证券	2	-	-	-	-	新增
中银国际	1	-	-	-	-	新增

注：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
中信建投	319,338,710.08	96.45%	48,625,100,000.00	99.97%	-	-
银河证券	11,752,114.94	3.55%	14,000,000.00	0.03%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	银河鸿利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	2015年6月6日
2	银河鸿利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	2015年6月6日
3	银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015年6月6日
4	关于旗下基金所持有股票“爱施德”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	2015年6月6日
5	关于旗下基金所持有股票“新华医疗”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	2015年6月9日
6	关于旗下基金所持有股票“华菱钢铁”因长期停牌变更估值方法	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015年6月11日

	的提示性公告	报》、公司网站	
7	关于旗下基金所持有股票“天源迪科”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	2015年6月19日
8	银河鸿利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	2015年6月20日
9	关于旗下基金所持有股票“仁和药业”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	2015年6月24日
10	关于旗下基金所持有股票“飞利信”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	2015年6月25日
11	关于旗下基金所持有股票“海南海药”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	2015年6月25日
12	关于旗下基金所持有股票“威创股份”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	2015年6月25日
13	关于旗下基金所持有股票“暴风科技”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	2015年6月26日
14	关于旗下基金所持有股票“雷柏科技”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	2015年6月30日
15	关于旗下基金所持有股票“金亚科技”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	2015年7月1日
16	关于旗下基金所持有股票“龙泉	《中国证券报》、《证	2015年7月1日

	股份”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	
17	关于旗下基金所持有股票“围海股份”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	2015年7月1日
18	银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购和赎回公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015年7月1日
19	关于银河鸿利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	2015年7月2日
20	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	2015年7月3日
21	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	2015年7月3日
22	关于旗下基金所持有股票“长江电力”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	2015年7月4日
23	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	2015年7月7日
24	银河基金管理有限公司关于公司及高级经营管理人员投资旗下基金相关事宜的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015年7月7日
25	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2015年7月8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	
26	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	2015年7月9日
27	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	2015年7月10日
28	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	2015年7月11日
29	关于银河基金管理有限公司旗下部分基金开展赎回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	2015年7月13日
30	银河基金管理有限公司关于直销平台基金转换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	2015年7月14日
31	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	2015年7月15日
32	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和定投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	2015年7月15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	2015年7月21日
34	关于开通银河鸿利灵活配置混合型证券投资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	2015年7月22日

		报》、公司网站	
35	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	2015年7月23日
36	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	2015年7月25日
37	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京展恒基金销售有限公司为代销机构及申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015年7月30日
38	银河基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米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	2015年7月30日
39	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安证券股份有限公司开通定投、转换业务并参加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	2015年8月13日
40	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽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》、公司网站	2015年8月14日
41	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信期货有限责任公司为代销机构并开通基金定投和转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015年8月18日
42	关于旗下基金参加中国国际金融股份有限公司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》、《证券日报》、	2015年8月19日

		公司网站	
43	银河基金管理有限公司关于总经理离职及副总经理代行总经理职务的公告	《证券时报》、公司网站	2015年8月21日
44	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》、《证券日报》、公司网站	2015年8月25日
45	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	2015年8月26日
46	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	2015年8月27日
47	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	2015年8月28日
48	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	2015年8月29日
49	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	2015年9月2日
50	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	2015年9月9日
51	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	2015年9月22日

52	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在平安证券有限责任公司开通定投业务并参加平安证券有限责任公司开展的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》、《证券日报》、公司网站	2015年9月24日
53	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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	2015年9月29日
54	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海银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	2015年10月16日
55	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	2015年10月16日
56	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券股份有限公司开通定投业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015年10月19日
57	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券（山东）有限责任公司开通定投业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015年10月19日
58	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	2015年10月20日
59	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	2015年10月21日

60	银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金 2015 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	2015 年 10 月 24 日
61	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米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》、公司网站	2015 年 10 月 26 日
62	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售投资顾问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	2015 年 11 月 10 日
63	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海凯石财富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	2015 年 11 月 10 日
64	银河基金管理有限公司关于旗下基金参加上海好买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》、《证券日报》、 公司网站	2015 年 11 月 10 日
65	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大泰金石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	2015 年 11 月 10 日
66	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳富济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	2015 年 11 月 10 日
67	银河基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《证	2015 年 11 月 12 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	
68	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	2015 年 11 月 13 日
69	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	2015 年 11 月 14 日
70	关于银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同、托管协议的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015 年 11 月 16 日
71	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	2015 年 11 月 17 日
72	银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金暂停(大额)申购(含转换转入及定期定额投资)的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2015 年 11 月 18 日
73	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	2015 年 11 月 19 日
74	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	2015 年 11 月 27 日
75	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》、《证券日报》、公司网站	2015 年 11 月 30 日
76	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富(北京)	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2015 年 12 月 10 日

	资本管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	报》、《证券日报》、 公司网站	
77	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京乐融多源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	2015 年 12 月 15 日
78	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	2015 年 12 月 22 日
79	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构及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	2015 年 12 月 24 日
80	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得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	2015 年 12 月 25 日
81	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	2015 年 12 月 29 日
82	银河基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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》、《证券日报》、 公司网站	2015 年 12 月 29 日
83	银河基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳众禄金融控股股份有限公司申购和定投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	2015 年 12 月 29 日
84	银河基金管理有限公司关于在指	《中国证券报》、《证	2015 年 12 月 31 日

	数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	券时报》、《上海证券报》、公司网站	
--	------------------------	-------------------	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2015年11月16日起银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金增加I类基金份额,并修改了基金合同、托管协议,相关内容已在指定媒体上公告。

§ 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鸿利灵活配置混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河鸿利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、银河鸿利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

13.2 存放地点

上海市世纪大道 1568 号中建大厦 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
2016年3月25日