

银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 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

报告送出日期：2021 年 4 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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 2021 年 4 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | |
|-------------|--|----------|----------|
| 基金简称 | 银河鑫利混合 | | |
| 场内简称 | - | | |
| 交易代码 | 519652 | | |
| 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 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 358,835,932.03 份 | | |
| 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 | 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、固定收益类资产投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、权证投资策略；7、存托凭证投资策略 | | |
| 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。 | | |
| 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 | | |
| 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 |
| 下属分级基金的场内简称 | - | - | - |
| 下属分级基金的交易代 | 519652 | 519653 | 519646 |

| | | | |
|-----------------|------------------|-----------------|------------------|
| 码 | | | |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 180,472,509.40 份 | 48,140,635.59 份 | 130,222,787.04 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | - | - | - |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021年1月1日—2021年3月31日） | | |
|-----------------|---------------------------|---------------|----------------|
| | 银河鑫利混合 A | 银河鑫利混合 C | 银河鑫利混合 I |
| 1. 本期已实现收益 | 4,854,689.02 | 1,140,361.15 | 3,470,346.08 |
| 2. 本期利润 | -732,405.57 | -463,127.31 | 735,458.53 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0042 | -0.0105 | 0.0056 |
| 4. 期末基金资产净值 | 276,377,472.19 | 73,047,642.59 | 186,552,686.75 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.531 | 1.517 | 1.433 |

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、基金合同生效日为 2015 年 4 月 22 日。

4、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。

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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.13% | 0.58% | 0.92% | 0.01% | -0.79% | 0.57% |
| 过去六个月 | 4.51% | 0.46% | 1.86% | 0.01% | 2.65% | 0.45% |
| 过去一年 | 33.60% | 0.64% | 3.74% | 0.01% | 29.86% | 0.63% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三年 | 43.62% | 0.48% | 11.25% | 0.01% | 32.37% | 0.47% |
| 过去五年 | 53.93% | 0.38% | 18.74% | 0.01% | 35.19% | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | 57.93% | 0.35% | 22.55% | 0.01% | 35.38% | 0.34% |

银河鑫利混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.07% | 0.58% | 0.92% | 0.01% | -0.99% | 0.57% |
| 过去六个月 | 4.19% | 0.47% | 1.86% | 0.01% | 2.33% | 0.46% |
| 过去一年 | 32.72% | 0.64% | 3.74% | 0.01% | 28.98% | 0.63% |
| 过去三年 | 41.38% | 0.48% | 11.25% | 0.01% | 30.13% | 0.47% |
| 过去五年 | 49.73% | 0.38% | 18.74% | 0.01% | 30.99% | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | 53.17% | 0.35% | 22.55% | 0.01% | 30.62% | 0.34% |

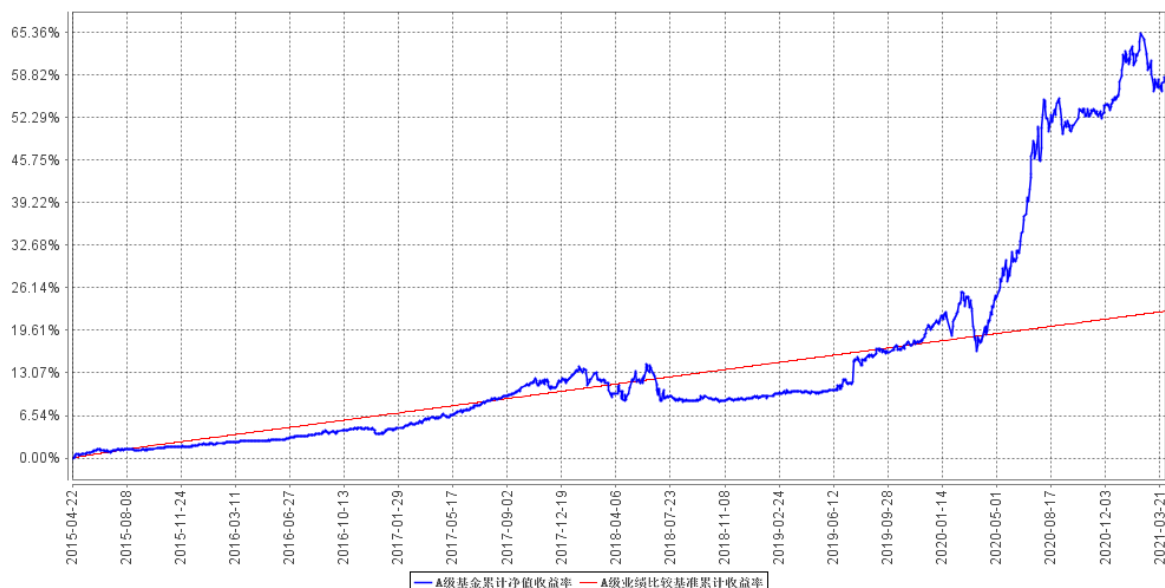
银河鑫利混合 I

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.14% | 0.58% | 0.92% | 0.01% | -0.78% | 0.57% |
| 过去六个月 | 4.52% | 0.46% | 1.86% | 0.01% | 2.66% | 0.45% |
| 过去一年 | 33.55% | 0.64% | 3.74% | 0.01% | 29.81% | 0.63% |
| 成立起至 2016-2-3 | 0.40% | 0.04% | 0.80% | 0.01% | -0.40% | 0.03% |
| 2016-9-14 至 2018-7-19 | 5.20% | 0.27% | 6.92% | 0.01% | -1.72% | 0.26% |
| 自 2019-3-14 起至今 | 43.30% | 0.53% | 7.68% | 0.01% | 35.62% | 0.52% |

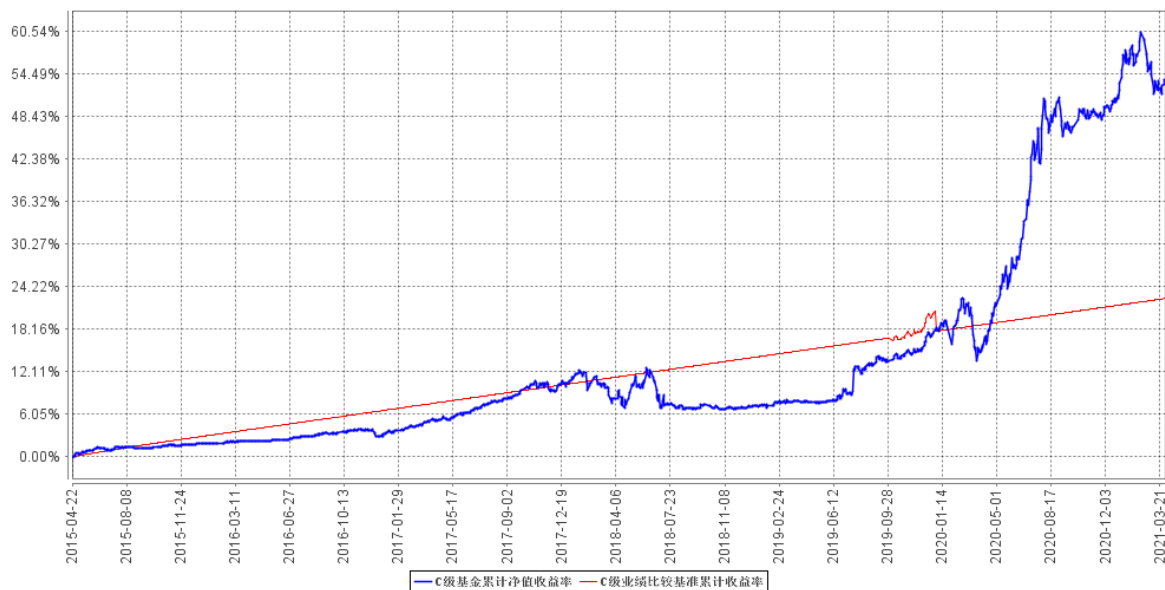
注：本基金 2016 年 2 月 3 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回；2016 年 9 月 14 日，银河鑫利混合 I 类基金新增基金份额 200,000,000.00 份；2018 年 7 月 19 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回；2019 年 3 月 14 日，银河鑫利混合 I 类基金新增份额 50,000,000.00 份，并存续至今。

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

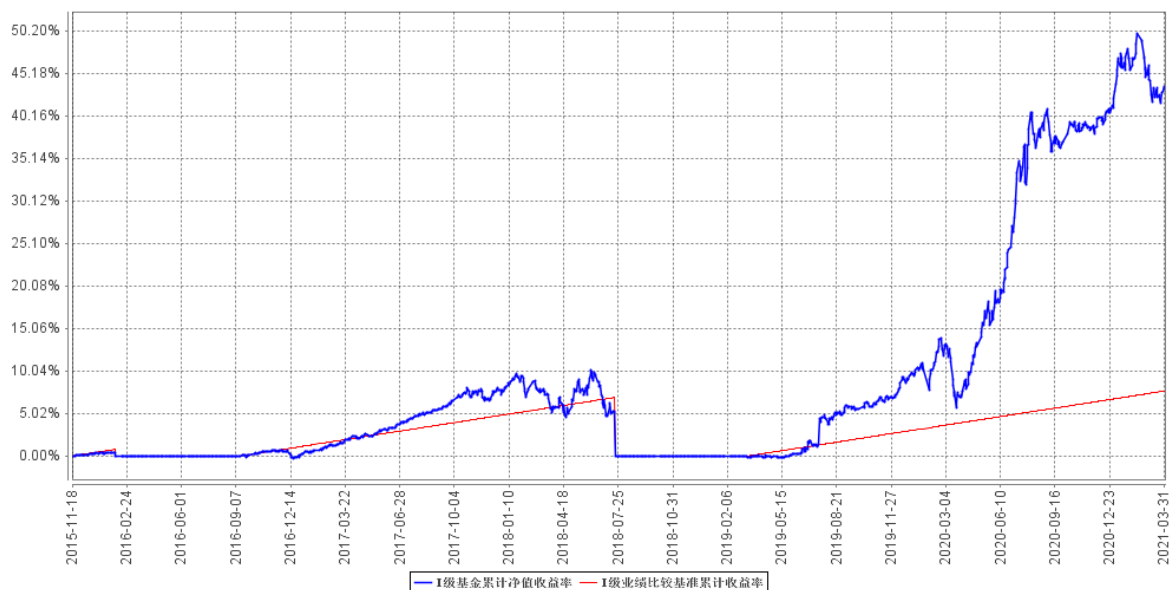
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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：1、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，并存续至今。

2、根据本基金合同规定，基金管理人应当自本基金合同生效之日起六个月内使本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。截止本报告期末，本基金各项资产配置比例符合本基金合同约定。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|------------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈伯祯 | 基金经理 | 2019 年 10 月 29 日 | - | 16 | 硕士研究生学历,16 年证券从业经历。曾任职于宏利证券投资信托股份有限公司(台湾)、泰达宏利基金管理有限公司、富兰克林华美证券投资信托股份有限公司(台湾),从事投资、研究相关工作。2018 年 4 月起 |

| | | | | | |
|----|------|-----------------|---|----|---|
| | | | | | 加入银河基金。2018 年 6 月起担任银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2019 年 10 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, 2020 年 2 月起担任银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2020 年 8 月起担任银河龙头精选股票型发起式证券投资基金、银河臻优稳健配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 刘铭 | 基金经理 | 2017 年 4 月 29 日 | - | 10 | 硕士研究生学历, 10 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，2019 年 6 月起担任银河睿安纯债债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起担任银河久泰纯债债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 12 月起担任银河睿鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 卢轶乔 | 基金经理 | 2017 年 4 月 29 日 | - | 13 | 博士研究生学历，13 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、上表中的任职日期及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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

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》、《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，努力实现基金份额持有人的利益，无损害基金份额持有人利益的行为，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定的回报。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度债券市场总体震荡上行，整个季度 1-3Y 国开上行 20BP 左右，5-7Y 国开上行 10BP 左右，10Y 国开上行 5BP 左右，曲线整体熊平。资金利率方面，一季度整体相对于去年四季度保持平稳，隔夜 7 天价格收敛，R001 一季度均值在 2.05% 附近，上行 24BP 左右，R007 均值在 2.39%，下行 12BP 左右。除 1 月底资金面出现明显收紧外，整体资金面持续宽松，跨季也较为平稳。一季度公开市场操作总体净回笼 5500 亿，其中 MLF 净回笼 405 亿。

债券方面，一季度债市先上后下，整体震荡向上。1 月份，央行缩量续作 MLF，同时公开市场持续净回笼，去年底资金宽松的局面不再，短端在资金面大幅收紧的冲击下快速上行；2 月份，资金面平稳短端价格稳中有降，但随着大宗商品价格大涨引发通胀担忧以及美债超预期上行，中长端收益率快速调整；3 月份，一方面资金面保持持续宽松，另一方面中美中欧等外部关系的冲突及股市持续调整导致避险情绪增加，曲线整体下行，整体走势趋于熊平。信用债方面，市场防守情绪较浓，短端收益率下行而中长端收益率小幅上行，1Y 及以下下行 5BP 左右，3Y 上行 6BP 左右，5Y 持平。

在本季度的运作期内，权益方面，基本维持行业配置比例不变。债券方面，参与了中长端利率债的交易，调整了利率债和信用债的配置比例。另外，基金还参与了新股和可转债的申购。

4.5 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 1.531 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.13%；截至本报告期末银河鑫利混合 C 基金份额净值为 1.517 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.07%；截至本报告期末银河鑫利混合 I 基金份额净值为 1.433 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.14%；同期业绩比较基准收益率为 0.92%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 144,480,768.61 | 26.92 |
| | 其中：股票 | 144,480,768.61 | 26.92 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 309,965,600.36 | 57.75 |
| | 其中：债券 | 304,039,600.36 | 56.64 |
| | 资产支持证券 | 5,926,000.00 | 1.10 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 72,700,000.00 | 13.54 |
| | 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 | 4,674,626.77 | 0.87 |
| 8 | 其他资产 | 4,937,198.63 | 0.92 |
| 9 | 合计 | 536,758,194.37 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,130,639.00 | 0.40 |
| B | 采矿业 | 2,465,113.00 | 0.46 |
| C | 制造业 | 89,183,763.83 | 16.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,838,348.12 | 0.53 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 418,072.40 | 0.08 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,732,966.00 | 0.51 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,212,844.04 | 0.41 |
| J | 金融业 | 31,144,975.10 | 5.81 |
| K | 房地产业 | 2,857,720.00 | 0.53 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,159,829.92 | 0.40 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,719,080.00 | 0.51 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 43,536.60 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 1,005,105.60 | 0.19 |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,568,775.00 | 0.48 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 144,480,768.61 | 26.96 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 6,552 | 13,162,968.00 | 2.46 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 93,500 | 7,358,450.00 | 1.37 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 131,561 | 6,722,767.10 | 1.25 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 13,600 | 4,381,512.00 | 0.82 |
| 5 | 601628 | 中国人寿 | 123,400 | 3,926,588.00 | 0.73 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 13,200 | 3,537,336.00 | 0.66 |
| 7 | 000333 | 美的集团 | 41,100 | 3,379,653.00 | 0.63 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 53,900 | 3,013,010.00 | 0.56 |
| 9 | 300760 | 迈瑞医疗 | 7,100 | 2,833,681.00 | 0.53 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 80,157 | 2,711,711.31 | 0.51 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 2,499,000.00 | 0.47 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 290,125,000.00 | 54.13 |
| | 其中：政策性金融债 | 89,764,000.00 | 16.75 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 10,190,000.00 | 1.90 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,225,600.36 | 0.23 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 304,039,600.36 | 56.73 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 200211 | 20 国开 11 | 500,000 | 49,950,000.00 | 9.32 |
| 2 | 2028047 | 20 交通银行 02 | 400,000 | 40,172,000.00 | 7.50 |
| 3 | 163830 | 20 华泰 S4 | 400,000 | 40,016,000.00 | 7.47 |
| 4 | 149288 | 20 长江 06 | 300,000 | 30,063,000.00 | 5.61 |
| 5 | 163842 | 20 国君 S3 | 300,000 | 30,051,000.00 | 5.61 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 179709 | QCF3A1 | 100,000 | 5,926,000.00 | 1.11 |

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金未进行贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂不参与股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不参与国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

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

5.11.2 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没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 167,952.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | 840,597.57 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,928,592.16 |
| 5 | 应收申购款 | 55.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,937,198.63 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 619,281.00 | 0.12 |
| 2 | 123049 | 维尔转债 | 164,605.60 | 0.03 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 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 |
|-------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 149,494,270.38 | 32,662,854.42 | 160,073,235.69 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 31,991,586.77 | 17,533,240.05 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,013,347.75 | 2,055,458.88 | 29,850,448.65 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列） | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 180,472,509.40 | 48,140,635.59 | 130,222,787.04 |

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额。

2、总赎回份额含转换出份额。

3、基金合同生效日为：2015 年 4 月 22 日。

4、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 类基金新增基金份额 200,000,000.00 份；2018 年 7 月 19 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，并存续至

今。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 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 | 20210101-20210331 | 96,784,183.59 | 31,968,670.08 | 29,850,448.65 | 98,902,405.02 | 27.56% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
- 5、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021) 38568888 / 400-820-0860

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司

2021 年 4 月 21 日