银河量化优选混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2018年8月28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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月27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2018年1月1日起至6月30日止。

本半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	银河量化优选混合
场内简称	-
基金主代码	004250
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4月27日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	59,086,804.66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	本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资,在严格控制风险的前提下,力求基金资产长期、稳定的增值。
投资策略	本基金将运用量化选股模型,以量化多因子选股、事件驱动选股策略为主,辅以量化行业配置、套利策略等多个策略,力求寻找基本面良好,并能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。同时,本基金也将对基金整体的波动和风险进行控制,力求基金资产长期、稳定的增值。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中等风险、中等收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	郭明
	联系电话	021-38568989	010-66105799
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95588
传真		021-38568769	010-66105798

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	http://www.galaxyasset.com
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、北京市西城区复兴门内大街55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

3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-2,021,378.23
本期利润	-3,232,445.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0700
本期基金份额净值增长率	-7.45%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0436
期末基金资产净值	56,510,453.78
期末基金份额净值	0.9564

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

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

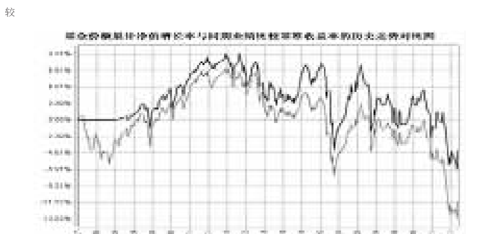
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.55%	1.54%	-7.36%	1.49%	3.81%	0.05%
过去三个月	-7.10%	1.24%	-11.49%	1.10%	4.39%	0.14%
过去六个月	-7.45%	1.29%	-12.59%	1.15%	5.14%	0.14%
过去一年	-5.18%	1.05%	-11.19%	0.97%	6.01%	0.08%
自基金合同生效起至今	-4.36%	0.97%	-11.50%	0.95%	7.14%	0.02%

注:本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%,每日进行再平衡过程。

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:根据本基金合同规定,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:本基金股票投资比例为基金资产的60-95%;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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证、股指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。

§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2018年6月30日,银河基金公司旗下共管理58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、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金、银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金、银河量化价值混合型证券投资基金、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、银河量化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、银河量化多策略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。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
楼华锋	基金经理	2017年4月27日	-	8	中共党员,硕士研究生学历,8年证券从业经历,先后就职于东方证券股份有限公司研究所分析师、光大证券股份有限公司信用业务高级经理、方正证券股份有限公司研究所分析师。2015年8月加入银河基金管理有限公司,现任数量与指数工作室负责人、基金经理。2016年1月起担任银河定投宝中证腾讯济安价值100A股指数型发起式证券投资基金的基金经理,2016年12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4月起担任银河量化优选混合型证券投资基金的基金经理,2017年10月起担任银河量化价值混合型证券投资基金的基金经理,2017年12月起担任银河量化稳进混合型证券投资基金的基金经理,2018年2月起担任银河量化配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年3月起担任银河量化多策略混合型证券投资基金的基金经理,2018年4月起担任银河犇利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、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,2018年6月起担任银河量化成长混合型证券投资基金的基金经理。

注:1、上表中任职日期为该基金合同生效之日;

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2018年上半年沪深300下跌12.9%,中证500下跌16.53%。市场整体普跌格局,从半年看只有医药、消费等部分板块获得正收益,抱团现象比2017年更加严重。

今年以来风格波动较大,市场波动率增大,市场的驱动变量有所变化。大类因子回顾来看:大市值效应非常明显,市场偏好各个行业中的龙头,大市值明显较小市值占优。估值类因子整体表现较好,DP、EP和PEG表现都远高于历史平均,但是BP因子表现则差强人意,重资产股票表现较轻资产更差。成长类因子表现符合预期;盈利类因子整体表现不错,体现市场在下跌行情中非常关注盈利。反转类因子:由于波动率上行,短期反转因子开始表现,相信随着波动率进一步上行,反转效应会进一步提升。

基金在上半年还是主要维持价值、成长、盈利等基本面因子的配置,随着3季度的市场波动上升可能还会适当增加价格、交易量类的因子配置。本基金在仓位上将在基准仓位上小幅度偏离,争取通过量化多因子模型精选个股取得相对基准的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9564元;本报告期基金份额净值增长率为-7.45%,业绩比较基准收益率为-12.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济上我们认为经济稳健小幅下行,经济是平的这一事实不会改变;二季度开始国内出现了明显的宏微观数据背离,即宏观上投资、社融数据二季度出现滑坡,而中微观数据显示经济仍然相当平稳。我们认为宏微观背离源于金融去杠杆,而非实体经济真正出现滑坡。因此我们对于经济观点仍然认为是小幅下行,总体平稳。二季度金融去杠杆、贸易战、资管新规、房地产调控等利空陆续落地。近期的市场暴跌,释放了上述利空因素,股债性价比出现了改善,资管新规落地到执行的预期差、中美贸易战变成了慢变量。因此我们认为指数不应该过于悲观,在市场情绪修复企稳之后,无论是成长、周期前期跌幅较大的股票在下半年可能都会有机会。

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

根据本基金《基金合同》约定: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12次,每次收益分配比例不得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。

本基金本报告期末可供分配利润为:-2,576,350.88元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,《公开募集证券投资基金运作管理办法》实施后,银河量化优选混合型证券投资基金2018年1月18日起低于5000万,6月4日回5000万以上。

§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

本报告期内,本基金托管人在对银河量化优选混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,银河量化优选混合型证券投资基金的管理人——银河基金管理有限公司在银河量化优选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对银河基金管理有限公司编制和披露的银河量化优选混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:银河量化优选混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		2,055,598.52	12,351,709.71
结算备付金		1,929,146.35	434,836.08
存出保证金		426,883.48	68,019.15
交易性金融资产		47,091,914.09	47,197,137.84
其中:股票投资		45,084,314.09	47,197,137.84
基金投资		-	-
债券投资		2,007,600.00	-
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		6,000,000.00	-
应收证券清算款		201,765.49	-
应收利息		18,566.15	11,881.83
应收股利		-	-
应收申购款		5,039.23	1,390.04
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		57,728,913.31	60,064,974.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		848,984.73	-
应付赎回款		1,847.30	319,218.03
应付管理人报酬		65,957.57	77,529.41
应付托管费		10,992.94	12,921.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		96,286.53	217,632.51
应交税费		499.33	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		193,891.13	261,203.08
负债合计		1,218,459.53	888,504.58
所有者权益:			
实收基金		59,086,804.66	57,266,077.16
未分配利润		-2,576,350.88	1,910,392.91
所有者权益合计		56,510,453.78	59,176,470.07
负债和所有者权益总计		57,728,913.31	60,064,974.65

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9564元,基金份额总额59086804.66份。

6.2 利润表

会计主体:银河量化优选混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日
一、收入		-2,408,399.03	3,501,166.47
1.利息收入		53,351.89	1,630,911.50
其中:存款利息收入		20,886.15	918,959.49
债券利息收入		10,356.16	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		22,109.58	711,952.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,309,764.22	71,686.27
其中:股票投资收益		-1,789,917.21	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		14,860.84	-
股利收益		465,292.15	71,686.27
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-1,211,067.31	1,191,656.27
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		59,080.61	606,912.43
减:二、费用		824,046.51	1,254,437.69
1.管理人报酬		348,631.13	932,209.87
2.托管费		58,105.24	155,368.30
3.销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		269,599.51	77,035.62
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		147,657.13	89,823.90
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-3,232,445.54	2,246,728.78
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-3,232,445.54	2,246,728.78

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银河量化优选混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	57,266,077.16	1,910,392.91	59,176,470.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-3,232,445.54	-3,232,445.54
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)	1,820,727.50	-1,254,298.25	566,429.25
其中:1.基金申购款	26,108,475.27	-328,172.68	25,780,302.59
2.基金赎回款	-24,287,747.77	-926,125.57	-25,213,873.34
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)	59,086,804.66	-2,576,350.88	56,510,453.78
项目	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	2,246,728.78	2,246,728.78
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)	-161,499,213.07	-291,219.60	-161,790,432.67
其中:1.基金申购款	52,470.91	175.55	52,646.46
2.基金赎回款	-161,551,683.98	-291,395.15	-161,843,079.13
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)	-161,499,213.07	1,955,509.18	-159,543,703.89

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:

______范永武______ ______范永武______ ____虞晓清____

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

银河量化优选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〔2016〕3089号《关于准予银河量化优选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2017年3月24日到2017年4月24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(2017)验字第60821717_B05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2017年4月27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389,335,908.89元,在募集期间产生的存款利息为人民币238,575.92元,以上实收基金(本息)合计为人民币389,574,484.81元,折合389,574,484.81份基金份额。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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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(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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单)、权证、股指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占基金资产的比例为60%-95%,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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证、股指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:中证500指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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(以下合称"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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司	同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

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 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	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
银河证券	-	-	76,231,270.10	100.00%

6.4.8.1.2 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。

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 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	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017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
银河证券	-	-	1,589,500,000.00	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均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 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017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	70,274.99	100.00%	70,274.99	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上海证券交易所买(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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	348,631.13	932,209.87
其中:支付销售机构的客户维护费	146,277.03	-

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×1.50%÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,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款指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,105.24	155,368.30

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×0.25%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,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款指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

注:本基金不设销售服务费。

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:本基金报告期及上一报告期末均未与关联方进行银行间同业债券(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:本基金本期与上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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:本基金本期末与上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
工商银行	2,055,598.52	17,980.15	11,240,478.94	179,223.81

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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018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

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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暂时停牌等流通受限股票。

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,本基金无从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

2 以公允价值计量的金融工具

2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年6月30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45,084,314.09元,属于第二层次的余额为人民币2,007,600.00元,属于第三层次余额为人民币0.00元。

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债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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末未发生变动。

§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	45,084,314.09	78.10
	其中:股票	45,084,314.09	78.10
2	固定收益投资	2,007,600.00	3.48
	其中:债券	2,007,600.00	3.48
	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	6,000,000.00	10.39
	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	3,984,744.87	6.90
7	其他各项资产	652,254.35	1.13
8	合计	57,728,913.31	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,245,358.80	3.97
C	制造业	31,179,547.33	55.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	745,143.00	1.32
E	建筑业	441,700.00	0.78
F	批发和零售业	1,057,510.00	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	313,233.00	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,420,531.96	7.82
J	金融业	2,130,340.00	3.77
K	房地产业	2,550,950.00	4.51
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	45,084,314.09	79.78

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	600031	三一重工	138,100	1,238,757.00	2.19
2	600273	嘉化能源	123,900	1,122,534.00	1.99
3	600309	万华化学	21,200	962,904.00	1.70
4	000718	苏宁环球	256,400	940,988.00	1.67
5	300532	今天国际	51,992	908,300.24	1.61
6	600351	亚宝药业	124,700	905,322.00	1.60
7	600256	广汇能源	218,780	894,810.20	1.58
8	300427	红相股份	61,800	889,920.00	1.57
9	000799	酒鬼酒	31,000	860,250.00	1.52
10	601318	中国平安	14,600	855,268.00	1.51

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	600256	广汇能源	1,973,220.00	3.33
2	002016	世荣兆业	1,820,598.00	3.08
3	601899	紫金矿业	1,246,880.00	2.11
4	002111	威海广泰	1,213,850.00	2.05
5	600031	三一重工	1,186,300.00	2.00
6	601288	农业银行	1,119,200.00	1.89
7	600029	南方航空	1,071,548.00	1.81
8	002332	仙琚制药	1,064,250.00	1.80
9	600273	嘉化能源	1,051,920.00	1.78
10	600606	绿地控股	1,027,776.00	1.74
11	601003	柳钢股份	1,002,037.00	1.69
12	000718	苏宁环球	999,678.00	1.69
13	000528	柳工	986,509.00	1.67
14	002675	东诚药业	986,115.00	1.67
15	600351	亚宝药业	958,347.00	1.62
16	002587	奥拓电子	941,531.00	1.59
17	600050	中国联通	927,678.00	1.57
18	000100	TCL集	926,757.00	1.57
19	600664	哈药股份	924,426.00	1.56
20	300274	阳光电源	914,544.00	1.55

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	002016	世荣兆业	2,061,521.00	3.48
2	600845	宝信软件	2,031,783.00	3.43
3	600708	光明地产	1,374,185.00	2.32
4	000725	京东方A	1,271,069.00	2.15
5	600754	锦江股份	1,227,666.00	2.07
6	600516	方大炭素	1,186,857.00	2.01
7	600507	方大特钢	1,170,570.00	1.98
8	002332	仙琚制药	1,169,508.00	1.98
9	601006	大秦铁路	1,128,773.00	1.91
10	600256	广汇能源	1,127,411.00	1.91
11	600031	三一重工	1,117,570.00	1.89
12	600572	康恩贝	1,114,256.00	1.88
13	600525	长园集团	1,105,307.56	1.87
14	600580	卧龙电气	1,077,074.00	1.82
15	600888	新疆众和	1,049,207.00	1.77
16	002195	二三四五	1,048,287.68	1.77
17	002279	久其软件	1,047,731.00	1.77
18	603518	维格娜丝	1,035,781.00	1.75
19	601717	郑煤机	1,031,020.00	1.74
20	600219	南山铝业	1,026,622.00	1.73

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	89,665,529.85
卖出股票收入(成交)总额	88,979,118.25

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,007,600.00	3.55
	其中:政策性金融债	2,007,600.00	3.55
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,007,600.00	3.55

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	018005	国开1701	20,000	2,007,600.00	3.55

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1808	中证500股指期货1808	2	2,056,880.00	51,013.33	-
公允价值变动总额合计(元)					51,013.33
股指期货投资本期收益(元)					15,306.67
股指期货投资本期公允价值变动(元)					51,013.33

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货以套期保值为主要目的,近期IC合约贴水幅度较大,做多部分合约进行多头套保。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	426,883.48
2	应收证券清算款	201,765.49
3	应收股利	-
4	应收利息	18,566.15
5	应收申购款	5,039.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	652,254.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§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

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
921	64,155.05	13,659,971.96	23.12%	45,426,832.70	76.88%

8.3 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	39,556.97	0.0669%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2017年4月27日)基金份额总额	389,574,484.81
本报告期期初基金份额总额	57,266,077.16
本报告期基金总申购份额	26,108,475.27
减:本报告期基金总赎回份额	24,287,747.77
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	59,086,804.66

§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未发生重大人事变动。

二、报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

报告期内基金投资策略无改变。

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

本报告期内,基金管理人收到上海证监局《关于对银河基金管理有限公司采取责令整改措施的决定》,责令公司进行整改并暂停受理公募基金注册申请3个月,对相关人员采取行政监管措施。公司高度重视,制定并实施相关整改措施,并将及时向监管部门提交整改报告。

除上述情况外,本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
东方证券	1	87,475,834.91	48.97%	79,716.22	48.42%	-
国金证券	1	48,311,335.26	27.04%	44,992.74	27.33%	-
川财证券	1	28,663,561.93	16.05%	26,694.49	16.22%	-
高华证券	1	14,193,916.00	7.95%	13,218.75	8.03%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注: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。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	85,800,000.00	94.49%	-	-
川财证券	2,007,200.00	100.00%	5,000,000.00	5.51%	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

§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

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。

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

2018年8月28日