

# 银河泽利保本混合型证券投资基金 2016 年 年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	21
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.....	22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	23
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	24
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	24
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	25
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.....	25
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>25</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	25
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.....	25
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.....	25
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>26</b>
6.1 审计报告基本信息.....	26
6.2 审计报告的基本内容.....	26
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>27</b>
7.1 资产负债表.....	27
7.2 利润表.....	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29
7.4 报表附注.....	30
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>59</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	63

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 .....	63
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 .....	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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 .....	65
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>66</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>66</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
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 .....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>76</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河泽利保本混合型证券投资基金
基金简称	银河泽利保本混合
场内简称	-
基金主代码	519654
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4月9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	2,282,251,835.46份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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。
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。

### 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	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区金融大街甲 17 号 首层
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区金融大街丙 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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.galaxyasset.com">http://www.galaxyasset.com</a>
基金年度报告备置地点	1. 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号 中国保险大厦
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司	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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 4 月 9 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	78,953,763.90	-52,896,907.26	-
本期利润	43,031,599.35	-34,228,488.70	-
加权平均基金份额本期利润	0.0172	-0.0119	-
本期加权平均净值利润率	1.72%	-1.21%	-
本期基金份额净值增长率	1.72%	-1.00%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	16,099,136.03	-45,271,005.43	-

期末可供分配基金份额利润	0.0071	-0.0167	-
期末基金资产净值	2,298,350,971.49	2,682,312,742.39	-
期末基金份额净值	1.007	0.990	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	0.70%	-1.00%	-

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

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

## 3.2 基金净值表现

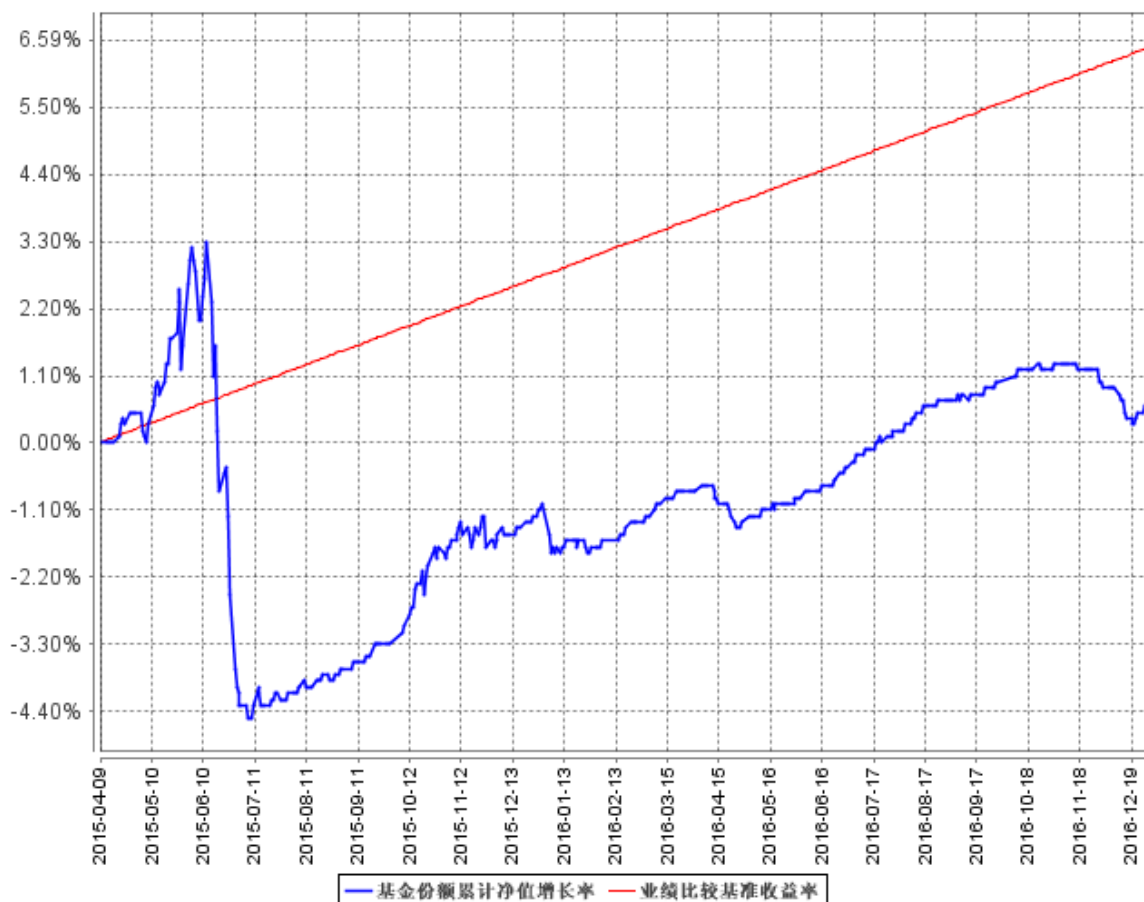
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.30%	0.06%	0.94%	0.01%	-1.24%	0.05%
过去六个月	1.10%	0.06%	1.89%	0.01%	-0.79%	0.05%
过去一年	1.72%	0.07%	3.75%	0.01%	-2.03%	0.06%
自基金合同生效起至今	0.70%	0.20%	6.49%	0.01%	-5.79%	0.19%

注：业绩比较基准为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

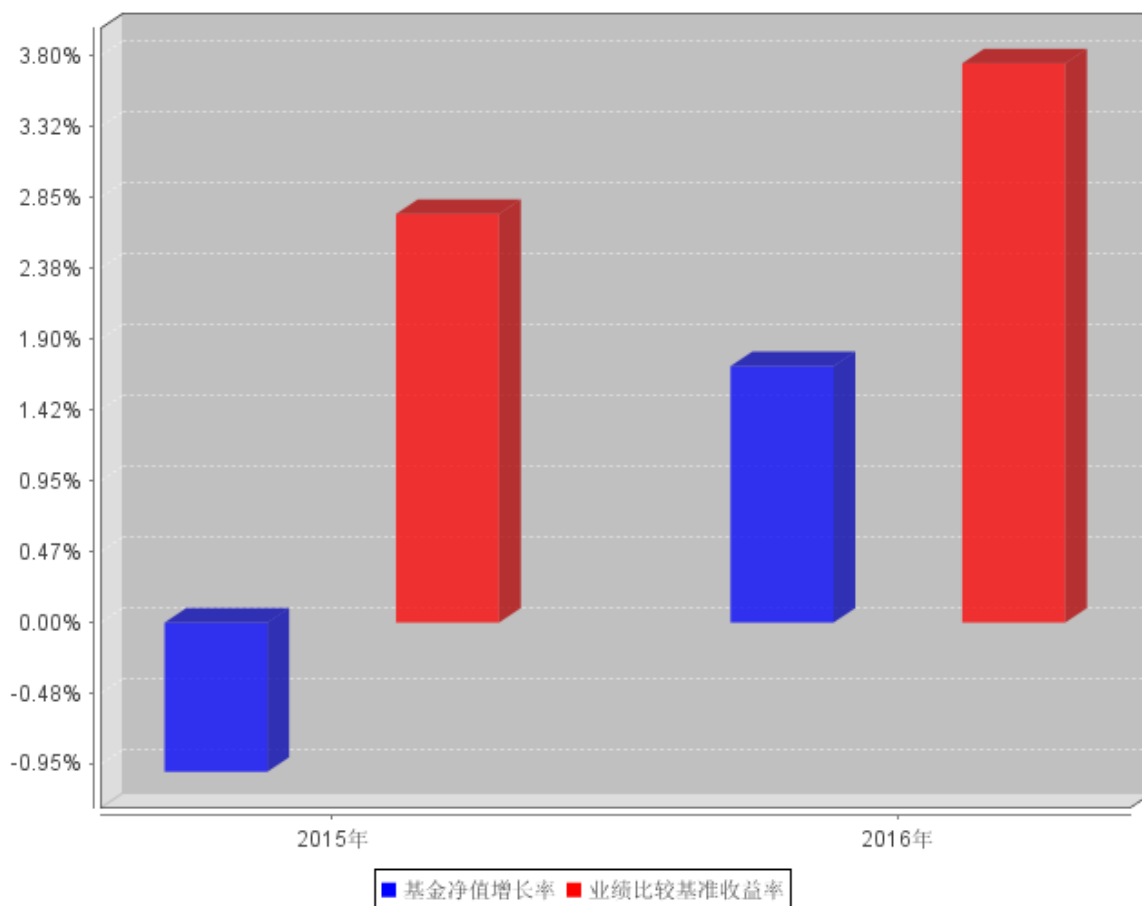
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金合同于 2015 年 4 月 9 日生效。

2、本项目按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，截至本报告期，银河基金管理有限公司管理 1 只封闭式与 33 只开放式证券投资基金，基本情况如下：

### 1、银丰证券投资基金

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2002 年 08 月 15 日

基金投资目标：为平衡型基金, 力求有机融合稳健型和进取型两种投资风格, 在控制风险的前提下追求基金资产的长期稳定增值。

### 2、银河银联系列证券投资基金

本系列基金为契约型开放式基金, 由两只基金构成, 包括银河稳健证券投资基金和银河收益证券投资基金, 每只基金彼此独立运作, 并通过基金间相互转换构成一个统一的基金体系。

基金合同生效日：2003 年 8 月 4 日

#### (1) 银河稳健证券投资基金

基金投资目标：以稳健的投资风格, 构造资本增值与收益水平适度匹配的投资组合, 在控制风险的前提下, 追求基金资产的长期稳定增值。

#### (2) 银河收益证券投资基金

基金投资目标：以债券投资为主, 兼顾股票投资, 在充分控制风险和保持较高流动性的前提下, 实现基金资产的安全及长期稳定增值。

### 3、银河银泰理财分红证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 3 月 30 日

基金投资目标：追求资产的安全性和流动性, 为投资者创造长期稳定的投资回报

### 4、银河银富货币市场基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 12 月 20 日

基金投资目标：在确保基金资产安全和高流动性的基础上, 追求高于业绩比较基准的回报。

### 5、银河银信添利债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007 年 3 月 14 日

基金投资目标：在满足本金稳妥与良好流动性的前提下, 追求基金资产的长期稳健增值。

### 6、银河竞争优势成长混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2008 年 5 月 26 日

基金投资目标：在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中长期资本增值。

#### 7、银河行业优选混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009 年 4 月 24 日

基金投资目标：本基金将“自上而下”的资产配置以及动态行业配置策略与“自下而上”的个股优选策略相结合，优选景气行业或预期景气行业中的优势企业进行投资，在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中长期资本增值。

#### 8、银河沪深 300 价值指数证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009 年 12 月 28 日

基金投资目标：通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段，追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。

#### 9、银河蓝筹精选混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010 年 7 月 16 日

基金投资目标：本基金投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司，在有效控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果。

#### 10、银河创新成长混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010 年 12 月 29 日

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

#### 11、银河强化收益债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011 年 5 月 31 日

基金投资目标：本基金主要投资于固定收益类品种，在控制风险，保持资产良好流动性的前提下，追求一定的当期收入和基金资产的长期稳健增值。

#### 12、银河消费驱动混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011 年 7 月 29 日

基金投资目标：本基金通过深入研究，重点投资与居民消费密切相关的行业中具有竞争优势的上市公司，分享由于中国巨大的人口基数、收入增长和消费结构变革所带来的投资机会，在严格控制风险的前提下，追求基金资产长期稳定增值。

13、银河通利债券型证券投资基金（LOF）

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012 年 4 月 25 日

基金投资目标：在合理控制风险的前提下，力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

14、银河主题策略混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012 年 9 月 21 日

基金投资目标：本基金在严格控制风险的前提下，采用主题投资策略和精选个股策略的方法进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。

15、银河领先债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012 年 11 月 29 日

基金投资目标：在合理控制风险的前提下，力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

16、银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013 年 3 月 29 日

基金投资目标：本基金为增强型股票指数基金，力求对沪深 300 成长指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

17、银河增利债券型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013 年 7 月 17 日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的具有投资

价值的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

#### 18、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式(本基金以定期开放的方式运作, 运作周期和自由开放期相结合, 以 1 年为一个运作周期, 每个运作周期共包含为 4 个封闭期和 3 个受限开放期)。

基金合同生效日：2013 年 8 月 9 日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，通过严谨的风险管理与主动管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

#### 19、银河灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 2 月 11 日

基金投资目标：本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，在确保超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值的前提下，力求获取超额收益。

#### 20、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 3 月 14 日

基金投资目标：本基金为股票型指数基金，力求对中证腾讯济安价值 100A 股指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离和跟踪误差的前提下追求跟踪误差的最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

#### 21、银河美丽优萃混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014-05-29

基金投资目标：本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的美丽主题相关股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 22、银河润利保本混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014-08-06

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略，并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

### 23、银河康乐股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014-11-18

基金投资目标：本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的健康快乐主题相关的股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 24、银河泽利保本混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-04-09

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略（优化的 CPPI 策略），并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

### 25、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-04-22

基金投资目标：本基金将充分把握中国经济可持续发展过程中现代服务主题相关行业及子行业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中现代服务主题相关行业及子行业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

### 26、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-04-22

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

### 27、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-05-12

基金投资目标：本基金将充分把握我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济战略布局过程中呈现的转型增长主题投资机会，充分利用我公司的研究投资优势，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的红利，在严格控制投资风险的条件

件下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

#### 28、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-06-19

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

#### 29、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年12月17日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，追求实现基金资产持续稳定增值的前提下，力求获取超额收益。

#### 30、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年3月11日

基金投资目标：在实现《中国制造 2025》规划的工业未来发展纲领和顶层设计目标的过程中，本基金将充分把握大国智造主题涵盖领域中相关行业和企业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享大国智造主题涵盖领域中相关行业及子行业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

#### 31、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年5月13日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

#### 32、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年8月17日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活

的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

### 33、银河君信灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016 年 9 月 7 日

基金投资目标：本基金在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产的持续稳定增值。

### 34、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016 年 9 月 5 日

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩晶	银河泽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	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、投资管理等工作。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，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



	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的基金经理、银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君怡纯债券型证券投资基金的基金经理、银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河				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 月起担任银河润利、银河泽利保本混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 5 月起担任银河旺利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 9 月起担任银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 11 月起担任银河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月起担任银河君怡纯债券型证券投资基金的基金经理、银河君盛、银河君润、银河睿利灵活配置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。
--	---	--	--	--	--

	君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、固定收益部负责人				
祝建辉	银河泽利保本混合型证券投资基金的基金经理、银河竞争优势成长混合型证券投资基金的基金经理、银河灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河润利保本混合型	2016 年 3 月 10 日	-	10	硕士研究生学历，曾就职于天治基金管理有限公司。2008 年 4 月加入银河基金管理有限公司，主要研究钢铁、煤炭、化工行业，历任研究员、高级研究员、研究部总监助理、银河稳健证券投资基金的基金经理助理、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、银河灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；2015 年 12 月起担任银河灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 2 月起担任银河竞争优势

	证券投资基金的基金经理				成长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 11 月起担任银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理。
孙伟仓	银河泽利保本债券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、银河增利债券型发起式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基金的基金经理、银河润利保本债券型证券投资基金的基金经理	2015 年 4 月 9 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 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；2014 年 8 月至 2016 年 3 月担任银河润利保本债券型证券投资基金的基金经理。
索峰	银河泽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	2015 年 4 月 9 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

	(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、银河润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			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；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；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；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。
--	---	--	--	--

注：1. 上表中索峰和孙伟仓的任职日期为该基金基金合同生效之日、离职日期为我公司做出决定之日；韩晶和祝建辉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

基金管理人对 2016 年债券市场和权益市场均持谨慎乐观的看法。我们判断报告期内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、降准可能性较小。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，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、股市及债券供给等因素的影响，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。

基于以上的判断，基金管理人在债券投资策略方面主要以降久期为主，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。权益市场则在控制仓位的前提下，以价值股为主要配置品种，参与波段操作。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，债券市场受益于银行理财迅猛发展，导致资金异常宽裕，可配资产相对缺失，各类债券品种在前三个季度当中收益率水平整体表现出超预期的下行，信用利差创造了历史新低，期限利差也处于相对较低的水平。期间四月份受几起信用事件发酵影响，信用品种曾出现过一定幅度的快速回调，后续随着对信用风险担忧的缓解，收益率再创新低。四季度，为落实中央经济工作会议对“抑制资产泡沫、防范金融风险”的要求，央行货币政策明显转向，通过公开市场操作“锁短放长”提高了银行间资金成本。同业理财受窗口指导，同业资金来源受限，银行理财资金出现缺口压力，银行委外资金集中赎回货币基金，资金面的紧绷导致债券市场出现了罕见的大幅调整。年底，债券急速调整导致“国海事件”发生，进一步加剧了流动性的危机。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，以结构性行情为主，上证综指表现明显强于中小板及创业板指表现。上半年食品饮料、新能源汽车产业链，下半年周期类股票表现出一定的上涨持续性，其余板块热点切换较快，把握行情的难度较大。

银河泽利保本基金规模较为平稳，基金上半年基本保持原有债券组合的配置，组合以城投品种为主，未加杠杆。下半年基金开始着手调整组合的久期，积极变现中长期的信用品种，转而配置以定存、同业存单、逆回购等短期现金类资产，较好回避了四季度债券市场的大调整。基金在股票投资方面主要配置了食品饮料、医药、家电等行业龙头股票，大多取得了不错的涨幅，但受安全垫较低的影响，股票仓位水平极低，对基金业绩整体贡献非常有限。基金因打新门槛的不断提高，为控制风险，管理人有选择性地参与不同市场的新股网下申购。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年银河泽利保本证券投资基金净值增长 1.72%，同期比较基准为 3.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于宏观经济基本面基金管理人判断工业价格回暖，企业补库存动力仍在，前期地方政府债务置换的平稳推进、财政发力、PPP 项目加快落地等措施短期内仍将稳定基建投资的增速。海外发达经济体从 PMI 指数来看都有回暖的迹象，亚洲各经济主体出口均有持续回暖的迹象，国内出口明年也有望对经济增长产生一定的贡献。经济企稳具备一定的惯性，但可持续性值得进一步观察。受制于地产调控和去年房地产相对较好的表现，房地产投资增速大概率下滑，对经济形成一定的负面影响。前期 PPI 的持续回升已超市场预期，后期在缺失需求面支撑的情形下，增速有望出现明显放缓。CPI 短期将会受原油价格的影响上行，但上行压力可控。原油价格受 OPEC 减产和川普扩张性财政政策预期影响，短期将表现强势，能否持续走高，仍然要看减产的执行效果和川普上台的执行力。人民币汇率中长期仍有贬值压力，短期或将受益于川普诉求，在其新政对美国产生明确的积极影响之前，美元可能保持弱势震荡。货币政策在“去杠杆、防风险”的主基调下，将会回归实质性稳健。在提高资金的成本的前提下，维持流动性稳定应该成为央行的政策首选。在成功抑制银行表外资产扩张之前，债券市场仍然面临较大的不确定性，前期调整中难以出清的低评级信用品种或将仍然要面对去杠杆的压力，加上相关企业融资困难的负反馈，信用风险不可忽视。“金融去杠杆”将驱使银行资金“脱虚向实”，但在银行年初表内信贷集中释放后，因需求的问题或仍将面对“缺资产”的尴尬。因此我们判断在流动性紧张局面回归正常后，银行所主导的债券配置需求仍将有利于利率债和高评级的信用债的表现。

从流动性相对收紧、无风险收益上行的角度来讲，权益市场仍然难有大的趋势性表现机会。市场所预期的工业价格指数回暖推动的企业盈利水平回升，短期内支撑周期类股票的表现，中期则还有来自行业需求面的持续支持及融资成本上移等不确定因素的干扰。股票供给节奏的加快变

相实现了“注册制”，目前已对次新股市场炒作产生了明显抑制作用，我们判断这也会对靠外延并购提估值的投资逻辑产生影响。新股申购仍然能带来较为可观的收益，但随着申购门槛的提高，如何控制股票仓位的风险将是面临的主要难题。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**

1、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。

2、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，本基金收益每年最多分配 12 次，每次收益分配比例不低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”。

3、本《基金合同》生效日为 2015 年 4 月 09 日

4、截止 2016 年 12 月 31 号，本基金可供分配利润 16,099,136.03 元，本期未进行利润分配。

#### **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**

注：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**

在本报告期内，本基金托管人在托管银河泽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、托管协议等有关规定，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**

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60821717_B25 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	银河泽利保本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泽利保本混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银河基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银河泽利保本混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	郭杭翔	薛晓礼
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼	

审计报告日期	2017 年 3 月 27 日
--------	-----------------

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银河泽利保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	170,304,294.39	3,594,739.41
结算备付金		1,972,733.43	17,511,529.93
存出保证金		73,994.26	1,441,056.49
交易性金融资产	7.4.7.2	2,084,835,996.12	2,400,437,834.10
其中：股票投资		63,424,421.42	149,591,496.90
基金投资		-	-
债券投资		2,021,411,574.70	2,250,846,337.20
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	-	-
应收证券清算款		151,522.07	200,040,126.69
应收利息	7.4.7.5	46,546,173.14	63,510,733.02
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,226,414.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,303,884,713.41	2,687,762,434.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,800,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		419,909.23	1,288,203.03
应付管理人报酬		2,352,337.46	2,747,712.30
应付托管费		392,056.24	457,952.05

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	164,595.10	686,109.40
应交税费		-	-
应付利息		48.00	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	404,795.89	269,715.40
负债合计		5,533,741.92	5,449,692.18
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,282,251,835.46	2,709,813,569.63
未分配利润	7.4.7.10	16,099,136.03	-27,500,827.24
所有者权益合计		2,298,350,971.49	2,682,312,742.39
负债和所有者权益总计		2,303,884,713.41	2,687,762,434.57

注：1，报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.007 元，基金份额总额 2282251835.46 份，

2，本基金合同于 2015 年 4 月 9 日生效，上年度可比期间为 2015 年 4 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：银河泽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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 9 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		79,542,129.38	-525,458.77
1. 利息收入		131,346,061.50	73,161,504.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,441,589.17	1,690,868.04
债券利息收入		125,361,820.67	58,164,838.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,542,651.66	13,305,797.88
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-17,618,861.05	-95,240,817.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,288,715.78	-98,901,032.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-16,815,767.58	2,324,390.55
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	485,622.31	1,335,824.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-35,922,164.55	18,668,418.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,737,093.48	2,885,435.20
<b>减：二、费用</b>		36,510,530.03	33,703,029.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	30,023,516.82	24,622,574.90
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,003,919.45	4,103,762.39
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	706,387.28	4,278,670.37
5. 利息支出		334,208.85	354,609.84
其中：卖出回购金融资产支出		334,208.85	354,609.84
6. 其他费用	7.4.7.20	442,497.63	343,412.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		43,031,599.35	-34,228,488.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		43,031,599.35	-34,228,488.70

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河泽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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,709,813,569.63	-27,500,827.24	2,682,312,742.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,031,599.35	43,031,599.35
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）	-427,561,734.17	568,363.92	-426,993,370.25
其中：1. 基金申购款	3,542,779.91	-29,402.95	3,513,376.96
2. 基金赎回款	-431,104,514.08	597,766.87	-430,506,747.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-	-



除认购费后的实收基金（本金）为人民币 2,987,652,767.94 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 801,757.18 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,988,454,525.12 元，折合 2,988,454,525.12 份基金份额。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的保本周期为二年。本基金第一个保本周期自本基金基金合同生效日起至二个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日或无该对应日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金继续存续；否则，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将按照基金合同的规定终止。

在第一个保本周期内，本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）；第一个保本周期之后的各保本周期，保本金额指在过渡期的限定期限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）之和，按照基金合同其他约定不适用保本条款的基金份额除外。

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其持有到期的基金份额在当期保本周期内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。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保本条款。

本基金第一个保本周期由中国投融资担保有限公司作为担保人，为基金管理人的保本义务提供不可撤销的连带责任保证。本基金第一个保本周期的保证范围为：在保本周期到期日，基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于认购保本金额的差额部分。担保人保证期间为本基金第一个保本周期到期日起六个月。担保人承担保证责任的最高限额不超过按基金合同生效之日确认的基金份额所计算的认购保本金额。

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。

本基金的基金资产包括固定收益类资产和风险资产，固定收益类资产为国内依法发行交易的债券、国债期货和定期存款等，其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、可转换债券等。

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。

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 30%；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 70%，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采用：三年期银行定期存款税后收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年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。

##### 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

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

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

#### (2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

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

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

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

(8) 股指/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%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

##### 1. 保本周期内的收益分配

(1) 仅采取现金分红一种收益分配方式,不进行红利再投资;

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。在保本周期内,当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,由基金管理人承担该项费用;

##### 2. 转型为非保本的债券型基金后的收益分配

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,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 10%;

(2) 基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4. 每一基金份额享有同等的收益分配权；

5. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

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

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

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

#### 7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	304,294.39	3,594,739.41
定期存款	170,000,000.00	-
其中：存款期限 1-3 个月	70,000,000.00	-
存款期限 3 个月-1 年	100,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计：	170,304,294.39	3,594,739.41



## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,635,128.18	63,424,421.42	2,789,293.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	304,730,225.12	300,180,074.70
	银行间市场	1,736,724,388.81	1,721,231,500.00
	合计	2,041,454,613.93	2,021,411,574.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,102,089,742.11	2,084,835,996.12	-17,253,745.99
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	146,687,937.28	149,591,496.90	2,903,559.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	586,980,111.90	584,244,937.20
	银行间市场	1,648,101,366.36	1,666,601,400.00
	合计	2,235,081,478.26	2,250,846,337.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,381,769,415.54	2,400,437,834.10	18,668,418.56

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	345.62	29,168.65
应收定期存款利息	606,250.16	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	976.47	8,668.11
应收债券利息	45,938,564.26	63,472,182.91
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	36.63	713.35
合计	46,546,173.14	63,510,733.02

**7.4.7.6 其他资产**

注：无。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	160,438.57	685,944.40
银行间市场应付交易费用	4,156.53	165.00
合计	164,595.10	686,109.40

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,795.89	19,715.40
预提审计费用	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	300,000.00	150,000.00
合计	404,795.89	269,715.40

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,709,813,569.63	2,709,813,569.63
本期申购	3,542,779.91	3,542,779.91
本期赎回(以“-”号填列)	-431,104,514.08	-431,104,514.08
- 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	2,282,251,835.46	2,282,251,835.46

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-45,271,005.43	17,770,178.19	-27,500,827.24
本期利润	78,953,763.90	-35,922,164.55	43,031,599.35
本期基金份额交易产生的变动数	1,745,579.20	-1,177,215.28	568,363.92
其中:基金申购款	-51,049.57	21,646.62	-29,402.95
基金赎回款	1,796,628.77	-1,198,861.90	597,766.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,428,337.67	-19,329,201.64	16,099,136.03

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	217,954.16	1,097,455.21
定期存款利息收入	4,081,916.83	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	135,041.20	580,016.87
其他	6,676.98	13,395.96
合计	4,441,589.17	1,690,868.04

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年4月9日(基金合 同生效日)至2015年12月31 日
卖出股票成交总额	262,960,886.37	1,329,013,072.15
减: 卖出股票成本总额	264,249,602.15	1,427,914,104.27
买卖股票差价收入	-1,288,715.78	-98,901,032.12

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年4月9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	-16,815,767.58	2,324,390.55
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	-16,815,767.58	2,324,390.55

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年4月9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	1,051,930,091.25	69,548,160.39
减: 卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成本总额	1,035,705,073.45	67,209,003.86
减: 应收利息总额	33,040,785.38	14,765.98
买卖债券差价收入	-16,815,767.58	2,324,390.55

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

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

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年4月9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	485,622.31	1,335,824.56
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	485,622.31	1,335,824.56

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016	上年度可比期间 2015年4月9日(基金合同
------	----------------------	---------------------------

	年 12 月 31 日	生效日)至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-35,922,164.55	18,668,418.56
——股票投资	-114,266.38	2,903,559.62
——债券投资	-35,807,898.17	15,764,858.94
——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	-35,922,164.55	18,668,418.56

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 9 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,735,692.22	2,863,924.70
转换费收入	1,401.26	438.69
其他	-	21,071.81
合计	1,737,093.48	2,885,435.20

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 9 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	702,354.78	4,269,750.37
银行间市场交易费用	4,032.50	8,920.00
合计	706,387.28	4,278,670.37

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 9 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	230,000.00
上清所数字证书服务	700.00	-

费		
其他	50.00	400.00
资金汇划费	5,747.63	5,512.43
帐户维护费	36,000.00	7,500.00
合计	442,497.63	343,412.43

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国投融资担保有限公司	保证人
中国银河证券股份有限公司	同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司	基金管理人的第一大股东
中国石油天然气集团公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海城投（集团）有限公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年4月9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	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
银河证券	434,647,148.50	100.00%	2,894,724,886.85	100.00%

#### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2015年4月9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	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
银河证券	219,783,374.04	100.00%	582,728,004.07	100.00%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年4月9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	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
银河证券	14,107,800,000.00	100.00%	89,428,900,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
银河证券	400,610.04	100.00%	160,438.57	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年4月9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
银河证券	2,624,698.87	100.00%	685,944.40	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。

## 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年4月9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	30,023,516.82	24,622,574.90
其中：支付销售机构的客户维护费	14,773,746.91	12,163,621.45

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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付指令，经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，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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年4月9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	5,003,919.45	4,103,762.39

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令经基金托管

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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
北京银行	49,268,067.03	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015 年 4 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

#### 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未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 9 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	期末余额	当期利息收入
北京银行	304,294.39	824,204.32	3,594,739.41	1,097,455.21

#### 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末进行利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300508	维宏股份	2016年4月12日	2017年4月19日	新股流通受限	20.08	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-
603660	苏州科达	2016年11月21日	2017年12月1日	新股流通受限	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	-
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

注：本基金持有的股票“苏州科达”和“维宏股份”为网下申购新股中签，中签部分为认购网下

老股东的转让部分，自愿设定 12 个月锁定期，锁定期自本次公开发行的股票在上交所上市交易之日起开始计算。

#### **7.4.12.2 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。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 1,800,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### **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 2016 年 12	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
---------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

月 31 日							
资产							
银行存款	304,294.39	170,000,000.00	-	-	-	-	170,304,294.39
结算备付金	1,972,733.43	-	-	-	-	-	1,972,733.43
存出保证金	73,994.26	-	-	-	-	-	73,994.26
交易性金融资产	49,840,000.00	571,721,000.00	760,824,539.30	639,026,035.40	-	63,424,421.42	2,084,835,996.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	151,522.07	151,522.07
应收利息	-	-	-	-	-	46,546,173.14	46,546,173.14
资产总计	52,191,022.08	741,721,000.00	760,824,539.30	639,026,035.40	-	110,122,116.63	2,303,884,713.41
负债							
卖出回购金融资产款	1,800,000.00	-	-	-	-	-	1,800,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	419,909.23	419,909.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,352,337.46	2,352,337.46
应付托管费	-	-	-	-	-	392,056.24	392,056.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	164,595.10	164,595.10
应付利息	-	-	-	-	-	48.00	48.00

其他 负债	-	-	-	-	-	404,795.89	404,795.89
负债 总计	1,800,000.00	-	-	-	-	3,733,741.92	5,533,741.92
利率 敏感 度缺 口	50,391,022.08	741,721,000.00	760,824,539.30	639,026,035.40	-106,388,374.71	2,298,350,971.49	
上年 度末 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	3,594,739.41	-	-	-	-	-	3,594,739.41
结算 备付 金	17,511,529.93	-	-	-	-	-	17,511,529.93
存出 保证 金	1,441,056.49	-	-	-	-	-	1,441,056.49
交易 性金 融资 产	176,004,598.70	66,642,000.00	275,479,000.00	1,732,720,738.50	-149,591,496.90	2,400,437,834.10	
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	200,040,126.69	200,040,126.69
应收 利息	-	-	-	-	-	63,510,733.02	63,510,733.02
应收 申购 款	-	-	-	-	-	1,226,414.93	1,226,414.93
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	198,551,924.53	66,642,000.00	275,479,000.00	1,732,720,738.50	-414,368,771.54	2,687,762,434.57	
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	1,288,203.03	1,288,203.03

应付管理人报酬	-	-	-	-	2,747,712.30	2,747,712.30
应付托管费	-	-	-	-	457,952.05	457,952.05
应付交易费用	-	-	-	-	686,109.40	686,109.40
其他负债	-	-	-	-	269,715.40	269,715.40
负债总计	-	-	-	-	5,449,692.18	5,449,692.18
利率敏感度缺口	198,551,924.53	66,642,000.00	275,479,000.00	1,732,720,738.50	-408,919,079.36	2,682,312,742.39

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	5,207,301.59	9,468,401.85
	市场利率上升 25 个基点	-5,207,301.59	-9,468,401.85

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以



外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		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	63,424,421.42	2.76	149,591,496.90	5.58
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	63,424,421.42	2.76	149,591,496.90	5.58

#### 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上证 A 股指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定上证 A 股指数变化 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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	上证 A 股指数上升 5%	3,651,271.78	9,257,305.67
	上证 A 股指数下降 5%	-3,651,271.78	-9,257,305.67

#### 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 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 63,386,187.58 元，属于第二层次的余额为人民币 2,021,449,808.54 元，无属于第三层次的余额。

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 137,191,496.90 元，属于第二层次的余额为人民币 2,263,246,337.20 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和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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次从第一层次转入第二层次。

##### 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	63,424,421.42	2.75
	其中：股票	63,424,421.42	2.75
2	固定收益投资	2,021,411,574.70	87.74
	其中：债券	2,021,411,574.70	87.74
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	172,277,027.82	7.48
7	其他各项资产	46,771,689.47	2.03
8	合计	2,303,884,713.41	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	40,221.20	0.00
C	制造业	56,830,248.52	2.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,330,648.80	0.14
E	建筑业	1,855,092.23	0.08
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	1,261,430.67	0.05
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	63,424,421.42	2.76

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	37,000	12,363,550.00	0.54
2	000858	五粮液	249,933	8,617,689.84	0.37
3	002002	鸿达兴业	1,019,954	7,486,462.36	0.33
4	600105	永鼎股份	510,000	5,268,300.00	0.23
5	002519	银河电子	228,700	5,122,880.00	0.22
6	600572	康恩贝	640,000	4,678,400.00	0.20
7	002101	广东鸿图	194,910	4,531,657.50	0.20
8	600452	涪陵电力	79,910	3,330,648.80	0.14
9	000568	泸州老窖	100,000	3,300,000.00	0.14
10	000739	普洛药业	300,000	2,259,000.00	0.10
11	002310	东方园林	130,000	1,839,500.00	0.08
12	603858	步长制药	15,000	1,429,500.00	0.06
13	300508	维宏股份	10,383	1,261,430.67	0.05
14	603660	苏州科达	26,007	837,945.54	0.04
15	000596	古井贡酒	10,000	455,000.00	0.02
16	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
17	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
18	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00

19	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
20	603033	三维股份	1,160	59,821.20	0.00
21	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
22	002828	贝肯能源	1,042	40,221.20	0.00
23	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
24	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
25	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
26	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
27	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
28	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
29	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
30	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	12,308,089.00	0.46
2	600519	贵州茅台	10,275,415.69	0.38
3	600895	张江高科	10,090,158.61	0.38
4	000858	五粮液	8,572,166.63	0.32
5	002002	鸿达兴业	7,535,559.75	0.28
6	002285	世联行	6,810,000.00	0.25
7	600735	新华锦	6,307,683.00	0.24
8	600105	永鼎股份	5,827,834.00	0.22
9	002519	银河电子	5,260,716.00	0.20
10	002385	大北农	4,979,524.28	0.19
11	002101	广东鸿图	4,768,613.98	0.18
12	600572	康恩贝	4,673,010.00	0.17
13	600884	杉杉股份	4,511,278.00	0.17
14	600816	安信信托	4,398,881.00	0.16
15	002364	中恒电气	3,910,526.00	0.15
16	600767	运盛医疗	3,891,191.00	0.15
17	600521	华海药业	3,713,132.00	0.14
18	600079	人福医药	3,554,716.00	0.13

19	600452	涪陵电力	3,294,384.38	0.12
20	600643	爱建集团	3,282,078.00	0.12

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600521	华海药业	32,838,117.10	1.22
2	000514	渝开发	27,960,687.00	1.04
3	000656	金科股份	14,856,687.00	0.55
4	600279	重庆港九	14,767,360.60	0.55
5	000565	渝三峡 A	12,418,909.50	0.46
6	000001	平安银行	12,269,100.00	0.46
7	600260	凯乐科技	11,930,941.00	0.44
8	600895	张江高科	10,500,380.00	0.39
9	300049	福瑞股份	10,358,653.00	0.39
10	300212	易华录	7,955,774.00	0.30
11	002285	世联行	7,495,819.93	0.28
12	002385	大北农	5,330,818.42	0.20
13	600735	新华锦	4,886,309.36	0.18
14	600816	安信信托	4,503,903.72	0.17
15	600884	杉杉股份	4,135,832.00	0.15
16	600919	江苏银行	3,799,263.18	0.14
17	002364	中恒电气	3,695,167.00	0.14
18	600767	运盛医疗	3,518,248.00	0.13
19	600079	人福医药	3,183,123.66	0.12
20	600643	爱建集团	3,178,001.24	0.12

#### 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	178,196,793.05
卖出股票收入（成交）总额	262,960,886.37

注：本项及 8.4.1、8.4.2 的买入股票成本及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	12,983,100.00	0.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	262,005,000.00	11.40
	其中：政策性金融债	109,890,000.00	4.78
4	企业债券	694,496,543.00	30.22
5	企业短期融资券	120,275,000.00	5.23
6	中期票据	602,721,500.00	26.22
7	可转债（可交换债）	2,288,431.70	0.10
8	同业存单	326,642,000.00	14.21
9	其他	-	-
10	合计	2,021,411,574.70	87.95

**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	1420003	14 三峡银行 债	1,500,000	152,115,000.00	6.62
2	101451055	14 中化工 MTN003	1,500,000	150,600,000.00	6.55
3	160211	16 国开 11	1,000,000	99,830,000.00	4.34
4	111699628	16 常熟农村 商行 CD092	1,000,000	99,040,000.00	4.31
5	111699577	16 泉州银行 CD138	1,000,000	99,030,000.00	4.31

**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：报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

## 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

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。

### 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：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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

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。

## 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	73,994.26
2	应收证券清算款	151,522.07
3	应收股利	-
4	应收利息	46,546,173.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,771,689.47



**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113010	江南转债	627,000.00	0.03

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
11,246	202,938.99	83,398,174.10	3.65%	2,198,853,661.36	96.35%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月9日）基金份额总额	2,988,454,525.12
本报告期期初基金份额总额	2,709,813,569.63
本报告期基金总申购份额	3,542,779.91
减:本报告期基金总赎回份额	431,104,514.08
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,282,251,835.46

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

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

2、2016年3月11日在法定报刊上刊登了《银河泽利保本混合型证券投资基金变更基金经理的公告》，孙伟仓不再担任本基金的基金经理，增聘韩晶、祝健辉担任本基金的基金经理。

3、2016年4月26日在法定报刊上刊登了《银河泽利保本混合型证券投资基金变更基金经理的公告》，解聘索峰担任本基金的基金经理。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

无。

### 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 100,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	434,647,148.50	100.00%	400,610.04	100.00%	-

注：1、专用席位的选择标准和程序

选择证券公司专用席位的标准

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；

(3) 签订协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	219,783,374.04	100.00%	14,107,800,000.00	100.00%	-	-

### 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旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016年1月12日

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	银河泽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》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 2 月 19 日
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
20	银河基金管理有限公司关于银河泽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
21	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 3 月 11 日
22	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
23	银河泽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
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 29 日

25	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
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	2016 年 4 月 13 日
27	银河泽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
28	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
29	银河基金管理有限公司关于银河泽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
30	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
31	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
32	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
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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2016 年 5 月 17 日

	估值方法的提示性公告	报》、公司网站	
34	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 18 日
35	银河泽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》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 5 月 23 日
36	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
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 6 月 22 日
38	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
39	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
40	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 7 月 6 日
41	银河泽利保本混合型证券投资基金 2016 年 2 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 7 月 19 日



42	关于旗下部分基金新增第一创业证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 8 月 4 日
43	关于旗下部分基金在第一创业证券股份有限公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 8 月 4 日
44	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 8 月 12 日
45	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增厦门市鑫鼎盛控股有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 8 月 22 日
46	银河基金管理有限公司关于旗下基金参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 8 月 23 日
47	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金开通浙江同花顺基金销售有限公司的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》、《证券日报》、公司网站	2016 年 8 月 24 日
48	银河泽利保本混合型证券投资基金 2016 年半年报 (2016. 8. 25)	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 8 月 25 日
49	银河基金管理有限公司关于与中国工商银行合作开通基金网上直销业务并实行费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 8 月 29 日

50	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 9 月 20 日
51	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京懒猫金融信息服务有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 9 月 23 日
52	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增武汉市伯嘉基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 9 月 23 日
53	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京广源达信投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 9 月 30 日
54	关于旗下部分基金新增中国民族证券有限责任公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 10 月 25 日
55	银河泽利保本混合型证券投资基金 2016 年 3 季报	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2016 年 10 月 26 日
56	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 11 月 11 日
57	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州科地瑞富基金	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2016 年 11 月 11 日

	销售公司为代销机构及费率优惠的公告	报》、《证券日报》、 公司网站	
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	2016 年 11 月 18 日
59	银河泽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》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 11 月 22 日
60	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 11 月 28 日
61	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 11 月 29 日
62	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 12 月 19 日
63	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2016 年 12 月 19 日
64	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2016 年 12 月 23 日
65	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司个人网上银行和手	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公	2016 年 12 月 30 日

	机银行基金申购费率的公告	司网站	
--	--------------	-----	--

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 楼

### 13.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38568888 /400-820-0860

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司  
2017 年 3 月 31 日