

银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资
基金
2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司(以下简称兴业银行)根据本基金合同规定，于 2018 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河沪深 300 成长分级		
场内简称	银河增强		
基金主代码	161507		
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	2013 年 3 月 29 日		
基金管理人	银河基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	12,504,379.23 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2013 年 6 月 6 日		
下属分级基金的基金简称	银河沪深 300 成长分级	银河沪深 300 成长分级 A	银河沪深 300 成长分级 B
下属分级基金的场内简称	银河增强	银河优先	银河进取
下属分级基金的交易代码	161507	150121	150122
报告期末下属分级基金份额总额	7,100,325.23 份	2,702,027.00 份	2,702,027.00 份

2.2 基金产品说明

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%。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在有效复制目标指数的基础上，在一定程度内调整个股在投资组合中的权重，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金将利用数量化模型，对跟踪误差及其相关指标进行动态管理，根据结果对基金投资组合进行相应调整；并将定期或不定期对数量化模型进行优化改善，力求减少跟踪误差，改进指数跟踪效果。
业绩比较基准	沪深 300 成长指数收益率*95% + 活期存款利率（税后）*5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，银河沪深 300 成长优先份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银河沪深 300 成长进取份额具有高风险、高预期收益的特征。

下属分级基金的风险收益特征	-	银河沪深 300 成长优先份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	银河沪深 300 成长进取份额具有高风险、高预期收益的特征。
---------------	---	---------------------------------	--------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	吴荣
	联系电话	021-38568989	021-62677777-213117
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	011693@cib.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95561
传真		021-38568769	021-62535823

2.4 信息披露方式

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、上海市静安区江宁路 168 号兴业大厦 20 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	1,372,317.20	-3,763,493.22	68,751,908.24
本期利润	4,650,158.60	-5,442,485.29	52,364,516.75
加权平均基金份额本期利润	0.2157	-0.1530	0.6481
本期基金份额净值增长率	19.16%	-10.83%	15.18%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4093	0.2026	0.3464
期末基金资产净值	16,409,826.85	26,499,785.72	50,258,696.96
期末基金份额净值	1.312	1.126	1.294

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.21%	0.88%	9.17%	0.91%	-3.96%	-0.03%
过去六个月	8.16%	0.75%	13.20%	0.78%	-5.04%	-0.03%
过去一年	19.16%	0.68%	26.45%	0.69%	-7.29%	-0.01%
过去三年	22.39%	1.66%	24.56%	1.58%	-2.17%	0.08%
过去五年	0.00%	1.46%	0.00%	1.46%	0.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	45.09%	1.46%	56.30%	1.46%	-11.21%	0.00%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 成长指数收益率*95% + 活期存款利率（税后）*5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

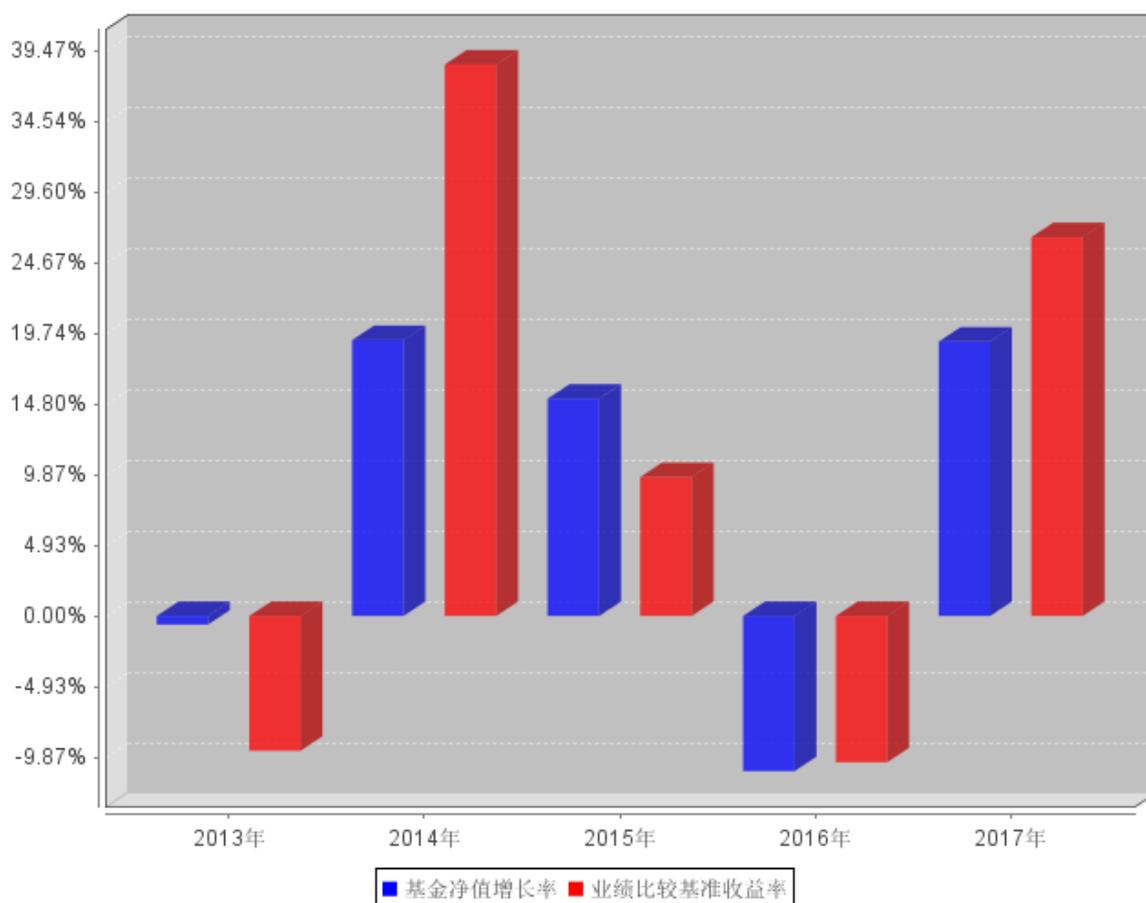
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：2013 年 03 月 29 日本基金成立，根据《银河沪深 300 成长增强指数分级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。截止本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自基金合同生效日(2013年03月29日)至报告期末未进行利润分配。

§ 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成立于2002年6月14日，是经中国证券监督管理委员会按照市场化机制批准成立的第一家基金管理公司（俗称：“好人举手第一家”），是中央汇金公司旗下专业资产管理机构。

银河基金公司的经营范围包括发起设立、管理基金等，注册资本2亿元人民币，注册地中国上海。银河基金公司的股东分别为：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。

截至 2017 年末, 银河基金公司旗下共管理 47 只公募基金产品: 银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联系列证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金 (LOF)、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河润利保本混合型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君欣纯债债券型证券投资基金、银河君腾灵活配置混合型证券投资基金、银河彝利灵活配置混合型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金、银河量化价值混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗博	基金经理	2013 年 3 月 29 日	-	12	中共党员，博士研究生学历，12 年证券从业经历。曾就职于华夏银行，中信万通证券有限公司，期间从事企业金融、投资

					<p>银行业务及上市公司购并等工作。</p> <p>2006 年 2 月加入银河基金管理有限公司，历任产品设计经理、衍生品量化投资研究员、行业研究员等职务，现担任基金经理。2009 年 12 月起担任银河沪深 300 价值指数证券投资基金的基金经理，</p> <p>2013 年 3 月起担任银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金的基金经理，</p> <p>2014 年 3 月担任银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金的基金经理，</p> <p>2016 年 12 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，2017 年 9 月起担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、上表中任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤奋律己、创新图强”的理念，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定，进一步加强风险管理

和完善内部控制体系，为基金份额持有人谋求长期稳健的风险回报。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，对组合参照指数成份股进行标准化配置，整体来看，蓝筹股的表现好于成长股的表现。

二、三季度，对指数样本股，采用行业中性策略进行指数权重的配置，对市场增强部分，采用量化增强的策略。

四季度，基本上回归了指数标准权重的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.312 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.16%，业绩比较基准收益率为 26.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.5.1 宏观经济和证券市场走势判断

从宏观的角度

一季度，通胀无忧，出口、消费和基建投资将发挥主要的经济拉动作用，宏观经济短期虽有下行波动，但看不到大的风险因素，支持龙头企业利润的改善和市场的震荡上行。风险因素在于美国加息

从量化投资的角度

通过以上的分析，我们可以看到，短期来看市场的上涨可以用动量的因素来解释，利润的增长和企业经营能力的提升对强势品种的上涨，不足以提供充分的解释。一季度会逐渐面临估值切换和一季报的预期，业绩的因素会逐渐增强，

风险因素在于美国持续的加息，对实体经济构成压力。

4.5.2 行业配置策略

本基金的市场组合，采用基本面分析选股的策略，主要关注以下投资机会：

关注价值投资的主线，以及龙头企业持续的竞争优势。

关注消费升级带来的各行业持续性的业绩增长。

中国经济走到今天，人口红利已经释放完毕，接下来促进中国经济增长的红利是智力红利，体现在创新和劳动生产率的提升。包括一些技术创新性公司和智能制造类的公司，以及企业级服务的公司具有持续的投资价值。

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

根据《基金合同》有关规定，本基金在存续期内不进行收益分配。

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

本报告期内，《公开募集证券投资基金运作管理办法》实施后，本基金已连续 60 个工作日出现资产净值低于五千万元的情形。我司已于 2016 年 4 月向中国证券监督管理委员会提交了《关于银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金基金净值连续 60 个交易日低于 5000 万元解决方案的报告》。

§ 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

本报告期，兴业银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《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，完全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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

本报告期内本基金由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)出具无保留意见审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		1,059,215.02	2,193,185.01
结算备付金		29,821.81	10,800.47
存出保证金		3,443.81	5,013.85
交易性金融资产		15,501,167.67	24,526,264.38
其中：股票投资		15,447,667.67	24,526,264.38
基金投资		-	-
债券投资		53,500.00	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		993.30	1,145.38
应收股利		-	-
应收申购款		4,351.37	473.72
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		16,598,992.98	26,736,882.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		21,336.07	3,608.08
应付管理人报酬		19,154.83	29,743.64
应付托管费		3,830.94	5,948.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		28,757.76	21,235.62
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		116,086.53	176,561.05
负债合计		189,166.13	237,097.09
所有者权益:			
实收基金		11,291,937.17	21,731,176.94
未分配利润		5,117,889.68	4,768,608.78
所有者权益合计		16,409,826.85	26,499,785.72
负债和所有者权益总计		16,598,992.98	26,736,882.81

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.312 元，其中优先份额参考净值为 1.050 元，进取份额参考净值为 1.574 元，成长份额的基金份额净值为 1.312 元。基金份额总额 12,504,379.23 份，其中优先份额的基金份额为 2,702,027.00 份，进取份额的基金份额为 2,702,027.00 份，成长份额的基金份额为 7,100,325.23 份。

7.2 利润表

会计主体：银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		5,484,181.30	-4,435,047.21
1.利息收入		30,414.68	48,847.85
其中：存款利息收入		30,406.62	48,847.85
债券利息收入		8.06	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,168,252.38	-2,827,249.97
其中：股票投资收益		1,767,138.19	-3,603,167.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益		4,402.69	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		396,711.50	775,917.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		3,277,841.40	-1,678,992.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		7,672.84	22,346.98
减：二、费用		834,022.70	1,007,438.08
1.管理人报酬		258,157.48	397,482.00
2.托管费		51,631.50	79,496.50
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		99,467.49	95,517.64
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		424,766.23	434,941.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,650,158.60	-5,442,485.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,650,158.60	-5,442,485.29

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	21,731,176.94	4,768,608.78	26,499,785.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,650,158.60	4,650,158.60
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）	-10,439,239.77	-4,300,877.70	-14,740,117.47
其中：1. 基金申购款	2,012,554.59	814,036.01	2,826,590.60
2. 基金赎回款	-12,451,794.36	-5,114,913.71	-17,566,708.07
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）	11,291,937.17	5,117,889.68	16,409,826.85
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	36,809,761.61	13,448,935.35	50,258,696.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,442,485.29	-5,442,485.29
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）	-15,078,584.67	-3,237,841.28	-18,316,425.95
其中：1. 基金申购款	6,876,225.21	1,100,060.10	7,976,285.31

2. 基金赎回款	-21,954,809.88	-4,337,901.38	-26,292,711.26
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）	21,731,176.94	4,768,608.78	26,499,785.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金(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[2012]1594 号《关于核准银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由银河基金管理有限公司作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2013 年 3 月 29 日生效，首次设立募集规模为 414,991,791.49 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、权证、央行票据、现金、股指期货等，以及法律法规及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得相关规定）。股票投资包括沪深 300 成长指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）等。

以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并依法进行投资管理。

本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 成长指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。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，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。如法律法规允许，本基金可以将股票投资比例提高到基金资产净值的 100%，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 成长指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%。

7.4.2 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计估计的变更在 7.4.5.2 会计估计变更的说明中披露，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 12 月 20 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益均无影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税

政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 企业所得税

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

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

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

7.4.6.4 个人所得税

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

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

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

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

7.4.7 关联方关系

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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未产生应支付关联方佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	258,157.48	397,482.00
其中：支付销售机构的客户维护费	41,492.53	264,704.99

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,631.50	79,496.50

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 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、公休日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期末产生销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	银河沪深 300 成长分级	银河沪深 300 成长分级 A	银河沪深 300 成长分 级 B
基金合同生效日（ 2013 年 3 月 29 日） 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	6,966,193.70	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	156,422.66	-	-
减：期间赎回/卖出总 份额	7,122,616.36	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	-

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	银河沪深 300 成长分级	银河沪深 300 成长分级 A	银河沪深 300 成长分 级 B
基金合同生效日 （2013 年 3 月 29 日）持有的基金 份额	-	-	-
期初持有的基金份额	6,786,107.83	-	-
期间申购/买入总份 额	-	-	-
期间因拆分变动份额	180,085.87	-	-
减：期间赎回/卖出 总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	6,966,193.70	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	29.6003%	-	-

注：(1)期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

(2)根据《银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金基金合同》、《关于银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金定期份额折算结果公告》，管理人以 2017 年 1 月 3 日为基金份额折算基准日，本期管理人持有本基金份额的增加全部来自于份额折算。

7.4.8.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 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1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,059,215.02	29,414.32	2,193,185.01	48,194.47

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2017年12月26日	2018年1月3日	未上市的配股	11.06	53.21	420	4,645.20	22,348.20	-

7.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017年12月5日	2018年1月12日	认购新发证券	100.00	100.00	518	51,800.00	51,800.00	-
128028	赣锋转债	2017年12月21日	2018年1月19日	认购新发证券	100.00	100.00	17	1,700.00	1,700.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项停牌	14.59	-	-	19,300	566,252.62	281,587.00	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项停牌	37.94	-	-	5,400	137,160.00	204,876.00	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项停牌	52.04	-	-	2,800	299,253.66	145,712.00	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项停牌	7.35	-	-	13,400	134,382.48	98,490.00	-
300104	乐视网	2017年4月17日	重大事项停牌	3.91	2018年1月24日	13.80	16,000	434,766.30	62,560.00	-
600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大事项停牌	17.40	-	-	2,400	50,388.97	41,760.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 14,590,334.47 元，属于第二层次的余额为人民币 848,273.2 元，属于第三层次余额为人民币 62,560.00 元（于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 23,014,388.51 元，属于第二层次的余额为人民币 1,511,875.87 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

上年度末余额人民币 0.00 元，2017 年度转入第三层次人民币 245,440.00 元，转出第三层次人民币 0.00 元，当期计入损益的利得或损失总额人民币-182,880.00 元，购买人民币 0.00 元，出售人民币 0.00 元，本期末余额人民币 62,560.00 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动人民币-182,880.00 元。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	15,447,667.67	93.06
	其中：股票	15,447,667.67	93.06
2	固定收益投资	53,500.00	0.32

	其中：债券	53,500.00	0.32
	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	1,089,036.83	6.56
7	其他各项资产	8,788.48	0.05
8	合计	16,598,992.98	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	47,574.00	0.29
B	采矿业	112,236.00	0.68
C	制造业	6,078,909.11	37.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,267.68	0.11
E	建筑业	320,080.39	1.95
F	批发和零售业	165,277.90	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	70,196.47	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	385,773.46	2.35
J	金融业	6,211,360.04	37.85
K	房地产业	825,486.75	5.03
L	租赁和商务服务业	270,842.26	1.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	137,653.19	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	113,596.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	249,378.40	1.52

S	综合	-	-
	合计	15,006,631.65	91.45

8.2.2 期末积极投资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	378,476.02	2.31
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	62,560.00	0.38
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	441,036.02	2.69

8.3 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

8.3.1 指数投资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

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	601318	中国平安	36,500	2,554,270.00	15.57
2	600519	贵州茅台	1,719	1,198,985.31	7.31
3	600036	招商银行	35,066	1,017,615.32	6.20
4	600016	民生银行	83,813	703,191.07	4.29
5	000333	美的集团	12,213	676,966.59	4.13
6	600000	浦发银行	48,188	606,686.92	3.70
7	000001	平安银行	42,008	558,706.40	3.40
8	002415	海康威视	9,691	377,949.00	2.30
9	600276	恒瑞医药	4,699	324,137.02	1.98
10	600048	保利地产	21,821	308,767.15	1.88

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 积极投资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

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	600485	信威集团	19,300	281,587.00	1.72
2	300104	乐视网	16,000	62,560.00	0.38
3	002129	中环股份	4,798	55,129.02	0.34
4	600666	奥瑞德	2,400	41,760.00	0.25

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	2,042,701.00	7.71
2	600036	招商银行	1,207,659.00	4.56
3	600015	华夏银行	692,868.00	2.61
4	601997	贵阳银行	657,854.00	2.48

5	600000	浦发银行	514,034.00	1.94
6	002415	海康威视	509,179.00	1.92
7	600518	康美药业	352,389.00	1.33
8	600016	民生银行	335,798.00	1.27
9	600690	青岛海尔	313,301.00	1.18
10	002027	分众传媒	307,135.00	1.16
11	000415	渤海金控	304,520.00	1.15
12	600816	安信信托	299,767.00	1.13
13	600048	保利地产	291,269.00	1.10
14	601012	隆基股份	264,878.00	1.00
15	601211	国泰君安	262,961.56	0.99
16	000413	东旭光电	243,581.00	0.92
17	002008	大族激光	237,575.00	0.90
18	300136	信维通信	230,755.00	0.87
19	600606	绿地控股	224,733.00	0.85
20	000538	云南白药	208,541.35	0.79

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	601318	中国平安	2,603,424.00	9.82
2	002142	宁波银行	1,942,630.32	7.33
3	000333	美的集团	1,480,671.19	5.59
4	601009	南京银行	1,382,621.56	5.22
5	000001	平安银行	1,356,196.00	5.12
6	600519	贵州茅台	1,125,151.00	4.25
7	600000	浦发银行	1,012,461.97	3.82
8	600015	华夏银行	918,526.24	3.47
9	600016	民生银行	850,261.64	3.21
10	002736	国信证券	739,714.00	2.79
11	600036	招商银行	685,884.00	2.59
12	000686	东北证券	532,994.52	2.01
13	601997	贵阳银行	521,748.44	1.97
14	002415	海康威视	500,507.82	1.89
15	601211	国泰君安	496,112.00	1.87

16	601668	中国建筑	469,356.92	1.77
17	000413	东旭光电	440,239.51	1.66
18	600276	恒瑞医药	403,113.98	1.52
19	600816	安信信托	376,968.78	1.42
20	600340	华夏幸福	324,598.42	1.22

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,537,834.73
卖出股票收入（成交）总额	37,661,411.03

注：买入股票成本及卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	53,500.00	0.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	53,500.00	0.33

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128024	宁行转债	518	51,800.00	0.32
2	128028	赣锋转债	17	1,700.00	0.01

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金依据基金合同的规定，以量化增强和控制跟踪误差相结合，现阶段未进行股指期货的投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金依据基金合同的规定，以量化增强和控制跟踪误差相结合，现阶段未进行股指期货的投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,443.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	993.30
5	应收申购款	4,351.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,788.48

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况

8.12.5.2 期末积极投资前五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	600485	信威集团	281,587.00	1.72	重大事项停牌
2	300104	乐视网	62,560.00	0.38	重大事项停牌
3	600666	奥瑞德	41,760.00	0.25	重大事项停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
银河沪深 300 成长分级	1,088	6,526.03	628,192.00	8.85%	6,472,133.23	91.15%
银河沪深 300 成长分级 A	125	21,616.22	1,481,635.00	54.83%	1,220,392.00	45.17%
银河沪深 300 成长分级 B	210	12,866.80	10,000.00	0.37%	2,692,027.00	99.63%
合计	1,345	9,296.94	2,119,827.00	16.95%	10,384,552.23	83.05%

9.2 期末上市基金前十名持有人

银河沪深 300 成长分级 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	511,200.00	4.09%
2	中国对外经济贸易信托有限公司-外贸信托-华夏未来泽时进取 6 号	464,606.00	3.72%
3	方春娣	159,342.00	1.27%
4	林炳权	159,300.00	1.27%
5	华夏未来资本管理有限公司-华夏未来添时 1 号基金	147,900.00	1.18%
6	华夏未来资本管理有限公司-华夏未	130,271.00	1.04%

	来润时量化 1 号私募证券投资基		
7	赖明理	120,500.00	0.96%
8	李大鹏	118,797.00	0.95%
9	张昕	105,712.00	0.85%
10	王书征	50,009.00	0.40%

银河沪深 300 成长分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	魏灵峰	579,037.00	4.63%
2	孔瑞珍	249,400.00	1.99%
3	洪一权	200,000.00	1.60%
4	丁贵怡	110,531.00	0.88%
5	陈敏芳	110,000.00	0.88%
6	雷春怡	102,741.00	0.82%
7	苏维维	102,584.00	0.82%
8	郁万福	100,000.00	0.80%
9	刘启凯	62,321.00	0.50%
10	沈汝干	60,000.00	0.48%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	银河沪深 300 成长分级	0.00	0.0000%
	银河沪深 300 成长分级 A	0.00	0.0000%
	银河沪深 300 成长分级 B	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银河沪深 300 成长分级	0
	银河沪深 300 成长分级 A	0
	银河沪深 300 成长分	0

	级 B	
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银河沪深 300 成长分级	0
	银河沪深 300 成长分级 A	0
	银河沪深 300 成长分级 B	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河沪深 300 成长分级	银河沪深 300 成长分级 A	银河沪深 300 成长分级 B
基金合同生效日（2013 年 3 月 29 日）	220,701,691.49	97,145,050.00	97,145,050.00
基金份额总额			
本报告期初基金份额总额	14,939,865.28	4,297,156.00	4,297,156.00
本报告期基金总申购份额	2,228,300.50	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	13,786,754.35	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	3,718,913.80	-1,595,129.00	-1,595,129.00
本报告期末基金份额总额	7,100,325.23	2,702,027.00	2,702,027.00

注：拆分变动份额为本基金三类份额之间的配对转换份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2017 年 9 月 28 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，由银河基金管理有限公司第四届董事会审议通过，秦长建先生担任公司的督察长，董伯儒先生不再担任公司督察长。

2、2017 年 12 月 9 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，由银河基金管理有限公司第四届董事会审议通过，刘立达先生调任公司董事长，许国平先生不再担任公司董事长。

3、2017 年 12 月 19 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，由银河基金管理有限公司第四届董事会审议通过，范永武先生担任公司总经理。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所，本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 5 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

国海证券	1	32,343,584.07	52.89%	30,122.00	53.43%	-
中信证券	1	28,814,048.05	47.11%	26,258.14	46.57%	-

注：1、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。

2、选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国海证券	27,404.50	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-------	----------------	------------

	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171219	6,966,193.70	156,422.66	7,122,616.36	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p>							

注：本期单一投资者申购份额为本基金折算增加份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

银河基金管理有限公司
2018 年 3 月 30 日