

# 银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019年 6月 30日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2019年 8月 26日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 08 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	银河鑫利混合		
场内简称	-		
基金主代码	519652		
前端交易代码	-		
后端交易代码	-		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年 4月 22日		
基金管理人	银河基金管理有限公司		
基金托管人	北京银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	254,100,359.86份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	-		
上市日期	-		
下属分级基金的基金简称	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I
下属分级基金场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	519652	519653	519646
报告期末下属分级基金份额总额	99,223,936.18份	4,675,407.89份	150,201,015.79份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。		
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略，将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置，同时采取积极主动的股票投资和债券投资策略，把握中国经济增长和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的 3 年期定期存款利率 (税后)+1%		
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	-	-	-

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	刘晔
	联系电话	021-38568989	010-66223586
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	liuye1@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95526
传真		021-38568769	010-66226045

### 2.4 信息披露方式

登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	1 中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道 1568号 15 层 2 北京市东城区朝阳门北大街 9号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I
3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2019年 1月 1日 - 2019年 6月 30日)	报告期 (2019年 1月 1日 - 2019年 6月 30日)	报告期 (2019年 1月 1日 - 2019年 6月 30日)
本期已实现收益	557,925.58	-2,286.21	577,007.10
本期利润	1,359,107.18	72,441.00	1,024,247.72
加权平均基金份额本期利润	0.0175	0.0146	0.0093
本期基金份额净值增长率	1.70%	1.41%	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 ( 2019年 6月 30日 )		
期末可供分配基金份额利润	0.0765	0.0756	0.0020
期末基金资产净值	106,815,985.94	5,028,914.95	151,450,268.94
期末基金份额净值	1.077	1.076	1.008

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 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列示。

4 基金合同生效日为 2015年 4月 22日。

5 本基金自 2015年 11月 18日起，增加银河鑫利混合 I类基金份额类别。增加基金份额类别后，本基金将分设 A类、C类及 I类三类基金份额，详情请参阅相关公告。

6 本基金 2016年 2月 3日，银河鑫利混合 I类基金份额全部赎回；2016年 9月 14日，银河鑫利混合 I类基金新增份额 200,000,000.00份。本基金 2018年 7月 20日，银河鑫利混合 I类基金份额全部赎回。2019年 3月 14日，银河鑫利混合 I类基金新增份额 50,000,000.00份。

#### 3.2 基金净值表现

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

## 银河鑫利混合 A

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	0.75%	0.20%	0.31%	0.01%	0.44%	0.19%
过去三个月	0.84%	0.12%	0.93%	0.01%	-0.09%	0.11%
过去六个月	1.70%	0.12%	1.86%	0.01%	-0.16%	0.11%
过去一年	0.37%	0.18%	3.76%	0.01%	-3.39%	0.17%
过去三年	7.76%	0.22%	11.24%	0.01%	-3.48%	0.21%
自基金合同生效起至今	11.10%	0.19%	15.99%	0.01%	-4.89%	0.18%

## 银河鑫利混合 C

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	0.65%	0.17%	0.31%	0.01%	0.34%	0.16%
过去三个月	0.65%	0.11%	0.93%	0.01%	-0.28%	0.10%
过去六个月	1.41%	0.12%	1.86%	0.01%	-0.45%	0.11%
过去一年	-0.19%	0.18%	3.76%	0.01%	-3.95%	0.17%
过去三年	5.89%	0.22%	11.24%	0.01%	-5.35%	0.21%
自基金合同生效起至今	8.65%	0.19%	15.99%	0.01%	-7.34%	0.18%

## 银河鑫利混合 I

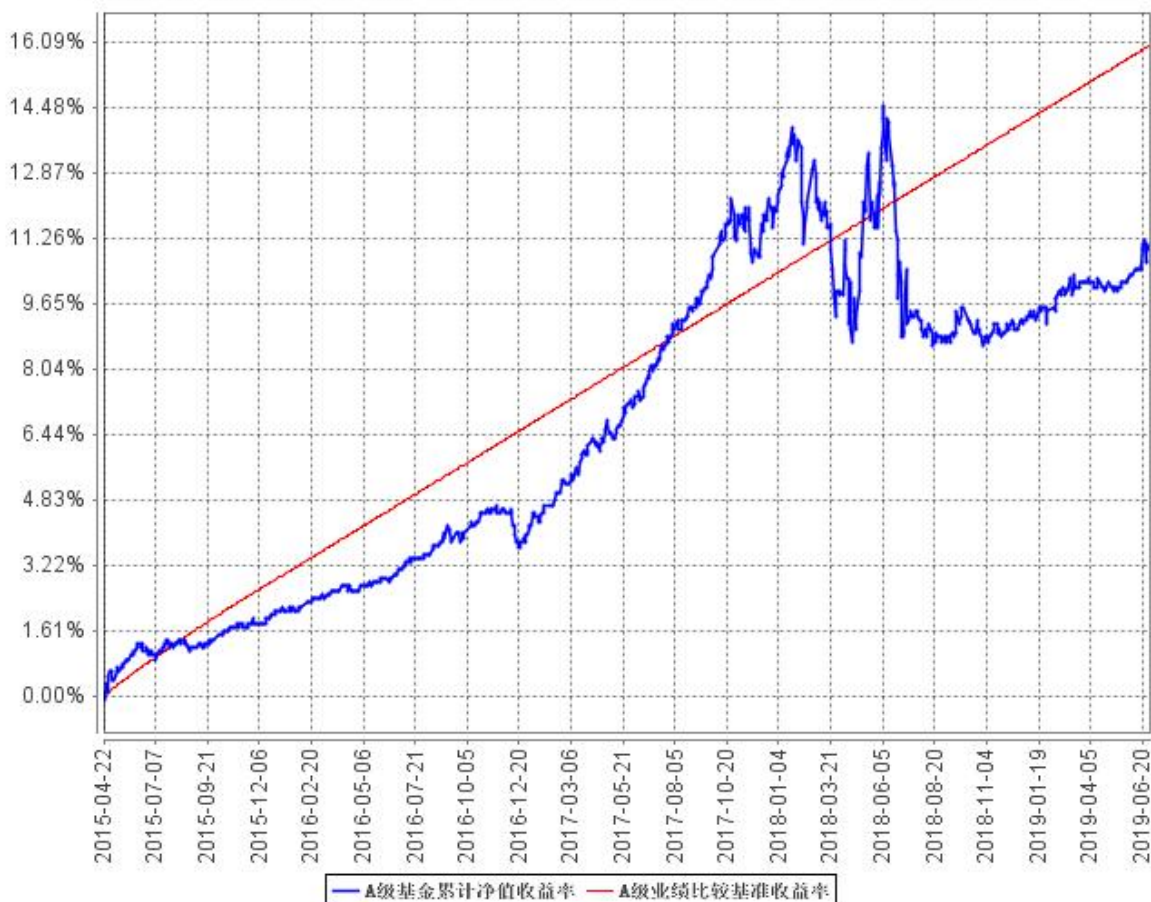
阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	0.70%	0.18%	0.31%	0.01%	0.39%	0.17%
过去三个月	0.80%	0.11%	0.93%	0.01%	-0.13%	0.10%
自 2019-3-14 起至今	0.80%	0.10%	1.12%	0.01%	-0.32%	0.09%

注：1 本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的 3 年期定期存款利率（税后）+1%

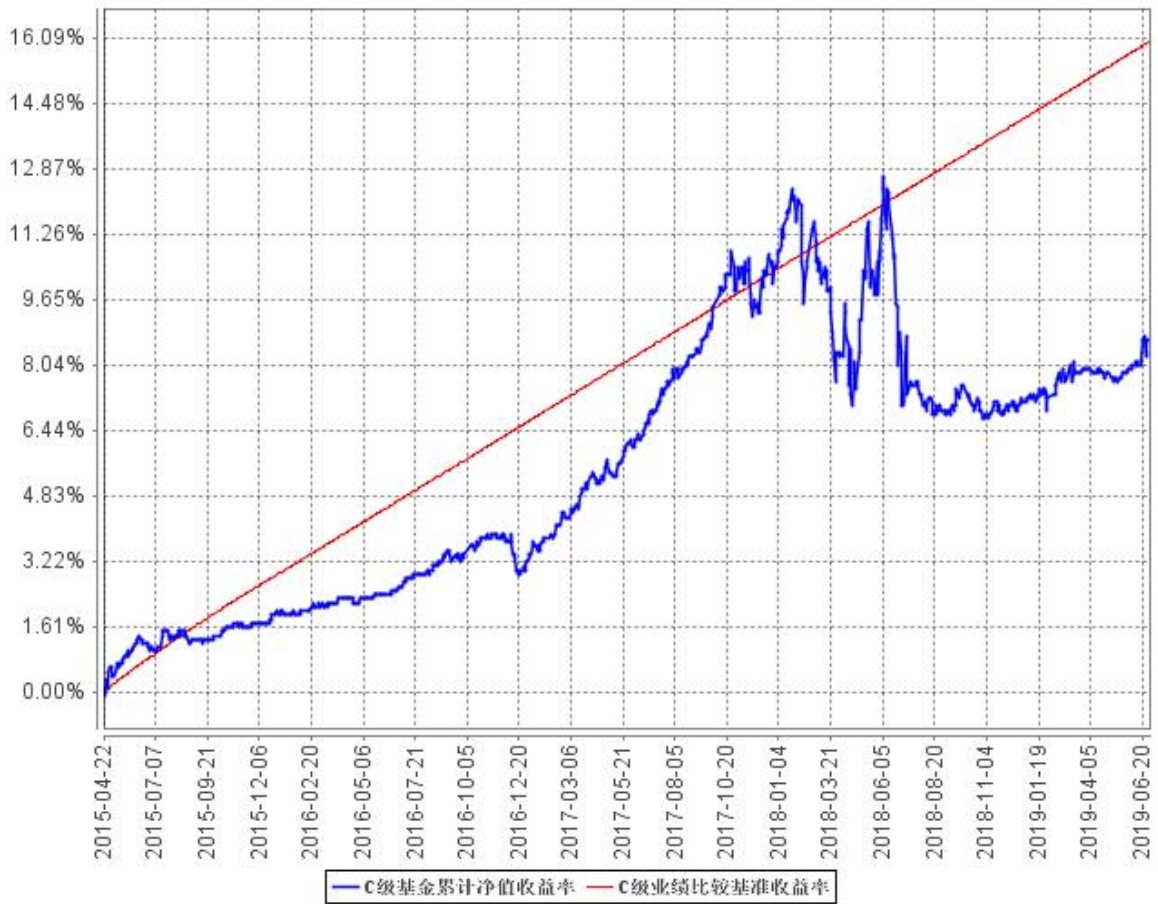
2 本基金 2016 年 2 月 3 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回；2016 年 9 月 14 日，银河鑫利混合 I 类基金新增份额 200,000,000.00 份。本基金 2018 年 7 月 20 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回。2019 年 3 月 14 日，银河鑫利混合 I 类基金新增份额 50,000,000.00 份。

### 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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

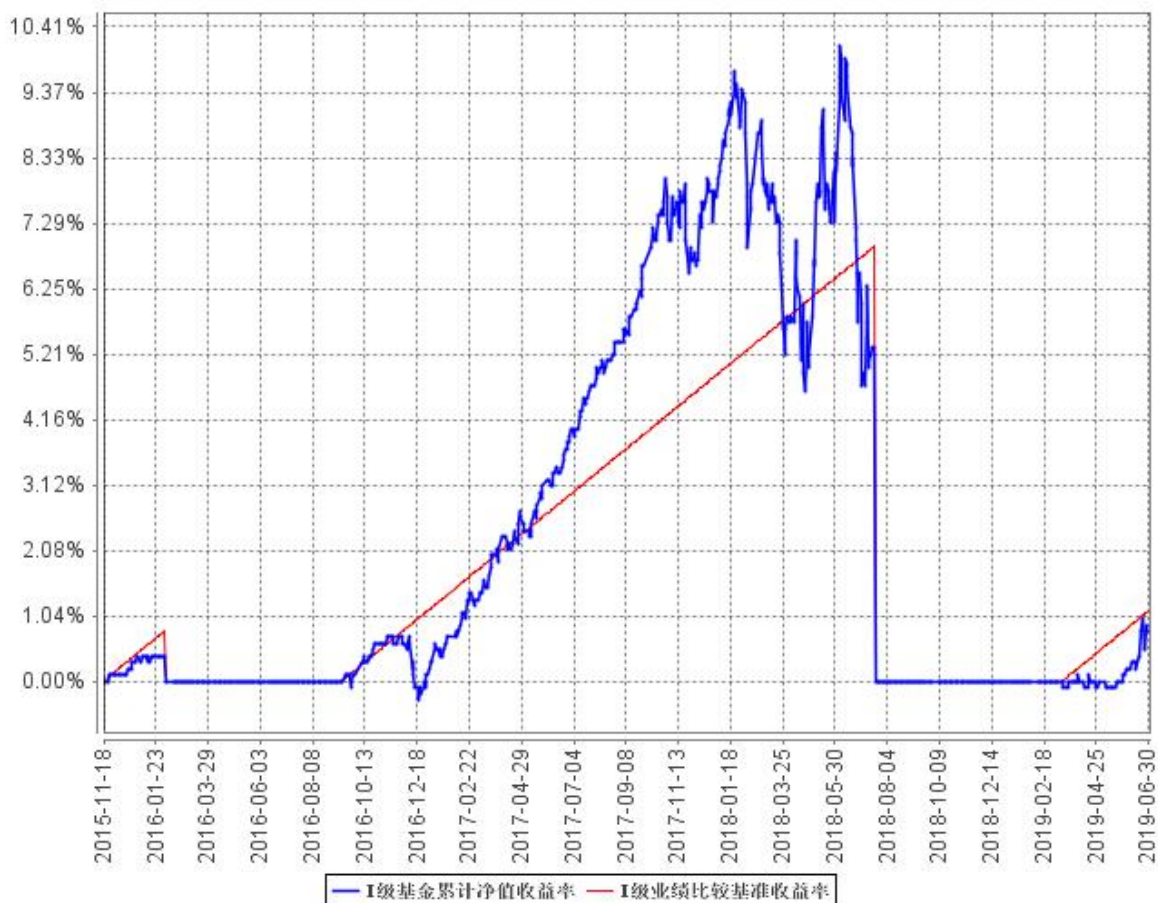


C级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





I级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2015年 4月 22日，根据《银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定，本基金应自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司成立于 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有限公司、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 2019 年 6 月 30 日，公司管理的基金有：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、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河久益回报 6 个月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、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股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、银河泰利纯债债券型证券投资基金、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、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金、银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银河和美生活主题混合型证券投资基金、银河如意债券型证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金、银河中债 -1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、银河睿安纯债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘铭	基金经理	2017年 4月 29 日	-	8	硕士研究生学历，8年金融行业相关从业经历。曾任职于上海汽车集团财务有限责任公司固定收益部、上海银行股份有限公司资产管理部，从事固定收益交易、研究与投资相关工作，2016年 7月加入我公司固定收益部。2017年 4月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银

					<p>河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年 12月起担任银河铭忆 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018年 3月起担任银河庭芳 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河鑫月享 6个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年 6月起担任银河景行 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018年 9月起担任银河沃丰纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018年 12月起担任银河家盈纯债债券型证券投资基金的基金经理，银河嘉裕纯债债券型证券投资基金的基金经理。</p>
卢轶乔	基金经 理	2017年 4月 29 日	-	11	<p>博士研究生学历，11年证券从业经历。曾就职于建设银行。2008年 7月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理等职，现担任基金经理。2012年 12月起担任银河消费驱动混合型证券投资基金的基金经理，2017年 4月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年 7月起担任银河君盛灵活配置混合型证</p>

					券投资基金的基金经理,2017年 10月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年 4月起担任银河文体娱乐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、离任日期均为我公司做出决定之日；

2 证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

针对同向交易部分,本报告期内,公司对旗下管理的所有投资组合(完全复制的指数基金除外),连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公开竞价交易的证券进行了

价差分析，并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内经济开局良好，2019年一季度 GDP同比增长 6.4%，各项数据超出市场一致预期，但二季度增长动能再度减弱。1-5月，全国固定资产投资规模同比增长 5.6%，较前四个月累计增速下滑 0.8%。前 5个月，出口同比增长 6.1%，进口同比增长 1.8%，贸易顺差 8933.6亿元，扩大 45%。1-5月社会消费品零售总额同比 8.1%，连续下滑，比去年同期下降 1.4%。1-5月工业增加值同比 6.0%，连续下滑，比去年同期下降 0.9%。海外方面，受国际贸易摩擦升级影响，全球经济景气度回落。今年上半年货币政策整体中性偏松，年初央行降准对冲 1季度的 MLF到期，2月份央行在公开市场的操作日趋谨慎，月末资金面出现超预期收紧，3月和 4月资金面整体仍不宽松，但 5月份中美贸易摩擦升级叠加同业刚兑打破的影响，央行除宣布对中小银行降准外，两次超量续作 MLF，并在公开市场不断投放资金，带来了较为宽松的资金面。

上半年债券市场收益率整体走势震荡，受资金面影响较大，先下后上再下，中债综合财富指数上半年上涨 1.82%。利率债方面，10年国开在 3.47-3.88区间震荡，10年国债在 3.06-3.43区间震荡。信用债方面，高评级信用利差较为平稳，低评级信用品种信用利差上行。

权益市场方面，整体震荡上行。受贸易谈判缓和、国内稳增长政策力度略超预期、经济数据表现较好的影响，1-4月股票市场强势上行，4月中下旬资金面收紧叠加 5月初贸易摩擦再度升温，

市场转而回落，6月受 G20后中美贸易战可能缓和、科创板开板等影响复又上行。上半年沪深 300 指数整体上涨 27.07%，各板块普涨，表现最好的是食品饮料、非银金融及农林牧渔板块，建筑、汽车、传媒板块表现较弱。

在今年股市走势较强的影响下，上半年上证转债指数上涨 10.87%。通信和食品饮料板块转债表现较好，纺织服装板块表现较弱。

报告期内，基金债券配置以中高评级短久期为主，基金股票仓位有所提高，积极参与了新股和可转债的网下申购。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河鑫利混合 A 基金份额净值为 1.077 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.70%；截至本报告期末银河鑫利混合 C 基金份额净值为 1.076 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.41%；同期业绩比较基准收益率为 1.88%。截至本报告期末银河鑫利混合 I 基金份额净值为 1.008 元，本报告期（2019 年 3 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日）基金份额净值增长率为 0.80%；同期业绩比较基准收益率为 1.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济将呈稳中向下的趋势。投资方面，制造业投资受贸易摩擦升级、企业盈利回落影响，向下压力较大；短期房地产投资仍能受益于补库动力较强以及去年下半年以来融资环境的放宽，保持偏稳定的增速，但在销售同比增速回落、融资再次边际收紧的情况下或将重回下行通道；唯有基建投资受益于财政政策刺激，对经济有一定的托底。消费方面，汽车销售仍然偏弱，下半年社零增速仍有压力；进出口方面，全球贸易摩擦升级，经济景气度下行，下半年出口增速影响较大。从中长期角度来讲，贸易摩擦有长期化的倾向，国内经济的发展仍然需要内生动力，经济结构调整、国有企业改革、民企融资环境的改善需持续推进，这都需要良好的资本环境支持。经济基本面及政策面都将支持无风险利率不会大幅上行，利率债将呈现震荡慢牛行情。信用债在市场风险偏好降低的背景下，信用利差预计将继续分化。权益和转债市场有一定的上涨预期，但空间不会太大，行情将结构性分化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》、中国基金业协会提供的相关估值

指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了由公司相关领导、监察部投资风控岗、研究部数量研究员、行业研究员、支持保障部基金会计等相关人员组成的估值委员会，以上人员拥有丰富的风控、合规、证券研究、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，但基金经理可以列席估值委员会会议提供估值建议，以便估值委员会决策。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《基金合同》有关规定，“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次收益分配比例不低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”。

截止 2019 年 6 月 30 日，本基金 A 级份额可供分配利润为 7,592,049.76 元，本基金 C 级份额可供分配利润为 353,507.06 元，本基金 I 级份额可供分配利润为 293,180.37 元。本报告期本基金未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年 6月 30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年 6月 30日	上年度末 2018年 12月 31日
<b>资产：</b>			
银行存款		2,032,393.91	79,894.82
结算备付金		14,502.33	454.80
存出保证金		15,643.24	65,876.07
交易性金融资产		250,532,303.19	60,373,342.24
其中：股票投资		99,266,703.19	2,150,263.44
基金投资		-	-
债券投资		131,311,600.00	58,223,078.80
资产支持证券投资		19,954,000.00	-
衍生金融资产		-	-
贵金属投资		-	-
买入返售金融资产		10,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,337,853.32	1,531,827.66
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		263,932,695.99	62,051,395.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年 6月 30日</b>	<b>上年度末 2018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		100,000.00	100,000.00
应付证券清算款		-	119.18
应付赎回款		213,908.24	-
应付管理人报酬		112,297.25	31,687.71
应付托管费		46,790.51	13,203.22
应付销售服务费		7,348.12	2,876.24
应付交易费用		92,871.77	-

应交税费		1,974.22	15.75
应付利息		29.04	-23.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		62,307.01	240,000.00
负债合计		637,526.16	387,878.28
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		254,100,359.86	58,229,671.46
未分配利润		9,194,809.97	3,433,845.85
所有者权益合计		263,295,169.83	61,663,517.31
负债和所有者权益总计		263,932,695.99	62,051,395.59

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，银河鑫利混合 A 基金份额净值 1.077 元，基金份额总额 99,223,936.18 份；银河鑫利混合 C 基金份额净值 1.076 元，基金份额总额 4,675,407.89 份；银河鑫利混合 I 基金份额净值 1.008 元，基金份额总额 150,201,015.79 份。银河鑫利混合份额总额合计为 254,100,359.86 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日
<b>一、收入</b>		3,390,922.76	-1,323,297.20
1.利息收入		2,175,067.65	3,463,919.02
其中：存款利息收入		25,461.83	41,054.53
债券利息收入		1,963,518.59	2,845,086.21
资产支持证券利息收入		138,988.90	100,810.64
买入返售金融资产收入		47,098.33	476,967.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-107,331.07	6,060,379.46
其中：股票投资收益		-450,657.52	6,292,322.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-473,608.18	-600,270.90
资产支持证券投资收益		-	36,305.54
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		816,934.63	332,022.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”		1,323,149.43	-10,847,659.55

号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)		36.75	63.87
<b>减：二、费用</b>		935,126.86	1,707,492.10
1. 管理人报酬		426,333.62	674,387.22
2. 托管费		177,638.92	280,994.69
3. 销售服务费		29,540.63	59,086.23
4. 交易费用		106,992.50	325,694.68
5. 利息支出		111,439.96	153,329.72
其中：卖出回购金融资产支出		111,439.96	153,329.72
6. 税金及附加		462.91	5,141.76
7. 其他费用		82,718.32	208,857.80
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		2,455,795.90	-3,030,789.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		2,455,795.90	-3,030,789.30

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	58,229,671.46	3,433,845.85	61,663,517.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,455,795.90	2,455,795.90
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)	195,870,688.40	3,305,168.22	199,175,856.62
其中：1. 基金申购款	301,782,052.13	3,949,846.21	305,731,898.34
2. 基金赎回款	-105,911,363.73	-644,677.99	-106,556,041.72
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）	254,100,359.86	9,194,809.97	263,295,169.83
项目	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	265,023,696.71	20,953,186.44	285,976,883.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,030,789.30	-3,030,789.30
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）	-99,802,099.96	-6,753,749.71	-106,555,849.67
其中：1.基金申购款	30,663.76	2,687.32	33,351.08
2.基金赎回款	-99,832,763.72	-6,756,437.03	-106,589,200.75
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）	165,221,596.75	11,168,647.43	176,390,244.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘立达</u>	<u>刘立达</u>	<u>廖理利</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]431号《关于准予银河鑫利灵活配置混合型证券

投资基金注册的批复》的核准，由银河基金管理有限公司作为管理人自 2015年 4月 15日到 2015年 4月 17日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2015）验字第 60821717\_B04号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015年 4月 22日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 734,079,931.45元，在募集期间产生的存款利息为人民币 88,597.55元，以上实收基金（本息）合计为人民币 734,168,529.00元，折合 734,168,529.00份基金份额，其中 A类基金份额为 594,375,763.26份，C类基金份额为 139,792,765.74份。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

本基金根据所收取认购/申购、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A类基金份额。在投资人认购/申购时不收取认购/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但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。

本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%；债券资产投资占基金资产的比例不低于 5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的 3年期定期存款利率（税后）+1%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关

于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和半年度报告》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

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》、财税 [2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2012]85 号《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》、财税 [2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通

知》、财税 [2015]101 号《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》、财税 [2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016]140号《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》、财税 [2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1)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、债券免征增值税；2018年 1月 1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2)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，暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事 A股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券 (股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系没有发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司 (“银河基金”)	基金管理人、基金销售机构
北京银行股份有限公司 (“北京银行”)	基金托管人、基金代销机构
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

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。



## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
银河证券	14,052,836.36	13.86%	215,730,974.18	100.00%

#### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
银河证券	75,943,679.23	95.00%	15,988,012.25	100.00%

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
银河证券	120,900,000.00	73.72%	1,329,100,000.00	100.00%

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
银河证券	13,087.28	14.12%	10,783.23	11.93%
关联方名称	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
银河证券	200,732.96	100.00%	99,836.52	100.00%

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

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	426,333.62
其中：支付销售机构的客户维护费	104,153.87	131,015.82

注：本基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5个工作日内支付。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日

		日
当期发生的基金应支付的托管费	177,638.92	280,994.69

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日 当期发生的基金应支付的销售服务费			
	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I	合计
	银河基金管理有限公司	-	2,223.89	-
北京银行股份有限公司	-	8,952.72	-	8,952.72
中国银河证券股份有限公司	-	684.50	-	684.50
合计	-	11,861.11	-	11,861.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日 当期发生的基金应支付的销售服务费			
	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I	合计
	银河基金管理有限公司	-	2,772.31	-
北京银行股份有限公司	-	12,035.93	-	12,035.93
中国银河证券股份有限公司	-	722.81	-	722.81
合计	-	15,531.05	-	15,531.05

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.6%，I 类基

基金份额的销售服务费年费率为 0.05%，销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

C 类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类基金份额销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值

I 类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 I 类基金份额销售服务费

E 为前一日的 I 类基金份额的基金资产净值

销售服务费自基金合同生效之日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至支付法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.8.5 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 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行	2,032,393.91	18,670.76	203,289.53	24,555.37

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2019年 6月 30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019年 06月 30日止，本基金从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 100,000.00元，于 2019年 07月 03日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	99,266,703.19	37.61
	其中：股票	99,266,703.19	37.61
2	基金投资		
3	固定收益投资	151,265,600.00	57.31
	其中：债券	131,311,600.00	49.75
	资产支持证券	19,954,000.00	7.56
4	贵金属投资		
5	金融衍生品投资		
6	买入返售金融资产	10,000,000.00	3.79
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,046,896.24	0.78
8	其他各项资产	1,353,496.56	0.51
9	合计	263,932,695.99	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,867,481.25	3.37
C	制造业	25,739,884.05	9.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,231,900.00	2.75
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	12,062,804.19	4.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,596,003.76	0.99
J	金融业	37,473,229.94	14.23
K	房地产业	5,295,400.00	2.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	99,266,703.19	37.70

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	109,000	9,658,490.00	3.67
2	601006	大秦铁路	1,083,000	8,761,470.00	3.33
3	600519	贵州茅台	6,952	6,840,768.00	2.60
4	600048	保利地产	415,000	5,295,400.00	2.01
5	601398	工商银行	862,000	5,077,180.00	1.93
6	601088	中国神华	235,000	4,789,300.00	1.82
7	601166	兴业银行	258,000	4,718,820.00	1.79
8	600036	招商银行	125,000	4,497,500.00	1.71
9	601328	交通银行	700,000	4,284,000.00	1.63
10	600660	福耀玻璃	185,500	4,216,415.00	1.60

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

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	9,399,123.00	15.24
2	601006	大秦铁路	9,392,316.00	15.23
3	600519	贵州茅台	6,666,517.60	10.81
4	600048	保利地产	5,405,497.00	8.77
5	601398	工商银行	5,017,400.00	8.14
6	601166	兴业银行	4,783,558.00	7.76
7	600036	招商银行	4,751,872.89	7.71
8	601088	中国神华	4,737,199.00	7.68
9	601328	交通银行	4,466,000.00	7.24
10	600660	福耀玻璃	4,046,843.00	6.56
11	600585	海螺水泥	3,953,952.00	6.41
12	600196	复星医药	3,890,227.00	6.31
13	600028	中国石化	3,837,000.00	6.22
14	600886	国投电力	3,815,900.00	6.19
15	601211	国泰君安	3,806,690.00	6.17
16	601288	农业银行	3,780,830.00	6.13
17	600741	华域汽车	3,572,782.00	5.79
18	600900	长江电力	3,332,000.00	5.40
19	601111	中国国航	3,295,513.50	5.34
20	603156	养元饮品	2,972,529.88	4.82
21	600309	万华化学	2,835,550.00	4.60
22	600050	中国联通	2,570,750.00	4.17
23	601688	华泰证券	1,459,978.00	2.37

注：买入金额不包括相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------



1	603156	养元饮品	2,474,006.36	4.01
2	603915	国茂股份	59,618.49	0.10
3	603217	元利科技	46,457.20	0.08

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	99,048,038.33
卖出股票收入（成交）总额	2,580,082.05

注：买入股票成本及卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,490,800.00	4.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,001,800.00	1.14
	其中：政策性金融债	3,001,800.00	1.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	116,819,000.00	44.37
9	其他	-	-
10	合计	131,311,600.00	49.87

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111909047	19浦发银行 CD047	300,000	29,118,000.00	11.06
2	111907050	19招商银行 CD050	300,000	29,115,000.00	11.06
3	111906043	19交通银行 CD043	200,000	19,594,000.00	7.44

4	111917008	19光大银行 CD008	200,000	19,586,000.00	7.44
5	019611	19国债 01	115,000	11,490,800.00	4.36

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	1989096	19上和 2B	200,000	19,954,000.00	7.58

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.9.1 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。

#### 7.9.2 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

**7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金未投资国债期货。

**7.10.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金未投资国债期货。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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

**7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.11.3 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	15,643.24
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	1,337,853.32
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,353,496.56

**7.11.4 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限的可转换债券。

**7.11.5 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。

**7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
银河鑫利混合 A	527	188,280.71	51,527,019.30	51.93%	47,696,916.88	48.07%
银河鑫利混合 C	642	7,282.57	0.00	0.00%	4,675,407.89	100.00%
银河鑫利混合 I	5	30,040,203.16	110,145,162.13	73.33%	40,055,853.66	26.67%
合计	1,174	216,439.83	161,672,181.43	63.63%	92,428,178.43	36.37%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	银河鑫利混合 A	0.00	0.0000%
	银河鑫利混合 C	0.00	0.0000%
	银河鑫利混合 I	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银河鑫利混合 A	0
	银河鑫利混合 C	0
	银河鑫利混合 I	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银河鑫利混合 A	0
	银河鑫利混合 C	0
	银河鑫利混合 I	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I
基金合同生效日(2015年4月22日)基金份额总额	594,375,763.26	139,792,765.74	-
本报告期期初基金份额总额	52,906,232.23	5,323,439.23	-
本报告期期间基金总申购份额	51,555,375.63	25,660.71	250,201,015.79
减:本报告期期间基金总赎回份额	5,237,671.68	673,692.05	100,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-	-
本报告期末基金份额总额	99,223,936.18	4,675,407.89	150,201,015.79

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2019年 5月 30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》，原总经理范永武先生因个人原因辞职，经公司第四届董事会审议通过，由董事长刘立达先生代为履行总经理职务。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无涉基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
招商证券	1	87,344,744.68	86.14%	79,596.42	85.88%	
银河证券	2	14,052,836.36	13.86%	13,087.28	14.12%	
东北证券	1					

注：1 选择证券公司专用席位的标准：

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

2 选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
招商证券	3,997,600.00	5.00%	43,100,000.00	26.28%		
银河证券	75,943,679.23	95.00%	120,900,000.00	73.72%		
东北证券						



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190320-20190618	-	46,859,418.93	-	46,859,418.93	18.44%
	2	20190314-20190617	-	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00	0.00%
	3	20190618-20190618	49,850,448.65	-	-	49,850,448.65	19.62%
个人	1	20190101-20190319	25,330,139.85	-	25,330,139.85	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。							

### 11.2 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

2019年 8月 26日