

# 银河研究精选混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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。

本报告中财务资料已经会计师事务所审计。

本报告编制期间说明：

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。原银丰证券投资基金的报告期自 2017 年 1 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 12 月 31 日止。

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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 基金名称         | 银河研究精选混合型证券投资基金    |
| 基金简称         | 银河研究精选混合           |
| 场内简称         | -                  |
| 基金主代码        | 150968             |
| 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 7 月 27 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       |
| 报告期末基金份额总额   | 1,038,577,161.09 份 |
| 基金合同存续期      | -                  |
| 基金份额上市的证券交易所 | -                  |
| 上市日期         | -                  |

### 2.1 基金基本情况（转型前）

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 基金名称         | 银丰证券投资基金           |
| 基金简称         | 基金银丰               |
| 场内简称         | -                  |
| 基金主代码        | 500058             |
| 前端交易代码       | -                  |
| 后端交易代码       | -                  |
| 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    |
| 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       |
| 报告期末基金份额总额   | 3,000,000,000.00 份 |
| 基金合同存续期      | -                  |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所            |
| 上市日期         | 2002 年 9 月 10 日    |

### 2.2 基金产品说明（转型后）

|      |                                                                       |
|------|-----------------------------------------------------------------------|
| 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

## 2.2 基金产品说明（转型前）

|        |                                                                                                                        |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。 |
|--|--------------------------------------------------------------|

### 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                    | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 秦长建                           | 田青                    |
|         | 联系电话 | 021-38568989                  | 010-67595096          |
|         | 电子邮箱 | qinchangjian@galaxyasset.com  | tianqingl.zh@ccb.com  |
| 客户服务电话  |      | 400-820-0860                  | 010-67595096          |
| 传真      |      | 021-38568769                  | 010-66275853          |
| 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 25 号       |
| 办公地址    |      | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码    |      | 200122                        | 100033                |
| 法定代表人   |      | 刘立达                           | 田国立                   |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                     |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》                                              |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.galaxyasset.com">http://www.galaxyasset.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 1. 上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼<br>2. 北京西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼               |

### §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

转型后

金额单位：人民币元

| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | 2017 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |
|----------------------|--------------------------------------------|
| 本期已实现收益              | 104,602,217.11                             |
| 本期利润                 | 143,379,343.07                             |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0667                                     |
| 本期加权平均净值利润率          | 6.49%                                      |
| 本期基金份额净值增长率          | 4.59%                                      |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2017 年 12 月 31 日                           |
| 期末可供分配利润             | 31,072,766.50                              |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0299                                     |
| 期末基金资产净值             | 1,081,059,416.45                           |
| 期末基金份额净值             | 1.0409                                     |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2017 年 12 月 31 日                           |
| 基金份额累计净值增长率          | 4.59%                                      |

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）。

转型前

金额单位：人民币元

| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | 2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 7 月 26 日 | 2016 年            | 2015 年           |
|----------------------|------------------------------------|-------------------|------------------|
| 本期已实现收益              | -207,539,604.83                    | 53,841,152.54     | 1,277,502,129.38 |
| 本期利润                 | -36,237,942.94                     | -1,353,953,025.08 | 2,007,964,580.40 |
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.0121                            | -0.4513           | 0.6693           |
| 本期加权平均净值利润率          | -1.19%                             | -37.62%           | 42.28%           |
| 本期基金份额净值增长率          | -1.17%                             | -26.63%           | 59.40%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2017 年 7 月 26 日                    | 2016 年末           | 2015 年末          |
| 期末可供分配利润             | -75,181,074.07                     | 79,207,705.67     | 1,038,517,378.22 |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.0251                            | 0.0264            | 0.3462           |
| 期末基金资产净值             | 3,042,969,762.73                   | 3,079,207,705.67  | 5,393,160,730.75 |
| 期末基金份额净值             | 1.014                              | 1.026             | 1.798            |

| 3.1.3 累计期末指标 | 2017 年 7 月 26 日 | 2016 年末 | 2015 年末 |
|--------------|-----------------|---------|---------|
| 基金份额累计净值增长率  | 375.93%         | 381.57% | 556.38% |

### 3.2 基金净值表现（转型后）

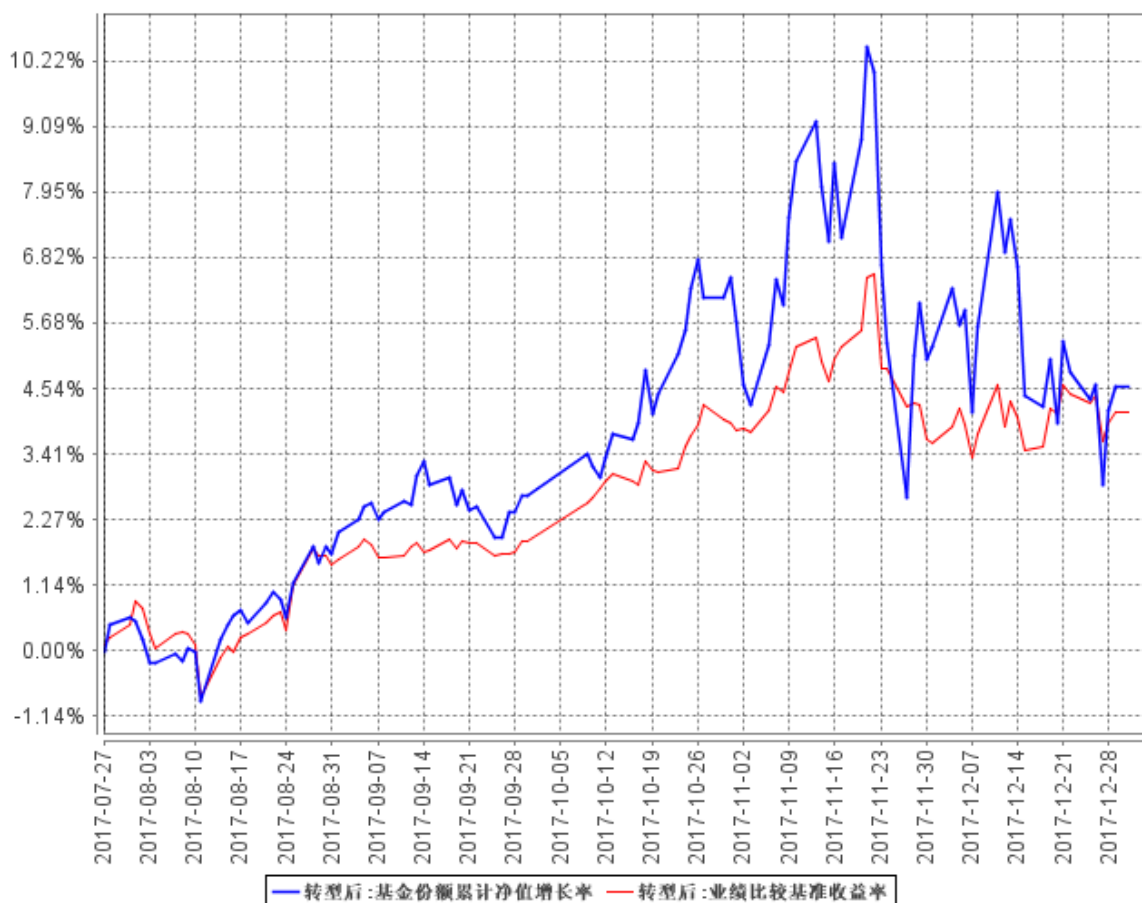
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | 1.84%    | 1.09%       | 2.19%      | 0.41%         | -0.35% | 0.68% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.59%    | 0.84%       | 4.14%      | 0.35%         | 0.45%  | 0.49% |

注：本基金的业绩比较基准为：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

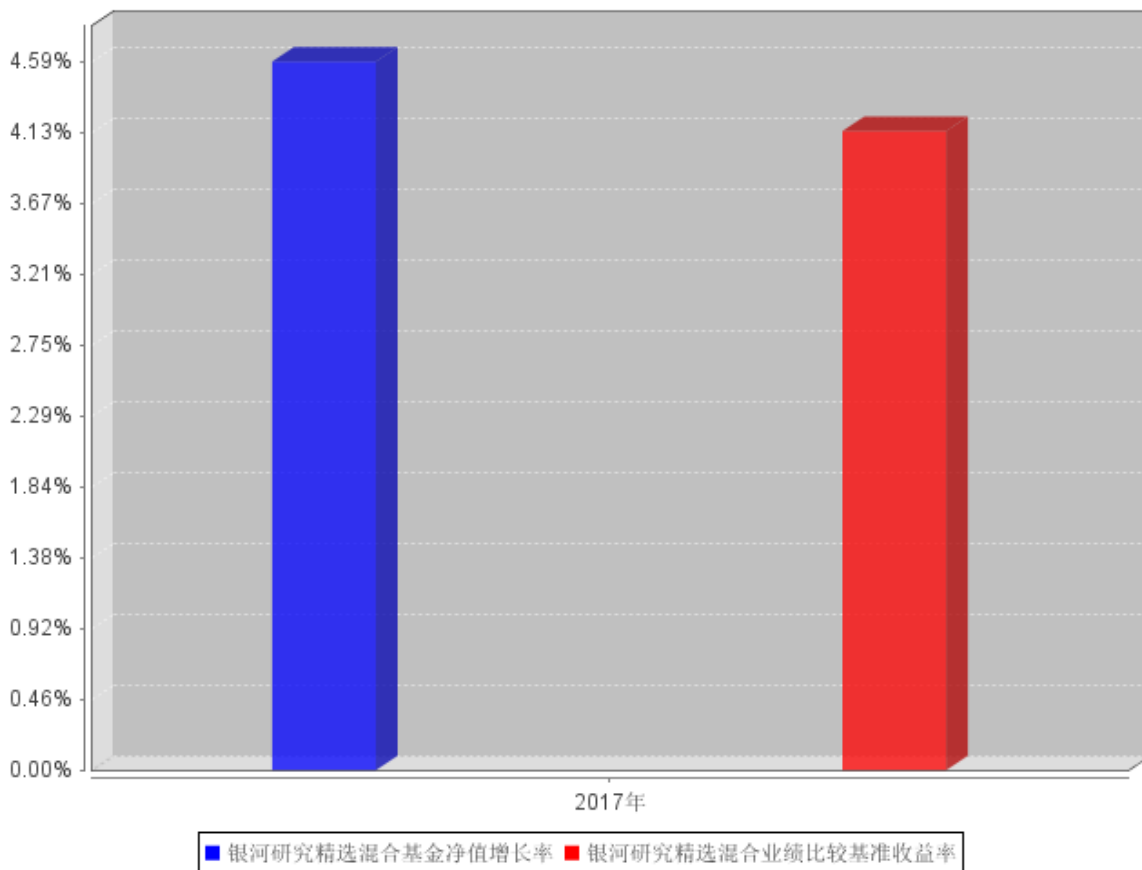
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。截止本报告期，

本基金自基金合同生效日起未满一年。

**3.2.3 自基金转型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**  
**银河研究精选混合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**



**3.2 基金净值表现（转型前）**

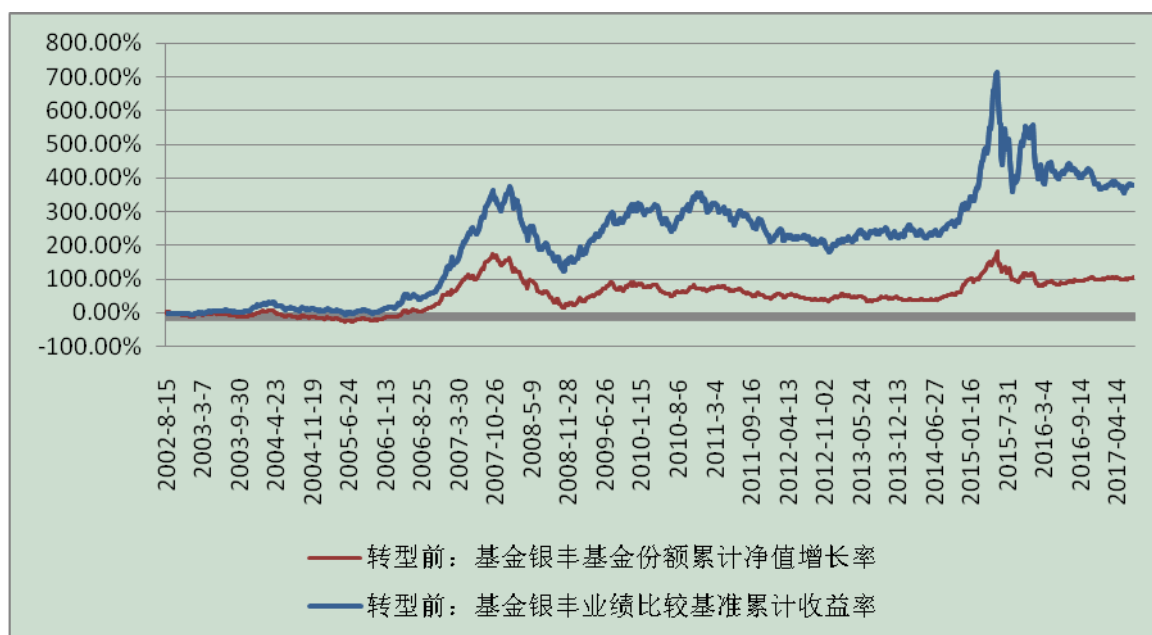
**3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**



| 阶段          | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月       | -0.20%   | 1.39%       | 2.20%      | 0.70%         | -2.40%  | 0.69% |
| 过去六个月       | 1.20%    | 1.26%       | 2.25%      | 0.86%         | -1.05%  | 0.40% |
| 过去一年        | -9.06%   | 1.39%       | 7.14%      | 0.97%         | -16.20% | 0.42% |
| 过去三年        | 43.58%   | 4.00%       | 43.86%     | 2.73%         | -0.28%  | 1.27% |
| 过去五年        | 49.68%   | 3.39%       | 46.07%     | 2.36%         | 3.61%   | 1.03% |
| 自基金合同生效日起至今 | 375.93%  | 3.01%       | 104.87%    | 2.55%         | 271.06% | 0.46% |

注：本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数涨跌幅 \* 75% + 同期国债收益率 \* 25%。

### 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

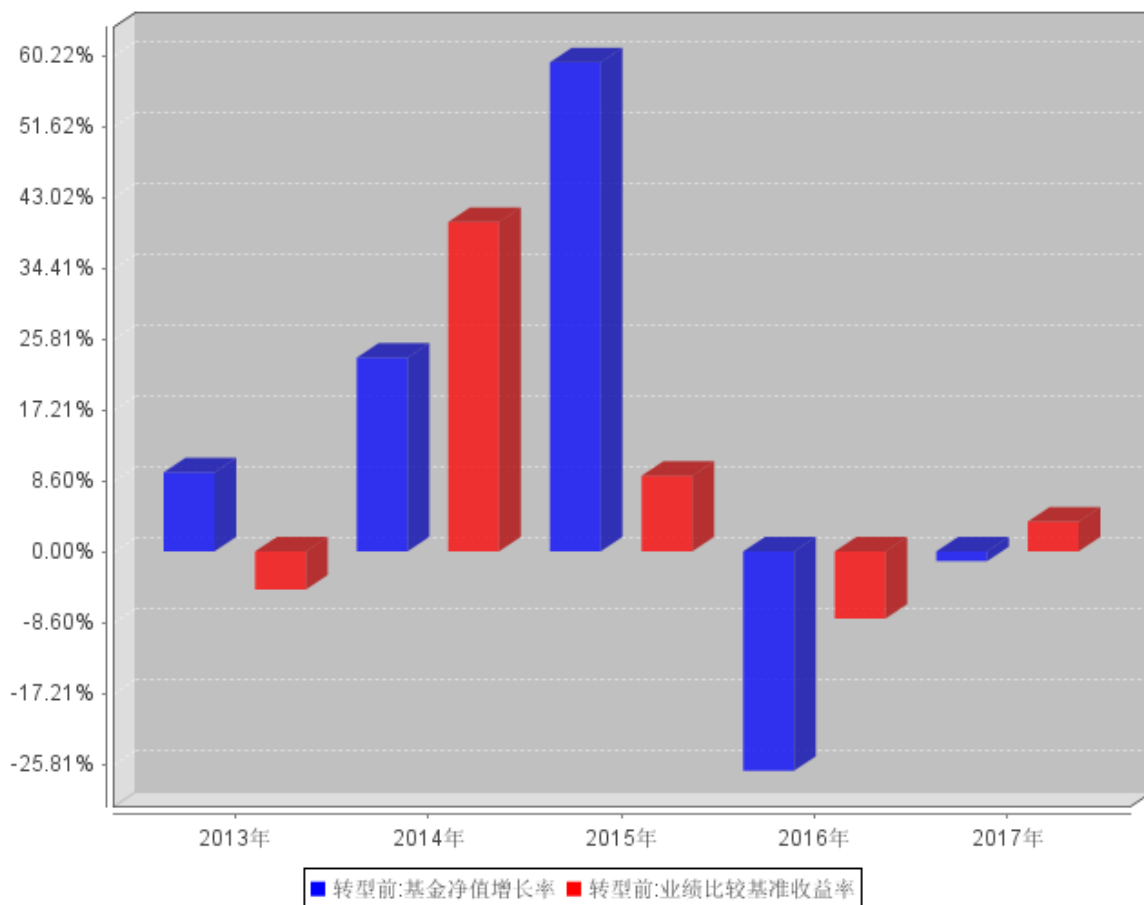


注：1、2002 年 8 月 15 日本基金成立，根据《银丰证券投资基金基金合同》规定，本基金应自基金合同生效日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截止本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定：（1）股票投资比例变动范围是：基金资产的 25%-75%；（2）债券投资比例变动范围是：基金资产的 25%-55%；（3）现金资产比例的变动范围是：基金资产的 0%-20%。

2、本基金自 2017 年 7 月 27 日起，由《银丰证券投资基金合同》修订而成《银河研究精选混合型证券投资基金合同》生效，原《银丰证券投资基金合同》失效。

### 3.2.3 过去五年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

过去五年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

转型前

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额<br>分红数 | 现金形式发放总<br>额   | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计   | 备注 |
|------|-----------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 2017 | -               | -              | -             | -              |    |
| 2016 | 3.2000          | 960,000,000.00 | -             | 960,000,000.00 |    |
| 2015 | -               | -              | -             | -              |    |
| 合计   | 3.2000          | 960,000,000.00 | -             | 960,000,000.00 |    |

转型后

注：本基金转型后未进行利润分配。

## §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

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（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 |        |                                                                                                                                                                             |
| 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。

#### 4.1.2 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 |        |                                                                                                                                      |
| 神玉飞 | 基金经理 | 2012 年 12 月 21 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

银河研究精选混合型证券投资基金（以下简称“银河研究精选”）在本报告期内严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，公平对待所管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

银河研究精选在本报告期内未发现异常交易行为。

## 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

2017 年, 美国经济强劲恢复, 引领全球经济稳步恢复。2017 年中国政府坚定不移的推动了供给侧改革, 传统的产能过剩的煤炭、钢铁等行业取得了卓越的效果; 叠加 2017 年地产行业的景气和政府对基建投资积极的鼓励支持, 中国经济增速见底回升, 工业企业盈利明显改善。2017 年中国国内权益市场和债券市场冰火两重天, 走出了截然相反的走势, 全年股票市场虽然绝对涨幅有限, 但是结构性牛市特征明显, 白马成长股的涨幅明显; 债券市场在去杠杆和通胀上行的预期的压制下表现逊于权益市场。2017 年, 沪深 300 指数和中小板指数分别上涨 21.78% 和 16.73%, 而创业板指数全年下跌 10.67%。分行业来看, 2017 年涨幅前三的行业依次为食品饮料、家电和非银行金融。本基金管理人在 2017 年虽然基本把握了阶段性的投资机会, 但是本基金管理人全年对市场的认识和判断还是出现了一定的偏差, 基金运作产生了一定的不利影响。回顾 2017 年本基金的管理运作, 本基金管理人重点参与了家电、消费电子、消费建材、新能源车和受益于供给侧改革的周期股, 但是还是对全年涨幅巨大的食品饮料、保险等行业的参与力度不够, 另外 2016 年年底配置的一些股票也在 2017 年年初对本基金的净值产生了一定的损耗。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后（2017 年 7 月 27 日-2017 年 12 月 31 日）：

本报告期基金份额增长率为 4.59%，同期业绩比较基准收益率为 4.14%。

转型前（2017 年 1 月 1 日-2017 年 7 月 27 日）：

本报告期基金份额增长率为-1.17%，同期业绩比较基准收益率为 3.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年全球经济形势, 本基金管理人判断“川普效应”逐渐兑现, 美国经济仍将维持比较强劲的增长, 但是通胀和后续加息预期会对美国经济的复苏产生较大的干扰; 欧元区经济 2017 年的复苏趋势有望在继续延续; 日本自身经济的韧性也将促使经济保持一定的竞争力; 资源品景气复苏有望推行新兴市场国家经济回暖。

展望 2018 年, 中国经济有望稳中求进, 防范风险。近年来的供给侧改革的成功经验在更多行业的推广给中国经济提供了坚实的盈利底部, 2017 年年底召开的中央经济工作会议, 已经明确指出了经济整体“稳中求进”, 2018 年的三大首要目标是“防风险、污染防治和精准扶贫”。因此本基金管理人借鉴公告中的观点, 判断 2018 年中国经济仍将保持平稳增长, 但是也需防范局部的风险。

本基金管理人判断 2018 年宏观经济基本面上行风险和宏观政策的下行风险将对。全球股市包括中国股市在享受经济复苏带来的基本面支持的同时, 也面临通胀上行引发的政策紧缩风险; 债券市场除了通胀上升引发的货币政策紧缩风险外还面临去杠杆带来的信用风险溢价上行的冲击。

基于对 2018 年股票市场相对谨慎乐观的判断, 本基金管理人将秉承绝对收益的理念, 谨慎选择股票仓位和具体投资标的, 重点关注符合经济转型估值合理的成长股、稳定增长高分红的价值股和供给侧改革三大方向的投资机会。在上述基础上, 本基金管理人也将密切跟踪研究周期股和消费股; 成长股和价值股估值溢价率的变化, 力争较好准确把握上述行业运行的机会与同时力争规避相关风险。

#### 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

转型前：

根据本基金《基金合同》，“基金收益分配比例不得低于基金净收益的 90%”，“基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额”，“基金收益分配采取现金方式，每年至少分配一次”。截止本报告期末（2017 年 7 月 26 日）可供分配利润为-75,181,074.07，本报告期末未进行利润分配。

转型后：

根据本基金《基金合同》，“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 4 次，每次收益分配比例不得低于该可供分配利润的 20%”。截止本报告期末可供分配利润为 31,072,766.50，本报告期末未进行利润分配。



## §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，中国建设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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金本报告期末进行利润分配。

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

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

## §6 审计报告（转型后）

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                            |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                      |
| 审计报告编号     | 安永华明(2018)审字第 60821717_B46 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题    | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告收件人   | 银河研究精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 审计意见      | <p>我们审计了银河研究精选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 7 月 27 日（基金合同转型日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的银河研究精选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银河研究精选混合型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 7 月 27 日（基金合同转型日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银河研究精选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>                                                                                                                                    |
| 强调事项      | 无。                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 其他事项      | 无。                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 其他信息      | <p>银河研究精选混合型证券投资基金管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>                   |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估银河研究精选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督银河研究精选混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银河研究精选混合型证券投资基金</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | <p>持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银河研究精选混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 注册会计师的姓名  | 蒋燕华   石静筠                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 审计报告日期    | 2018 年 3 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

## §6 审计报告（转型前）

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（转型后）

### 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：银河研究精选混合型证券投资基金

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<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |
| 银行存款            |            | 56,335,687.06                   |
| 结算备付金           |            | 3,904,947.70                    |
| 存出保证金           |            | 565,067.47                      |
| 交易性金融资产         |            | 885,387,626.79                  |
| 其中：股票投资         |            | 882,454,126.79                  |
| 基金投资            |            | -                               |
| 债券投资            |            | 2,933,500.00                    |
| 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        |            | 130,000,000.00                  |
| 应收证券清算款         |            | 14,159,515.46                   |
| 应收利息            |            | 235,584.88                      |
| 应收股利            |            | -                               |
| 应收申购款           |            | 24,852.46                       |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            |            | -                               |
| 资产总计            |            | 1,090,613,281.82                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                 |
| 短期借款            |            | -                               |
| 交易性金融负债         |            | -                               |
| 衍生金融负债          |            | -                               |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               |
| 应付证券清算款         |            | -                               |

|               |  |                  |
|---------------|--|------------------|
| 应付赎回款         |  | 1,497,160.85     |
| 应付管理人报酬       |  | 1,401,302.21     |
| 应付托管费         |  | 233,550.38       |
| 应付销售服务费       |  | -                |
| 应付交易费用        |  | 2,224,931.84     |
| 应交税费          |  | 2,143,158.46     |
| 应付利息          |  | -                |
| 应付利润          |  | -                |
| 递延所得税负债       |  | -                |
| 其他负债          |  | 2,053,761.63     |
| 负债合计          |  | 9,553,865.37     |
| <b>所有者权益：</b> |  |                  |
| 实收基金          |  | 1,019,405,224.83 |
| 未分配利润         |  | 61,654,191.62    |
| 所有者权益合计       |  | 1,081,059,416.45 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 1,090,613,281.82 |

注：（1）报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0409 元，基金份额总额

1,038,577,161.09 份。

（2）本基金由银丰证券投资基金转型而成，转型日为 2017 年 7 月 27 日。

## 7.2 利润表

会计主体：银河研究精选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号 | 本期<br>2017 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------------|-----|-----------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       |     | 167,884,852.73                                      |
| 1. 利息收入           |     | 16,010,292.33                                       |
| 其中：存款利息收入         |     | 844,632.72                                          |
| 债券利息收入            |     | 898,662.44                                          |
| 资产支持证券利息收入        |     | -                                                   |
| 买入返售金融资产收入        |     | 14,266,997.17                                       |
| 其他利息收入            |     | -                                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |     | 105,847,990.19                                      |
| 其中：股票投资收益         |     | 128,348,915.08                                      |
| 基金投资收益            |     | -                                                   |
| 债券投资收益            |     | -25,323,624.11                                      |
| 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                       |  | 2,822,699.22          |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     |  | 38,777,125.96         |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |  | -                     |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         |  | 7,249,444.25          |
| <b>减：二、费用</b>              |  | <b>24,505,509.66</b>  |
| 1. 管理人报酬                   |  | 14,593,458.32         |
| 2. 托管费                     |  | 2,432,243.04          |
| 3. 销售服务费                   |  | -                     |
| 4. 交易费用                    |  | 7,292,893.62          |
| 5. 利息支出                    |  | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |  | -                     |
| 6. 其他费用                    |  | 186,914.68            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |  | <b>143,379,343.07</b> |
| 减：所得税费用                    |  | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |  | <b>143,379,343.07</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河研究精选混合型证券投资基金

本报告期：2017年7月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2017年7月27日(基金合同生效日)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）                   | 3,000,000,000.00                      | 42,969,762.73   | 3,042,969,762.73  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | 143,379,343.07  | 143,379,343.07    |
| 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） | -1,980,594,775.17                     | -124,694,914.18 | -2,105,289,689.35 |
| 其中：1. 基金申购款                       | 19,366,056.35                         | 299,815.62      | 19,665,871.97     |
| 2. 基金赎回款（以“-”号填列）                 | -1,999,960,831.52                     | -124,994,729.80 | -2,124,955,561.32 |
| 四、本期向基金份额持有人分                     | -                                     | -               | -                 |

|                               |                  |               |                  |
|-------------------------------|------------------|---------------|------------------|
| 配利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以“-”号填列) |                  |               |                  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)               | 1,019,405,224.83 | 61,654,191.62 | 1,081,059,416.45 |

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：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>刘立达 | _____<br>刘立达 | _____<br>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      |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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，银丰证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字〔2002〕39号文《关于同意设立银丰证券投资基金的批复》的核准，由中国银河投资管理有限公司（原名中国银河证券有限责任公司）、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限公司（原名上海市城市建设投资开发总公司）、湖南广播电视产业中心、银河基金管理有限公司于2002年8月15日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发行规模为30亿份基金份额。本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证债字〔2002〕12号文审核同意，于2002年9月10日在上交所挂牌交易。根据本基金基金份额持有人大会审议通过的银丰证券投资基金转型有关事项的议案，并经向中国证监会备案及上海证券交易所自律监管决定书〔2017〕194号文《关于终止银丰证券投资基金上市的决定》的同意，基金银丰于2017年7月27日终止上市，原《银丰证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《银河研究精选混合型证券投资基金基金合同》于2017年7月27日起生效，同时基金银丰更名为银河研究精选混合型证券投资基金，基金正式转型为契约型开放式，存续期限调整为不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银河基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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。

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。

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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

#### 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 日的财务状况以及自 2017 年 7 月 27 日（基金合同转型日）起至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.4.2 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影响金额为人民币198,186.24元。

### 7.4.4.3 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。

## 7.4.5 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。

#### 7.4.6 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 银河基金管理有限公司           | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 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（“首都机场”）     | 基金管理人的股东            |

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 上海城投（集团）有限公司（“上海城投”） | 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（“银河证券”） | 同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构 |
| 中国银河投资管理有限公司（“银河投资”） | 同受基金管理人第一大股东控制        |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2017年7月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |                  |
|--------------|---------------------------------------|------------------|
|              | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1,439,051,227.80                      | 31.64%           |

##### 7.4.7.1.2 债券交易

注：本基金本报告期通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年7月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |                  |
|-------|---------------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 银河证券  | 41,210,000,000.00                     | 68.22%           |

##### 7.4.7.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2017年7月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |            |            |              |
|--------------|---------------------------------------|------------|------------|--------------|
|              | 当期佣金                                  | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1,340,189.06                          | 32.01%     | 908,012.29 | 40.81%       |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除由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。

#### 7.4.7.2 关联方报酬

##### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年7月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |               |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                        | 14,593,458.32 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 465,703.48                            |               |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年7月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |              |
|----|---------------------------------------|--------------|
|    | 当期发生的基金应支付的托管费                        | 2,432,243.04 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在

月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 7.4.7.2.3 销售服务费

注：本基金不设销售服务费。

### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2017 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |        |              |       |      |       |      |
|--------------------------------------------------|--------|--------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                                   | 债券交易金额 |              | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                                  | 基金买入   | 基金卖出         | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 建设银行                                             | -      | 9,907,560.99 | -     | -    | -     | -    |

### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.7.4.1 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<br>2017 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |   |
|-------------------|--------------------------------------------------|---|
|                   | 基金合同生效日持有的基金份额                                   | - |
| 期初持有的基金份额         | -                                                |   |
| 期间申购/买入总份额        | -                                                |   |
| 期间因拆分变动份额         | 3,056,761.86                                     |   |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -                                                |   |
| 期末持有的基金份额         | 3,056,761.86                                     |   |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.29%                                            |   |

注：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。

#### 7.4.7.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2017 年 7 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |                  |
|-------|---------------------------------------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额                                           | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |

|      |              |       |
|------|--------------|-------|
| 首都机场 | 3,056,761.86 | 0.29% |
| 上海城投 | 1,528,380.93 | 0.15% |
| 银河投资 | 9,170,285.59 | 0.88% |

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金系在正常业务范围内按一般商业条款进行，投资本基金的费率是公允的。

#### 7.4.7.5 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<br>2017年7月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |            |
|--------------|---------------------------------------|------------|
|              | 期末余额                                  | 当期利息收入     |
| 中国建设银行股份有限公司 | 56,335,687.06                         | 351,883.12 |

#### 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.8 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.8.1 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

| 7.4.8.1.1 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<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 说明 |
| 002923              | 润都股份 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日 | 认购新发证券 | 17.01 | 17.01  | 954          | 16,227.54  | 16,227.54  | -  |
| 300664              | 鹏鹞环保 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日 | 认购新发证券 | 8.88  | 8.88   | 3,640        | 32,323.20  | 32,323.20  | -  |
| 300713              | 英可瑞  | 2017年10月23日 | 2018年11月  | 新股限售   | 40.29 | 77.46  | 7,008        | 282,352.32 | 542,839.68 | -  |



|        |      |                        |                         |            |       |       |       |           |           |  |
|--------|------|------------------------|-------------------------|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|
|        |      |                        | 1 日                     |            |       |       |       |           |           |  |
| 603080 | 新疆火炬 | 2017 年<br>12 月<br>25 日 | 2018<br>年<br>1 月<br>3 日 | 认购新发<br>证券 | 13.60 | 13.60 | 1,187 | 16,143.20 | 16,143.20 |  |
| 603161 | 科华控股 | 2017 年<br>12 月<br>28 日 | 2018<br>年<br>1 月<br>5 日 | 认购新发<br>证券 | 16.75 | 16.75 | 1,239 | 20,753.25 | 20,753.25 |  |

## 7.4.8.1.2 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<br>(单位：张) | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 说明 |
|--------|------|-----------------------|--------------------------|------------|--------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 123003 | 蓝思转债 | 2017 年<br>12 月<br>8 日 | 2018<br>年<br>1 月<br>17 日 | 认购新发<br>证券 | 100.00 | 100.00 | 29,335       | 2,933,500.00 | 2,933,500.00 |    |

注：“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

## 7.4.8.2 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 |
|--------|------|---------------------------|------------|--------|----------------------|--------|--------|--------------|--------------|----|
| 002919 | 名臣健康 | 2017<br>年<br>12 月<br>28 日 | 重大事<br>项停牌 | 35.26  | 2018<br>年 1 月<br>2 日 | 38.79  | 821    | 10,311.76    | 28,948.46    |    |
| 300730 | 科创信息 | 2017<br>年<br>12 月<br>25 日 | 重大事<br>项停牌 | 41.55  | 2018<br>年 1 月<br>2 日 | 45.71  | 821    | 6,863.56     | 34,112.55    |    |
| 603986 | 兆易创新 | 2017<br>年<br>11 月<br>1 日  | 重大事<br>项停牌 | 163.12 | 2018<br>年 3 月<br>2 日 | 150.00 | 33,000 | 5,164,209.00 | 5,382,960.00 |    |

## 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.8.3.1 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。

#### 7.4.8.3.2 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证券款余额。

### 7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 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 876,379,818.91 元，属于第二层次的余额为人民币 8,464,968.2 元，属于第三层次余额为人民币 542,839.68 元。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

###### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

上年度末余额人民币 0.00 元，2017 年度转入第三层次人民币 561,340.80 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 -18,501.12 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 542,839.68 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-18,501.12 元。

## §7 年度财务报表（转型前）

### 7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：银丰证券投资基金

报告截止日：2017 年 7 月 26 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 7 月 26 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            |            | 27,699,830.76                  | 9,547,444.58                     |
| 结算备付金           |            | 49,863,562.56                  | 7,175,366.35                     |
| 存出保证金           |            | 566,659.42                     | 864,091.70                       |
| 交易性金融资产         |            | 2,436,795,366.25               | 2,967,112,473.57                 |
| 其中：股票投资         |            | 1,592,029,498.85               | 2,183,505,978.57                 |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 844,765,867.40                 | 783,606,495.00                   |
| 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        |            | 540,000,000.00                 | 95,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 5,226,190.48                   | 7,848,594.19                     |
| 应收利息            |            | 17,642,246.23                  | 21,133,500.49                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 3,077,793,855.70               | 3,108,681,470.88                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 7 月 26 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          |            | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 26,012,928.33                  | 17,131,857.91                    |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 3,272,829.23                   | 3,991,781.54                     |
| 应付托管费           |            | 545,471.55                     | 665,296.94                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          |            | 737,858.24                     | 3,391,670.36                     |
| 应交税费            |            | 2,143,158.46                   | 2,143,158.46                     |

|               |  |                  |                  |
|---------------|--|------------------|------------------|
| 应付利息          |  | -                | -                |
| 应付利润          |  | -                | -                |
| 递延所得税负债       |  | -                | -                |
| 其他负债          |  | 2,111,847.16     | 2,150,000.00     |
| 负债合计          |  | 34,824,092.97    | 29,473,765.21    |
| <b>所有者权益：</b> |  |                  |                  |
| 实收基金          |  | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 未分配利润         |  | 42,969,762.73    | 79,207,705.67    |
| 所有者权益合计       |  | 3,042,969,762.73 | 3,079,207,705.67 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 3,077,793,855.70 | 3,108,681,470.88 |

注：(1) 报告截止日 2017 年 7 月 26 日，基金份额净值 1.014 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

(2) 本基金自 2017 年 7 月 27 日起转型为银河研究精选混合型证券投资基金。

## 7.2 利润表

会计主体：银丰证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 26 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 7 月 26 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | 3,746,291.40                             | -1,257,674,477.82                              |
| 1. 利息收入                |            | 24,106,875.37                            | 39,318,432.45                                  |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 354,075.34                               | 531,971.38                                     |
| 债券利息收入                 |            | 17,107,544.60                            | 36,762,808.90                                  |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                        | -                                              |
| 买入返售金融资产收入             |            | 6,645,255.43                             | 2,023,652.17                                   |
| 其他利息收入                 |            | -                                        | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -191,662,245.86                          | 110,801,267.35                                 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -196,327,611.86                          | 104,280,921.29                                 |
| 基金投资收益                 |            | -                                        | -                                              |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -13,398,220.61                           | -6,762,163.64                                  |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.5 | -                                        | -                                              |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -                                        | -                                              |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -                                        | -                                              |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 18,063,586.61                            | 13,282,509.70                                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 171,301,661.89                           | -1,407,794,177.62                              |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号        |            | -                                        | -                                              |

|                             |  |                |                   |
|-----------------------------|--|----------------|-------------------|
| 填列)                         |  |                |                   |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列)         |  | -              | -                 |
| <b>减: 二、费用</b>              |  | 39,984,234.34  | 96,278,547.26     |
| 1. 管理人报酬                    |  | 25,888,813.94  | 54,331,179.94     |
| 2. 托管费                      |  | 4,314,802.38   | 9,055,196.64      |
| 3. 销售服务费                    |  | -              | -                 |
| 4. 交易费用                     |  | 9,412,855.58   | 29,468,921.47     |
| 5. 利息支出                     |  | -              | 16,852.21         |
| 其中: 卖出回购金融资产支出              |  | -              | 16,852.21         |
| 6. 其他费用                     |  | 367,762.44     | 3,406,397.00      |
| <b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b> |  | -36,237,942.94 | -1,353,953,025.08 |
| 减: 所得税费用                    |  | -              | -                 |
| <b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>   |  | -36,237,942.94 | -1,353,953,025.08 |

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 银丰证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 26 日

单位: 人民币元

| 项目                                      | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 26 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)                        | 3,000,000,000.00                      | 79,207,705.67  | 3,079,207,705.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)               | -                                     | -36,237,942.94 | -36,237,942.94   |
| 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)      | -                                     | -              | -                |
| 其中: 1. 基金申购款                            | -                                     | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                                | -                                     | -              | -                |
| 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）                        | 3,000,000,000.00                 | 42,969,762.73     | 3,042,969,762.73  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 3,000,000,000.00                 | 2,393,160,730.75  | 5,393,160,730.75  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | -1,353,953,025.08 | -1,353,953,025.08 |
| 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）      | -                                | -                 | -                 |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                                | -                 | -                 |
| 2. 基金赎回款                               | -                                | -                 | -                 |
| 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） | -                                | -960,000,000.00   | -960,000,000.00   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 3,000,000,000.00                 | 79,207,705.67     | 3,079,207,705.67  |

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

银丰证券投资基金(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”)证监基金字 2002 39 号文《关于同意设立银丰证券投资基金的批复》的核准,由中国银河投资管理有限公司(原名中国银河证券有限责任公司)、首都机场集团公司、上海城投(集团)有限公司(原名上海市城市建设投资开发总公司)、湖南广播电视产业中心、银河基金管理有限公司于 2002 年 8 月 15 日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式,存续期为 15 年,发行规模为 30 亿份基金份额。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上

债字[2002]12 号文审核同意，于 2002 年 9 月 10 日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《银河研究精选混合型证券投资基金基金合同》及《关于银丰证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2017 年 7 月 27 日起转型为契约型开放式证券投资基金并更名为银河研究精选混合型证券投资基金。

本基金只投资于在国内依法公开发行上市、具有良好流动性的金融工具，主要包括在上海证券交易所和深圳证券交易所挂牌的股票和债券，法律、法规及中国证监会允许的其他金融工具也将纳入本基金投资范围。本基金的投资组合遵循下列比例规定：（1）本基金投资于股票、债券的比例，不得低于基金资产总值的 80%；（2）本基金投资于债券的比例不低于基金资产总值的 25%，不高于基金资产总值的 55%；（3）本基金持有的一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；（4）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；（5）本基金投资于国家债券的比例，不得低于基金资产净值的 20%；（6）遵守法律、法规、中国证监会及本基金契约所规定的其他比例限制。

本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数涨跌幅×75%+同期国债收益率×25%。

#### 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。

根据《银河研究精选混合型证券投资基金基金合同》及《关于银丰证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2017 年 7 月 27 日起转型为契约型开放式证券投资基金并更名为银河研究精选混合型证券投资基金，故本财务报表仍以持续经营假设为基础列报。



### 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 7 月 26 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 7 月 26 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

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

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

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

#### 7.4.6.2 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；

#### 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           | 基金管理人、基金发起人          |
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 基金托管人                |
| 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（“首都机场”）     | 基金管理人的股东、基金发起人       |
| 上海城投（集团）有限公司（“上海城投”） | 基金管理人的股东、基金发起人       |
| 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（“银河证券”） | 同受基金管理人第一大股东控制       |
| 中国银河投资管理有限公司（“银河投资”） | 同受基金管理人第一大股东控制、基金发起人 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年7月26日 |                      | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                      |
|-------|----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 |
| 银河证券  | -                          | -                    | 1,298,454,055.74                 | 6.70%                |

#### 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债券回购交易。

#### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                |            |                      |
|-------|----------------------------------|----------------|------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付<br>佣金总额的<br>比例 |
| 银河证券  | 1,183,281.86                     | 6.65%          | 115,212.79 | 3.40%                |

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。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。

#### 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<br>2017年1月1日至2017年<br>7月26日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月<br>31日 |
|------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费               | 25,888,813.94                  | 54,331,179.94                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup> | -                              | -                                    |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理费。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇节假日、休息日等，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 7 月 26 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 | 4,314,802.38                    | 9,055,196.64                     |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金不设销售服务费。

#### 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                              | 上年度可比期间                          |
|----|---------------------------------|----------------------------------|
|    | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 26 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |

|                   |              |              |
|-------------------|--------------|--------------|
| 基金合同生效日持有的基金份额    | 3,000,000.00 | 3,000,000.00 |
| 期初持有的基金份额         | -            | -            |
| 期间申购/买入总份额        | -            | -            |
| 期间因拆分变动份额         | -            | -            |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -            | -            |
| 期末持有的基金份额         | 3,000,000.00 | 3,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.10%        | 0.10%        |

注：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。

#### 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2017年7月26日 |                     | 上年度末<br>2016年12月31日 |                     |
|-------|-------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
|       | 持有的基金份额           | 持有的基金份额占基金总份额的比例(%) | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例(%) |
| 首都机场  | 3,000,000.00      | 0.10%               | 3,000,000.00        | 0.10%               |
| 上海城投  | 1,500,000.00      | 0.05%               | 1,500,000.00        | 0.05%               |
| 银河投资  | 9,000,000.00      | 0.30%               | 9,000,000.00        | 0.30%               |

#### 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<br>2017年1月1日至2017年7月26日 |           | 上年度可比期间<br>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     |
| 建设银行  | 27,699,830.76              | 71,492.80 | 9,547,444.58                     | 220,798.04 |

#### 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7月26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<br>(单位: 股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 说明 |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|---------------|-----------|-----------|----|
| 300679 | 电连技术 | 2017年7月21日 | 2017年7月31日 | 新股流通受限 | 67.72 | 67.72  | 1,184         | 80,180.48 | 80,180.48 | -  |
| 603730 | 岱美股份 | 2017年7月20日 | 2017年7月28日 | 新股流通受限 | 24.92 | 24.92  | 1,738         | 43,310.96 | 43,310.96 | -  |
| 603233 | 大参林  | 2017年7月21日 | 2017年7月31日 | 新股流通受限 | 24.72 | 24.72  | 1,287         | 31,814.64 | 31,814.64 | -  |
| 603063 | 禾望电气 | 2017年7月20日 | 2017年7月28日 | 新股流通受限 | 13.36 | 13.36  | 2,361         | 31,542.96 | 31,542.96 | -  |
| 603357 | 设计总院 | 2017年7月24日 | 2017年8月1日  | 新股流通受限 | 10.44 | 10.44  | 2,705         | 28,240.20 | 28,240.20 | -  |
| 603825 | 华扬联众 | 2017年7月25日 | 2017年8月2日  | 新股流通受限 | 14.67 | 14.67  | 1,578         | 23,149.26 | 23,149.26 | -  |
| 002889 | 东方嘉盛 | 2017年7月20日 | 2017年7月31日 | 新股流通受限 | 12.94 | 12.94  | 1,515         | 19,604.10 | 19,604.10 | -  |
| 300682 | 朗新科技 | 2017年7月24日 | 2017年8月1日  | 新股流通受限 | 5.51  | 5.51   | 1,997         | 11,003.47 | 11,003.47 | -  |
| 300678 | 中科信息 | 2017年7月17日 | 2017年7月28日 | 新股流通受限 | 7.85  | 7.85   | 1,033         | 8,109.05  | 8,109.05  | -  |

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

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 |
|--------|------|------------|--------|--------|-----------|--------|------------|----------------|----------------|----|
| 002013 | 中航机电 | 2017年5月12日 | 重大事项停牌 | 10.33  | 2017年8月2日 | 11.36  | 9,749,995  | 111,354,303.63 | 100,717,448.35 |    |
| 002026 | 山东威达 | 2017年7月24日 | 重大事项停牌 | 8.52   | 2017年8月7日 | 8.61   | 13,000,000 | 173,707,888.23 | 110,760,000.00 |    |

### 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 7 月 26 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 7 月 26 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证券款余额。

### 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 7 月 26 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 1,461,024,662.78 元，属于第二层次的余额为人民币 975,770,703.47 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 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 2,279,487,269.07 元，属于第二层次的余额为人民币 687,625,204.50 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未发生变动。

## §8 投资组合报告（转型后）

### 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              | 882,454,126.79   | 80.91         |
|    | 其中：股票             | 882,454,126.79   | 80.91         |
| 2  | 固定收益投资            | 2,933,500.00     | 0.27          |
|    | 其中：债券             | 2,933,500.00     | 0.27          |
|    | 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          | 130,000,000.00   | 11.92         |
|    | 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      | 60,240,634.76    | 5.52          |
| 7  | 其他各项资产            | 14,985,020.27    | 1.37          |
| 8  | 合计                | 1,090,613,281.82 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

**8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | 19,694,500.00  | 1.82          |
| C  | 制造业              | 750,733,817.94 | 69.44         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | 15,222,198.20  | 1.41          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17,957.94      | 0.00          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 2,699,000.00   | 0.25          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 34,112.55      | 0.00          |
| J  | 金融业              | 29,116,250.00  | 2.69          |
| K  | 房地产业             | 63,930,500.00  | 5.91          |
| 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    | 989,646.96     | 0.09          |
| 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               | 882,454,126.79 | 81.63         |

**8.2.2 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。

**8.2.3 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  | 002372 | 伟星新材 | 4,850,000 | 87,203,000.00 | 8.07          |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 1,560,000 | 86,470,800.00 | 8.00          |
| 3  | 600585 | 海螺水泥 | 2,650,000 | 77,724,500.00 | 7.19          |
| 4  | 000789 | 万年青  | 5,800,000 | 60,958,000.00 | 5.64          |

|    |        |       |           |               |      |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 5  | 002475 | 立讯精密  | 2,300,000 | 53,912,000.00 | 4.99 |
| 6  | 000002 | 万科 A  | 1,500,000 | 46,590,000.00 | 4.31 |
| 7  | 600519 | 贵州茅台  | 63,954    | 44,607,275.46 | 4.13 |
| 8  | 600702 | 沱牌舍得  | 900,000   | 41,994,000.00 | 3.88 |
| 9  | 000418 | 小天鹅 A | 599,914   | 40,704,164.90 | 3.77 |
| 10 | 600584 | 长电科技  | 1,900,000 | 40,527,000.00 | 3.75 |

### 8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.3.1 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

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      | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|---------------|-----------------|
| 1  | 000789 | 万年青   | 77,329,650.24 | 7.15            |
| 2  | 601668 | 中国建筑  | 73,729,971.00 | 6.82            |
| 3  | 600584 | 长电科技  | 69,570,918.05 | 6.44            |
| 4  | 603589 | 口子窖   | 65,008,500.14 | 6.01            |
| 5  | 600585 | 海螺水泥  | 64,655,020.21 | 5.98            |
| 6  | 300433 | 蓝思科技  | 50,822,557.84 | 4.70            |
| 7  | 001979 | 招商蛇口  | 48,831,977.97 | 4.52            |
| 8  | 000932 | 华菱钢铁  | 46,393,885.78 | 4.29            |
| 9  | 600519 | 贵州茅台  | 42,468,676.51 | 3.93            |
| 10 | 600498 | 烽火通信  | 41,380,369.69 | 3.83            |
| 11 | 600702 | 舍得酒业  | 40,141,976.31 | 3.71            |
| 12 | 600760 | 中航沈飞  | 37,353,969.00 | 3.46            |
| 13 | 600643 | 爱建集团  | 36,662,712.00 | 3.39            |
| 14 | 000717 | 韶钢松山  | 35,271,466.72 | 3.26            |
| 15 | 002285 | 世联行   | 35,142,739.68 | 3.25            |
| 16 | 002456 | 欧菲科技  | 34,334,480.45 | 3.18            |
| 17 | 000418 | 小天鹅 A | 34,225,766.77 | 3.17            |
| 18 | 600622 | 光大嘉宝  | 34,002,766.06 | 3.15            |
| 19 | 603833 | 欧派家居  | 32,923,810.52 | 3.05            |
| 20 | 002080 | 中材科技  | 31,952,037.50 | 2.96            |
| 21 | 600801 | 华新水泥  | 31,305,242.60 | 2.90            |
| 22 | 300618 | 寒锐钴业  | 30,171,283.00 | 2.79            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 23 | 002450 | 康得新  | 30,158,989.26 | 2.79 |
| 24 | 000063 | 中兴通讯 | 27,154,271.36 | 2.51 |
| 25 | 002156 | 通富微电 | 26,897,714.04 | 2.49 |
| 26 | 002026 | 山东威达 | 26,345,685.23 | 2.44 |
| 27 | 300672 | 国科微  | 26,279,844.00 | 2.43 |
| 28 | 300059 | 东方财富 | 26,226,582.65 | 2.43 |
| 29 | 601988 | 中国银行 | 25,977,000.00 | 2.40 |
| 30 | 600563 | 法拉电子 | 25,899,218.01 | 2.40 |
| 31 | 601336 | 新华保险 | 25,343,396.26 | 2.34 |
| 32 | 002138 | 顺络电子 | 23,647,642.16 | 2.19 |
| 33 | 002460 | 赣锋锂业 | 23,394,735.40 | 2.16 |
| 34 | 000001 | 平安银行 | 22,248,355.80 | 2.06 |
| 35 | 603868 | 飞科电器 | 21,771,445.00 | 2.01 |

注：本项及下项 8.3.2， 8.3.3 的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.3.2 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  | 002013 | 中航机电 | 120,842,537.34 | 11.18           |
| 2  | 002026 | 山东威达 | 113,552,621.91 | 10.50           |
| 3  | 002138 | 顺络电子 | 93,009,722.85  | 8.60            |
| 4  | 000333 | 美的集团 | 91,446,585.86  | 8.46            |
| 5  | 600885 | 宏发股份 | 76,723,984.61  | 7.10            |
| 6  | 002405 | 四维图新 | 72,977,247.54  | 6.75            |
| 7  | 603589 | 口子窖  | 71,357,801.49  | 6.60            |
| 8  | 002372 | 伟星新材 | 70,646,365.55  | 6.53            |
| 9  | 601668 | 中国建筑 | 70,623,417.00  | 6.53            |
| 10 | 603660 | 苏州科达 | 70,377,190.06  | 6.51            |
| 11 | 002050 | 三花智控 | 68,403,432.24  | 6.33            |
| 12 | 601336 | 新华保险 | 67,933,264.47  | 6.28            |
| 13 | 600038 | 中直股份 | 67,756,987.46  | 6.27            |
| 14 | 002475 | 立讯精密 | 64,671,270.05  | 5.98            |
| 15 | 600801 | 华新水泥 | 60,449,092.22  | 5.59            |
| 16 | 600585 | 海螺水泥 | 52,383,967.82  | 4.85            |
| 17 | 000910 | 大亚圣象 | 50,260,188.00  | 4.65            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 18 | 603368 | 柳州医药 | 46,224,449.47 | 4.28 |
| 19 | 001979 | 招商蛇口 | 45,701,643.32 | 4.23 |
| 20 | 600498 | 烽火通信 | 41,563,279.35 | 3.84 |
| 21 | 000932 | 华菱钢铁 | 41,540,535.54 | 3.84 |
| 22 | 601318 | 中国平安 | 39,939,601.88 | 3.69 |
| 23 | 000002 | 万科A  | 38,264,637.40 | 3.54 |
| 24 | 002285 | 世联行  | 37,596,431.11 | 3.48 |
| 25 | 000789 | 万年青  | 33,968,830.88 | 3.14 |
| 26 | 600643 | 爱建集团 | 33,428,569.20 | 3.09 |
| 27 | 000717 | 韶钢松山 | 33,426,737.00 | 3.09 |
| 28 | 002035 | 华帝股份 | 31,602,707.34 | 2.92 |
| 29 | 600486 | 扬农化工 | 31,146,368.40 | 2.88 |
| 30 | 002080 | 中材科技 | 30,944,439.86 | 2.86 |
| 31 | 601998 | 中信银行 | 30,149,127.52 | 2.79 |
| 32 | 002460 | 赣锋锂业 | 30,010,410.75 | 2.78 |
| 33 | 300618 | 寒锐钴业 | 29,653,998.00 | 2.74 |
| 34 | 002078 | 太阳纸业 | 27,966,057.09 | 2.59 |
| 35 | 300059 | 东方财富 | 27,270,037.01 | 2.52 |
| 36 | 600760 | 中航沈飞 | 27,212,920.00 | 2.52 |
| 37 | 002456 | 欧菲科技 | 26,316,177.50 | 2.43 |
| 38 | 002508 | 老板电器 | 26,175,580.37 | 2.42 |
| 39 | 600622 | 光大嘉宝 | 25,909,987.75 | 2.40 |
| 40 | 601988 | 中国银行 | 25,628,688.00 | 2.37 |
| 41 | 300433 | 蓝思科技 | 25,352,610.02 | 2.35 |
| 42 | 600563 | 法拉电子 | 25,006,560.72 | 2.31 |
| 43 | 600362 | 江西铜业 | 24,889,910.00 | 2.30 |
| 44 | 600584 | 长电科技 | 24,676,595.72 | 2.28 |
| 45 | 300672 | 国科微  | 24,151,373.00 | 2.23 |
| 46 | 600570 | 恒生电子 | 21,920,052.33 | 2.03 |
| 47 | 002466 | 天齐锂业 | 21,653,406.51 | 2.00 |

### 8.3.3 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 | 1,846,849,496.24 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,701,317,819.58 |

#### 8.4 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      | -            | -             |
|    | 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） | 2,933,500.00 | 0.27          |
| 8  | 同业存单      | -            | -             |
| 9  | 其他        | -            | -             |
| 10 | 合计        | 2,933,500.00 | 0.27          |

#### 8.5 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     | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------|--------------|---------------|
| 1  | 123003 | 蓝思转债 | 29,335 | 2,933,500.00 | 0.27          |

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

**8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.10.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.10.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11 投资组合报告附注****8.11.1**

报告期内本基金投资的前十名证券中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。

**8.11.2**

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.11.3 其他资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 565,067.47    |
| 2  | 应收证券清算款 | 14,159,515.46 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 235,584.88    |
| 5  | 应收申购款   | 24,852.46     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 14,985,020.27 |

#### **8.11.4 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。

#### **8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。



## §8 投资组合报告（转型前）

### 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              | 1,592,029,498.85 | 51.73        |
|    | 其中：股票             | 1,592,029,498.85 | 51.73        |
| 2  | 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            | -                | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 5  | 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 | -                | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 77,563,393.32    | 2.52         |
| 7  | 其他资产              | 23,435,096.13    | 0.76         |
| 8  | 合计                | 3,077,793,855.70 | 100.00       |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 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 |

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 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         |

### 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  | 600068 | 葛洲坝  | 120,340,640.70 | 3.91           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 2  | 600977 | 中国电影 | 107,478,604.63 | 3.49 |
| 3  | 601595 | 上海电影 | 75,795,878.37  | 2.46 |
| 4  | 002138 | 顺络电子 | 75,419,609.89  | 2.45 |
| 5  | 000401 | 冀东水泥 | 74,305,650.54  | 2.41 |
| 6  | 600885 | 宏发股份 | 72,236,974.27  | 2.35 |
| 7  | 603708 | 家家悦  | 67,329,577.06  | 2.19 |
| 8  | 601800 | 中国交建 | 66,222,210.02  | 2.15 |
| 9  | 603660 | 苏州科达 | 66,076,378.15  | 2.15 |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 59,105,753.07  | 1.92 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 57,008,312.12  | 1.85 |
| 12 | 300033 | 同花顺  | 53,063,662.25  | 1.72 |
| 13 | 300097 | 智云股份 | 50,181,186.32  | 1.63 |
| 14 | 000002 | 万科 A | 49,562,716.40  | 1.61 |
| 15 | 000823 | 超声电子 | 47,419,724.72  | 1.54 |
| 16 | 601336 | 新华保险 | 46,919,736.94  | 1.52 |
| 17 | 300197 | 铁汉生态 | 46,904,552.24  | 1.52 |
| 18 | 601233 | 桐昆股份 | 45,707,848.07  | 1.48 |
| 19 | 601390 | 中国中铁 | 44,814,360.36  | 1.46 |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 42,570,827.20  | 1.38 |

注：本项及下项 8.4.2， 8.4.3 的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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  | 600977 | 中国电影 | 140,503,153.64 | 4.56           |
| 2  | 601595 | 上海电影 | 112,046,043.28 | 3.64           |
| 3  | 002458 | 益生股份 | 108,645,945.13 | 3.53           |
| 4  | 002120 | 韵达股份 | 107,707,399.81 | 3.50           |
| 5  | 600068 | 葛洲坝  | 97,853,748.19  | 3.18           |
| 6  | 600990 | 四创电子 | 89,654,026.31  | 2.91           |
| 7  | 300061 | 康旗股份 | 86,231,127.54  | 2.80           |
| 8  | 603658 | 安图生物 | 82,043,983.16  | 2.66           |
| 9  | 300033 | 同花顺  | 71,673,479.30  | 2.33           |
| 10 | 002746 | 仙坛股份 | 69,059,380.21  | 2.24           |
| 11 | 600028 | 中国石化 | 66,121,145.20  | 2.15           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 601800 | 中国交建 | 65,948,875.15 | 2.14 |
| 13 | 002101 | 广东鸿图 | 63,660,273.56 | 2.07 |
| 14 | 603368 | 柳州医药 | 63,527,280.25 | 2.06 |
| 15 | 000401 | 冀东水泥 | 59,407,934.41 | 1.93 |
| 16 | 600038 | 中直股份 | 58,224,037.34 | 1.89 |
| 17 | 603708 | 家家悦  | 57,197,493.70 | 1.86 |
| 18 | 002353 | 杰瑞股份 | 56,631,183.53 | 1.84 |
| 19 | 002026 | 山东威达 | 54,859,059.39 | 1.78 |
| 20 | 000538 | 云南白药 | 54,011,189.74 | 1.75 |

### 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 | 2,743,400,476.98 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,316,947,622.95 |

### 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      | 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        |

### 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 | 公允价值 | 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 |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 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：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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中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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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   | 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 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|---------------|
| 1  | 113009 | 广汽转债 | 41,794,500.00 | 1.37          |
| 2  | 110031 | 航信转债 | 38,413,400.00 | 1.26          |

### 8.12.5 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  | 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     |

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息（转型后）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 40,605       | 25,577.57     | 399,464,953.39 | 38.46%     | 639,112,207.70 | 61.54%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00      | 0.0000%  |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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



## §9 基金份额持有人信息（转型前）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 29,641       | 101,211.16    | 1,696,339,805.00 | 56.54%     | 1,303,660,195.00 | 43.46%     |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                                          | 持有份额（份）        | 占上市总份额<br>比例 |
|----|------------------------------------------------|----------------|--------------|
| 1  | 泰康人寿保险有限责任公司—分红<br>—个人分红—019L—FH002 沪          | 289,240,565.00 | 9.64%        |
| 2  | 泰康人寿保险有限责任公司—传统<br>—普通保险产品—019L—CT001 沪        | 103,722,537.00 | 3.46%        |
| 3  | 中国人寿资产管理有限公司                                   | 100,465,958.00 | 3.35%        |
| 4  | 伦敦市投资管理有限公司—客户资<br>金                           | 97,453,133.00  | 3.25%        |
| 5  | 中国人寿保险股份有限公司                                   | 83,953,910.00  | 2.80%        |
| 6  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司<br>—传统—普通保险产品                  | 79,133,754.00  | 2.64%        |
| 7  | 上海斯诺波投资管理有限公司—私<br>募工场自由之路母基金证券投资基金            | 70,837,465.00  | 2.36%        |
| 8  | 建信人寿保险股份有限公司—普通                                | 56,518,221.00  | 1.88%        |
| 9  | 中国人寿保险股份有限公司                                   | 53,766,598.00  | 1.79%        |
| 10 | 中国太平洋财产保险股份有限公司<br>—传统—普通保险产品—013C—<br>CT001 沪 | 47,721,391.00  | 1.59%        |

**§ 10 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                      | 3,000,000,000.00 |
| 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              | 76,208,619.57    |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 2,037,631,458.48 |
| 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                       | 1,038,577,161.09 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金以现场方式召开了基金份额持有人大会，基金份额持有人大会表决投票时间为 2017 年 7 月 13 日。本次基金份额持有人大会的权益登记日为 2017 年 6 月 15 日，权益登记日本基金总份额为 3,000,000,000 份，亲自出席会议的基金份额持有人与受托出席会议者所代表的基金份额持有人所代表的基金份额为 1,735,333,563 份，占权益登记日基金总份额的 57.84%，亲自出席会议与受托出席会议的中小投资者超过 50 人，本次基金份额持有人大会的表决结果为：同意票所代表的基金份额为 1,714,829,363 份，占出席本次大会且有表决权的基金份额总数的 98.82%；满足法定生效条件，本次《关于银丰证券投资基金转型有关事项的议案》于 2017 年 7 月 13 日有效通过。

根据《银丰证券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，本基金管理人已对《银丰证券投资基金基金合同》、《银丰证券投资基金托管协议》进行了修订，修订后的《银河研究精选混合型证券投资基金基金合同》、《银河研究精选混合型证券投资基金托管协议》已报中国证监会变更注册，自基金银丰终止上市之日起生效，《银丰证券投资基金基金合同》、《银丰证券投资基金托管协议》自基金银丰终止上市之日起失效。根据修订后的基金合同及托管协议，本基金管理人已拟定《银河研究精选混合型证券投资基金招募说明书》并已向中国证监会备案。

### 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：

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。

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。

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：  
 2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

**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**

报告期内无涉基金投资策略的改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金本期报告内应支付给安永华明会计师事务所的报酬为 100,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 9 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（转型后）**

**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易              |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|------|--------|-------------------|--------------|--------------|------------|----|
|      |        | 成交金额              | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 银河证券 | 41     | 41,439,051,227.80 | 31.64%       | 1,340,189.06 | 32.01%     | -  |
| 天风证券 | 2      | 926,855,043.97    | 20.38%       | 844,644.55   | 20.17%     | -  |
| 兴业证券 | 2      | 424,336,577.71    | 9.33%        | 391,599.87   | 9.35%      | -  |
| 国信证券 | 2      | 359,864,039.43    | 7.91%        | 327,943.49   | 7.83%      | -  |

|      |   |                |       |            |       |   |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 中信证券 | 3 | 299,646,082.48 | 6.59% | 279,061.93 | 6.67% | - |
| 长江证券 | 1 | 281,741,816.25 | 6.19% | 256,751.41 | 6.13% | - |
| 东北证券 | 3 | 258,855,571.32 | 5.69% | 235,895.14 | 5.63% | - |
| 中泰证券 | 1 | 248,346,923.24 | 5.46% | 226,318.69 | 5.41% | - |
| 中银国际 | 1 | 193,318,673.42 | 4.25% | 176,170.53 | 4.21% | - |
| 平安证券 | 1 | 116,151,360.20 | 2.55% | 108,173.56 | 2.58% | - |
| 宏源证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 民生证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 华信证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 东吴证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 湘财证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 渤海证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 安信证券 | 3 | -              | -     | -          | -     | - |
| 光大证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 东兴证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 东方证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 中信建投 | 2 | -              | -     | -          | -     | - |
| 广发证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 国海证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 申银万国 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 中金公司 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 网信证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 华创证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 国泰君安 | 2 | -              | -     | -          | -     | - |
| 海通证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 国金证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 瑞银证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 汉唐证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 浙商证券 | 2 | -              | -     | -          | -     | - |
| 中投证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |

注：本基金本期退租中投证券 1 个交易单元。

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 银河证券 | -              | -            | 41,210,000,000.00 | 68.22%         | -    | -            |
| 天风证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | -              | -            | 6,270,000,000.00  | 10.38%         | -    | -            |
| 国信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 中信证券 | 594,185,793.60 | 100.00%      | 12,304,000,000.00 | 20.37%         | -    | -            |
| 长江证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 中泰证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 中银国际 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 平安证券 | -              | -            | 626,000,000.00    | 1.04%          | -    | -            |
| 宏源证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 华信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 湘财证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 渤海证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东方证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 网信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 汉唐证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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 |    |
| 天风证券 | 2      | 22,437,149,500.77 | 40.21%       | 2,220,975.86 | 39.96%     | -  |
| 中金公司 | 1      | 12,181,666,437.54 | 36.00%       | 1,999,136.20 | 35.97%     | -  |
| 兴业证券 | 2      | 409,022,321.01    | 6.75%        | 380,922.61   | 6.85%      | -  |
| 海通证券 | 1      | 311,403,040.40    | 5.14%        | 290,010.95   | 5.22%      | -  |
| 中信证券 | 3      | 270,555,109.35    | 4.46%        | 251,967.57   | 4.53%      | -  |
| 东北证券 | 3      | 195,353,128.95    | 3.22%        | 181,929.87   | 3.27%      | -  |
| 广发证券 | 1      | 157,613,345.32    | 2.60%        | 143,633.10   | 2.58%      | -  |
| 长江证券 | 1      | 97,585,216.59     | 1.61%        | 88,929.23    | 1.60%      | -  |
| 国泰君安 | 2      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 华创证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 宏源证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 民生证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 华信证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 国信证券 | 2      | -                 | -            | -            | -          | -  |
| 东吴证券 | 1      | -                 | -            | -            | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 网信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 汉唐证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 9 | - | - | - | - | - |

注：本基金本期新增光大证券 1 个交易单元、新增中金证券 1 个交易单元。

选择证券公司专用席位的标准

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

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；



(3) 签订协议。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 天风证券 | 6,073,386.20   | 1.73%        | 90,000,000.00     | 0.20%          | -    | -            |
| 中金公司 | 283,965,652.50 | 80.99%       | 29,869,000,000.00 | 67.13%         | -    | -            |
| 兴业证券 | 9,723,785.50   | 2.77%        | 1,153,000,000.00  | 2.59%          | -    | -            |
| 海通证券 | 6,773,943.00   | 1.93%        | 6,652,500,000.00  | 14.95%         | -    | -            |
| 中信证券 | 18,325,066.30  | 5.23%        | 2,521,000,000.00  | 5.67%          | -    | -            |
| 东北证券 | 25,741,239.40  | 7.34%        | 4,209,000,000.00  | 9.46%          | -    | -            |
| 广发证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 华创证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 宏源证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 华信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 湘财证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 渤海证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东方证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国海证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 申银万国 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 网信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 平安证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 瑞银证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 汉唐证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |

## §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

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。

### 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