

银河研究精选混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 26 日

§1 重要提示

银河研究精选混合型证券投资基金由银丰证券投资基金转型而来。银丰证券投资基金转型获中国证监会证监许可【2017】829 号文《关于准予银丰证券投资基金变更注册的批复》批复，并于 2017 年 7 月 13 日经银丰证券投资基金基金份额持有人大会决议通过。自 2017 年 7 月 27 日起，由《银丰证券投资基金基金合同》修订而成的《银河研究精选混合型证券投资基金基金合同》生效，原《银丰证券投资基金基金合同》同日起失效。

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告编制期间说明：

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。原银丰证券投资基金的报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 2017 年 7 月 26 日止，银河研究精选混合型证券投资基金基金报告期自 2017 年 7 月 27 日起至 2017 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	银河研究精选混合
场内简称	-
交易代码	150968
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 27 日
报告期末基金份额总额	3,071,834,352.62 份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过对行业

	发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入研究，精选出质地优秀、成长性良好的公司进行投资，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券（含可分离交易的可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。</p> <p>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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 45%-90%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

转型前：

基金简称	基金银丰
场内简称	-
交易代码	500058
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002 年 8 月 15 日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份

投资目标	本基金为平衡型基金，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。
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的精选个股相结合的投资策略。在正常的市场情况下，股票投资比例变动范围是：基金资产的 25%-75%；债券投资比例变动范围是：基金资产的 25%-55%；现金资产比例的变动范围是：基金资产的 0%-20%。
业绩比较基准	上证 A 股指数涨跌幅 * 75% + 同期国债收益率 * 25%。
风险收益特征	本基金为封闭式平衡型基金，在证券投资基金中属风险相对较低品种，其风险与收益特征从长期平均及预期来看介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间，或介于单纯的成长型组合与单纯的价值型组合之间，力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看大于比较基准的单位风险收益值。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月27日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	35,958,675.66
2. 本期利润	81,805,784.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0266
4. 期末基金资产净值	3,139,848,052.32
5. 期末基金份额净值	1.0221

注：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。

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

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月1日—2017年7月26日）
1. 本期已实现收益	16,653,127.51
2. 本期利润	-41,978,294.09
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0140
4. 期末基金资产净值	3,042,969,762.73
5. 期末基金份额净值	1.014

注：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。

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

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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

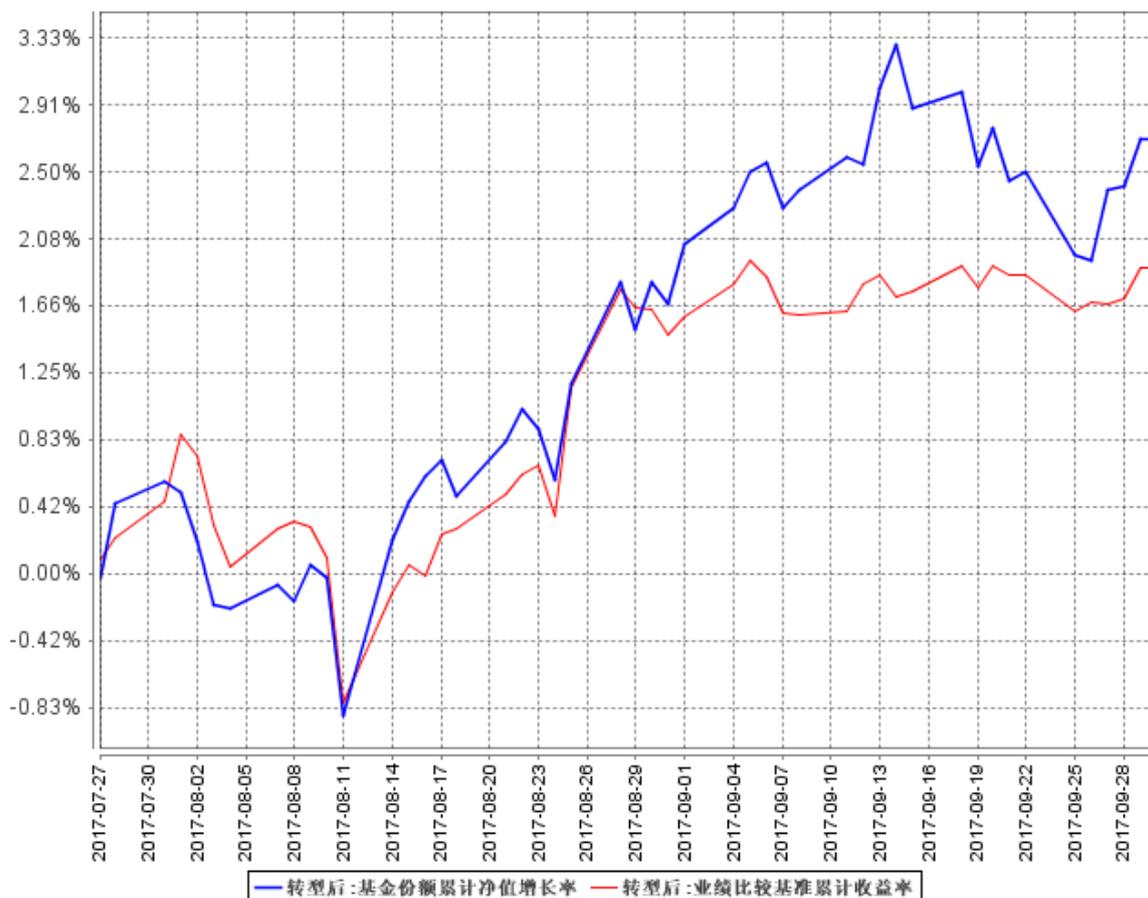
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	2.70%	0.34%	1.91%	0.27%	0.79%	0.07%

注：1、过去三个月指 2017 年 7 月 27 日起至 2017 年 9 月 30 日止。

2、本基金（转型后）的整体业绩比较基准采用：沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



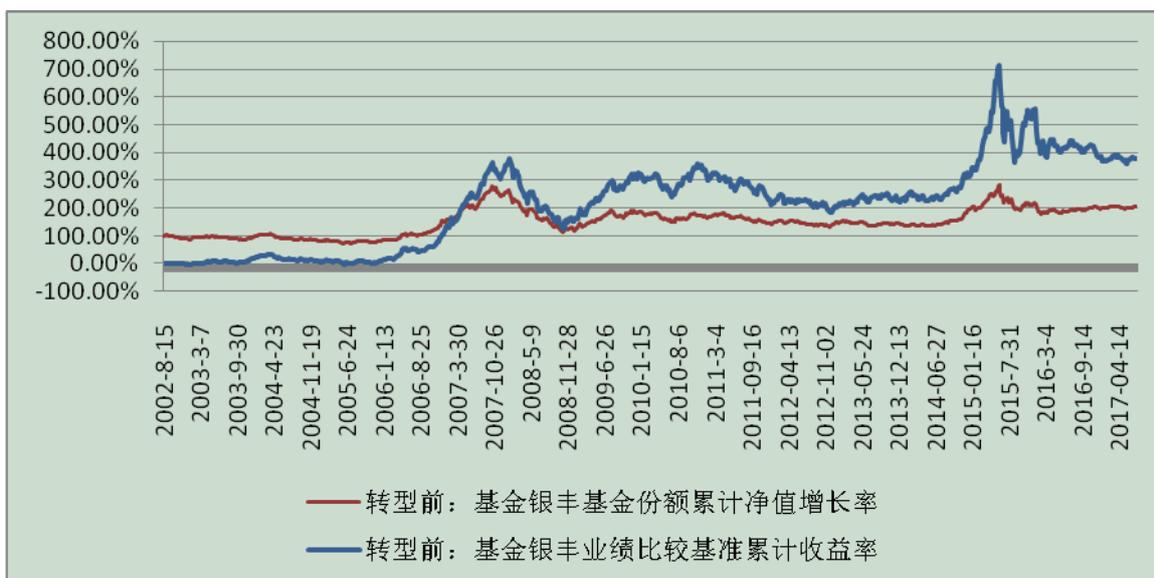
注：本基金由银丰证券投资基金转型而来，转型生效日为 2017 年 7 月 27 日。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-1.36%	0.28%	1.30%	0.22%	-2.66%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
神玉飞	基金经理	2016年2月2日	2017年4月8日	9	中共党员，博士研究生学历，9年证券从业经历。2007年9月加入银河基金管理有限公司，曾担任宏观策略研究员、行业研究员、基金经理助理等职，期间主要从事宏观策略行业研究和股票投资策略研究工作。2012年12月起担任银丰证券投资基金的基金经理，2015年12月起担任银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

- 注：1、上表中任职日期为该基金合同生效之日。
- 2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
神玉飞	基金经理	2017 年 7 月 27 日	-	9	中共党员，博士研究生学历，9 年证券从业经历。2007 年 9 月加入银河基金管理有限公司，曾担任宏观策略研究员、行业研究员、基金经理助理等职，期间主要从事宏观策略行业研究和股票投资策略研究工作。2015 年 12 月起担任银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月起担任银河研究精选混合型证券投资基金的基金经理。

- 注：1、上表中任职日期为该基金合同生效之日。
- 2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项管理办法、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚实信用、勤奋律己、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金持有人的利益，无损害基金持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤奋律己、创新图强”的理念，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定，进一步加强风险管理和完善内部控制体系，为基金份额持有人谋求长期稳健的风险回报。

4.3 公平交易专项说明

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，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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年 3 季度初，本基金管理人判断 3 季度市场存在大幅波动的风险，应该警惕市场上涨后的回调风险；三季度初整体控制仓位均衡配置思路为主，重点配置了具备建筑建材、轻工、家电、电子、计算机和新能源等行业。

回顾 2017 年 3 季度市场走势，本基金管理人对 3 季度的市场判断基本正确，三季度初，市场经历了小幅调整后持续上涨，但是季度末市场又出现了一定的调整。截至 9 月 30 日，三季度上证指数、中小板指数和创业板指数分别上涨 4.9%、8.86% 和 2.69%。分行业来看，涨幅居前的行业依次为有色金属、钢铁、煤炭、建材和非银行金融；涨幅居后的行业依次为传媒、医药、公

用事业、纺织服装和军工。

回顾重点投资行业的三季度表现，除了建材、计算机和新能源表现还可以外，其他配置表现一般。银丰基金已经于 2017 年 7 月 27 日转型为银河研究精选，考虑到银河研究精选将面临封转开赎回压力，本基金管理人在三季度一直处于持续降低了股票仓位，随着市场调整的深入，本基金管理人逐渐提高了股票仓位，同时通过调整持仓结构参与结构性的机会来赢得收益。相对于今年二季度，本基金管理人大幅降低了轻工制造、军工和新能源产业链的配置比例，适当增加了水泥、房地产和金融的配置比例。

截止 2017 年 9 月 30 日，银河研究精选投资基金净值上涨 4.04%。总结存在以下几点教训：

(1) 行业和个股配置出现了很大偏差，对于三季度表现较好的煤炭行业的配置比例为零，同时对于有色和钢铁的配置比例也偏低；(2) 个股配置在三季度出现了一定的钝化，配置效率不高，对于三季度这样一个趋势性很强的市场，本基金管理人未能积极紧随市场趋势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后（2017 年 7 月 27 日-2017 年 9 月 30 日）：

本报告期基金份额增长率为 2.70%，同期业绩比较基准收益率为 1.91%。

转型前（2017 年 7 月 1 日-2017 年 7 月 27 日）：

本报告期基金份额增长率为-1.36%，同期业绩比较基准收益率为 1.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,534,184,254.12	48.67
	其中：股票	1,534,184,254.12	48.67
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	10,062,000.00	0.32
	其中：债券	10,062,000.00	0.32
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,430,000,000.00	45.36
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	174,979,547.90	5.55
8	其他资产	3,116,142.88	0.10
9	合计	3,152,341,944.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,226,408,124.92	39.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,290,385.45	0.10
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	136,996,026.58	4.36
K	房地产业	165,271,615.79	5.26
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	2,174,100.88	0.07
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	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,534,184,254.12	48.86

5.2.2 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港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002026	山东威达	13,801,449	130,975,751.01	4.17
2	002372	伟星新材	7,300,000	126,290,000.00	4.02
3	000333	美的集团	2,800,000	123,732,000.00	3.94
4	600585	海螺水泥	4,500,000	112,365,000.00	3.58
5	002138	顺络电子	4,749,925	98,988,437.00	3.15
6	002475	立讯精密	3,600,000	74,376,000.00	2.37
7	002013	中航机电	6,199,942	73,655,310.96	2.35
8	603589	口子窖	1,499,896	73,314,916.48	2.33
9	603660	苏州科达	1,600,000	69,888,000.00	2.23
10	000002	万科A	2,500,000	65,625,000.00	2.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,062,000.00	0.32
	其中：政策性金融债	10,062,000.00	0.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,062,000.00	0.32

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110226	11 国开 26	100,000	10,062,000.00	0.32

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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：本基金未进行贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注**5.11.1**

本基金投资的前十名证券中，没有发行主体被监管部门立案调查的情形，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	493,937.44
2	应收证券清算款	2,869,541.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-247,336.00
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,116,142.88

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之和之间可能存在尾差。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,592,029,498.85	51.73
	其中：股票	1,592,029,498.85	51.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	844,765,867.40	27.45
	其中：债券	844,765,867.40	27.45
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	540,000,000.00	17.55
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	77,563,393.32	2.52
8	其他资产	23,435,096.13	0.76
9	合计	3,077,793,855.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,750,000.00	0.22

B	采矿业	-	-
C	制造业	1,291,671,673.46	42.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,535.05	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	44,308,314.64	1.46
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	52,198,261.78	1.72
J	金融业	147,866,925.40	4.86
K	房地产业	46,837,751.68	1.54
L	租赁和商务服务业	19,604.10	0.00
M	科学研究和技术服务业	105,998.90	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,253,433.84	0.07
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	1,592,029,498.85	52.32

5.2.2 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港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002372	伟星新材	8,800,000	158,928,000.00	5.22
2	000333	美的集团	3,500,000	148,190,000.00	4.87
3	002026	山东威达	13,000,000	110,760,000.00	3.64
4	002475	立讯精密	5,150,000	108,665,000.00	3.57
5	002013	中航机电	9,749,995	100,717,448.35	3.31
6	600885	宏发股份	1,899,929	77,517,103.20	2.55
7	002138	顺络电子	3,999,925	73,158,628.25	2.40
8	600038	中直股份	1,599,814	71,015,743.46	2.33
9	603660	苏州科达	1,950,000	70,492,500.00	2.32
10	002050	三花智控	3,999,841	65,597,392.40	2.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	472,852,352.80	15.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	291,163,947.20	9.57
	其中：政策性金融债	291,163,947.20	9.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	80,749,567.40	2.65
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	844,765,867.40	27.76

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018002	国开 1302	2,199,980	225,805,947.20	7.42
2	019546	16 国债 18	1,900,090	189,856,992.80	6.24
3	010107	21 国债(7)	1,805,000	184,290,500.00	6.06
4	019313	13 国债 13	500,000	49,840,000.00	1.64
5	113009	广汽转债	330,000	41,794,500.00	1.37

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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：本基金未进行贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券中，没有发行主体被监管部门立案调查的情形，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	566,659.42
2	应收证券清算款	5,226,190.48
3	应收股利	-
4	应收利息	17,642,246.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,435,096.13

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

1	113009	广汽转债	41,794,500.00	1.37
2	110031	航信转债	38,413,400.00	1.26

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002026	山东威达	110,760,000.00	3.64	重大事项
2	002013	中航机电	100,717,448.35	3.31	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之和之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2017年7月27日）基金份 额总额	3,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	71,834,352.62
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）	-
报告期期末基金份额总额	3,071,834,352.62

注：表格中申购份额为基金折算产生。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

注：本报告期基金管理人持有本基金份额未发生变动。

6.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细（转型后）

注：本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：本报告期基金管理人持有本基金份额未发生变动。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

银河研究精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由银丰证券投资基金（以下简称“基金银丰”）转型而成。基金转型事项获中国证监会 2017 年 6 月 1 日《关于准予银丰证券投资基金变更注册的批复》（证监许可 [2017]829 号）批复，并于 2017 年 7 月 13 日经银丰证券投资基金基金份额持有人大会决议通过。自 2017 年 7 月 27 日起，由《银丰证券投资基金基金合同》修订而成的《银河研究精选混合型证券投资基金基金合同》生效，原《银丰证券投资基金基金合同》同日失效。

§9 备查文件目录

备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河研究精选混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河研究精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河研究精选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、银河研究精选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

9.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层
北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

9.3 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 10 月 26 日