银河泽利保本混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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:2016年3月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2015年4月9日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河泽利保本混合
场内简称	-
基金主代码	519954
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9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	2,709,813,569.63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	-

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金应用优化的恒定比例投资保险策略(优化的CPPI策略),并引入保证人,在保证本金安全的基础上,本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下,力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。
投资策略	本基金运用优化的恒定比例组合保险原理,动态调整保本资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保本基金在保本周期到期时的本金安全,并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。

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	董伯儒	刘晔
	联系电话	021-38568888	010-66226586
	电子邮箱	dongborui@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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	1.上海市世纪大道1568号中建大厦15楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年4月9日(基金合同生效日)-2015年12月31日	2014年	2013年
本期已实现收益	-52,896,907.26	-	-
本期利润	-34,228,488.70	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0119	-	-
本期基金份额净值增长率	-1.00%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0167	-	-
期末基金资产净值	2,682,312,742.39	-	-
期末基金份额净值	0.990	-	-

注:1.本基金合同生效期未满一年。
2.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;
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(为期末金额,不是当期发生数)。
4.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

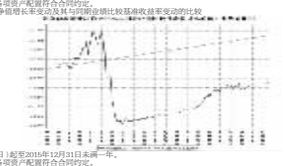
3.2 基金净值表现

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	2.38%	0.15%	0.95%	0.01%	1.43%	0.14%
过去六个月	3.13%	0.12%	1.89%	0.01%	1.24%	0.11%
自基金合同生效起至今	-1.00%	0.30%	2.74%	0.01%	-3.74%	0.29%

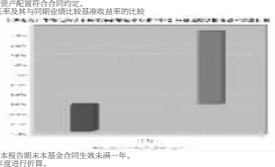
注:1.本基金合同生效日(2015年4月9日)起至2015年12月31日未满一年。
2.截止2015年10月9日建仓期满,本基金各项资产配置符合合同约定。

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.本基金自合同生效日(2015年4月9日)起至2015年12月31日未满一年。
2.截止2015年10月9日建仓期满,本基金各项资产配置符合合同约定。

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



注:1.本基金合同于2015年4月9日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满一年。
2.本项目按实际存续期计算,不按整个会计年度进行折算。

§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设立于2002年4月14日,公司的股东分别为中国银河证券股份有限责任公司(股权股东)、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。

目前,除本基金外,银河基金管理有限公司另管理15封闭式基金与26只开放式证券投资基金,基本情况如下:

1.稳平证券投资基金
类型:契约型封闭式
成立日:2002年8月15日
基金投资目标: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。

2.银河银联系列证券投资基金
本系列基金为契约型开放式基金,由两只基金构成,包括银河稳健证券投资基金和银河收益证券投资基金,每只基金按此数立转换构成一个统一的基金体系。

基金合同生效日:2003年6月4日
(1)银河稳健证券投资基金
基金投资目标:以稳健的投资风格,构造资本增值与收益水平适度匹配的投资组合,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
(2)银河收益证券投资基金
基金投资目标:以债券投资为主,兼顾股票投资,在充分控制风险和保持较高流动性的前提下,实现基金资产的安全及长期稳定增值。

3.银河银泰理财分红证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年3月30日
基金投资目标:追求资产的安全性和流动性,为投资者创造长期稳定的投资回报

4.银河银盛货币市场基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年12月20日
基金投资目标:在确保基金资产安全和高流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的回报。

5.银河银信添利债券型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2007年3月14 日
基金投资目标:在满足本金稳妥与良好流动性的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。

6.银河竞争优势成长混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2008年5月26日
基金投资目标:在有效控制风险,保持良好流动性的前提下,通过主动式管理,追求基金中长期资本增值。

7.银河行业优选混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2008年4月24日
基金投资目标:本基金将"自上而下"的个股优选策略和结合,优选景气行业或预期景气行业中的优势企业进行投资,在有效控制风险,保持良好流动性的前提下,追求基金资产的持续稳定增值。

8.银河沪深300价值指数证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年12月28日
基金投资目标:通过严格的投资纪律和严谨、数字模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段,追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。

9.银河蓝筹精选混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2010年7月16日
基金投资目标:本基金投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司,在有效控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果。

10.银河创新成长混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2010年12月20日
基金投资目标:本基金投资于具有良好成长性的创新类上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

11.银河强化收益债券型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年5月31日
基金投资目标:本基金投资于固定收益类品种,在控制风险,保持资产良好流动性的前提下,追求一定的当期收入和基金资产的长期稳健增值。

12.银河消费驱动混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年7月29日
基金投资目标:本基金通过深入研究,重点投资与居民消费密切相关的行业中具有竞争优势的上市公司,分享由于中国巨大的人口基数、收入增长和消费结构变革所带来的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求基金资产长期稳定增值。

13.银河美利债券型证券投资基金(LOF)
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年4月26日
基金投资目标:在有效控制风险的前提下,力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

14.银河主题策略混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年9月21日
基金投资目标:本基金严格控制风险的前提下,采用主题投资策略和精选个股策略的方法进行投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。

15.银河先锋债券型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年11月26日
基金投资目标:在有效控制风险的前提下,力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

16.银河沪深300基础指数分级证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2013年3月29日
基金投资目标:本基金为赌强势股票指数基金,力求对沪深300成长指数进行有效跟踪,在模拟投资、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实现公正、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投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析。

针对同时发生交易的、本基金与其他投资组合发生交易的、公司对整个市场的交易情况进行了梳理和分析,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分析分析,并针对盘价金额、占统计规模及其差异绝对值等进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。

针对定价交易异常情况,公司对整个不同投资组合的定价方式(包括权责系统估值、公允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或交易少于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)。

对于以公允价值计量的证券,公司根据相关法律法规及证券投资基金估值业务指引,在充分考虑市场因素、证券品种的特性、比例分配的原则对获配额度进行分配。

4.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,中国宏观经济继续规模收缩,全年GDP增速6.9%,四季度同比6.8%,环比增速低于三季度,显示经济下行压力继续存在。整体来看,经济继续转型,全年保持平稳。价格指数方面,CPI维持低位,PPI同比持续为负,通胀压力相小。货币政策方面,央行整体政策较为宽松,全年通动保持稳定,资金面除个别时点略紧张,整体充沛。财政政策方面,政府推动了积极的财政政策,以期通过财政资金带动经济下行压力。

债券市场方面,从基本面来看,平稳的经济面和较低的通胀概有利于债市,全年债市表现相对较好,收益率曲线整体平坦化下移,各期限利率债和各评级、期限信用债均有较大涨幅。整体方面,上半年市场大幅上涨,下半年震荡调整,可转债方面,上半年出现了一波牛市行情,之后存量大幅减少,下半年以震荡为主。

2015年,沪深指数4月成立,5月债券市场调整,基金债券配置较少。三季度,沪深指数在IPO暂停后开始加仓债券资产,主要配置品种为短久期中等评级信用债,控制信用风险,积累安全垫,四季度债券趋势了相对配置,权益部分,基金四月开始新申购,和重安全垫,并在CPI模型控制下逐步在二级市场买入股票。三季度在市场调整过程中大幅减仓,后续产品投资,四季度开始重仓,并在CPI模型控制下逐步在二级市场买入股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年银河泽利保本混合型证券投资基金净值增长-1.00%,同期比较基准为2.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望展望

展望后续经济表现,中国经济继续规模收缩,全年GDP增速或将下降至6.8%,且环比增速低于三季度,显示经济下行压力仍然很大。预计政府稳增长措施将继续推进,货币政策有望进一步宽松,财政政策也将持续发力,以托底经济。价格指数方面,CPI继续维持低位,预示普通居民消费需求仍然不强,但考虑到猪肉等食品价格受季节性影响,且上涨之力,非食品项和食品项都预示着后续通胀大幅反弹可能性较低。整体来看,经济转弱,通胀较低,也预示着货币政策宽松。货币政策整体宽松的动势料将持续,新政政策也将推进。

债券市场方面,经济低压环境,通胀较低,央行宽松预期为主,长期国对债市有利。短期来看,短端利率债收益率依然较低,受制于资金利率水平,继续大幅下行概率较小,长端利率债收益率受过期货利率影响,于目前达到了历史较低水平,总体了市场对中国经济的系统预期,利率长期趋势仍然向下,但受制于资金面,短期内,期货市场调整风险,信用债方面,收益率曲线持续平坦化下移,信用利差收窄,中短久期信用债表现相对较好,长久期信用债表现相对较差。

本报告期内,为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益,监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则,依据国家有关法律法规、基金合同和管理制度,采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式,对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的控制及相应制度进行了持续的监察稽核,对发现的问题进行跟示和追踪调查,以期督促有关部门采取有效措施改进。

本基金管理人采取的主要稽核内容:

(1)根据银河证券基金管理有限公司内部控制制度,采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式,多次组织全体员工开展《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其配套法规,公司内部制度等的学习,通过上述学习宣传活动,使员工加深了对法律法规的认识,并进一步培养法律意识与内控制度落实到日常工作中,确保其行为不违反法律、严格自律、恪守诚实信用原则,以及保守基金持有人利益为目标。

(2)继续完善公司内部控制,严格按照现代企业制度的要求,以规范经营运作、健全、健全了相关结构和运行机制,明确界定董事会、监事会职责范围,认真贯彻了"独立董事制度、重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意,保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥,保证了各项重大决策的客观公正。

(3)不断完善规章制度体系,根据国家有关法律法规及证券投资公司实际运作的要求,对现有的规章制度体系不断进行完善,对经营管理中出现的问题,及时制定相应的管理制度,并根据实际情况,对管理制度进行修改。

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颁布的、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。

为确保估值的公允性,公平性,本基金管理人设立了估值工作小组,由基金管理人的投资、研究、风控、监察、市场、运营、基金会计、基金核算、基金估值业务人员等人员组成,其中,估值小组成员具有证券、基金、会计、法律、经济等相关专业知识和从业经验,其中,基金经理不参与估值工作小组的决策。

估值小组定期召开会议,对估值政策、估值方法、估值程序、估值结果等进行讨论、决策。

4.7 报告期内利润分配情况的说明

1.保本期期内,仅在满足基金分红一年期基金份额持有人利益为目标,以基金份额为配方式,本报告期内,本基金未进行分红。

2.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10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配"。

3.本《基金合同》生效日为2015年4月9日,截止2015年12月31日,未满1年。

4.截止2015年12月31日,本基金可供分配利润-0.2671元,0.01元,未满足进行利润分配。

5.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况的说明

注:无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规声明

在本报告期内,本基金托管人根据法律法规及基金合同、托管协议和其他有关规定,对基金管理人在投资基金过程中,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、托管协议等有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,以保证资金安全、保证基金资产的增值和收益。

5.2 托管人对报告期内基金投资运作、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。本发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核申报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,保证复核内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

姓名	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2016)审字第60821717_B25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	银河泽利保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的银河泽利保本混合型证券投资基金财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表和2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银河基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)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而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评估管理层采用的会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了银河泽利保本混合型证券投资基金2015年12月31日的财务状况以及2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	郭杭翔 蒋燕华
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)
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	2016年3月23日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:银河泽利保本混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	3,594,739.41	-
结算备付金		17,511,529.93	-
存出保证金		1,441,056.49	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,400,437,834.10	-
其中:股票投资		149,591,496.90	-
基金投资		-	-
债券投资		2,250,846,337.20	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		200,040,126.69	-
应收利息	7.4.7.5	63,510,733.02	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,226,414.93	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,687,762,434.57	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,288,203.03	-
应付管理人报酬		2,747,712.30	-
应付托管费		457,952.05	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	686,109.40	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	269,715.40	-
负债合计		5,449,692.18	-
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,709,813,569.63	-
未分配利润	7.4.7.10	-27,500,827.24	-
所有者权益合计		2,682,312,742.39	-
负债和所有者权益总计		2,687,762,434.57	-

注:1.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.990元,基金份额总额2,709,813,569.63份。
2.本基金合同于2015年4月9日生效,至报告期末未满1年。

7.2 利润表
会计主体:银河泽利保本混合型证券投资基金
本报告期:2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目		本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		146,687,937.28	149,591,496.90	2,903,559.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	586,980,111.90	584,244,937.20	-2,735,174.70
	银行间市场	1,648,101,366.36	1,666,601,400.00	18,500,033.64
	合计	2,235,081,478.26	2,250,846,337.20	15,764,858.94
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,381,769,415.54	2,400,437,834.10	18,668,418.56

7.4.2.2 衍生金融资产/负债
注:本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。
7.4.3.4 买入返售金融资产
7.4.3.1 各项买入返售金融资产期末余额
注:本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。
7.4.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券
注:本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。
7.4.3.3 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	29,168.65	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	8,668.11	-
应收债券利息	63,472,182.91	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	713.35	-
合计	63,510,733.02	-

7.4.7.6 其他资产
注:本基金本报告期末无其他资产余额。
7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	685,944.40	-
银行间市场应付交易费用	165.00	-
合计	686,109.40	-

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	19,715.40	-
预提费用	250,000.00	-
合计	269,715.40	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,988,454,525.12	2,988,454,525.12
本期申购	28,782,232.27	28,782,232.27
本期赎回(以"-"号填列)	-307,423,187.76	-307,423,187.76
-基金拆分/分份额拆算前	-	-
基金拆分/分份额拆算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	2,709,813,569.63	2,709,813,569.63

注:"1.申购"含红利再投、转换入份额,赎回"含转出份额。
(2)本基金合同于2015年4月9日生效,设立日募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币2,987,662,767.94元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币801,757.18元,以上实收基金(本息)合计为人民币2,988,464,525.12元,折合2,988,464,525.12份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-52,896,907.26	18,668,418.56	-34,228,488.70
本期基金份额交易产生的变动数	7,625,901.83	-898,240.37	6,727,661.46
其中:基金申购款	-397,702.84	218,778.19	-178,924.65
基金赎回款	8,023,604.67	-1,117,018.56	6,906,586.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-45,271,005.43	17,770,178.19	-27,500,827.24

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	1,097,456.21	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	580,016.87	-
其他	13,396.96	-
合计	1,690,868.04	-

7.4.7.12 股票投资收益
7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	1,329,013,072.15	-
减:卖出股票成本总额	1,427,914,104.27	-
买卖股票差价收入	-98,901,032.12	-

7.4.7.12 债券投资收益
7.4.7.12.1债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	2,324,390.55	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,324,390.55	-

7.4.7.12.2债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	69,548,160.39	-
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	67,209,003.86	-
减:应收利息总额	14,765.98	-
买卖债券差价收入	2,324,390.55	-

7.4.7.13 资产支持证券投资收益
注:本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。
7.4.7.14 贵金属投资收益
7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成
注:本基金本报告期末无贵金属投资收益。
7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入
注:本基金本报告期末无贵金属投资收益。
7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入
注:本基金本报告期末无贵金属投资收益。
7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入
注:本基金本报告期末无贵金属投资收益。
7.4.7.15 衍生工具收益
7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入
注:本基金本报告期末无衍生工具收益。
7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益
注:本基金本报告期末无衍生工具收益。
7.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,335,824.56	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,335,824.56	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.交易性金融资产	18,668,418.56	-
——股票投资	2,903,559.62	-
——债券投资	15,764,858.94	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	18,668,418.56	-

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目名称	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	2,863,924.70	-
其他	21,071.81	-
转换费收入	438.69	-
合计	2,885,435.20	-

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	4,299,750.37	-
银行间市场交易费用	8,920.00	-
合计	4,278,670.37	-

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	100,000.00	-
信息披露费	230,000.00	-
其他	400.00	-
资金汇划费	5,512.43	-
帐户维护费	7,500.00	-
合计	343,412.43	-

7.4.7.21 分红报告
无。
7.4.8 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、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国投融资担保有限公司	保证人
中国银河证券股份有限公司	回购基金管理人第一大股东控制、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司	基金管理人的第一大股东
中国石油天然气集团公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海城投(集团)有限公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
注:以下关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款订立。
7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年4月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
北京银行	3,594,739.41	1,097,455.21	-	-

7.4.9.2 本报告期末持有的因参与关联方承销证券投资的情况
注:本基金本报告期末未参与期内直接向人关联方承销的证券。
7.4.9.3 其他关联交易事项的说明
无。
7.4.10 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。
7.4.10.2 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
300049	福瑞股份	2015年11月30日	筹划重大事项	31.00	2016年1月4日	30.95	400,000	12,258,230.48	12,400,000.00	-

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2015年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。
7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2015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。
7.4.11 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2015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金额为人民币137,191,496.90元,属于第二层次的金额为人民币2,263,246,327.20元,无属于第三层次的余额。
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,可转换债券,资产支持证券和私募债券,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复牌日期间,交易不活跃期间及限售期间不采用实时公允价值列入第一层次;持有