银河银泰理财分红证券投资基金 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	银河银泰混合
场内简称	-
基金主代码	150103
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	2004年3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
报告期末基金份额总额	1,124,207,354.57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	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。
投资策略	1、资产配置策略 本基金采用多因素分析框架，从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求因素等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判，适度把握市场时机，合理配置股票、债券和现金等各类资产间的投资比例，确定风格资产、行业资产的投资比例布局。 2、股票投资策略 本基金将在投资风险控制计划的指导下，获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择，主要投资于经评估或预期认为具有可持续发展能力的价值型股票和成长型股票，同时兼顾较高的流动性要求。 3、债券投资策略 根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合判断，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上，通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合，为投资者获得长期稳定的回报。
业绩比较基准	上证A股指数× 40%+中证全债指数× 55%＋金融同业存款利率× 5%。
风险收益特征	本基金属于风险较低的投资品种，风险-收益水平介于债券基金与股票基金之间

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楼 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	-99,273,467.55
本期利润	-153,855,389.13
加权平均基金份额本期利润	-0.1344
本期基金份额净值增长率	-11.57%
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	0.0361
期末基金资产净值	1,164,836,098.78
期末基金份额净值	1.0361

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)。

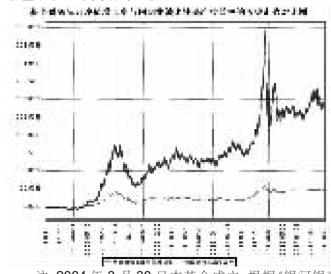
3.2 基金净值表现

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	-5.56%	1.37%	-2.89%	0.46%	-2.67%	0.91%
过去三个月	-6.02%	1.07%	-2.96%	0.42%	-3.06%	0.65%
过去六个月	-11.57%	1.22%	-3.39%	0.43%	-8.18%	0.79%
过去一年	0.66%	1.08%	-2.03%	0.34%	2.69%	0.74%
过去三年	-20.73%	1.78%	-8.16%	0.59%	-12.57%	1.19%
自基金合同生效起至今	535.98%	1.48%	84.65%	0.66%	451.33%	0.82%

注：本基金的业绩比较基准为：上证A股指数× 40%+中证全债指数× 55%＋金融同业存款利率× 5%，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：2004年3月30日本基金成立，根据《银河银泰理财分红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。截止本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§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
张杨	基金经理	2011年10月10日	-	14	硕士研究生学历，CFA，14年证券从业经历，曾先后就职于上海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司，从事宏观经济及股票策略研究工作。2008年9月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理等职务，现任股票投资部副总监、基金经理。2011年10月起担任银河银泰理财分红证券投资基金的基金经理，2016年2月起担任银河主题策略混合型证券投资基金的基金经理，2016年3月起担任银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
杨琪	基金经理	2017年1月7日	-	8	硕士研究生学历，8年金融行业相关从业经历。曾任职于上海原点资产管理有限公司研究部，2011年11月加入我公司，从事投资、研究相关工作。2017年1月起担任银河银泰理财分红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，2017年4月起担任银河美丽优萃混合型证券投资基金的基金经理，2017年7月起担任银河君耀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。

随着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年上半年市场震荡向下，上证指数下跌10.14%，创业板指数下跌15.46%，市场围绕消费有结构性机会，此外其他行业出现较大幅度跌幅，中美贸易争端、国内去杠杆政策导向都进一步带来悲观预期。从行业表现排名来看，居前的是食品饮料、休闲服务、医药等，居后的是通信、军工等偏主题类投资行业。从这一行业表现分布来看，市场投资情绪低落即避险风格主导了市场。

操作层面上，立足于防御的想法得以实现，但整体仓位没有大幅降低，目前仓位为75%，处于同类基金平均水平，结构变化上主要增持了医药、食品、家电行业个股，减持了金融、电子等行业个股。

从行业配置来看，下半年我们看好医疗服务、食品饮料、软件服务、非银等行业。并积极把握高端制造类个股交易性机会。短期医疗服务、食品类公司涨幅较大，估值偏高，存在一定的调整压力，根据市场情况作出一定比例的调整。

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1.0361元；本报告期基金份额净值增长率为-11.57%，业绩比较基准收益率为-3.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从整体宏观环境来看，时隔3年，政府2季度再提"扩大内需"，但此次同时强调了要与"调结构"结合起来。我们认为，"防风险"作为未来三年的三大攻坚战之一，在去杠杆、严监管基调未改之下，此次"扩大内需"将更多围绕经济结构调整展开，紧扣迈向高质量发展的主线。与央行近期定向降准显露的意图相呼应，在中美贸易摩擦走向未定、一季度宏观和社融数据显示经济有承压迹象的情况下，"扩大内需"更多体现了中央主动维护宏观经济平稳运行、并引导稳定的市场预期的意图，货币政策转向的说法还为时尚早。此外，资管新规出台基本符合市场预期并有所宽松，过渡期的大幅延长使得银行和其他金融机构有更充分的时间逐步适应新的监管体系。展望下半年，市场进入调整寻底阶段，结合历史经验，市场跌幅和时间较为充裕，市场有望迎来阶段性低估反弹。在此阶段，投资组合以均衡为主，在下跌中积极寻找投资机会。

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：本基金收益分配比例不低于基金净收益90%；基金收益分配每年至少一次，成立不满3个月，收益可不分配；基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金收益分配后每基金份额资产净值不能低于面值；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。截至本报告期末，本基金可供分配利润为40,628,744.21元。本基金本期末实施利润分配。

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

本报告期内，本基金托管人在对银河银泰理财分红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，银河银泰理财分红证券投资基金的管理人——银河基金管理有限公司在银河银泰理财分红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。本报告期内，银河银泰理财分红证券投资基金未进行利润分配。

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银泰理财分红证券投资基金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：银河银泰理财分红证券投资基金

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		60,403,341.53	32,117,084.12
结算备付金		3,663,697.34	7,560,625.98
存出保证金		721,760.31	697,208.41
交易性金融资产		1,129,671,747.97	1,348,617,778.25
其中：股票投资		876,272,845.57	1,043,615,197.85
基金投资		-	-
债券投资		253,398,902.40	305,002,580.40
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		-	-
应收证券清算款		-	19,628,862.17
应收利息		5,233,877.04	7,899,504.49
应收股利		-	-
应收申购款		155,200.00	525,853.83
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,199,849,624.19	1,417,046,917.25
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		-	25,000,000.00
应付证券清算款		29,548,365.98	13,799,262.14
应付赎回款		356,980.92	987,782.39
应付管理人报酬		1,494,931.53	1,725,904.67
应付托管费		249,155.27	287,650.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,642,406.88	3,187,864.17
应交税费		1,172,998.40	1,172,998.40
应付利息		-	22,952.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		548,686.43	551,089.48
负债合计		35,013,525.41	46,735,504.95
所有者权益：			
实收基金		1,124,207,354.57	1,169,653,980.07
未分配利润		40,628,744.21	200,657,432.23
所有者权益合计		1,164,836,098.78	1,370,311,412.30
负债和所有者权益总计		1,199,849,624.19	1,417,046,917.25

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.0361元，基金份额总额1124207354.57份。

6.2 利润表

会计主体：银河银泰理财分红证券投资基金

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1月1日至2017年6月30日
一、收入		-134,900,577.12	55,011,163.52
1.利息收入		5,407,088.72	6,097,536.16
其中：存款利息收入		141,297.37	185,165.35
债券利息收入		5,265,791.35	5,804,286.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	108,084.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-85,825,780.52	-3,879,563.60
其中：股票投资收益		-94,357,851.82	-9,988,812.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益		111,583.19	-45,105.50
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		8,420,488.11	6,154,354.79
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-54,581,921.58	52,720,247.28
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		100,036.26	72,943.68
减：二、费用		18,954,812.01	15,297,425.06
1. 管理人报酬		9,596,881.83	9,487,635.96
2. 托管费		1,599,480.33	1,581,272.64
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		7,385,473.24	3,397,059.13
5. 利息支出		154,465.43	613,854.39
其中：卖出回购金融资产支出		154,465.43	613,854.39
6. 其他费用		218,057.36	217,602.94
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-153,855,389.13	39,713,738.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-153,855,389.13	39,713,738.46

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：银河银泰理财分红证券投资基金

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)	1,169,653,980.07	200,657,432.23	1,370,311,412.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-153,855,389.13	-153,855,389.13
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)	-45,446,625.50	-6,173,298.89	-51,619,924.39
其中：1.基金申购款	31,314,149.00	4,892,521.15	36,206,670.15
2.基金赎回款	-76,760,774.50	-11,065,820.04	-87,826,594.54
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)	1,124,207,354.57	40,628,744.21	1,164,836,098.78

项目	上年度可比期间 2017年1月1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)	1,289,117,929.52	-2,520,632.05	1,286,597,297.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	39,713,738.46	39,713,738.46
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)	-43,083,653.17	-636,774.12	-43,720,427.29
其中：1.基金申购款	20,475,268.59	28,186.64	20,503,455.23
2.基金赎回款	-63,558,921.76	-664,960.76	-64,223,882.52
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)	1,246,034,276.35	36,556,332.29	1,282,590,608.64

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

银河银泰理财分红证券投资基金(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[2004]12号文《关于同意银河银泰理财分红证券投资基金募集的批复》的核准，由银河基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于2004年3月30日正式生效，首次设立募集规模为6,013,222,027.96份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为银河基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法公开发行上市的具有良好流动性的债券、股票、央行票据、回购等金融工具，以及未来法律法规和中国证监会许可的其他金融工具。其中，债券投资包括国债、金融债、信用评级在投资级以上的企业债(包含可转换公司债券)等。

基金成立6个月之后，本基金资产配置比例的基本范围是：股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%；国债的比例不低于基金资产净值的20%。

本基金的业绩比较基准为：上证A股指数× 40%+中证全债指数× 55%＋金融同业存款利率× 5%。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

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1月1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	294,729,338.64	6.04%	-	-

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1月1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	32,000,000.00	18.29%	-	-

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	274,478.84	6.10%	172,460.18	10.50%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1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	-	-	-	-

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1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,596,881.83	9,487,635.96
其中：支付销售机构的客户维护费	2,659,499.03	2,640,203.65

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

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1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,599,480.33	1,581,272.64

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× 0.25%/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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

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：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均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：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均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及上年度末均未投资本基金。

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 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1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
工商银行	60,403,341.53	94,100.17	5,755,518.85	155,127.07

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

无。

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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	认购新发证券	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	认购新发证券	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	认购新发证券	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603156	养元饮品	2018年2月2日	2019年2月12日	新股限售	78.73	56.94	37,756	2,972,529.88	2,149,826.64	注1
603156	养元饮品	2018年5月8日	2019年2月12日	新股限售-送股	-	56.94	15,102	-	859,907.88	注2
300713	英可瑞	2017年10月23日	2018年11月1日	新股限售	40.29	39.07	7,008	282,352.32	273,802.56	注1
300713	英可瑞	2018年6月19日	2018年11月1日	新股限售-转增	-	39.07	5,606	-	219,026.42	注2

注：1.以上"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。

2.本基金持有的限售新股养元饮品于2018年5月8日实施2017年度权益分派方案，向全体股东每股派送0.4股，因送股所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

本基金持有的限售新股英可瑞于2018年6月19日实施2017年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每10股转增8.00股，因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

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2018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，本基金无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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872,682,251.92元，属于第二层次的余额为人民币253,486,932.55元，属于第三层次余额为人民币3,502,563.50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	876,272,845.57	73.03
	其中：股票	876,272,845.57	73.03
2	固定收益投资	253,398,902.40	21.12
	其中：债券	253,398,902.40	21.12
	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	-	-
	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	64,067,038.87	5.34
7	其他各项资产	6,110,837.35	0.51
8	合计	1,199,849,624.19	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	-	-
C	制造业	603,912,336.19	51.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	49,821,156.00	4.28
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	78,747,176.42	6.76
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,121,548.00	0.35
J	金融业	71,232,602.90	6.12
K	房地产业	4,493,147.37	0.39
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	1,487,626.14	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	62,385,692.70	5.36
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	876,272,845.57	75.23

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	002304	洋河股份	657,646	86,546,213.60	7.43
2	600519	贵州茅台	90,000	65,831,400.00	5.65
3	600763	通策医疗	1,281,810	62,385,692.70	5.36
4	600754	锦江股份	1,611,704	59,568,579.84	5.11
5	600867	通化东宝	2,475,319	59,333,396.43	5.09
6	603589	口子窖	922,728	56,701,635.60	4.87
7	600298	安琪酵母	1,505,830	53,728,014.40	4.61
8	603883	老百姓	599,100	49,821,156.00	4.28
9	300408	三环集团	1,628,833	38,277,575.50	3.29
10	000333	美的集团	708,300	36,987,426.00	3.18

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	002304	洋河股份	102,273,438.07	7.46
2	600703	三安光电	85,994,256.49	6.28
3	600036	招商银行	85,773,739.98	6.26
4	600298	安琪酵母	78,774,267.71	5.75
5	600029	南方航空	73,546,657.65	5.37
6	000063	中兴通讯	64,399,883.89	4.70
7	600519	贵州茅台	61,110,545.00	4.46
8	601318	中国平安	60,588,796.00	4.42
9	600754	锦江股份	57,501,213.30	4.20
10	603589	口子窖	57,079,849.77	4.17
11	600585	海螺水泥	56,254,497.00	4.11
12	600763	通策医疗	56,063,624.64	4.09
13	600867	通化东宝	53,706,666.62	3.92
14	601111	中国国航	52,853,901.63	3.86
15	601939	建设银行	52,692,460.29	3.85
16	000069	华侨城A	51,913,290.86	3.79
17	001979	招商蛇口	51,854,801.60	3.78
18	600584	长电科技	49,476,830.94	3.61
19	601601	中国太保	49,161,848.08	3.59
20	600779	水井坊	48,535,852.78	3.54
21	300323	华灿光电	47,673,481.15	3.48
22	600183	生益科技	47,115,498.68	3.44
23	300408	三环集团	44,751,995.03	3.27
24	601166	兴业银行	43,511,121.36	3.18
25	603883	老百姓	43,140,507.95	3.15
26	600188	兖州煤业	38,915,590.24	2.84
27	600570	恒生电子	36,001,739.18	2.63
28	002709	天赐材料	35,178,114.56	2.57
29	600340	华夏幸福	34,937,300.20	2.55
30	600729	重庆百货	34,458,615.82	2.51
31	601688	华泰证券	33,620,263.00	2.45
32	000002	万科A	33,052,610.40	2.41
33	601998	中信银行	31,503,345.50	2.30
34	600282	南钢股份	29,927,456.00	2.18
35	600643	爱建集团	29,373,330.30	2.14
36	600690	青岛海尔	28,030,800.68	2.05

注：本项及下项7.4.2、7.4.3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。

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	000001	平安银行	86,859,637.85	6.34
2	601318	中国平安	86,505,729.01	6.31
3	000858	五粮液	82,264,252.01	6.00
4	600703	三安光电	73,150,430.59	5.34
5	600779	水井坊	69,011,169.52	5.04
6	600029	南方航空	67,532,707.41	4.93
7	000426	兴业矿业	63,593,408.07	4.64
8	002304	洋河股份	63,108,643.74	4.61
9	002035	华帝股份	59,351,516.96	4.33
10	000048	保利地产	57,786,758.02	4.22
11	601336	新华保险	56,922,022.49	4.15
12	000069	华侨城A	53,237,060.52	3.89
13	600584	长电科技	48,623,217.95	3.55
14	601111	中国国航	47,998,636.61	3.50
15	600183	生益科技	47,227,293.49	3.45
16	601939	建设银行	45,553,339.11	3.32
17	300323	华灿光电	45,400,097.32	3.31
18	600519	贵州茅台	45,180,451.89	3.30
19	600036	招商银行	44,671,726.74	3.26
20	001979	招商蛇口	42,946,392.12	3.13
21	600298	安琪酵母	42,437,027.67	3.10
22	601166	兴业银行	42,048,679.32	3.07
23	601601	中国太保	41,933,143.00	3.06
24	600176	中国巨石	41,790,842.86	3.05
25	600729	重庆百货	41,407,516.04	3.02
26	600383	金地集团	41,036,381.02	2.99
27	002475	立讯精密	39,752,899.87	2.90
28	000671	阳光城	38,921,692.50	2.84
29	000333	美的集团	37,094,536.11	2.71
30	000002	万科A	36,691,602.19	2.68
31	600585	海螺水泥	36,646,895.61	2.67
32	600362	江西铜业	35,999,005.89	2.63
33	600643	爱建集团	35,748,557.01	2.61
34	000725	京东方A	35,411,660.00	2.58
35	601600	中国铝业	34,517,134.90	2.52
36	600340	华夏幸福	34,133,521.72	2.49
37	600188	兖州煤业	33,079,187.01	2.41
38	600570	恒生电子	33,015,426.00	2.41
39	601688	华泰证券	32,843,758.00	2.40
40	002709	天赐材料	32,677,943.97	2.38
41	600282	南钢股份	29,059,901.14	2.12
42	300433	蓝思科技	28,934,180.16	2.11
43	601998	中信银行	28,921,744.60	2.11

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	2,433,538,584.08
卖出股票收入(成交)总额	2,449,419,164.26

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	182,819,902.40	15.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,579,000.00	6.06
	其中：政策性金融债	70,579,000.00	6.06
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	253,398,902.40	21.75

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	010107	21国债(7)	808,590	82,637,898.00	7.09
2	019303	13国债03	500,020	50,112,004.40	4.30
3	170024	17附息国债24	500,000	50,070,000.00	4.30
4	130229	13国开29	300,000	30,015,000.00	2.58
5	018002	国开1302	200,000	20,300,000.00	1.74

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

注：本基金依据基金合同未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金依据基金合同未进行股指期货投资。

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	721,760.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,233,877.04
5	应收申购款	155,200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,110,837.35

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
35,811	31,392.79	7,616,761.35	0.68%	1,116,590,593.22	99.32%

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	600.05	0.0001%

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(2004年3月30日)基金份额总额	6,013,222,027.96
本报告期期初基金份额总额	1,169,653,980.07
本报告期基金总申购份额	31,314,149.00
减：本报告期基金总赎回份额	76,760,774.50
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	1,124,207,354.57

§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发生如下重大变动： 无

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
海通证券	1	1,130,530,200.14	23.18%	1,030,253.98	22.88%	-
光大证券	1	1,080,779,177.16	22.16%	1,006,529.23	22.35%	-
国泰君安	1	894,408,865.66	18.34%	832,962.07	18.50%	-
国金证券	1	389,653,175.40	7.99%	362,883.65	8.06%	-
中金公司	2	368,236,579.63	7.55%	335,573.54	7.45%	-
太平洋证券	1	295,137,127.48	6.05%	268,957.15	5.97%	-
银河证券	6	294,729,338.64	6.04%	274,478.84	6.10%	-
华金证券	1	173,922,421.49	3.57%	161,974.55	3.60%	-
长江证券	1	135,816,179.03	2.78%	123,769.65	2.75%	-
高华证券	1	113,748,124.17	2.33%	105,932.79	2.35%	-
华泰联合	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

注：专用席位的选择标准和程序

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
海通证券	2,459,838.00	7.69%	-	-	-	-
光大证券	3,058,175.70	9.56%	28,000,000.00	16.00%	-	-
国泰君安	22,968,364.60	71.81%	18,000,000.00	10.29%	-	-
国金证券	2,998,800.00	9.38%	42,000,000.00	24.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	500,965.60	1.57%	37,000,000.00	21.14%	-	-
银河证券	-	-	32,000,000.00	18.29%	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	18,000,000.00	10.29%	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

§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