

银河润利保本混合型证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 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。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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 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 | 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 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 17 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 17 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 18 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 19 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 20 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| §5 托管人报告 | 21 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 21 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 21 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 21 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 21 |
| 6.1 资产负债表..... | 21 |
| 6.2 利润表..... | 22 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 23 |
| 6.4 报表附注..... | 25 |
| §7 投资组合报告 | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 44 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 45 |
| 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..... | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 49 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 49 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 49 |

| | |
|--|-----------|
| §8 基金份额持有人信息 | 50 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 50 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| §9 开放式基金份额变动 | 51 |
| §10 重大事件揭示 | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 52 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 53 |
| 10.8 其他重大事件..... | 53 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 57 |
| §12 备查文件目录 | 57 |
| 12.1 备查文件目录..... | 57 |
| 12.2 存放地点..... | 57 |
| 12.3 查阅方式..... | 58 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称 | 银河润利保本混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 银河润利保本 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 519675 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014 年 8 月 6 日 | |
| 基金管理人 | 银河基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,308,163,837.10 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: | 银河润利混合 A | 银河润利混合 I |
| 下属分级基金场内简称: | - | - |
| 下属分级基金的交易代码: | 519675 | 519648 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | - | - |
| 下属分级基金的后端交易代码 | - | - |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 284,194,161.97 份 | 1,023,969,675.13 份 |

注：本基金于 2015 年 11 月 19 日 I 类级别开始持有份额，基金分为 A 级和 I 级。

2.2 基金产品说明

| | | |
|---------------|---|----------|
| 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。 | |
| 投资策略 | 本基金运用优化的恒定比例组合保险原理，动态调整保本资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。 | |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款税后收益率 | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金。 | |
| | 银河润利混合 A | 银河润利混合 I |
| 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 | 北京银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 董伯儒 | 刘晔 |
| | 联系电话 | 021-38568888 | 010-66223586 |
| | 电子邮箱 | dongboru@galaxyasset.com | liuyel@bankofbeijing.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-820-0860 | 95526 |
| 传真 | | 021-38568769 | 010-66226045 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区世纪大道1568号15层 | 北京市西城区金融大街甲17号首层 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区世纪大道1568号15层 | 北京市西城区金融大街丙17号 |
| 邮政编码 | | 200122 | 100033 |
| 法定代表人 | | 许国平 | 闫冰竹 |

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》、《证券日报》 |
| 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、（基金会计补充） |

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 | 上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦 |
| 基金保证人 | 中国投融资担保有限公司 | 北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层 |

§ 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

| 基金级别 | 银河润利混合 A | 银河润利混合 I |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日) | 报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 8,916,399.14 | 20,306,116.86 |
| 本期利润 | 5,274,844.50 | 12,615,818.86 |

| | | |
|----------------------|-------------------------|------------------|
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0178 | 0.0122 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.26% | 1.21% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.28% | 1.19% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 114,424,778.57 | 19,642,705.35 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4026 | 0.0192 |
| 期末基金资产净值 | 404,924,908.36 | 1,043,612,380.48 |
| 期末基金份额净值 | 1.425 | 1.019 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 42.50% | 1.90% |

注：1、基金合同生效于2014年8月6日，于2015年11月19日I类级别开始持有份额，基金分为A级和I级。本基金于2016年8月1日正式将单位份额净值保留四位，第五位四舍五入；在此之前依旧是保留三位，第四位四舍五入。

2、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。

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银河润利混合 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.64% | 0.04% | 0.35% | 0.01% | 0.29% | 0.03% |
| 过去三个月 | 0.71% | 0.04% | 1.06% | 0.01% | -0.35% | 0.03% |
| 过去六个月 | 1.28% | 0.05% | 2.11% | 0.01% | -0.83% | 0.04% |
| 过去一年 | 6.26% | 0.39% | 4.26% | 0.01% | 2.00% | 0.38% |
| 自基金合同生效日起至 今 | 42.50% | 0.60% | 8.09% | 0.01% | 34.41% | 0.59% |

银河润利混合 I

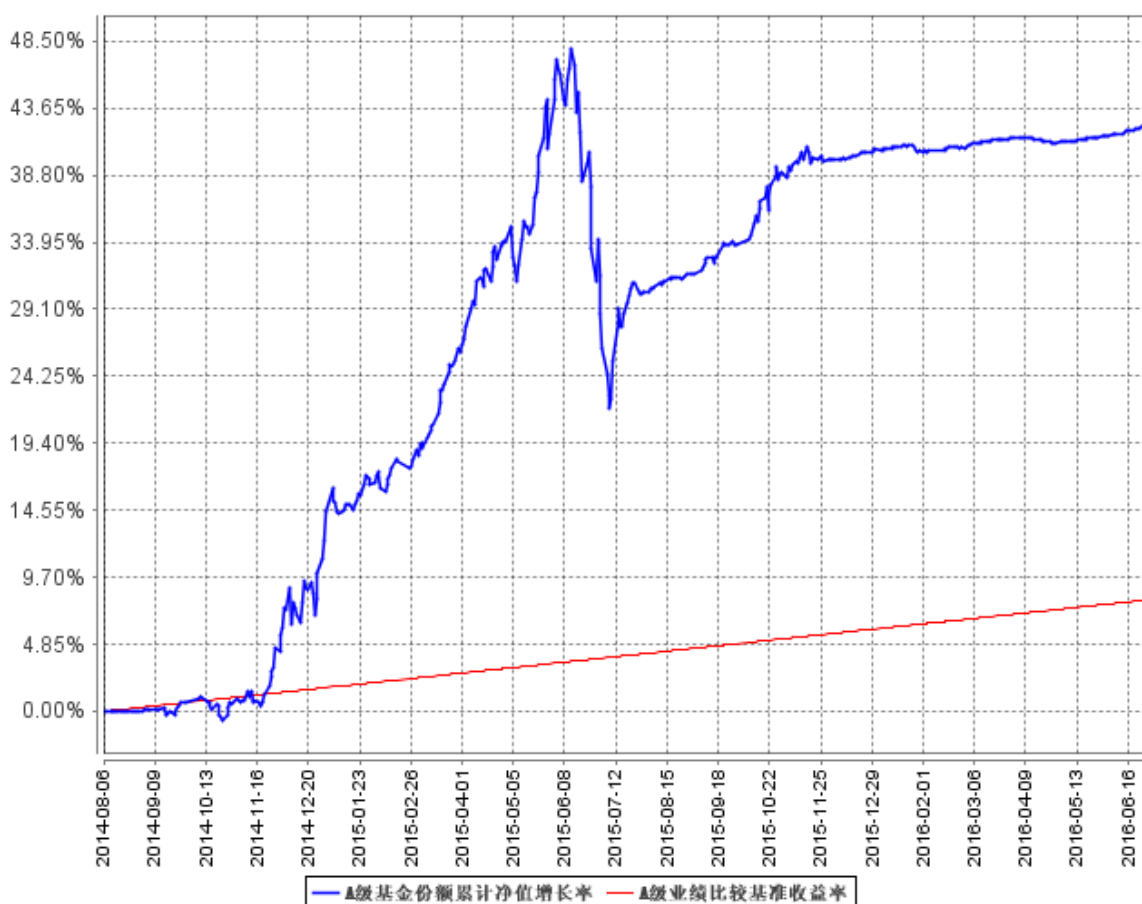
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|-----------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.59% | 0.06% | 0.35% | 0.01% | 0.24% | 0.05% |
| 过去三个月 | 0.69% | 0.06% | 1.06% | 0.01% | -0.37% | 0.05% |
| 过去六个月 | 1.19% | 0.06% | 2.11% | 0.01% | -0.92% | 0.05% |
| 过去一年 | 1.90% | 0.06% | 2.61% | 0.01% | -0.71% | 0.05% |
| 自基金合同生效日起至 今 | 1.90% | 0.06% | 2.61% | 0.01% | -0.71% | 0.05% |

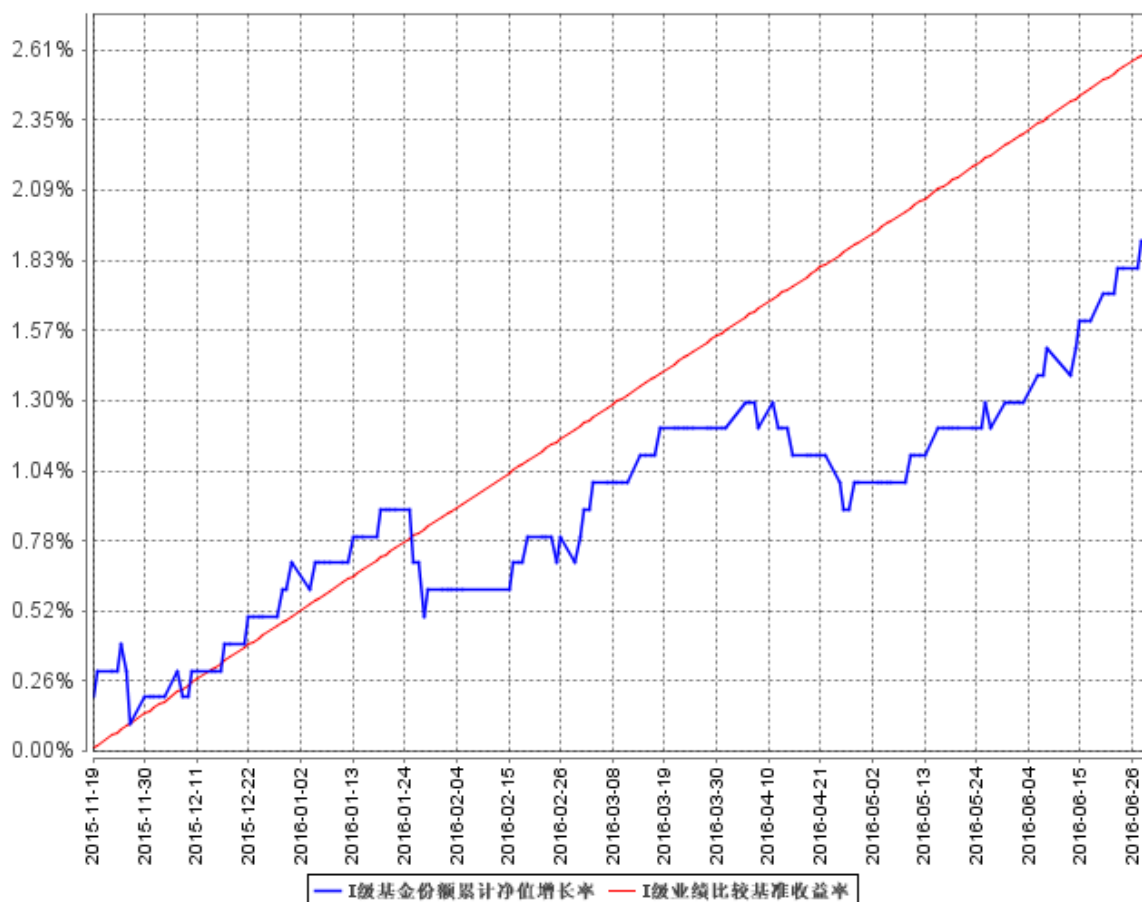
注：业绩比较基准：三年期银行定期存款税后收益率

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



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、本基金于 2015 年 11 月 19 日 I 类级别开始持有份额，基金分为 A 级和 I 级。

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 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定：本基金投资的债券等固定收益类资产占基金资产的不低于 60%，股票等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，全部权证市值不得超过基金资产的 3%，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。截止 2014 年 2 月 6 日建仓期满，本基金各项资产配置符合合同约定

§ 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 29 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 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 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 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：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 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 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 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。

23、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 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。

24、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。

25、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。

26、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。

27、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。

28、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。

29、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。

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 | 银河润利保本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、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金 | 2016 年 3 月 10 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 |

| | | | | | |
|-----|--|----------------|-----------------|----|---|
| | 的基金经理、银河泽利保本混合型证券投资基金的基金经理、银河旺利混合型证券投资基金的基金经理、固定收益部负责人 | | | | 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；2014 年 7 月起担任银河收益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；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；2015 年 6 月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 3 月起担任银河泽利保本混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 5 月起担任银河旺利混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 5 月起担任固定收益部负责人。 |
| 索峰 | 银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理、银河通利债券型证券投资基金（LOF）的基金经理、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理、银河泽利保本混合型证券投资基金的基金经理、总经理助理、固定收益部总监 | 2014 年 8 月 6 日 | 2016 年 4 月 25 日 | 21 | 中共党员，本科学历，曾就职于润庆期货公司、申银万国证券公司、原君安证券和中国银河证券有限责任公司，期间主要从事国际商品期货交易，营业部债券自营业务和证券投资咨询工作。2004 年 6 月加入银河基金管理有限公司，从事固定收益产品投资工作，历任银河银富货币市场基金的基金经理、银河收益证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理；2012 年 4 月至 2016 年 4 月担任银河通利债券型证券投资基金（LOF）的基金经理；2013 年 8 月至 2016 年 4 月担任银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2015 年 4 月至 2016 年 4 月担任银河泽利保本混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 8 月至 2016 年 4 月担任银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理；2011 年 5 月至 2016 年 4 月担任总经理助理，2006 年 9 月至 2016 年 4 月担任固定收益部总监。 |
| 孙伟仓 | 银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资 | 2014 年 8 月 6 日 | 2016 年 3 月 10 日 | 8 | 硕士研究生学历。2008 年 5 月加入银河基金管理有限公司，历任数量研究员、债券经理，期间主要从事数量研究和债券投资工作。2012 |

| | | | | |
|--|---|--|--|--|
| | 资基金的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河泽利保本债券型证券投资基金的基金经理 | | | 年 12 月至 2016 年 3 月担任银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理；2013 年 7 月至 2016 年 3 月担任银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理；2013 年 8 月至 2016 年 3 月担任银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2015 年 4 月至 2016 年 3 月担任银河泽利保本债券型证券投资基金的基金经理；2014 年 8 月至 2016 年 3 月担任银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|---|--|--|--|

注：1、上表中索峰、孙伟仓的任职日期为该基金基金合同生效之日，离任日期为公司做出决定之日；韩晶的任职日期为公司做出决定之日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》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

在经历近两年的债券牛市之后，银河润利保本基金经理人对今年上半年债券市场和权益市场均持谨慎乐观的看法。我们认为 2016 年国内经济基本面整体仍然是稳中趋降的形势，通胀压力可控，货币政策、财政政策都将保持相对的宽松和积极，但考虑到人民币汇率稳定的需要，降息可能性较小，降准预期也有所减弱。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。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使得企业利息负担沉重，一些经营困难的民企和过剩产能企业将面临较大的融资困难，信用违约事件的不断发生将明显降低市场风险偏好，主流配置需求将向更为安全的资产上倾斜。我们认为短久期的城投品种仍然是难得的避风港。债券市场在某些时点上将受到汇率调整、股市反弹及利率供给的压力等因素的影响，但这些因素并不会大幅改变市场收益率的水平。我们认为权益市场整体不具备趋势性上涨的条件，只是在经历去年大幅调整之后，市场处于相对底部阶段，存在着阶段性反弹的机会，尤其是一些兼具成长性、估值又比较合理的价值型股票具备了配置的价值，参与波段操作的风险可控。受新规的影响中签率走低，新股收益将明显被稀释，但制度红利仍然存在，中期看仍是无风险获利的品种。因此在投资策略方面基金选择主要以降久期为主，增加对短久期信用品种的配置，寻机参与中长端利率品种的波段操作机会。权益市场则在较低仓位的前提下，以价值股为主要配置品种。相对股票而言，转债品种因其存量较小，普遍较高的转股溢价使其投资价值相对较低，我们选择回避。

报告期内，债券市场初期在资金宽裕、资产缺失的格局下，信用品种尤其是中高资质的品种维持收益率下行的趋势，利率则受去年四季度收益率过快下行和一季度激增的信贷投放的影响，出现明显回调，期末才在“英国脱欧”事件的驱动下随全球风险偏好降低而走强。四月份受几起信用事件发酵影响，信用品种出现大幅度的快速回调，后续随着对信用风险担忧的缓解，收益率有所下行，但整体信用利差有所走阔，信用分化明显，一级市场受此影响取消发行的品种明显增多。权益市场经历了年初两次熔断下跌的行情，随后在存量资金博弈的背景下整体维持底部震荡的格局，食品饮料、新能源汽车产业链等少数板块上涨的持续性较好，其余板块热点切换较快，把握行情的难度较大。银河润利保本基金规模有较大增长，基金按既定策略，以短久期的信用品种、定存和逆回购为主要增配品种，组合未加杠杆，基金还把握了中长端利率的波段投资机会。期末，基金开始着手减持债券以应对即将到期的第一个保本周期。同样基于这点考虑，虽然基金安全垫积累较厚，但在股票投资方面仍然选择了保守的策略，以期回避权益市场波动的风险，从而为投资者锁定两年以来取得的较为丰厚的盈利成果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年度银河润利保本混合型证券投资基金 A 类份额净值增长 1.28%，同期比较基准为 2.11%；银河润利保本混合型证券投资基金 I 类份额净值增长 1.19%，同期比较基准为 2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预期经济增速在中期来看仍在下降通道中，但短期看经济失速下行的概率不大，未来两个季度 GDP 和工业增加值同比增速大概率走平或继续小幅下探，影响经济近期走势的关键因素可能仍是房地产投资增速反弹的持续性。通胀数据短期不会构成市场的压力，随着猪肉价格基数的走高，CPI 同比三季度大概率继续回落，需要关注的是四季度 PPI 同比转正的可能及其对通胀预期的影响。汇率方面自年初以来累计对美元贬值约 3%，5 月以来，伴随美元走强，贬值压力有增大迹象，可能会制约货币政策进一步宽松的空间。

基于以上对宏观经济的判断，我们判断除了季末等少数时点的扰动，央行料将维持货币市场利率的大体稳定，通过逆回购、MLF 等工具熨平流动性的波动。在经济增速没有失速下行的情况下，逆回购利率可能会锚定在 2.25%，央行通过降准放松货币政策托底经济的意愿不强，短端利率不下的情况下也压制了长端利率下行的空间。

在去产能和降杠杆的宏观背景下，过剩产能行业的信用风险预计仍然没有充分释放，后续跟踪评级的调整和信用事件的发酵可能进一步推动信用分化，市场对低评级民企、产能过剩行业债

券的风险偏好降低导致其再融资环境被动收紧，这些债券可能持续面临估值风险。

综合以上分析，我们对债市维持谨慎乐观的判断，我们认为利率债存在窄幅的交易性机会、但可能难见较大空间的趋势性行情。而信用利差在不出现超预期信用冲击的假设下整体将维持稳定，品种之间的分化仍将继续扩大，中高信用等级信用债和城投债仍将跑赢低评级信用债。低评级信用债面临再融资能力下滑和评级下调的风险，信用风险有可能加剧暴露。

权益市场仍大概率保持震荡的格局，英国脱欧导致避险情绪上升，全球风险偏好的降低制约了风险类资产的整体表现机会，脱欧事件引发人民币大幅贬值、资本外流的可能性也较小，资金方面的冲击有限。震荡市中围绕业绩主线，配置价值股仍然是不错的选择。在市场热点较难持续的情形下，次新股因其集中持股的不足仍然会成为市场风险偏好较高资金的追逐对象，加之 A 类机构投资者数量已趋稳定和对网下个人客户申购上限的监管，有利于下一阶段新股申购收益的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、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

保本周期内，仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资。本报告期末进行利润分配。

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

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

在本报告期内，本基金托管人在托管银河增利债券型发起式证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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。

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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 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：银河润利保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 378,324,208.19 | 2,471,281.88 |
| 结算备付金 | | 3,333,333.33 | 31,569,187.04 |
| 存出保证金 | | 174,039.25 | 749,059.82 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 552,137,756.27 | 1,358,833,106.25 |
| 其中：股票投资 | | 28,063,409.07 | 29,620,184.05 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 524,074,347.20 | 1,329,212,922.20 |
| 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 | 500,000,000.00 | 120,000,000.00 |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收证券清算款 | | 401,085.09 | 632,714,662.47 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 16,186,053.74 | 27,492,898.95 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 7,064.38 | 1,703,334.95 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,450,563,540.25 | 2,175,533,531.36 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 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 | 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 | | 218,328.12 | 2,036,182.58 |
| 应付管理人报酬 | | 1,421,304.50 | 2,219,505.09 |
| 应付托管费 | | 236,884.08 | 369,917.51 |
| 应付销售服务费 | | 42,623.20 | 74,143.26 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 9,895.60 | 219,160.10 |
| 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 | 97,215.91 | 212,589.37 |
| 负债合计 | | 2,026,251.41 | 5,131,497.91 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,308,163,837.10 | 2,035,195,134.94 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 140,373,451.74 | 135,206,898.51 |
| 所有者权益合计 | | 1,448,537,288.84 | 2,170,402,033.45 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,450,563,540.25 | 2,175,533,531.36 |

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，银河润利保本 A 级份额净值为 1.425 元，A 级基金份额为 284,194,161.97 份；润利保本 I 级份额净值为 1.019 元，I 级基金份额为 1,023,969,675.13 份。
2、本基金合同于 2014 年 8 月 6 日成立生效，于 2015 年 11 月 19 日 I 类级别开始持有份额，基金分为 A 级和 I 级。

6.2 利润表

会计主体：银河润利保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至 2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日 |
|-----|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
| | | | |

| | | | |
|-----------------------|------------|----------------|----------------|
| 一、收入 | | 28,701,855.21 | 122,671,635.38 |
| 1.利息收入 | | 23,545,533.85 | 15,626,232.04 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 4,853,022.96 | 258,161.30 |
| 债券利息收入 | | 16,167,515.97 | 15,326,851.26 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,524,994.92 | 41,219.48 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 16,083,402.30 | 178,328,950.44 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 10,182,079.40 | 177,859,299.89 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 5,152,785.64 | -642,751.34 |
| 资产支持证券投资 | 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 | 748,537.26 | 1,112,401.89 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -11,331,852.64 | -74,567,780.42 |
| 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 | 404,771.70 | 3,284,233.32 |
| 减：二、费用 | | 10,811,191.85 | 10,342,188.25 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 8,618,088.81 | 4,134,111.04 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,436,348.16 | 689,018.49 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 255,105.58 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 52,623.47 | 2,322,459.19 |
| 5. 利息支出 | | 335,423.84 | 3,095,805.98 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 335,423.84 | 3,095,805.98 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 113,601.99 | 100,793.55 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 17,890,663.36 | 112,329,447.13 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 17,890,663.36 | 112,329,447.13 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河润利保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----------------------|
| | 2016年1月1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) | 2,035,195,134.94 | 135,206,898.51 | 2,170,402,033.45 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | 17,890,663.36 | 17,890,663.36 |
| 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) | -727,031,297.84 | -12,724,110.13 | -739,755,407.97 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,014,404,635.59 | 18,260,452.53 | 1,032,665,088.12 |
| 2.基金赎回款 | -1,741,435,933.43 | -30,984,562.66 | -1,772,420,496.09 |
| 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) | 1,308,163,837.10 | 140,373,451.74 | 1,448,537,288.84 |
| | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | | |
| 项目 | 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) | 732,216,784.22 | 105,752,215.86 | 837,969,000.08 |
| 二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润) | - | 112,329,447.13 | 112,329,447.13 |
| 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) | -313,512,356.76 | -75,389,684.29 | -388,902,041.05 |
| 其中：1.基金申购款 | 69,105,446.59 | 20,430,836.72 | 89,536,283.31 |
| 2.基金赎回款 | -382,617,803.35 | -95,820,521.01 | -478,438,324.36 |
| 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) | 418,704,427.46 | 142,691,978.70 | 561,396,406.16 |

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银河润利保本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[2014]632 号《关于核准银河润利保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由银河基金管理有限公司作为管理人自 2014 年 7 月 18 日到 2014 年 7 月 31 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（2014）验字第 60821717_B10 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 2014 年 8 月 6 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 812,003,248.23 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 265,641.28 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 812,268,889.51 元，折合 812,268,889.51 份基金份额。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为北京银行股份有限公司，保证人为中国投融资担保有限公司。

根据《银河润利保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，在第一个保本周期内，本基金的保本金额为基金募集期内认购本基金的投资者认购并持有到期的基金份额的认购金额（即认购保本金额，包括该等基金份额的净认购金额、认购费用以及募集期间的认购利息）。发生本基金转入下一保本周期的情形时，下一保本周期的保本金额为在过渡期内进行申购的投资者申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和（即过渡期申购保本金额），以及从本基金上一个保本周期结束后默认选择转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人在上一保本周期持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值（即从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额保本金额），按照基金合同其他约定未获得可享受保本条款确认的基金份额除外。

在保本周期到期日，如基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和计算的总金额低于其保本金额（低出的部分即为“保本赔付差额”），则基金管理人或保本义务人应补足该保本赔付差额，并在保本周期到期日后 20 个工作日（含第 20 个工作日）内将该保本赔付差额支付给基金份额持有人。但发生基金合同约定的不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用本条款。

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并转入下一保本周期，该保本周期的具体起止日期以本基金管理人届时公告为准。如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金在到期期间截止日次日起转型为非保本的债券型证券投资基金，基金名称相应变更为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证、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，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：债券、国债期货和定期存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%；股票、权证、股指期货和可转债等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金应保留不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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并发布的《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。

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 2016 年 6 月 30 日的财

务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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与最近一期年度报告相一致。

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

本报告期无会计政策的变更。

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、营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债

利息收入免征增值税；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，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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[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[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；

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 2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 18,324,208.19 |
| 定期存款 | 360,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 1 个月 | 360,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 378,324,208.19 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 25,507,138.75 | 28,063,409.07 | 2,556,270.32 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 402,922,347.20 | 9,483,582.62 |
| | 银行间市场 | 121,152,000.00 | -343,784.76 |
| | 合计 | 524,074,347.20 | 9,139,797.86 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 540,441,688.09 | 552,137,756.27 | 11,696,068.18 |

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**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 | |
|--------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 500,000,000.00 | - |
| 合计 | 500,000,000.00 | - |

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 2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 8,029.68 |
| 应收定期存款利息 | 117,222.20 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 1,500.00 |
| 应收债券利息 | 15,913,203.84 |
| 应收买入返售证券利息 | 146,019.72 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 78.30 |
| 合计 | 16,186,053.74 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,226.08 |
| 银行间市场应付交易费用 | 6,669.52 |
| 合计 | 9,895.60 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 2,736.07 |
| 预提信息披露费 | 49,726.04 |
| 预提审计费 | 44,753.80 |
| 合计 | 97,215.91 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 银河润利混合 A | | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 302,873,357.78 | 302,873,357.78 |
| 本期申购 | 20,345,229.65 | 20,345,229.65 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -39,024,425.46 | -39,024,425.46 |
| 本期末 | 284,194,161.97 | 284,194,161.97 |

金额单位：人民币元

| 银河润利混合 I | | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,732,321,777.16 | 1,732,321,777.16 |
| 本期申购 | 994,059,405.94 | 994,059,405.94 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,702,411,507.97 | -1,702,411,507.97 |
| 本期末 | 1,023,969,675.13 | 1,023,969,675.13 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 银河润利混合 A | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 112,785,295.71 | 10,407,803.79 | 123,193,099.50 |
| 本期利润 | 8,916,399.14 | -3,641,554.64 | 5,274,844.50 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -7,276,916.28 | -460,281.33 | -7,737,197.61 |
| 其中：基金申购款 | 7,691,971.42 | 627,887.05 | 8,319,858.47 |
| 基金赎回款 | -14,968,887.70 | -1,088,168.38 | -16,057,056.08 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 114,424,778.57 | 6,305,967.82 | 120,730,746.39 |

单位：人民币元

| 银河润利混合 I | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 11,694,089.56 | 319,709.45 | 12,013,799.01 |
| 本期利润 | 20,306,116.86 | -7,690,298.00 | 12,615,818.86 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,625,931.97 | -1,360,980.55 | -4,986,912.52 |
| 其中：基金申购款 | 14,502,439.67 | -4,561,845.61 | 9,940,594.06 |
| 基金赎回款 | -18,128,371.64 | 3,200,865.06 | -14,927,506.58 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 28,374,274.45 | -8,731,569.10 | 19,642,705.35 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 290,980.90 |
| 定期存款利息收入 | 4,352,888.87 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 205,326.45 |
| 其他 | 3,826.74 |
| 合计 | 4,853,022.96 |

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 |
|------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 20,670,482.60 |
| 减：卖出股票成本总额 | 10,488,403.20 |
| 买卖股票差价收入 | 10,182,079.40 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30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 | 5,152,785.64 |

| | |
|----------------|--------------|
| 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 | 5,152,785.64 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,418,876,867.36 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,379,556,408.89 |
| 减：应收利息总额 | 34,167,672.83 |
| 买卖债券差价收入 | 5,152,785.64 |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 748,537.26 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 748,537.26 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -11,331,852.64 |
| ——股票投资 | -1,948,833.57 |
| ——债券投资 | -9,383,019.07 |
| ——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 | -11,331,852.64 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|--------------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 404,708.00 |
| 转换费收入 519675 | 63.70 |
| 合计 | 404,771.70 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 51,033.47 |
| 银行间市场交易费用 | 1,590.00 |
| 合计 | 52,623.47 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 审计费用 | 44,753.80 |
| 信息披露费 | 49,726.04 |
| 上清所数字证书服务费 | 200.00 |
| 其他 | 50.00 |
| 资金汇划费 | 6,872.15 |
| 帐户维护费 | 12,000.00 |
| 合计 | 113,601.99 |

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

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的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

本基金本报告期内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 |
|--------------|----------------------|
| 银河基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 北京银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构 |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 |
| 银河证券 | 29,476,810.45 | 100.00% | 1,448,853,222.52 | 100.00% |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 银河证券 | 696,433,761.26 | 100.00% | 80,501,716.77 | 100.00% |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 |
| 银河证券 | 18,719,500,000.00 | 100.00% | 22,733,000,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 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。

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 2016年1月1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 |
| 银河证券 | 27,014.67 | 100.00% | 3,226.08 | 100.00% |

| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015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 |
| 银河证券 | 1,301,188.06 | 100.00% | 491,376.68 | 100.00% |

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

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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,618,088.81 | 4,134,111.04 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 736,183.93 | 793,145.95 |

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，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,436,348.16 | 689,018.49 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 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 | | |
|----------------|----------------------|------------|------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 银河润利混合 A | 银河润利混合 I | 合计 |
| 银河直销 | - | 255,093.79 | 255,093.79 |
| 合计 | - | 255,093.79 | 255,093.79 |

注:1、本基金于2015年11月19日I类级别开始持有份额,基金分为A级和I级。

2、银河润利混合A级本报告期及上年度可比期间均无销售服务费;银河润利混合I级上年度可比期间无销售服务费。

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:本基金报告期及上一报告期末均未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及上年度可比区间未运用固有资金投资本基金。

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:基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度可比期间未投资本基金。

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 | | 上年度可比期间 | |
|------------|----------------------|------------|----------------------|-----------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 2015年1月1日至2015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 |
| 北京银行股份有限公司 | 18,324,208.19 | 290,980.90 | 6,907,674.39 | 95,649.32 |

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:本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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。

6.4.12 期末（2016 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 |
| 300508 | 维宏股份 | 2016年4月12日 | - | 新股流通受限 | 20.08 | 254.50 | 10,383 | 208,490.64 | 2,642,473.50 | 新股锁定12个月 |
| 601966 | 玲珑轮胎 | 2016年6月24日 | 2016年7月6日 | 新股流通受限 | 12.98 | 12.98 | 10,300 | 133,694.00 | 133,694.00 | - |
| 603016 | 新宏泰 | 2016年6月23日 | 2016年7月1日 | 新股流通受限 | 8.49 | 8.49 | 1,602 | 13,600.98 | 13,600.98 | - |
| 300520 | 科大国创 | 2016年6月30日 | 2016年7月8日 | 新股流通受限 | 10.05 | 10.05 | 926 | 9,306.30 | 9,306.30 | - |
| 002805 | 丰元股份 | 2016年6月29日 | 2016年7月7日 | 新股流通受限 | 5.80 | 5.80 | 971 | 5,631.80 | 5,631.80 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2016 年 6 月 30 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。

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016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 | 378,324,208.19 | - | - | - | - | - | 378,324,208.19 |
| 结算备付金 | 3,333,333.33 | - | - | - | - | - | 3,333,333.33 |
| 存出保证金 | 174,039.25 | - | - | - | - | - | 174,039.25 |
| 交易性金融资产 | 29,997,000.00 | 60,279,000.00 | 61,651,113.90 | 171,818,170.10 | 200,329,063.20 | 28,063,409.07 | 552,137,756.27 |
| 买入返售金融资产 | 500,000,000.00 | - | - | - | - | - | 500,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 401,085.09 | 401,085.09 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 16,186,053.74 | 16,186,053.74 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 7,064.38 | 7,064.38 |
| 资产总计 | 911,828,580.77 | 60,279,000.00 | 61,651,113.90 | 171,818,170.10 | 200,329,063.20 | 44,657,612.28 | 1,450,563,540.25 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 218,328.12 | 218,328.12 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,421,304.50 | 1,421,304.50 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 236,884.08 | 236,884.08 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 42,623.20 | 42,623.20 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 9,895.60 | 9,895.60 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 97,215.91 | 97,215.91 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 2,026,251.41 | 2,026,251.41 |
| 利率敏感度缺口 | 911,828,580.77 | 60,279,000.00 | 61,651,113.90 | 171,818,170.10 | 200,329,063.20 | 42,631,360.87 | 1,448,537,288.84 |
| 上年度末 | 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 |

| | | | | | | | |
|------------------|----------------|--------------|------------|----------------|----------------|-----------------|------------------|
| 2015 年 12 月 31 日 | | | | | | | |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 2,471,281.88 | - | - | - | - | - | 2,471,281.88 |
| 结算备付金 | 31,569,187.04 | - | - | - | - | - | 31,569,187.04 |
| 存出保证金 | 749,059.82 | - | - | - | - | - | 749,059.82 |
| 交易性金融资产 | 834,242,129.50 | 7,911,200.00 | 652,000.00 | 231,442,540.60 | 254,965,052.10 | 29,620,184.05 | 1,358,833,106.25 |
| 买入返售金融资产 | 120,000,000.00 | - | - | - | - | - | 120,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | -632,714,662.47 | 632,714,662.47 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | -27,492,898.95 | 27,492,898.95 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | -1,703,334.95 | 1,703,334.95 |
| 资产总计 | 989,031,658.24 | 7,911,200.00 | 652,000.00 | 231,442,540.60 | 254,965,052.10 | 691,531,080.42 | 2,175,533,531.36 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | -2,036,182.58 | 2,036,182.58 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | -2,219,505.09 | 2,219,505.09 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | -369,917.51 | 369,917.51 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | -74,143.26 | 74,143.26 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | -219,160.10 | 219,160.10 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | -212,589.37 | 212,589.37 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | -5,131,497.91 | 5,131,497.91 |
| 利率敏感度缺口 | 989,031,658.24 | 7,911,200.00 | 652,000.00 | 231,442,540.60 | 254,965,052.10 | 686,399,582.51 | 2,170,402,033.45 |

6.4.13.4.1.2 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（2016 年 6 月 30 日） | 上年度末（2015 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 2,241,364.86 | 4,297,607.76 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -2,241,364.86 | -4,297,607.76 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 | | 上年度末 2015年12月31日 | |
|--------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 28,063,409.07 | 1.94 | 29,620,184.05 | 1.36 |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 28,063,409.07 | 1.94 | 29,620,184.05 | 1.36 |

6.4.13.4.3.2 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（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 934,720.57 | 1,228,807.36 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -934,720.57 | -1,228,807.36 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1 公允价值

1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

1.2 以公允价值计量的金融工具

1.2.1 各层次金融工具公允价值于 2016 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级的余额为人民币 26,317,334.75 元，属于第二层级的余额为人民币 525,820,421.52 元，属于第三层级余额为人民币 0 元。

1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 26 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层级转入第二层级。

1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 28,063,409.07 | 1.93 |
| | 其中：股票 | 28,063,409.07 | 1.93 |
| 2 | 固定收益投资 | 524,074,347.20 | 36.13 |
| | 其中：债券 | 524,074,347.20 | 36.13 |
| | 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 | 500,000,000.00 | 34.47 |
| | 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 | 381,657,541.52 | 26.31 |
| 7 | 其他各项资产 | 16,768,242.46 | 1.16 |
| 8 | 合计 | 1,450,563,540.25 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 6,875,673.83 | 0.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 743,643.24 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 2,712,965.90 | 0.19 |
| J | 金融业 | 17,711,000.00 | 1.22 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 20,126.10 | 0.00 |
| 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 | 28,063,409.07 | 1.94 |

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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 | 601939 | XD 建设银 | 2,300,000 | 10,925,000.00 | 0.75 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 780,000 | 6,786,000.00 | 0.47 |
| 3 | 002583 | 海能达 | 520,741 | 6,269,721.64 | 0.43 |
| 4 | 300508 | 维宏股份 | 10,383 | 2,642,473.50 | 0.18 |
| 5 | 601611 | 中国核建 | 35,547 | 743,643.24 | 0.05 |
| 6 | 601127 | 小康股份 | 8,662 | 206,761.94 | 0.01 |
| 7 | 601966 | 玲珑轮胎 | 10,300 | 133,694.00 | 0.01 |
| 8 | 603131 | 上海沪工 | 1,263 | 76,664.10 | 0.01 |
| 9 | 300515 | 三德科技 | 1,355 | 63,508.85 | 0.00 |
| 10 | 300518 | 盛讯达 | 1,306 | 61,186.10 | 0.00 |
| 11 | 002799 | 环球印务 | 1,080 | 47,131.20 | 0.00 |
| 12 | 603958 | 哈森股份 | 2,372 | 34,394.00 | 0.00 |
| 13 | 002802 | 洪汇新材 | 1,629 | 24,565.32 | 0.00 |
| 14 | 603909 | 合诚股份 | 1,095 | 20,126.10 | 0.00 |
| 15 | 603016 | 新宏泰 | 1,602 | 13,600.98 | 0.00 |
| 16 | 300520 | 科大国创 | 926 | 9,306.30 | 0.00 |
| 17 | 002805 | 丰元股份 | 971 | 5,631.80 | 0.00 |

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 | 000001 | 平安银行 | 7,285,167.71 | 0.34 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 1,521,160.14 | 0.07 |
| 3 | 300508 | 维宏股份 | 208,490.64 | 0.01 |
| 4 | 002797 | 第一创业 | 169,027.04 | 0.01 |
| 5 | 601966 | 玲珑轮胎 | 133,694.00 | 0.01 |
| 6 | 601611 | 中国核建 | 123,348.09 | 0.01 |
| 7 | 603377 | 东方时尚 | 113,750.40 | 0.01 |
| 8 | 601900 | 南方传媒 | 112,559.06 | 0.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|-----------|------|
| 9 | 002791 | 坚朗五金 | 85,697.61 | 0.00 |
| 10 | 603608 | 天创时尚 | 78,341.20 | 0.00 |
| 11 | 603919 | 金徽酒 | 72,247.76 | 0.00 |
| 12 | 002792 | 通宇通讯 | 70,678.14 | 0.00 |
| 13 | 002788 | 鹭燕医药 | 68,314.95 | 0.00 |
| 14 | 603868 | 飞科电器 | 59,372.79 | 0.00 |
| 15 | 601127 | 小康股份 | 50,326.22 | 0.00 |
| 16 | 002790 | 瑞尔特 | 50,104.76 | 0.00 |
| 17 | 300511 | 雪榕生物 | 48,307.04 | 0.00 |
| 18 | 300512 | 中亚股份 | 39,164.43 | 0.00 |
| 19 | 603861 | 白云电器 | 34,476.00 | 0.00 |
| 20 | 300474 | 景嘉微 | 33,649.88 | 0.00 |

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 | 300244 | 迪安诊断 | 3,134,654.00 | 0.14 |
| 2 | 300049 | 福瑞股份 | 2,655,533.74 | 0.12 |
| 3 | 603508 | 思维列控 | 1,812,626.55 | 0.08 |
| 4 | 300496 | 中科创达 | 1,410,400.00 | 0.06 |
| 5 | 603996 | 中新科技 | 787,768.61 | 0.04 |
| 6 | 300494 | 盛天网络 | 584,115.40 | 0.03 |
| 7 | 002782 | 可立克 | 508,651.52 | 0.02 |
| 8 | 603778 | 乾景园林 | 499,962.80 | 0.02 |
| 9 | 002786 | 银宝山新 | 495,752.40 | 0.02 |
| 10 | 300493 | 润欣科技 | 479,640.16 | 0.02 |
| 11 | 603299 | 井神股份 | 422,982.00 | 0.02 |
| 12 | 002787 | 华源包装 | 421,362.99 | 0.02 |
| 13 | 300497 | 富祥股份 | 416,820.81 | 0.02 |
| 14 | 002797 | 第一创业 | 391,078.10 | 0.02 |
| 15 | 002780 | 三夫户外 | 380,980.00 | 0.02 |
| 16 | 601900 | 南方传媒 | 363,016.74 | 0.02 |
| 17 | 603377 | 东方时尚 | 347,562.96 | 0.02 |
| 18 | 002777 | 久远银海 | 346,718.37 | 0.02 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 19 | 300491 | 通合科技 | 332,028.00 | 0.02 |
| 20 | 300474 | 景嘉微 | 319,505.16 | 0.01 |

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 | 10,880,461.79 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 20,670,482.60 |

7.5 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 | 29,997,000.00 | 2.07 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 60,873,000.00 | 4.20 |
| | 其中：政策性金融债 | 60,873,000.00 | 4.20 |
| 4 | 企业债券 | 371,123,071.70 | 25.62 |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,279,000.00 | 4.16 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,802,275.50 | 0.12 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 524,074,347.20 | 36.18 |

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

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 | 124952 | 14 马高新 | 500,000 | 52,645,000.00 | 3.63 |
| 2 | 124050 | PR 榆城投 | 520,000 | 40,367,600.00 | 2.79 |
| 3 | 124978 | 14 新密债 | 300,000 | 31,824,000.00 | 2.20 |
| 4 | 124943 | 14 兰国投 | 300,000 | 31,485,000.00 | 2.17 |
| 5 | 140208 | 14 国开 08 | 300,000 | 30,588,000.00 | 2.11 |

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投资。

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投资。

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：报告期内本基金未参与股指期货的投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内本基金未参与股指期货的投资。

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**

报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

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：报告期内本基金未参与国债期货的投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内本基金未参与国债期货的投资。

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 | 174,039.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | 401,085.09 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 16,186,053.74 |
| 5 | 应收申购款 | 7,064.38 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 16,768,242.46 |

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 | 300508 | 维宏股份 | 2,642,473.50 | 0.18 | 新股锁定 12 个月 |
| 2 | 601611 | 中国核建 | 743,643.24 | 0.05 | 临时停牌 |
| 3 | 601966 | 玲珑轮胎 | 133,694.00 | 0.01 | 新股锁定 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

| 份额级别 | 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 |
| 银河润利混合 A | 4,789 | 59,343.11 | 114,034,497.41 | 40.13% | 170,159,664.56 | 59.87% |
| 银 | 2 | 511,984,837.57 | 1,023,969,675.13 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |

| | | | | | | |
|----------------------------|-------|------------|------------------|--------|----------------|--------|
| 河 润 利 混 合 I | | | | | | |
| 合 计 | 4,791 | 273,046.09 | 1,138,004,172.54 | 86.99% | 170,159,664.56 | 13.01% |

8.2 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 | 银河润利混合 A | 0.00 | 0.0000% |
| | 银河润利混合 I | 0.00 | 0.0000% |
| | 合计 | 0.00 | 0.0000% |

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 | 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 | 银河润利混合 A | 0 |
| | 银河润利混合 I | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 银河润利混合 A | 0 |
| | 银河润利混合 I | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 银河润利混合 A | 银河润利混合 I |
|-------------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日（2014 年 8 月 6 日）基金份额总额 | 812,268,889.51 | - |
| 本报告期初基金份额总额 | 302,873,357.78 | 1,732,321,777.16 |
| 本报告期基金总申购份额 | 20,345,229.65 | 994,059,405.94 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 39,024,425.46 | 1,702,411,507.97 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” | - | - |

| | | |
|-------------|----------------|------------------|
| 填列) | | |
| 本报告期末基金份额总额 | 284,194,161.97 | 1,023,969,675.13 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

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

2、2016年3月11日在法定报刊上刊登了《银河康乐股票型证券投资基金变更基金经理的公告》，张杨不再担任本基金的基金经理。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无涉基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 银河证券 | 2 | 29,476,810.45 | 100.00% | 27,014.67 | 100.00% | - |

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 |
| 银河证券 | 696,433,761.26 | 100.00% | 18,719,500,000.00 | 100.00% | - | - |

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发生指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016年1月5日 |
| 2 | 银河基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016年1月6日 |
| 3 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰科技服务（深圳）前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 | 2016年1月8日 |
| 4 | 银河基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016年1月8日 |
| 5 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016年1月9日 |
| 6 | 银河基金管理有限公司关于 | 《中国证券报》、《证 | 2016年1月12日 |

| | | | |
|----|---|------------------------------------|-----------------|
| | 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 | 券时报》、《上海证券报》、公司网站 | |
| 7 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 1 月 14 日 |
| 8 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 1 月 15 日 |
| 9 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2016 年 1 月 18 日 |
| 10 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 1 月 19 日 |
| 11 | 银河润利保本混合型证券投资基金 2015 年 4 季报 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2016 年 1 月 22 日 |
| 12 | 关于调整旗下基金对账单服务形式的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 1 月 23 日 |
| 13 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 1 月 29 日 |
| 14 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 2 月 2 日 |
| 15 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 2 月 6 日 |
| 16 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 2 月 16 日 |
| 17 | 银河基金管理有限公司关于总经理任职的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券 | 2016 年 2 月 19 日 |

| | | | |
|----|---|------------------------------------|-----------------|
| | | 报》、公司网站 | |
| 18 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票估值调整的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 2 月 23 日 |
| 19 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国银河证券股份有限公司开通定投业务并参加基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 2 月 26 日 |
| 20 | 银河润利保本混合型证券投资基金恢复(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 | 2016 年 3 月 7 日 |
| 21 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金开通直销平台基金转换的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 3 月 7 日 |
| 22 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 3 月 10 日 |
| 23 | 银河基金管理有限公司关于银河润利保本混合型证券投资基金变更基金经理的公告 | 《证券时报》、公司网站 | 2016 年 3 月 11 日 |
| 24 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 3 月 11 日 |
| 25 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2016 年 3 月 18 日 |
| 26 | 银河润利保本混合型证券投资基金招募说明书(更新摘要) | 《中国证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2016 年 3 月 21 日 |
| 27 | 银河润利保本混合型证券投资基金 2015 年年度报告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2016 年 3 月 25 日 |
| 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 | 2016 年 3 月 29 日 |
| 29 | 银河基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金最 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券 | 2016 年 4 月 8 日 |

| | | | |
|----|--|--|-----------------|
| | 低认、申购金额的公告 | 报》、《证券日报》、 公司网站 | |
| 30 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为代销机构并转换业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站 | 2016 年 4 月 11 日 |
| 31 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站 | 2016 年 4 月 13 日 |
| 32 | 银河润利保本混合型证券投资基金 2016 年 1 季报 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站 | 2016 年 4 月 21 日 |
| 33 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站 | 2016 年 4 月 22 日 |
| 34 | 银河基金管理有限公司关于银河润利保本混合型证券投资基金变更基金经理的公告 | 《证券时报》、 公司网站 | 2016 年 4 月 26 日 |
| 35 | 银河基金管理有限公司关于网上交易系统关闭支付宝基金支付业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站 | 2016 年 5 月 5 日 |
| 36 | 银河基金管理有限公司关于淘宝店关闭基金申购业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站 | 2016 年 5 月 5 日 |
| 37 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站 | 2016 年 5 月 14 日 |
| 38 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站 | 2016 年 5 月 17 日 |
| 39 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金开通直销平台基金转换的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站 | 2016 年 5 月 18 日 |
| 40 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金开通直销平台基金转换的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站 | 2016 年 5 月 18 日 |
| 41 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券 | 2016 年 5 月 18 日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------------|-----------------|
| | 停牌变更估值方法的提示性公告 | 报》、公司网站 | |
| 42 | 银河基金管理有限公司关于网上交易开通基金赎回极速回倍利宝业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2016 年 5 月 30 日 |
| 43 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 6 月 22 日 |
| 44 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2016 年 6 月 30 日 |
| 45 | 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》、公司网站 | 2016 年 6 月 30 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河润利保本混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河润利保本混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河润利保本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、银河润利保本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

上海市世纪大道 1568 号中建大厦 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
2016 年 8 月 25 日