

银河丰利纯债债券型证券投资基金 2017年半年度报告

2017年 6月 30日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2017年 8月 29日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人北京银行股份有限公司（以下简称：北京银行）根据本基金合同规定，于 2017 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

银河泽利保本混合型证券投资基金的保本周期为两年，自银河泽利保本混合型证券投资基金合同生效之日（即 2015 年 4 月 9 日）起至两个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，即 2017 年 4 月 10 日为银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期日。银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期，已根据银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同的规定变更为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变为“519654”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，根据银河泽利基金合同规定，本基金保本周期到期期间为保本周期到期日及其后三个工作日，即本基金的到期期间为（2017 年 4 月 10 日至 4 月 13 日）结束后，即 2017 年 4 月 14 日起，“银河泽利保本混合型证券投资基金”转型为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。银河丰利纯债债券型证券投资基金基金合同及托管协议即日生效。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况（转型后） | 6 |
| 2.1 基金基本情况（转型前） | 6 |
| 2.2 基金产品说明（转型后） | 6 |
| 2.2 基金产品说明（转型前） | 7 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 7 |
| 2.4 信息披露方式 | 8 |
| 2.5 其他相关资料 | 8 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 9 |
| 3.2 基金净值表现（转型后） | 10 |
| 3.2 基金净值表现（转型前） | 11 |
| 3.3 其他指标 | 13 |
| §4 管理人报告 | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 14 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 26 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 27 |
| 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 | 27 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 28 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 29 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 30 |
| 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 | 30 |
| §5 托管人报告 | 31 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 31 |
| 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 | 31 |
| 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 | 31 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后） | 32 |
| 6.1 资产负债表（转型后） | 32 |
| 6.2 利润表 | 33 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 34 |
| 6.4 报表附注 | 35 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前） | 58 |
| 6.1 资产负债表（转型前） | 58 |
| 6.2 利润表 | 59 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 60 |
| 6.4 报表附注 | 61 |
| §7 投资组合报告（转型后） | 86 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 86 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 86 |
| 7.3 报告期内股票投资组合的重大变动 | 87 |

| | | |
|------|-----------------------------------|-----|
| 7.4 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 88 |
| 7.5 | 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 | 88 |
| 7.6 | 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 | 88 |
| 7.7 | 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 | 89 |
| 7.8 | 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 | 89 |
| 7.9 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 89 |
| 7.10 | 投资组合报告附注 | 89 |
| §7 | 投资组合报告（转型前） | 91 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 91 |
| 7.2 | 期末按行业分类的股票投资组合 | 91 |
| 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 | 92 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 | 92 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 94 |
| 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 | 94 |
| 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 | 95 |
| 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 | 95 |
| 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 | 95 |
| 7.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 95 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 95 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 | 96 |
| §8 | 基金份额持有人信息（转型后） | 98 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 98 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 98 |
| 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 | 98 |
| §8 | 基金份额持有人信息（转型前） | 99 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 99 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 99 |
| 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 | 99 |
| § 9 | 开放式基金份额变动(转型后) | 100 |
| § 9 | 开放式基金份额变动(转型前) | 101 |
| §10 | 重大事件揭示 | 102 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 102 |
| 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 | 102 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 102 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 102 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 102 |
| 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 | 102 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） | 102 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） | 103 |
| 10.9 | 其他重大事件（转型后） | 104 |
| 10.9 | 其他重大事件（转型前） | 107 |
| §11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 110 |
| 11.1 | 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 | 110 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 110 |
| §12 | 备查文件目录 | 111 |

| | |
|------------------|-----|
| 12.1 备查文件目录..... | 111 |
| 12.2 存放地点..... | 111 |
| 12.3 查阅方式..... | 111 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

| | |
|--------------|-----------------|
| 基金名称 | 银河丰利纯债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 银河丰利债券 |
| 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 | 2017年 4月 14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 | 223,297,066.60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 | - |

注：上表中“报告期末”指 2017年 6月 30日。

2.1 基金基本情况（转型前）

| | |
|--------------|-----------------|
| 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 | 332,392,064.70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 | - |

注：上表中“报告期末”指 2017年 4月 13日。

2.2 基金产品说明（转型后）

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的 |

| | |
|--------|---|
| | 整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金，属于中低风险收益预期的基金品种，其预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

2.2 基金产品说明（转型前）

| | |
|--------|---|
| 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 | liuye1@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 | 张东宁 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.galaxyasset.com |
| 基金年度报告备置地点 | 1 上海市世纪大道 1568号中建大厦 15楼 2 北京市西城区金融大街丙 17号 |

2.5 其他相关资料

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

注：基金保证人指为银河泽利保本混合型证券投资基金在保本期内（即 2015年 4月 9日至 2017年 4月 10日）提供担保义务的中国投融资担保股份有限公司。自本基金 2017年 4月 14日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金不再有担保人。

§ 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

转型后

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017年 4月 14日 (基金合同生效日)至 2017年 6月 30日 |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -846,073.67 |
| 本期利润 | 495,747.82 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0022 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.22% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.27% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017年 6月 30日 |
| 期末可供分配利润 | 3,481,154.90 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0156 |
| 期末基金资产净值 | 227,703,999.25 |
| 期末基金份额净值 | 1.0197 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2017年 6月 30日 |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.27% |

注：1 转型前的基金合同生效于 2015 年 4 月 9 日，银河泽利保本混合型证券投资基金于 2017 年 4 月 14 日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金且新基金合同生效 转型前报告期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 13 日，转型后报告期指 2017 年 4 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日。

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 按现行法规，在列示涉及基金业绩表现的财务指标时，应有费用提示条款，包括但不限于。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）。

转型前

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 6,747,313.07 |
| 本期利润 | 22,385,473.89 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0102 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.01% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.99% |

| | |
|----------------------|----------------|
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017年 4月 13日 |
| 期末可供分配利润 | 5,765,799.79 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0173 |
| 期末基金资产净值 | 338,157,864.49 |
| 期末基金份额净值 | 1.017 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2017年 4月 13日 |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.70% |

注：1 转型前的基金合同生效于 2015年 4月 9日。

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 按现行法规，在列示涉及基金业绩表现的财务指标时，应有费用提示条款，包括但不限于。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（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

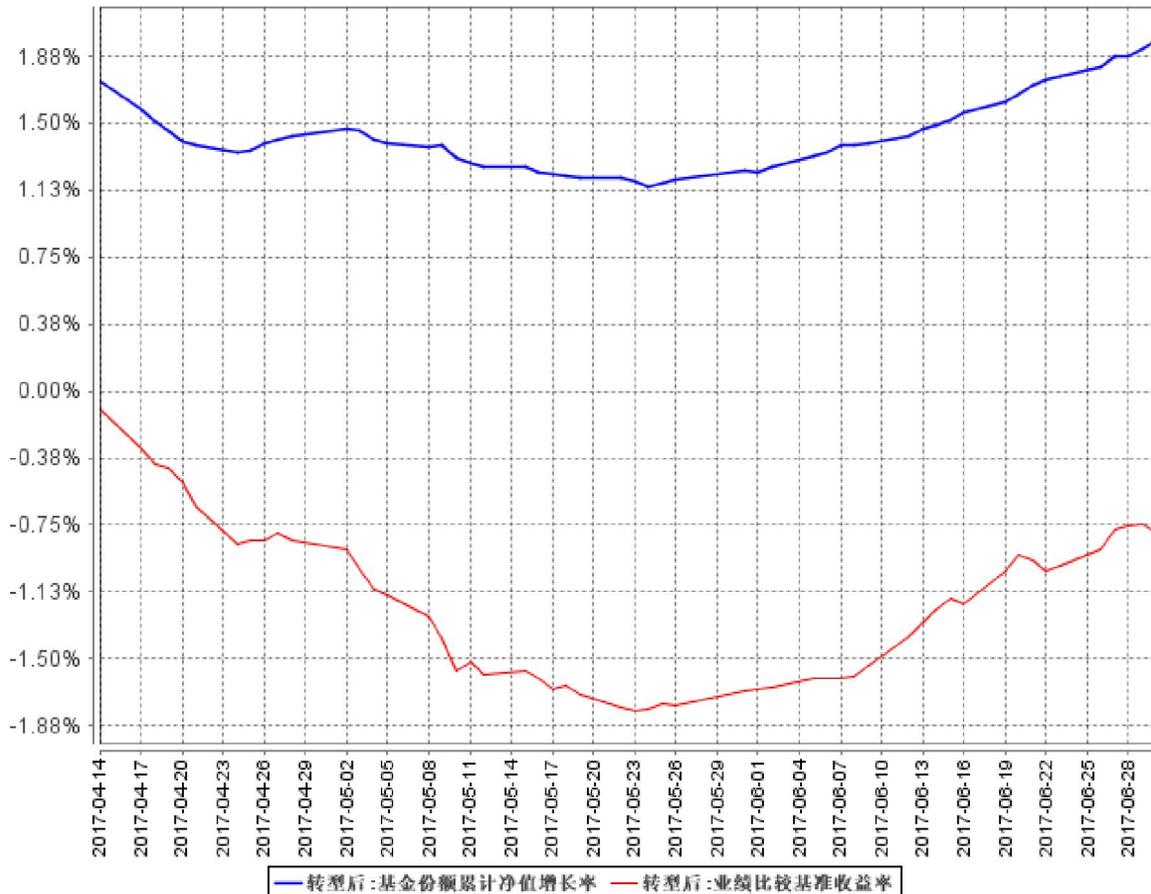
| 阶段 | 份额净值增长率 | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | - | - |
|------------|---------|------------|-----------|--------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.72% | 0.02% | 0.90% | 0.06% | -0.18% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.27% | 0.04% | -0.79% | 0.09% | 1.06% | -0.05% |

注：转型后基金合同生效于 2017年 4月 14日，银河泽利保本混合型证券投资基金于 2017年 4月 14日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金，转型后报告期指 2017年 4月 14日至 2017年 6月 30日。

本基金的业绩比较基准采用：中债综合全价指数收益率

3.2.2 自基金转型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



注：1 银河泽利保本混合型证券投资基金于 2017年 4月 14日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金，即转型后基金合同生效日为 2017年 4月 14日，且转型后报告期指 2017年 4月 14日至 2017年 6月 30日。

3 按照基金合同规定，银河丰利纯债债券型证券投资基金自转型日 2017年 4月 14日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定，目前自转型起未满六个月。

3.2 基金净值表现（转型前）

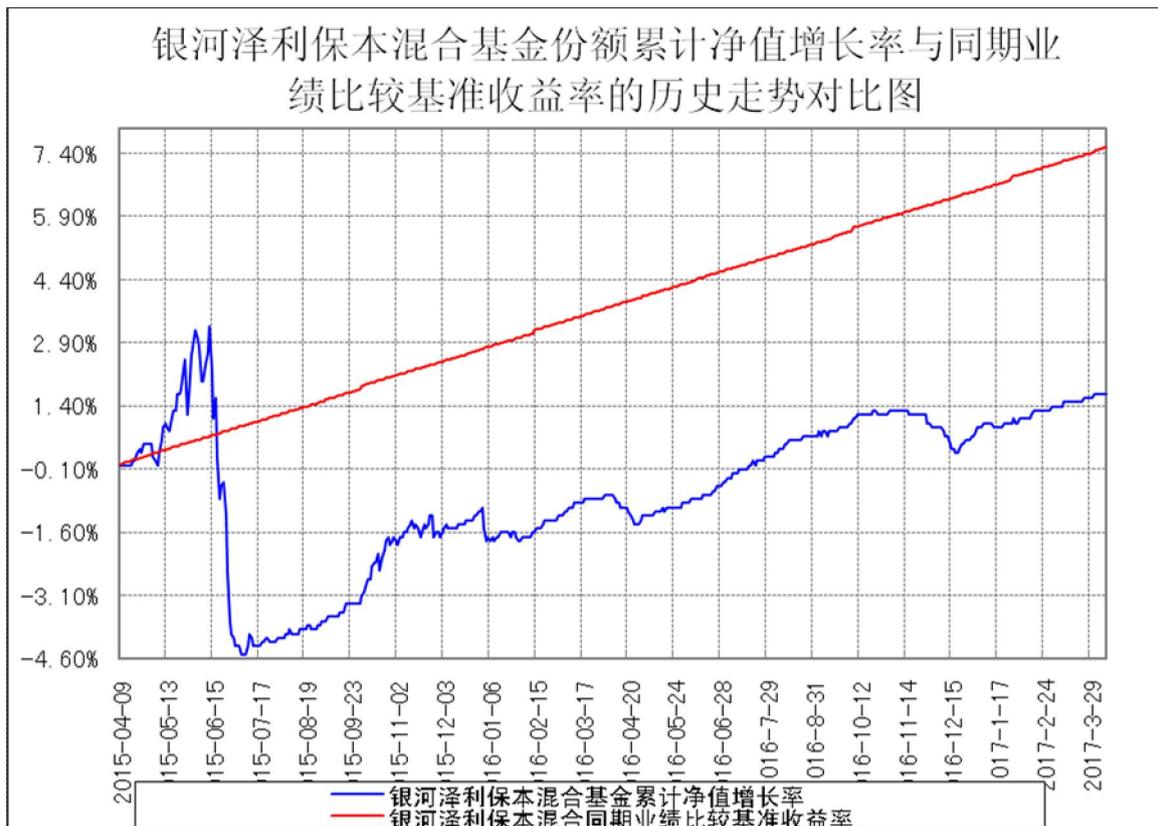
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率 | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | | |
|----------------------|---------|------------|-----------|--------------|--------|-------|
| 2017-4-1 至 2017-4-13 | 0.10% | 0.04% | 0.13% | 0.02% | -0.03% | 0.02% |
| 2017-1-1 至 2017-4-13 | 0.99% | 0.04% | 1.06% | 0.01% | -0.07% | 0.03% |
| 2016-7-1 至 2017-4-13 | 2.11% | 0.05% | 2.94% | 0.01% | -0.83% | 0.04% |
| 自基金成立日起至 2017-4-13 | 1.70% | 0.19% | 7.55% | 0.01% | -5.85% | 0.18% |

注：转型前的基金合同生效于 2015年 4月 9日，银河泽利保本混合型证券投资基金于 2017年 4月 14日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金。

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。

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



注：1 转型前本基金于 2015年 4月 9日合同成立，根据《银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同》规定，本基金应自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

2 银河泽利保本混合型证券投资基金于 2017年 4月 14日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，截止本报告期，银河基金管理有限公司管理 1只封闭式与 43只开放式证券投资基金，基本情况如下：

1 银丰证券投资基金

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2002年 08月 15日

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

2 银河银联系列证券投资基金

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

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2003年 08月 04日

（1）银河稳健证券投资基金

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

（2）银河收益证券投资基金

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

3 银河银泰理财分红证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004年 03月 30日

基金投资目标：追求资产的安全性和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报。

4 银河银富货币市场基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004年 12月 20日

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

5 银河银信添利债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007年 03月 14日

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

6 银河竞争优势成长股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2008年 05月 26日

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

7 银河行业优选股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009年 04月 24日

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

8 银河沪深 300价值指数证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009年 12月 28日

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

9 银河蓝筹精选股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010年 07月 16日

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

10 银河创新成长股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010年 12月 29日

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

11 银河强化收益债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年 06月 09日

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

12 银河消费驱动股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011年 07月 29日

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

13 银河通利债券型证券投资基金（LOF）

基金运作方式：上市契约型开放式（LOF）

基金合同生效日：2012年 04月 25日

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

14 银河主题策略股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012年 09月 21日

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

15 银河领先债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012年 11月 29日

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

投资收益。

16 银河沪深 300成长增强指数分级证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013年 03月 29日

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

17 银河增利债券型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013年 07月 17日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的具有投资价值的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

18 银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金

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

基金合同生效日：2013年 08月 09日

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

19 银河灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年 02月 11日

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

20 银河定投宝中证腾安价值 100指数型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年 03月 14日

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

21 银河美丽优萃股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年 05月 29日

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

22 银河润利保本混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年 08月 06日

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

23 银河康乐股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年 11月 18日

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

24 银河丰利纯债债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年 04月 08日

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

25 银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年 04月 22日

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

26 银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年 04月 22日

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

27 银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年 5月 12日

基金投资目标：本基金将充分把握我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济战略布局过程中呈现的转型增长主题投资机会，充分利用我公司的研究投资优势，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的红利，在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

28 银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年 6月 19日

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

29 银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年 12月 17日

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

30 银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 3月 11日

基金投资目标：在实现《中国制造 2025》规划的工业未来发展纲领和顶层设计目标的过程中，本基金将充分把握大国智造主题涵盖领域中相关行业和企业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享大国智造主题涵盖领域中相关行业及子行业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控

制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

31 银河旺利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 5月 13日

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

32 银河君尚灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 8月 17日

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

33 银河君信灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 9月 7日

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

34 银河君荣灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 9月 5日

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

35 银河君耀灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 11月 18日

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

36 银河君盛灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 12月 9日

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

37 银河君怡纯债债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 12月 27日

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

38 银河君润灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 12月 27日

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

39 银河睿利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2016年 12月 29日

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

40 银河君腾灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年 3月 2日

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

41 银河君欣纯债债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年 3月 2日

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

42 银河犇利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年 3月 10日

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

43 银河君辉纯债债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年 4月 20日

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

44 银河量化优选混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2017年 4月 27日

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

| 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 | 基金经理 | 2016年 3月 10日 | - | 15 | 中共党员，经济学硕士，15年证券从业经历，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 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>品设计、投资管理等工作。</p> <p>2008年 6月加入银河基金管理有限公司，先后担任债券经理助理、债券经理等职务。现任固定收益部负责人、基金经理。2011年 8月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理，2012年 11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2014年 7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理，2015年 4月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，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月起担任银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河润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、银河君荣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债券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、银河君润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，2017年 3月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣纯债债券型证券投</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|-----|------|-----------------|---|----|---|
| | | | | | 资基金的基金经理、银河丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 4 月起担任银河君辉纯债债券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、银河增利债券型发起式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。 |
| 祝建辉 | 基金经理 | 2016 年 3 月 10 日 | - | 11 | 硕士研究生学历，11 年证券从业经历，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、研究部总监助理等职务，现担任基金经理。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 月起担任银河丰利纯债债券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。 |

注：1 上表中任职日期均为我公司做出决定之日；

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

| 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 | 基金经理 | 2016 年 3 月 10 日 | - | 15 | 中共党员，经济学硕士，15 年证券从业经历，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，先后担任债券经理助理、债券经理等职务。 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>现任固定收益部负责人、基金经理。2011年 8月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理，2012年 11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2014年 7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理，2015年 4月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河丰利纯债债券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、银河润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、银河君荣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债券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、银河君润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，2017年 3月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河犇利灵活配置混合型证券投资基</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|-----|------|--------------|---|----|---|
| | | | | | 金的基金经理，2017年 4月起担任银河君辉纯债债券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、银河增利债券型发起式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。 |
| 祝建辉 | 基金经理 | 2016年 3月 10日 | - | 11 | 硕士研究生学历，11 年证券从业经历，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、研究部总监助理等职务，现担任基金经理。2015 年 4 月起担任银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，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。 |

注：1 上表中任职日期均为我公司做出决定之日；

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

在近两年市场连续出现“股灾”和“债灾”的影响之后，基金管理人对于监管升级有所预期，对流动性尤为关注，对债券市场和权益市场均持谨慎乐观的判断。我们认为大类资产短期并不具备趋势性上涨的条件，但并不排除在经历调整之后都会出现波段性的投资机会。对 2017 年国内宏观经济基本面，我们认为经济在年初会保持企稳的惯性，而随着时间的推移，随着补库存动力的

减弱加之金融“去杠杆、防泡沫”的政策导向，经济会逐季向弱。去年持续高增长的 PPI 同比增速将明显调头，食品类价格可控，全年 CPI 将保持平稳的水平。随着美国货币政策正常化的推进，未来仍然会对人民币汇率产生较大的压力。从时间窗口来讲，调控政策亦早不亦迟，因此我们预期监管政策将会在上半年开始收紧，以达到金融去杠杆的政策目标。在此形势下，企业杠杆或受利润的持续改善而出现向好的一面，但去年受债券市场调整影响，信用债一级市场发行困难，屡现取消的现象仍然使得我们对发债主体未来的流动性保持警惕。山东地区频现财务报表存疑、互保链条脆弱等风险事件，也加深了我们对信用风险的担忧。鉴于监管政策收紧的预期加强，我们判断权益市场新增资金将受限、无风险收益的上行也会制约估值水平的抬升、股市融资是去杠杆的主要手段，股票供给节奏的加快也会对市场产生一定的压力。考虑到经济增长短期的惯性，我们还是对年初周期行业维持乐观判断。因此基金投资策略债券方面以短久期、高评级债券为主，严格控制杠杆；考虑到基金保本周期临近到期日，基金制定了逐步减持所有权益类配置的计划。

报告期内，在经历去年末大幅下跌之后，年初债券市场明显存在着一定的配置需求，甚至在一季度末 MPA 考核季将过之时，对未来宏观经济基本面趋弱的判断导致债券市场交易情绪也明显提升，中长端利率出现一定程度的下行。但是，从同业存单持续高增长的形势来推论“金融去杠杆”并没有实质性的进展，随后就看到了二季度监管政策的持续升级，市场出现流动性紧张的局面，债券市场二季度再次出现大幅调整。基金坚持年初的投资策略，并结合保本周期于四月份到期的自身因素，基金年初以来持续减持原有债券配置，并替换成与保本周期相匹配的同业存单。年初基金陆续减持了所持有的权益类资产，有效回避了市场波动的风险。以上投资运作的实施，确保了基金的平稳有序地转型，基金目前已由保本基金转型成为一只纯债基金。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自 2017 年 4 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日银河丰利纯债债券型证券投资基金份额净值增长 0.27%，同期比较基准增长率为 -0.79%

自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 13 日银河泽利保本混合型证券投资基金份额净值增长 0.99%，同期比较基准增长率为 1.06%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断，下半年经济增速相较年初水平或将出现放缓，但仍然保持平稳可控的局面。除去

消费、出口有望保持平稳增长外，地产和基建受政策的影响，或将影响到投资端增速的下滑。原油及工业原材料价格增速的持续回落、国内食品价格的回落趋势、加之国内 M2 增速的快速回落，今年国内 CPI 将控制在 2% 的增速之内，通胀压力较小。

近期，欧洲政治风险趋缓，海外主要发达经济体的持续复苏动力明显，一改前期美国经济“一枝独秀”的局面，有助于国内出口持续回暖的同时，也暂缓了人民币贬值压力。人民币汇率的稳定甚至升值预期将为国内政策提供了更好的施政空间。

宏观基本面的“天平”正在向着有利于债券投资的方向倾斜，但是债券下行的空间将明显受到政策面的制约。虽然，近期政策表明监管明显加强了协调，但今年以来银行同业存单收益和存量都创出新高，一方面这体现出了银行超储极低，负债来源短缺的窘境；另一方面反映出银行短期内仍然有“以新续旧”承接消化过去两年激增的资产的被动需求；前者决定了债券市场配置主力资金的欠缺，后者决定了银行短端融资需求仍然会抬高或维持短期“无风险”利率的中枢水平。目前极度平缓的收益率曲线抑制了长端的下行空间，债券牛市还寄希望于短端利率的下行，实际上就是以同业存单为代表的银行短端负债成本的明显下行，而并不是公开市场操作利率的下行。目前从监管路径来看，越来越倾向于以时间换空间的方式进行，因为全球经济背景正在使得这个“时间”变得相对宽裕。自查期限的放宽，同时伴随着银行自觉地、有计划地整改，金融去杠杆正在逐步接近监管的合意目标。我们判断货币政策在三季度仍然坚持“不松不紧”的基调，监管政策出台也会在预期之内，为机构预留充足的时间去执行。

信用债我们仍然更为看好高评级的信用品种和老城投的配置价值。考虑到下半年到期信用债的本金、利息偿付压力较大，低评级的企业存在融资成本高企，续发困难的压力，短期内仍然需要警惕信用风险的升级。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1 本基金转型前银河泽利保本混合型证券投资基金的《基金合同》生效日为 2015年 4月 09 日，于 2017年 4月 10日保本周期到期并于 2017年 4月 14日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金。转型前未进行利润分配。

2 转型前后，根据银河丰利纯债债券型证券投资基金《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 截止 2017年 6月 30号，本基金可供分配利润 3,481,154.90元，本期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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本基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及恪遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定不存在损害基金份额持有人利益的行为，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）。托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：银河丰利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017年 6月 30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017年 6月 30日 |
|-----------------|------------|-----------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 11,546,290.51 |
| 结算备付金 | | 542,500.00 |
| 存出保证金 | | 148,632.72 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 134,159,627.25 |
| 其中：股票投资 | | 1,064,986.65 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 133,094,640.60 |
| 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 | 79,435,329.15 |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,342,537.69 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 228,174,917.32 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017年 6月 30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 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 130,448.25 |
| 应付托管费 | | 37,270.92 |
| 应付销售服务费 | | - |

| | | |
|---------------|----------|----------------|
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 4,844.62 |
| 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 | 298,354.28 |
| 负债合计 | | 470,918.07 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 223,297,066.60 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 4,406,932.65 |
| 所有者权益合计 | | 227,703,999.25 |
| 负债和所有者权益总计 | | 228,174,917.32 |

注：银河泽利保本混合型证券投资基金（转型前）于 2017 年 4 月 14 日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金（转型后），截止至本报告日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.0197 元，基金份额总额为 223,297,066.60 份。

6.2 利润表

会计主体：银河丰利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 4 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|
| 一、收入 | | 1,023,219.77 |
| 1.利息收入 | | 2,800,847.53 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 47,699.24 |
| 债券利息收入 | | 2,307,938.00 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 445,210.29 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -3,123,009.15 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 544,538.55 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -3,669,232.95 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 1,685.25 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 1,341,821.49 |

| | | |
|-----------------------------|------------|-------------------|
| 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 | 3,559.90 |
| 减：二、费用 | | 527,471.95 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 340,917.34 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 97,404.91 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 2,331.14 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 86,818.56 |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) | | 495,747.82 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列) | | 495,747.82 |

注：银河泽利保本混合型证券投资基金（转型前）于 2017 年 4 月 14 日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金（转型后），以上本期为 2017 年 4 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日且无上年可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河丰利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 4 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|--|---|---------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 332,392,064.70 | 5,765,799.79 | 338,157,864.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 495,747.82 | 495,747.82 |
| 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) | -109,094,998.10 | -1,854,614.96 | -110,949,613.06 |
| 其中：1 基金申购款 | - | - | - |
| 2 基金赎回款(以“-”号填列) | -109,094,998.10 | -1,854,614.96 | -110,949,613.06 |
| 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) | 223,297,066.60 | 4,406,932.65 | 227,703,999.25 |

注：本基金转型后本报告期间指 2017年 4月 14日至 2017年 6月 30日，且无上年可比期间。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

银河丰利纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),由银河泽利保本混合型证券投资基金于 2017年 4月 14日转型更名,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]389号《关于准予银河泽利保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由银河基金管理有限公司作为管理人自 2015年 3月 30日到 2015年 4月 2日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第 60821717_B02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015年 4月 9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 2,987,652,767.94元,在募集期间产生的存款利息为人民币 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,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,第一保本周期的保证人为中国投融资担保有限公司。

根据《银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,在第一个保本周期内,本基金的保本金额为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。本基金保本周期届满时，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。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“银河丰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。2017 年 4 月 10 日为银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期日。银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期，已根据银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同的规定变更为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变为“519654”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于固定收益类品种，包括国债、国债期货、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、可转债、中期票据、分离交易可转债、资产支持证券、债券回购、银河定期存款、同业存单等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金不直接买入股票、权证等权益类资产，也不参与新股申购或增发新股，仅可持有因可转债形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；其中可转债投资比例不高于基金资产的 30%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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：中债综合全价指数收益率

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 4 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 4 月 14 日（基金转型生效日）起至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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为债券投资；

(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。

6.4.4.4 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债券等，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，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)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；

(2) 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)”。

6.4.4.9 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) 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；

(6) 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；

(7) 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。

6.4.4.10 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 0.70% 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (3) 基金收益分配后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分配权；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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 增值税

根据财政部、国家税务总局财税 [2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税 [2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可

选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3 企业所得税

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

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

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

4 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 | |
|---------------|---------------------|--------------|
| | 活期存款 | 1,546,290.51 |
| 定期存款 | 10,000,000.00 | |
| 其中：存款期限 1-3个月 | 10,000,000.00 | |
| 其他存款 | - | |
| 合计： | 11,546,290.51 | |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 | | |
|-------------------|---------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票 | 208,836.21 | 1,064,986.65 | 856,150.44 |
| 贵金属投资_金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 43,580,688.21 | 42,742,640.60 |
| | 银行间市场 | 90,643,866.51 | 90,352,000.00 |
| | 合计 | 134,224,554.72 | 133,094,640.60 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 134,433,390.93 | 134,159,627.25 | -273,763.68 |

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 2017年 6月 30日 | |
|-----------------|---------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 59,435,329.15 | - |
| 买入返售证券_固定平 台 | 20,000,000.00 | - |

| | |
|----|---------------|
| 合计 | 79,435,329.15 |
|----|---------------|

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 |
|------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,467.04 |
| 应收定期存款利息 | 20,833.35 |
| 应收其他存款利息 | |
| 应收结算备付金利息 | 244.10 |
| 应收债券利息 | 2,132,323.60 |
| 应收买入返售证券利息 | 187,602.70 |
| 应收申购款利息 | |
| 应收黄金合约拆借孳息 | |
| 其他 | 66.90 |
| 合计 | 2,342,537.69 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 |
|-------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 721.31 |
| 银行间市场应付交易费用 | 4,123.31 |
| 合计 | 4,844.62 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 6月 30日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | |
| 应付赎回费 | |
| 预提费用 | 298,354.28 |
| 合计 | 298,354.28 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日) 至 2017年 6月 30日 | |
|-----------------|---|-----------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 332,392,064.70 | 332,392,064.70 |
| 本期申购 | | |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -109,094,998.10 | -109,094,998.10 |
| - 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 | 223,297,066.60 | 223,297,066.60 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。本基金转型后报告期为 2017年 4月 14日至 2017年 6月 30日，且上表基金合同生效日指转型日（2017年 4月 14日）。

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 基金合同生效日 | 6,385,004.69 | -619,204.90 | 5,765,799.79 |
| 本期利润 | -846,073.67 | 1,341,821.49 | 495,747.82 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,057,776.12 | 203,161.16 | -1,854,614.96 |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | -2,057,776.12 | 203,161.16 | -1,854,614.96 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,481,154.90 | 925,777.75 | 4,406,932.65 |

注：本基金转型后报告期为 2017年 4月 14日至 2017年 6月 30日，且上表基金合同生效日指转型日（2017年 4月 14日）。

6.4.7.11 存款利息收入

| 项目 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日) 至 2017年 6月 30日 |
|-----------|---|
| 活期存款利息收入 | 24,346.02 |
| 定期存款利息收入 | 20,833.35 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 1,927.67 |
| 其他 | 592.20 |
| 合计 | 47,699.24 |

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日)至 2017 年 6月 30日 |
|------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 753,029.19 |
| 减：卖出股票成本总额 | 208,490.64 |
| 买卖股票差价收入 | 544,538.55 |

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 2017年 4月 14日至 2017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 | -3,669,232.95 |
| 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 | -3,669,232.95 |

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 2017年 4月 14日至 2017年 6月 30日 |
|-------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额 | 103,142,155.89 |
| 减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额 | 104,496,072.12 |
| 减：应收利息总额 | 2,315,316.72 |
| 买卖债券差价收入 | -3,669,232.95 |

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：本基金本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期间无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期间无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期间无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益 -- 其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日)至 2017年 6 月 30日 |
|-------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,685.25 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,685.25 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日)至 2017年 6月 30日 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 3,559.90 |
| 合计 | 3,559.90 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日)至 2017年 6月 30日 |
|-----------|---|
| 交易所市场交易费用 | 1,506.14 |
| 银行间市场交易费用 | 825.00 |
| 合计 | 2,331.14 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日)至 2017 年 6月 30日 |
|------------|--|
| 审计费用 | 21,369.66 |
| 信息披露费 | 64,108.98 |
| 上清所数字证书服务费 | - |
| 其他 | - |
| 资金汇划费 | 1,339.92 |
| 帐户维护费 | - |
| 合计 | 86,818.56 |

6.4.7.21 分部报告

注：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

本报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

| | |
|--------------|-----------------------|
| 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 | 同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 2017年 4月 14日 (基金合同生效日) 至 2017年 6月 30日 | |
|-------|---|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 银河证券 | 753,029.19 | 100.00% |

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期即 2017年 4月 14日至 2017年 6月 30日未通过关联方交易单元进行债券交易、且无上年可比区间。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日) 至 2017年 6月 30日 | |
|-------|---|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 银河证券 | 121,700,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日) 至 2017年 6月 30日 | |
|-------|---|--|
|-------|---|--|

| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
|------|--------|------------|----------|--------------|
| 银河证券 | 686.27 | 100.00% | 721.31 | 100.00% |

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------------|---------------------------------------|
| | 2017年 4月 14日 (基金合同生效日) 至 2017年 6月 30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 340,917.34 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.7%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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 |
|----------------|---------------------------------------|
| | 2017年 4月 14日 (基金合同生效日) 至 2017年 6月 30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 97,404.91 |

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：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，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取。若遇法

定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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末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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年 4月 14日 (基金合同生效日)至 2017年 6月 30日 | |
|-------|--|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 北京银行 | 24,346.02 | 22,878.96 |

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（2017年 6月 30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-------------|------------|--------|------|--------|--------------|------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 说明 |
| 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 | 40.95 | 26,007 | 208,836.21 | 1,064,986.65 | |

注：本基金持有的股票“苏州科达”为转型前 2016年 11月 21日网下申购新股中签，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。转型后依据新基金合同且不再进行股票的投资。

6.4.12.17 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。

6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购

截止至本报告期末，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。

6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购

截止至本报告期末，本基金无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

金额单位：人民币元

| 本期末 2017年 6月 | 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 |
|-----------------|-------|-------|---------|------|----------|-----|----|
| | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|---------------|--|----------------|----------------|
| 30日 | | | | | | | |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 11,546,290.51 | | | | | | 11,546,290.51 |
| 结算备付金 | 542,500.00 | | | | | | 542,500.00 |
| 存出保证金 | 148,632.72 | | | | | | 148,632.72 |
| 交易性金融资产 | 19,926,000.00 | 20,366,000.00 | 40,071,640.60 | 52,731,000.00 | | 1,064,986.65 | 134,159,627.24 |
| 买入返售金融资产 | 59,435,000.00 | | | | | | 59,435,000.00 |
| 应收利息 | | | | | | 2,342,537.69 | 2,342,537.69 |
| 其他资产 | | | | | | 20,000,329.15 | 20,000,329.15 |
| 资产总计 | 91,598,423.23 | 20,366,000.00 | 40,071,640.60 | 52,731,000.00 | | 23,407,853.49 | 228,174,917.32 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | | | | | | 130,448.25 | 130,448.25 |
| 应付托管费 | | | | | | 37,270.92 | 37,270.92 |
| 应付交易费用 | | | | | | 4,844.62 | 4,844.62 |
| 其他负债 | | | | | | 298,354.28 | 298,354.28 |
| 负债总计 | | | | | | 470,918.07 | 470,918.07 |
| 利率敏感度缺口 | 91,598,423.23 | 20,366,000.00 | 40,071,640.60 | 52,731,000.00 | | -22,936,935.42 | 227,703,999.24 |

注：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。

6.4.13.4.1.2 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（2017年 6月 30日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 492,841.52 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -492,841.52 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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 2017年 6月 30日 | |
|---------------|---------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 1,064,986.65 | 0.47 |
| 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 | 1,064,986.65 | 0.47 |

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上证 A 股指数变动时，股票资产相应的理论变动 | |
| | 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（2017年 6月 30日） |
| | 上证 A 股指数上升 5% | 89,255.67 |
| | 上证 A 股指数下降 5% | -89,255.67 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

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。

2以公允价值计量的金融工具

2.1各层次金融工具公允价值

于 2017年 6月 30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 84,640.60 元，属于第二层次的余额为人民币 134,074,986.65 元，属于第三层次余额为人民币 0.00元。

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（包括涨跌停时的交易不活跃）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。

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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表（转型前）

会计主体：银河泽利保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017年 4月 13日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017年 4月 13日 | 上年度末 2016年 12月 31日 |
|-----------------|------------|-----------------------------|-------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 664,609,996.22 | 170,304,294.39 |
| 结算备付金 | | 1,119,565.22 | 1,972,733.43 |
| 存出保证金 | | 183,091.87 | 73,994.26 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 188,097,928.52 | 2,084,835,996.12 |
| 其中：股票投资 | | 1,768,143.72 | 63,424,421.42 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 186,329,784.80 | 2,021,411,574.70 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 151,522.07 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 3,506,955.92 | 46,546,173.14 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 857,517,537.75 | 2,303,884,713.41 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017年 4月 13日 | 上年度末 2016年 12月 31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 1,800,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 518,072,789.87 | 419,909.23 |
| 应付管理人报酬 | | 732,298.63 | 2,352,337.46 |
| 应付托管费 | | 122,049.78 | 392,056.24 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 2,593.31 | 164,595.10 |
| 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 | 6.4.7.8 | 429,941.67 | 404,795.89 |
| 负债合计 | | 519,359,673.26 | 5,533,741.92 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 332,392,064.70 | 2,282,251,835.46 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 5,765,799.79 | 16,099,136.03 |
| 所有者权益合计 | | 338,157,864.49 | 2,298,350,971.49 |
| 负债和所有者权益总计 | | 857,517,537.75 | 2,303,884,713.41 |

注：银河泽利保本混合型证券投资基金（转型前）于 2017 年 4 月 14 日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金（转型后），上表本期末指 2017 年 4 月 13 日，基金份额净值为 1.017 元，基金份额总额为 332,392,064.70 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 13 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 13 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 31,399,117.24 | 32,983,199.59 |
| 1 利息收入 | | 30,517,917.86 | 68,812,216.45 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 4,792,045.95 | 2,159,237.30 |
| 债券利息收入 | | 24,018,791.49 | 65,745,775.01 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,707,080.42 | 907,204.14 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2 投资收益(损失以“-”填列) | | -15,113,091.50 | -22,522,499.13 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 6,188,495.00 | -14,647,307.81 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -21,286,159.00 | -8,188,599.13 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | -15,427.50 | 313,407.81 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17 | 15,638,160.82 | -14,213,503.54 |
| 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 | 356,130.06 | 906,985.81 |
| 减：二、费用 | | 9,013,643.35 | 18,812,986.81 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 7,442,265.35 | 15,434,126.19 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,240,377.56 | 2,572,354.36 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 190,598.80 | 395,741.49 |
| 5. 利息支出 | | 3,112.85 | 191,155.93 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 3,112.85 | 191,155.93 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 137,288.79 | 219,608.84 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 22,385,473.89 | 14,170,212.78 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 22,385,473.89 | 14,170,212.78 |

注：银河泽利保本混合型证券投资基金（转型前）于 2017 年 4 月 14 日转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金（转型后），以上本期为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 13 日且上年可比期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日。

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 13 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 13 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） | 2,282,251,835.46 | 16,099,136.03 | 2,298,350,971.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 22,385,473.89 | 22,385,473.89 |
| 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） | -1,949,859,770.76 | -32,718,810.13 | -1,982,578,580.89 |
| 其中：1 基金申购款 | 41,770.79 | 789.75 | 42,560.54 |
| 2 基金赎回款 | -1,949,901,541.55 | -32,719,599.88 | -1,982,621,141.43 |
| 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） | 332,392,064.70 | 5,765,799.79 | 338,157,864.49 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 2,709,813,569.63 | -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） | - | 14,170,212.78 | 14,170,212.78 |
| 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） | -210,321,843.19 | 2,295,939.31 | -208,025,903.88 |
| 其中：1 基金申购款 | 2,694,416.73 | -34,107.61 | 2,660,309.12 |
| 2 基金赎回款 | -213,016,259.92 | 2,330,046.92 | -210,686,213.00 |
| 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） | 2,499,491,726.44 | -11,034,675.15 | 2,488,457,051.29 |

注：本基金转型前本报告期间指 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日，且上年可比期间为 2016年 1月 1日至 2016年 6月 30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银河泽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[2015]389号《关于准予银河泽利保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由银河基金管理有限公司作为管理人自 2015年 3月 30日到 2015年 4月 2日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第 60821717_B02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015年 4月 9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 2,987,652,767.94元,在募集期间产生的存款利息为人民币 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,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,第一保本周期的保证人为中国投融资担保有限公司。

根据《银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,在第一个保本周期内,本基金的保本金额为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(即认购保本基金金额,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个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。本基金保本周期届满时,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。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“银河丰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。银河泽利保本混合型证券投资基金的保本周期为两年,自银河泽利保本混合型证券投资基金合同生效之日(即 2015年 4月 9日)起至两个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日,即 2017年 4月 10日为银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期日。银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期,已根据银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同的规定变更为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变,基金代码亦保持不变为“519654”。转型后基金的投资目标、投资范围、投

资策略以及基金费率等按照《基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

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。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

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 2017 年 4 月 13 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 13 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 4 月 13 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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为债券投资；

(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。

6.4.4.4 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债券等，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，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) 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；

(2) 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)”。

6.4.4.9 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)债券投资收益 / (损失) 于交易日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6)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；

(7)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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)保本周期内的收益分配

仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

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。

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%;

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。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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 增值税

根据财政部、国家税务总局财税 [2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税 [2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018年 1月 1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018年 1月 1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3 企业所得税

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

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

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

4 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 4月 13日 |
|---------------|---------------------|
| 活期存款 | 664,609,996.22 |
| 定期存款 | |
| 其中：存款期限 1-3个月 | |
| 其他存款 | |
| 合计： | 664,609,996.22 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 4月 13日 | | |
|---------------|---------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票 | 417,326.85 | 1,768,143.72 | 1,350,816.87 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 43,580,688.21 | 42,878,784.80 |
| | 银行间市场 | 145,715,498.63 | 143,451,000.00 |
| | 合计 | 189,296,186.84 | 186,329,784.80 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 189,713,513.69 | 188,097,928.52 | -1,615,585.17 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 4月 13日 |
|------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 78,817.00 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 1,385.28 |
| 应收债券利息 | 3,426,569.16 |
| 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 | 184.48 |
| 合计 | 3,506,955.92 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 4月 13日 |
|-------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 35.04 |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,558.27 |
| 合计 | 2,593.31 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年 4月 13日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 17,066.03 |
| 预提费用 | 412,875.64 |
| 合计 | 429,941.67 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 | |
|---------------|---------------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,282,251,835.46 | 2,282,251,835.46 |
| 本期申购 | 41,770.79 | 41,770.79 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,949,901,541.55 | -1,949,901,541.55 |
| - 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 | 332,392,064.70 | 332,392,064.70 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。本报告期间为转型前 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 35,428,337.67 | -19,329,201.64 | 16,099,136.03 |
| 本期利润 | 6,747,313.07 | 15,638,160.82 | 22,385,473.89 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -35,790,646.05 | 3,071,835.92 | -32,718,810.13 |
| 其中：基金申购款 | 871.46 | -81.71 | 789.75 |
| 基金赎回款 | -35,791,517.51 | 3,071,917.63 | -32,719,599.88 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 6,385,004.69 | -619,204.90 | 5,765,799.79 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
|-----------|---------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 158,558.98 |
| 定期存款利息收入 | 4,624,383.17 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 8,498.51 |
| 其他 | 605.29 |
| 合计 | 4,792,045.95 |

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
|------------|---------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 82,127,987.94 |
| 减：卖出股票成本总额 | 75,939,492.94 |
| 买卖股票差价收入 | 6,188,495.00 |

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 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
|----------------------|---------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券 | -21,286,159.00 |

| | |
|----------------|----------------|
| 到期兑付) 差价收入 | |
| 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 | -21,286,159.00 |

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 |
|-------------------------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
| 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额 | 2,915,220,358.51 |
| 减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额 | 2,876,794,047.09 |
| 减：应收利息总额 | 59,712,470.42 |
| 买卖债券差价收入 | -21,286,159.00 |

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：本基金本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期间无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期间无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期间无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益 -- 其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
| 股票投资产生的股利收益 | -15,427.50 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | -15,427.50 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
| 基金赎回费收入 | 356,130.00 |
| 合计 | 356,130.00 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
| 交易所市场交易费用 | 181,061.30 |
| 银行间市场交易费用 | 9,537.50 |
| 合计 | 190,598.80 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 |
| 审计费用 | 28,218.91 |
| 信息披露费 | 84,656.73 |
| 上清所数字证书服务费 | 500.00 |

| | |
|-------|------------|
| 其他 | 475.00 |
| 资金汇划费 | 5,438.15 |
| 帐户维护费 | 18,000.00 |
| 合计 | 137,288.79 |

6.4.7.21 分部报告

注：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

本报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------|-----------------------|
| 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 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 | | 上年度可比期间 2016年 1月 1日至 2016年 6月 30日 | |
|-------|---------------------------------|----------------------|--------------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 |
| 银河证券 | 97,529,889.82 | 100.00% | 229,176,198.26 | 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 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 | | 上年度可比期间 2016年 1月 1日至 2016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 | 239,280,060.49 | 100.00% | 162,723,027.46 | 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 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 | | 上年度可比期间 2016年 1月 1日至 2016年 6月 30日 | |
|-------|---------------------------------|----------------------------|--------------------------------------|----------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 |
| 银河证券 | 627,000,000.00 | 100.00% | 13,021,000,000.00 | 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 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13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 | 89,952.67 | 100.00% | 35.04 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 210,932.00 | 100.00% | 31,411.27 | 100.00% |

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 4 月 13日 | 上年度可比期间 2016年 1月 1日至 2016年 6月 30 日 |
|------------------------------|-------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 7,442,265.35 | 15,434,126.19 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 ¹ | 3,890,688.87 | 7,597,681.25 |

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：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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。

根据银河泽利基金合同规定，本基金保本周期到期期间为保本周期到期日及其后三个工作日，即本基金的到期期间为（2017年 4月 10日至 4月 13日）结束后，即 2017年 4月 14日起，“银河泽利保本混合型证券投资基金”转型为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。且本基金到期期间除保本到期日 2017年 4月 10日外，2017年 4月 11日至 2017年 4月 13日基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年 1月 1日至 2017年 4 | 上年度可比期间 2016年 1月 1日至 2016年 6月 30 |
|----|----------------------------|-------------------------------------|
|----|----------------------------|-------------------------------------|

| | 月 13日 | 日 |
|----------------|--------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,240,377.56 | 2,572,354.36 |

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：

$H = E \times 0.2\% \times \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，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取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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末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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.5 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 | |
|-------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日 | 2016年 1月 1日至 2016年 6月 30日 | 2016年 1月 1日至 2016年 6月 30日 | 2016年 1月 1日至 2016年 6月 30日 |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 北京银行 | 2,700,642.15 | 2,700,642.15 | 13,084,690.56 | 113,597.48 |

注：本基金转型前的报告期为 2017年 1月 1日至 2017年 4月 13日，上表期末指 2017年 4月 13日，即本期关联方（北京银行）产生的利息收入均已实现。

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：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年 4月 13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 | 说明 | |
| 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 | 87.71 | 10,383 | 208,490.64 | 910,692.93 | | |
| 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 | 32.97 | 26,007 | 208,836.21 | 857,450.79 | | |

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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

截止至本报告期末 2017年 4月 13日，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

截止至本报告期末 2017年 4月 13日，本基金无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

金额单位：人民币元

| 本期末 2017年 4月 13 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 | 664,609,996.22 | | | | | | 664,609,996.22 |
| 结算备付金 | 1,119,565.22 | | | | | | 1,119,565.22 |
| 存出保证金 | 183,091.87 | | | | | | 183,091.87 |
| 交易性金融资产 | 20,285,000.00 | | 20,495,784.80 | 145,549,000.00 | | 1,768,143.72 | 188,097,928.52 |
| 应收利息 | | | | | | 3,506,955.92 | 3,506,955.92 |
| 资产总计 | 686,197,653.33 | | 20,495,784.80 | 145,549,000.00 | | 5,275,099.64 | 857,517,537.75 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | | | | | | 518,072,789.87 | 518,072,789.87 |
| 应付管理人报酬 | | | | | | 732,298.63 | 732,298.63 |
| 应付托管费 | | | | | | 122,049.78 | 122,049.78 |
| 应付交 | | | | | | 2,593.31 | 2,593.31 |

| | | | | | | | |
|-------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------|-----------------|------------------|
| 易费用 | | | | | | | |
| 其他负债 | | | | | | 429,941.67 | 429,941.67 |
| 负债总计 | | | | | | 519,359,673.26 | 519,359,673.26 |
| 利率敏感度缺口 | 686,197,653.33 | | 20,495,784.80 | 145,549,000.00 | | -514,084,573.62 | 338,157,864.49 |
| 上年度末 2016年 12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 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 | 52,191,022.06 | 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 |

| | | | | | | | |
|-----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|--|----------------|------------------|
| 息 | | | | | | | |
| 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 | 50,391,022.00 | 741,721,000.00 | 760,824,539.30 | 639,026,035.40 | | 106,388,374.71 | 2,298,350,971.49 |

注：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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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 2017年 4月 13日 | | 上年度末 2016年 12月 31日 | |
|---------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例(%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例(%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 1,768,143.72 | 0.52 | 63,424,421.42 | 2.76 |
| 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 | 1,768,143.72 | 0.52 | 63,424,421.42 | 2.76 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

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。

2以公允价值计量的金融工具

2.1各层次金融工具公允价值

于 2017年 4月 13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 87,784.80 元，属于第二层次的余额为人民币 188,010,143.72 元，属于第三层次余额为人民币 0.00元。

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（包括涨跌停时的交易不活跃）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。

2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

§ 7 投资组合报告（转型后）

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 | 1,064,986.65 | 0.47 |
| | 其中：股票 | 1,064,986.65 | 0.47 |
| 2 | 固定收益投资 | 133,094,640.60 | 58.33 |
| | 其中：债券 | 133,094,640.60 | 58.33 |
| | 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 | 79,435,329.15 | 34.81 |
| | 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 | 12,088,790.51 | 5.30 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,491,170.41 | 1.09 |
| 8 | 合计 | 228,174,917.32 | 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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | | |
| B | 采矿业 | | |
| C | 制造业 | 1,064,986.65 | 0.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | | |
| E | 建筑业 | | |
| F | 批发和零售业 | | |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | | |
| H | 住宿和餐饮业 | | |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | | |
| J | 金融业 | | |
| 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 | 1,064,986.65 | 0.47 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

7.2.3 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 | 603660 | 苏州科达 | 26,007 | 1,064,986.65 | 0.47 |

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：依据转型后的基金合同相关规定，2017年 4月 14日至 2017年 6月 30日期间不存在股票的买入情况。

7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|
| 1 | 300508 | 维宏股份 | 753,029.19 | 0.33 |

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.3.3 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 | 0.00 |
|--------------|------|

| | |
|--------------|------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 752,209.32 |
|--------------|------------|

注：本项及 7.4.1、7.4.2 的“买入金额”（或“买入股票成本”）及“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，不包括相关交易费用。

7.4 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,957,000.00 | 4.37 |
| | 其中：政策性金融债 | 9,957,000.00 | 4.37 |
| 4 | 企业债券 | 73,097,000.00 | 32.10 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 30,030,000.00 | 13.19 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 84,640.60 | 0.04 |
| 8 | 同业存单 | 19,926,000.00 | 8.75 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 133,094,640.60 | 58.45 |

7.5 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 | 124249 | 13大城投 | 700,000 | 42,658,000.00 | 18.73 |
| 2 | 101565005 | 15水电物资 MTN001 | 300,000 | 30,030,000.00 | 13.19 |
| 3 | 1480507 | 14抚顺城投 小微债 01 | 200,000 | 20,366,000.00 | 8.94 |
| 4 | 111710282 | 17兴业银行 CD282 | 200,000 | 19,926,000.00 | 8.75 |
| 5 | 1480546 | 14攀城投小 微债 | 100,000 | 10,073,000.00 | 4.42 |

7.6 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。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.9.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

7.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

7.9.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未投资国债期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

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。

7.10.2

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。

7.10.3 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 | 148,632.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | |
| 3 | 应收股利 | |
| 4 | 应收利息 | 2,342,537.69 |
| 5 | 应收申购款 | |
| 6 | 其他应收款 | |

| | | |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | |
| 8 | 其他 | |
| 9 | 合计 | 2,491,170.41 |

7.10.4 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。

7.10.5 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 | 603660 | 苏州科达 | 1,064,986.65 | 0.47 | 新股锁定 |

注：本基金持有的股票“苏州科达”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。

7.10.6 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。

§ 7 投资组合报告（转型前）

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 | 1,768,143.72 | 0.21 |
| | 其中：股票 | 1,768,143.72 | 0.21 |
| 2 | 固定收益投资 | 186,329,784.80 | 21.73 |
| | 其中：债券 | 186,329,784.80 | 21.73 |
| | 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 | 665,729,561.44 | 77.63 |
| 7 | 其他资产 | 3,690,047.79 | 0.43 |
| 8 | 合计 | 857,517,537.75 | 100.00 |

注：以下转型前的本报告期末均指 2017年 4月 13日。

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | | |
| B | 采矿业 | | |
| C | 制造业 | 857,450.79 | 0.25 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | | |
| E | 建筑业 | | |
| F | 批发和零售业 | | |
| 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 | 910,692.93 | 0.27 |
| J | 金融业 | | |
| 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 | 1,768,143.72 | 0.52 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 300508 | 维宏股份 | 10,383 | 910,692.93 | 0.27 |
| 2 | 603660 | 苏州科达 | 26,007 | 857,450.79 | 0.25 |

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 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 | 600104 | 上汽集团 | 7,529,059.00 | 0.33 |
| 2 | 600820 | 隧道股份 | 2,294,072.00 | 0.10 |
| 3 | 000739 | 普洛药业 | 1,955,902.00 | 0.09 |
| 4 | 000596 | 古井贡酒 | 1,411,906.88 | 0.06 |
| 5 | 600572 | 康恩贝 | 1,096,500.00 | 0.05 |
| 6 | 600452 | 涪陵电力 | 692,808.00 | 0.03 |
| 7 | 600105 | 永鼎股份 | 421,654.00 | 0.02 |

| | | | | |
|----|--------|------|-----------|------|
| 8 | 603626 | 科森科技 | 47,049.60 | 0.00 |
| 9 | 002841 | 视源股份 | 32,020.80 | 0.00 |
| 10 | 603639 | 海利尔 | 30,089.70 | 0.00 |
| 11 | 300580 | 贝斯特 | 23,869.51 | 0.00 |
| 12 | 300599 | 雄塑科技 | 22,211.20 | 0.00 |
| 13 | 002851 | 麦格米特 | 20,786.36 | 0.00 |
| 14 | 002845 | 同兴达 | 16,757.52 | 0.00 |
| 15 | 300600 | 瑞特股份 | 15,432.52 | 0.00 |
| 16 | 300597 | 吉大通信 | 14,632.38 | 0.00 |
| 17 | 603628 | 清源股份 | 14,376.17 | 0.00 |
| 18 | 603089 | 正裕工业 | 12,641.81 | 0.00 |
| 19 | 603668 | 天马科技 | 12,519.36 | 0.00 |
| 20 | 002824 | 和胜股份 | 11,867.80 | 0.00 |

注：买入金额不包括相关交易费用。

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 | 600519 | 贵州茅台 | 13,837,231.65 | 0.60 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 10,346,606.15 | 0.45 |
| 3 | 600104 | 上汽集团 | 7,927,343.90 | 0.34 |
| 4 | 002002 | 鸿达兴业 | 7,425,014.12 | 0.32 |
| 5 | 600572 | 康恩贝 | 5,568,850.00 | 0.24 |
| 6 | 600105 | 永鼎股份 | 5,248,645.00 | 0.23 |
| 7 | 002519 | 银河电子 | 4,757,475.60 | 0.21 |
| 8 | 002101 | 广东鸿图 | 4,683,839.00 | 0.20 |
| 9 | 000739 | 普洛药业 | 4,457,846.60 | 0.19 |
| 10 | 600452 | 涪陵电力 | 4,200,927.00 | 0.18 |
| 11 | 000568 | 泸州老窖 | 3,784,957.00 | 0.16 |
| 12 | 600820 | 隧道股份 | 2,289,783.00 | 0.10 |
| 13 | 000596 | 古井贡酒 | 2,064,848.95 | 0.09 |
| 14 | 002310 | 东方园林 | 1,935,409.45 | 0.08 |
| 15 | 603858 | 步长制药 | 1,332,087.00 | 0.06 |
| 16 | 601375 | 中原证券 | 238,386.35 | 0.01 |
| 17 | 603877 | 太平鸟 | 126,258.00 | 0.01 |
| 18 | 603626 | 科森科技 | 116,588.16 | 0.01 |
| 19 | 002851 | 麦格米特 | 104,495.44 | 0.00 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 20 | 002841 | 视源股份 | 104,428.80 | 0.00 |
|----|--------|------|------------|------|

注：卖出金额不包括相关交易费用。

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 | 15,721,691.61 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 81,375,778.62 |

注：本项及 7.4.1 7.4.2 的“买入金额”（或“买入股票成本”）及“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，不包括相关交易费用。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 155,924,000.00 | 46.11 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 30,318,000.00 | 8.97 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 87,784.80 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 186,329,784.80 | 55.10 |

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 | 1180065 | 11沈国资债 | 600,000 | 62,346,000.00 | 18.44 |
| 2 | 124249 | 13大城投 | 700,000 | 42,791,000.00 | 12.65 |
| 3 | 101565005 | 15水电物资 MTN001 | 300,000 | 30,318,000.00 | 8.97 |
| 4 | 1480507 | 14抚顺城投 小微债 01 | 200,000 | 20,408,000.00 | 6.04 |
| 5 | 1180100 | 11清河投资 | 500,000 | 20,285,000.00 | 6.00 |

| | | | | |
|--|--|---|--|--|
| | | 债 | | |
|--|--|---|--|--|

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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不在本基金投资范围之内，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。

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

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 183,091.87 |
| 2 | 应收证券清算款 | |
| 3 | 应收股利 | |
| 4 | 应收利息 | 3,506,955.92 |
| 5 | 应收申购款 | |
| 6 | 其他应收款 | |
| 7 | 待摊费用 | |
| 8 | 其他 | |
| 9 | 合计 | 3,690,047.79 |

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 | 910,692.93 | 0.27 | 新股锁定 |
| 2 | 603660 | 苏州科达 | 857,450.79 | 0.25 | 新股锁定 |

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。

7.12.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|--------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 1,728 | 129,222.84 | 2,000,125.00 | 0.90% | 221,296,941.60 | 99.10% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00 | 0.00% |

注：本报告期期末基金管理人所有从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|--------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 2,306 | 144,142.27 | 2,000,125.00 | 0.60% | 330,391,939.70 | 99.40% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员 持有本基金 | 0.00 | 0.00% |

注：本报告期期末基金管理人所有从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|-------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部 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 |

§ 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日基金份额总额 | 223,297,066.60 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 223,297,066.60 |

注：1 此表中合同生效日指本基金的转型日，即本基金于 2017年 4月 14日起转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金。

2 报告期期间指 2017年 4月 14日起至 2017年 6月 30日止。报告期期初指 2017年 4月 13日，报告期期末指 2017年 6月 30日。

§ 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日基金份额总额 | 2,988,454,525.12 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,282,251,835.46 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 41,770.79 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 1,949,901,541.55 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 332,392,064.70 |

注：报告期期间指 2017 年 1 月 1 起日至 2017 年 4 月 13 日止。报告期期初指 2016 年 12 月 31 日，报告期期末指 2017 年 4 月 13 日。

§ 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未发生重大人事变动。

二、报告期内基金托管人未发生重大变动。

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

本基金由银河泽利保本混合型证券投资基金于 2017 年 4 月 14 日转型为银河丰利纯债债券行证券投资基金，转型前投资策略仍按原来的不变，转型后本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

| | 数量 | 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 | 753,029.19 | 100.00% | 686.27 | 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。

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 | | | 121,700,000.00 | 100.00% | | |

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

| | 数量 | 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 | | 197,529,889.82 | 100.00% | 89,952.67 | 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。

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 | 239,280,060.49 | 100.00% | 627,000,000.00 | 100.00% | | |

10.9 其他重大事件（转型后）

| 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变 | 《中国证券报》、《证 | 2017年 1月 6日 |

| | | | |
|---|--|------------------------------------|--------------|
| | 更注册地址名称的公告 | 券时报》、《上海证券报》、公司网站 | |
| 2 | 银河基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京肯特瑞财富投资管理有限公司基金定投业务最少定投金额的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 1月 11日 |
| 3 | 银河泽利保本混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 1月 20日 |
| 4 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 2月 18日 |
| 5 | 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 | 2017年 2月 23日 |
| 6 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 2月 27日 |
| 7 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 3月 10日 |
| 8 | 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保本周期到期的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 3月 24日 |
| 9 | 关于开通银河泽利保本混合型 | 《中国证券报》、《证 | 2017年 3月 31日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------------|--------------|
| | 证券投资基金到期期间转换业务的公告 | 券时报》、《上海证券报》、公司网站 | |
| 10 | 关于修订银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 3月 31日 |
| 11 | 银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金后运作的相关业务规则公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 3月 31日 |
| 12 | 银河泽利保本混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 3月 31日 |
| 13 | 关于银河泽利保本混合型证券投资基金暂停申购（含转换转入及定期定额投资）转托管业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 4月 5日 |
| 14 | 关于银河丰利纯债债券型证券投资基金（原银河泽利保本混合型证券投资基金）暂停赎回、转换转出业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 4月 11日 |
| 15 | 关于旗下部分基金新增南京银行股份有限公司为代销机构的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 4月 18日 |
| 16 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 | 2017年 4月 19日 |

| | | | |
|----|--|--|--------------|
| | 的公告 | 公司网站 | |
| 17 | 银河泽利保本混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站 | 2017年 4月 21日 |
| 18 | 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 | 2017年 4月 24日 |
| 19 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中民财富管理（上海）有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站 | 2017年 4月 28日 |
| 20 | 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 | 2017年 5月 23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 | 2017年 6月 1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 | 2017年 6月 15日 |
| 23 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、 公司网站 | 2017年 6月 30日 |

10.9 其他重大事件（转型前）

| 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变更注册地址名称的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 1月 6日 |
| 2 | 银河基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京肯特瑞财富投资管理有限公司基金定投业务最少定投金额的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 1月 11日 |
| 3 | 银河泽利保本混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 1月 20日 |
| 4 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 2月 18日 |
| 5 | 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 | 2017年 2月 23日 |
| 6 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 2月 27日 |
| 7 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 3月 10日 |
| 8 | 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保本周期到期的提示性公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 3月 24日 |
| 9 | 关于开通银河泽利保本混合型证券投资基金到期期间转换业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 3月 31日 |
| 10 | 关于修订银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 3月 31日 |
| 11 | 银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金后运作的相关业务规则公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 3月 31日 |
| 12 | 银河泽利保本混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 3月 31日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------------|--------------|
| 13 | 关于银河泽利保本混合型证券投资基金暂停申购（含转换转入及定期定额投资）转托管业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 4月 5日 |
| 14 | 关于银河丰利纯债债券型证券投资基金（原银河泽利保本混合型证券投资基金）暂停赎回、转换转出业务的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站 | 2017年 4月 11日 |
| 15 | 关于旗下部分基金新增南京银行股份有限公司为代销机构的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 4月 18日 |
| 16 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 4月 19日 |
| 17 | 银河泽利保本混合型证券投资基金 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 4月 21日 |
| 18 | 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 | 2017年 4月 24日 |
| 19 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中民财富管理（上海）有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站 | 2017年 4月 28日 |
| 20 | 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 | 2017年 5月 23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 | 2017年 6月 1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 | 2017年 6月 15日 |
| 23 | 银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、公司网站 | 2017年 6月 30日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2017年 4月 14日起，“银河泽利保本混合型证券投资基金”转型为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。银河丰利纯债债券型证券投资基金基金合同及托管协议即日生效。

§ 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

12.2 存放地点

中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道 1568号 15楼

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38568888 /400-820-0860

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司

2017年 8月 29日