银河鸿利灵活配置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:中信银行股份有限公司

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。本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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年08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01月01日起至06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	银河鸿利混合		
场内简称	-		
基金主代码	519640		
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6月19日		
基金管理人	银河基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	585,852,241.69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	银河鸿利混合A	银河鸿利混合C	银河鸿利混合I
下属分级基金场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	519640	519641	519647
报告期末下属分级基金份额总额	34,375,140.95份	2,909,501.91份	548,567,598.83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。本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略、股指期货和国债期货投资策略、权证投资策略等。		
业绩比较基准	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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	李修滨
	联系电话	021-38568989	4006800000
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		400-820-0860	95558
传真		021-38568769	010-85230024

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	银河鸿利混合A	银河鸿利混合C	银河鸿利混合I
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)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	254,292.42	8,886.66	3,804,065.17
本期利润	508,329.78	30,399.68	7,662,583.27
加权平均基金份额本期利润	0.0130	0.0101	0.0124
本期加权平均净值利润率	1.27%	0.99%	1.22%
本期基金份额净值增长率	1.19%	0.99%	1.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)		
期末可供分配利润	292,825.93	14,353.09	4,657,077.26
期末可供分配基金份额利润	0.0085	0.0049	0.0085
期末基金资产净值	35,211,142.17	2,969,566.20	560,405,595.87
期末基金份额净值	1.024	1.021	1.022
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	7.78%	6.05%	6.81%

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、所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。

4、本基金自2015年11月18日起,增加银河鸿利混合I类基金份额类别,详情参阅相关公告。

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

银河鸿利混合A

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	0.10%	0.17%	0.28%	0.01%	-0.18%	0.16%
过去三个月	1.59%	0.24%	0.85%	0.01%	0.74%	0.23%
过去六个月	1.19%	0.25%	1.70%	0.01%	-0.51%	0.24%
过去一年	2.44%	0.19%	3.48%	0.01%	-1.04%	0.18%
过去三年	7.78%	0.14%	11.35%	0.01%	-3.57%	0.13%
自基金合同生效起至今	7.78%	0.14%	11.51%	0.01%	-3.73%	0.13%

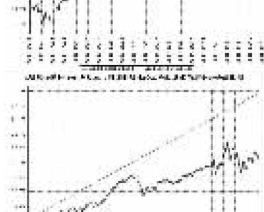
银河鸿利混合C

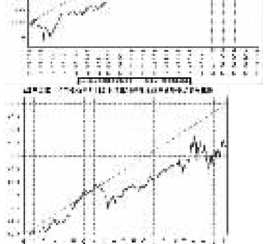
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.10%	0.19%	0.28%	0.01%	-0.18%	0.18%
过去三个月	1.49%	0.24%	0.85%	0.01%	0.64%	0.23%
过去六个月	0.99%	0.25%	1.70%	0.01%	-0.71%	0.24%
过去一年	1.97%	0.19%	3.48%	0.01%	-1.51%	0.18%
过去三年	6.05%	0.14%	11.35%	0.01%	-5.30%	0.13%
自基金合同生效起至今	6.05%	0.14%	11.51%	0.01%	-5.46%	0.13%

银河鸿利混合I

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	0.20%	0.18%	0.28%	0.01%	-0.08%	0.17%
过去三个月	1.59%	0.23%	0.86%	0.01%	0.73%	0.22%
过去六个月	1.19%	0.25%	1.72%	0.01%	-0.53%	0.24%
过去一年	2.49%	0.19%	3.54%	0.01%	-1.05%	0.18%
过去三年	6.81%	0.13%	9.81%	0.01%	-3.00%	0.12%
自基金合同生效起至今	6.81%	0.13%	9.81%	0.01%	-3.00%	0.12%

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、本基金合同于2015年6月19日生效。

2、按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定: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。

3、截止至2015年12月18日建仓期满,本基金各项资产配置比例符合合同约定。

4、本基金自2015年11月18日起,增加银河鸿利混合I类基金份额类别。

§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	任本基金的基金经理(助理)期限 离任日期	证券从业年限	说明
韩晶	基金经理	2015年6月19日	-	16	中共党员,经济学硕士,16年证券从业经历,曾就职于中国民族证券有限责任公司,期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。2008年6月加入银河基金管理有限公司,先后担任债券经理助理、债券经理等职务。现任固定收益部总监、基金经理。2011年8月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理,2012年11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理,2014年7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理,2015年6月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年3月起担任银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理、银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理,2016年12月起担任银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年3月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年4月起担任银河通利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理,2017年9月起担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君辉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2月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿达灵活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。
蒋磊	基金经理	2016年8月26日	-	12	硕士研究生学历,12年证券从业经历。曾先后在星展银行(中国)有限公司、中宏人寿保险有限公司工作。2016年4月加入银河基金管理有限公司,就职于固定收益部。2016年8月起担任银河岁岁回报定期开放债券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、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理、银河领先债券型证券投资基金的基金经理,2017年1月起担任银河君怡纯债债券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3月起担任银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理,2017年4月起担任银河通利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理,2017年9月起担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君辉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2月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年6月起担任银河睿嘉纯债债券型证券投资基金的基金经理。
余科苗	基金经理	2018年6月21日	-	8	硕士研究生学历,8年金融行业从业经历。曾任职于天治基金管理有限公司,2011年4月加入银河基金管理有限公司,从事投资、研究相关工作。现担任基金经理。2017年12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,2018年3月起担任银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河康乐股票型证券投资基金的基金经理,2018年6月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:1、上表中韩晶的任职日期为该基金合同生效之日,其余任职日期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》、《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 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

上半年国内经济仍有韧性,2018年一季度GDP同比增长6.8%。但在固定资产投资增速、社零增速下滑,进出口受贸易摩擦影响波动下行的背景下,经济下滑的风险仍在。1-5月,全国固定资产投资规模同比增长6.1%,较前四个月累计增速下滑0.9%。前5个月,出口同比增长5.5%,进口同比增长12.6%,贸易顺差6498.1亿元,收窄31%。1-5月社会消费品零售总额同比9.5%,其中5月社零增速同比8.5%,创过去十五年来新低。海外方面,美国经济强劲,3月和6月如期加息。欧洲经济呈现疲弱趋势。今年上半年货币政策在维持中性的同时,明显有边际放松的倾向。1~2月份央行通过普惠金融定向降准和CRA的运用,确保了流动性的平稳。4月份通过MLF到期续作和定向降准,释放了流动性。6月公告定向降准支持债转股和小微企业贷款继续释放利好信号。在紧信用的政策背景下,社融下滑明显,5月社融规模增量7068亿元,创22个月以来新低。

在货币政策和基本面利好的环境下,债券市场收益率显著下行,中债财富综合指数上涨3.81%。利率债方面,10年国开从年初的5.0下行75bp至4.25,10年国债从年初的3.9下行42bp至3.48。信用债方面,受信用风险事件影响,各类别信用债利差开始出现分化,高评级信用利差较为平稳,低评级信用品种及长端信用利差均有较大幅度上行。

权益市场方面,在宏观经济下滑预期攀升和贸易摩擦加剧的背景下,上半年整体呈弱势下行趋势,沪深300指数下跌14.1%,各板块走势分化。医药、计算机、食品饮料和休闲服务板块表现较好,通信、电气设备、建筑装饰和有色金融等行业出现明显回调。

在今年股市走势偏弱的影响下,上半年上证转债指数下跌3.76%。医药和计算机板块转债表现良好,光伏和建筑等板块转债下跌明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河鸿利混合A基金份额净值为1.024元,本报告期基金份额净值增长率为1.19%,同期业绩比较基准收益率为1.70%;截至本报告期末银河鸿利混合C基金份额净值为1.021元,本报告期基金份额净值增长率为0.99%,同期业绩比较基准收益率为1.70%;截至本报告期末银河鸿利混合I基金份额净值为1.022元,本报告期基金份额净值增长率为1.19%,同期业绩比较基准收益率为1.72%。

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,房地产和基建投资将维持在较低水平,贸易摩擦将对制造业投资产生影响。消费方面,汽车销售仍然偏弱;进出口方面,6月美欧PMI都有所下滑,叠加贸易摩擦影响,预计国内进出口同比增速也将有所趋缓。基本面和货币政策仍然利好债市,利率债将呈现震荡慢牛行情,监管趋严、信用政策放松将会成为制约债市快速下行的风险因素。信用债下半年到期量较大,预计信用利差将继续分化。权益和转债市场仍将弱势震荡,呈现结构性分化行情。

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

本基金于2015年6月19日成立,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"。

根据本基金管理人于2017年12月28日发布的分红公告,本基金向2018年1月2日在本基金注册登记机构登记在册的A类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.0600元,利润分配合计为人民币255,725.54元,其中现金形式发放总额为人民币238,235.66元,再投资形式发放总额为人民币17,489.88元;C类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.0400元,利润分配合计为人民币13,301.11元,其中现金形式发放总额为人民币11,960.43元,再投资形式发放总额为人民币1,340.68元;I类基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.0500元,利润分配合计为人民币3,727,201.53元,其中现金形式发放总额为人民币3,727,201.53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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金2018年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,银河基金管理有限公司在银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认为,银河基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:银河鸿利灵活配置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		1,147,515.81	12,258,097.43
结算备付金		470,117.40	3,400,047.60
存出保证金		55,000.31	31,405.90
交易性金融资产		555,089,990.85	763,960,876.38
其中:股票投资		46,730,740.85	93,630,425.78
基金投资		-	-
债券投资		508,359,250.00	670,330,450.60
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		36,000,000.00	30,000,165.00
应收证券清算款		2,623,430.62	-
应收利息		12,012,072.43	7,544,259.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		607,398,127.42	817,194,851.94
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		4,300,000.00	13,000,000.00
应付证券清算款		3,617,237.99	-
应付赎回款		-	115,218.99
应付管理人报酬		295,733.07	408,574.30
应付托管费		123,222.13	170,239.30
应付销售服务费		24,474.10	33,957.35
应付交易费用		104,094.55	113,332.02
应交税费		48,705.25	-
应付利息		-	8,748.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		298,356.09	290,000.00
负债合计		8,811,823.18	14,140,070.86
所有者权益:			
实收基金		585,852,241.69	791,416,199.93
未分配利润		12,734,062.55	11,638,581.15
所有者权益合计		598,586,304.24	803,054,781.08
负债和所有者权益总计		607,398,127.42	817,194,851.94

注:报告截止日2018年06月30日,基金份额总额585,852,241.69份,其中A类基金份额净值1.024元,份额总额34,375,140.95份;C类基金份额净值1.021元,份额总额2,909,501.91份;I类基金份额净值1.022元,份额总额548,567,598.83份。

6.2 利润表

会计主体:银河鸿利灵活配置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1月1日至2017年6月30日
一、收入		11,903,165.07	24,001,141.73
1.利息收入		11,826,344.32	19,881,551.30
其中:存款利息收入		30,211.18	518,775.73
债券利息收入		11,586,040.84	12,722,267.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		210,092.30	6,640,507.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-4,057,640.82	-8,464,168.49
其中:股票投资收益		-5,008,872.63	3,352,010.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益		363,885.82	-12,613,061.58
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		587,345.99	796,882.35
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		4,134,068.48	12,583,349.91
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		393.09	409.01
减:二、费用		3,701,852.34	5,548,533.72
1. 管理人报酬		1,998,486.11	3,416,643.10
2. 托管费		832,702.60	1,423,601.29
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	164,999.50	289,604.53
4. 交易费用		260,312.26	180,453.60
5. 利息支出		188,693.73	-
其中:卖出回购金融资产支出		188,693.73	-
6. 其他费用		225,144.37	238,231.20
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		8,201,312.73	18,452,608.01
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		8,201,312.73	18,452,608.01

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银河鸿利灵活配置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)	791,416,199.93	11,638,581.15	803,054,781.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	8,201,312.73	8,201,312.73
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)	-205,563,958.24	-3,109,603.15	-208,673,561.39
其中:1.基金申购款	56,352.09	972.16	57,324.25
2.基金赎回款	-205,620,310.33	-3,110,575.31	-208,730,885.64
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)	-	-3,996,228.18	-3,996,228.18
五、期末所有者权益(基金净值)	585,852,241.69	12,734,062.55	598,586,304.24
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)	1,134,405,705.13	29,752,127.58	1,164,157,832.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	18,452,608.01	18,452,608.01
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)	-21,870,365.96	-592,316.91	-22,462,682.87
其中:1.基金申购款	164,094.38	3,953.58	168,047.96
2.基金赎回款	-22,034,460.34	-596,270.49	-22,630,730.83
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)	-	-26,188,482.78	-26,188,482.78
五、期末所有者权益(基金净值)	1,112,535,339.17	21,423,935.90	1,133,959,275.07

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

银河鸿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]1074号《关于准予银河鸿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6月9日到2015年6月12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_B09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6月19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631,357,459.49元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币96,927.45元,以上实收基金(本息)合计为人民币631,454,386.94元,折合631,454,386.94份基金份额,其中A类份额557,970,796.89份,C类份额73,483,590.05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,基金托管人为中信银行股份有限公司。本基金自2015年11月16日起增加I类基金份额,自增加I类基金份额类别后,本基金分设A类、C类和I类三类基金份额。对于A类基金份额,投资者申购时需缴纳申购费;对于C类基金份额,投资者申购时无需缴纳申购费,而从C类基金资产中收取销售服务费;对于I类基金份额,投资者仅可通过管理人指定的特定销售渠道申购,且首笔申购资金不低于人民币1,000.00万元,投资者申购时无需缴纳申购费,而从I类基金资产中收取销售服务费。

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三年期定期存款利率(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制订的《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3号《半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06月30日的财务状况以及2018年上半年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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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

本报告期不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。

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
中信银行股份有限公司("中信银行")	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

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
中国银河证券股份有限公司	76,976,773.41	49.10%	59,841,318.66	56.19%

6.4.8.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	1,157.80	0.23%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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 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
中国银河证券股份有限公司	70,149.03	48.56%	39,288.42	38.35%
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
中国银河证券股份有限公司	54,533.78	55.65%	35,865.96	70.20%

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	1,998,486.11	3,416,643.10
其中:支付销售机构的客户维护费	109,303.34	193,713.75

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.6%的年费率计提(2016年4月8日前按前一日的基金资产净值的1.2%的年费率计提)。计算方法如下:

$H=E\times 0.6\%/$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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人在收到计算结果当日完成复核,并于当日从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,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	832,702.60	1,423,601.29

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:

$H=E\times 0.25\%/$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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,基金管理人应于次月首日起三个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并作出划付指令,基金托管人复核后于当日从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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 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 银河鸿利混合A	银河鸿利混合C	银河鸿利混合I	合计
银河基金管理有限公司	-	703.56	155,858.67	156,562.23
中信银行股份有限公司	-	5,635.75	-	5,635.75
中国银河证券股份有限公司	-	1,528.21	-	1,528.21
合计	-	7,867.52	155,858.67	163,726.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 银河鸿利混合A	银河鸿利混合C	银河鸿利混合I	合计
银河基金管理有限公司	-	1,470.26	265,817.35	267,287.61
中信银行股份有限公司	-	17,496.02	-	17,496.02
中国银河证券股份有限公司	-	2,639.56	-	2,639.56
合计	-	21,605.84	265,817.35	287,423.19

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/I类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

$H=E\times$ 销售服务费年费率/当年天数

H为每日应计提的C/I类基金份额销售服务费

E为前一日的C/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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中信银行股份有限公司	10,066,228.08	-	-	-	20,790,000.00	1,373.06
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中信银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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末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 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
中信银行股份有限公司	1,147,515.81	20,671.17	3,260,548.72	137,046.44

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(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:本基金无因认购新发/增发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2018年06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2018年06月30日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额4,300,000.00元,于2018年07月02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

1 公允价值

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。

1.2 以公允价值计量的金融工具

1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年06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46,730,740.85元,属于第二层次的余额为人民币508,359,250.00元,无属于第三层次的余额。

于2017年06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90,637,452.50元,属于第二层次的余额为人民币664,378,573.79元,无属于第三层次的余额。

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和债券,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。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定,自2015年3月26日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

1.2.3 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	46,730,740.85	7.69
	其中:股票	46,730,740.85	7.69
2	固定收益投资	508,359,250.00	83.69
	其中:债券	508,359,250.00	83.69
	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	36,000,000.00	5.93
	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	1,617,633.21	0.27
7	其他各项资产	14,690,503.36	2.42
8	合计	607,398,127.42	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	33,509,940.85	5.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,696,000.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,952,500.00	0.66
J	金融业	3,192,000.00	0.53
K	房地产业	-	-
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	4,380,300.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	46,730,740.85	7.81

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	000651	格力电器	400,000	18,860,000.00	3.15
2	300463	迈克生物	419,945	10,469,228.85	1.75
3	600763	通策医疗	90,000	4,380,300.00	0.73
4	600845	宝信软件	150,000	3,952,500.00	0.66
5	601398	工商银行	600,000	3,192,000.00	0.53
6	000333	美的集团	50,000	2,611,000.00	0.44
7	600998	九州通	100,000	1,696,000.00	0.28
8	603387	基蛋生物	20,000	1,015,600.00	0.17
9	002832	比音勒芬	14,976	554,112.00	0.09

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	000651	格力电器	14,766,903.00	1.84
2	000858	五粮液	14,673,401.00	1.83
3	300463	迈克生物	10,657,555.50	1.33
4	600763	通策医疗	4,162,165.00	0.52
5	600845	宝信软件	3,249,457.00	0.40
6	000333	美的集团	2,585,544.00	0.32
7	600419	天润乳业	2,297,245.70	0.29
8	600998	九州通	1,676,421.00	0.21
9	603517	绝味食品	1,624,842.00	0.20
10	603387	基蛋生物	1,026,281.00	0.13
11	600079	人福医药	677,748.98	0.08
12	002832	比音勒芬	554,966.60	0.07
13	600901	江苏租赁	155,843.75	0.02
14	601828	美凯龙	134,064.15	0.02
15	601838	成都银行	89,465.01	0.01
16	603680	今创集团	47,171.67	0.01
17	300504	天邑股份	39,989.72	0.00
18	603897	长城科技	28,167.70	0.00
19	600929	湖南盐业	21,132.16	0.00
20	603301	振德医疗	21,128.12	0.00

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	600887	伊利股份	14,818,062.64	1.85
2	000858	五粮液	13,444,022.52	1.67
3	002304	洋河股份	11,023,170.89	1.37
4	601988	中国银行	8,688,000.00	1.08
5	600741	华域汽车	8,083,203.84	1.01
6	601601	中国太保	7,410,514.40	0.92
7	600079	人福医药	6,186,734.00	0.77
8	601166	兴业银行	6,032,000.00	0.75
9	000651	格力电器	4,709,566.00	0.59
10	000910	大亚圣象	4,382,627.00	0.55
11	601398	工商银行	3,746,835.00	0.47
12	601211	国泰君安	3,603,407.00	0.45
13	600419	天润乳业	2,835,723.92	0.35
14	603517	绝味食品	1,864,380.00	0.23
15	601828	美凯龙	293,485.55	0.04
16	600901	江苏租赁	265,807.10	0.03
17	601838	成都银行	187,249.37	0.02
18	300504	天邑股份	137,790.00	0.02
19	603712	七一二	106,221.02	0.01
20	603056	德邦股份	106,054.68	0.01

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	58,589,505.94
卖出股票收入(成交)总额	98,818,509.80

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,103,000.00	6.70
	其中:政策性金融债	40,103,000.00	6.70
4	企业债券	51,751,250.00	8.65
5	企业短期融资券	120,619,000.00	20.15
6	中期票据	265,998,000.00	44.44
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	29,888,000.00	4.99
9	其他	-	-
10	合计	508,359,250.00	84.93

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	101458007	14闽漳龙MTN001(五年期)	300,000	30,663,000.00	5.12
2	180404	18农发04	300,000	30,090,000.00	5.03
3	136577	16鲁能01	300,000	29,313,000.00	4.90
4	101758037	17粤电MTN001	200,000	20,190,000.00	3.37
5	101760059	17中化工MTN002	200,000	20,182,000.00	3.37

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:本基金暂时不参与股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂时不参与股指期货的投资。

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

本基金暂时不参与国债期货的投资。

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:本基金暂时不参与国债期货的投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金暂时不参与国债期货的投资。

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出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	55,000.31
2	应收证券清算款	2,623,430.62
3	应收股利	-
4	应收利息	12,012,072.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,690,503.36

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的情况。

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

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 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
银河鸿利混合A	642	53,543.83	0.00	0.00%	34,375,140.95	100.00%
银河鸿利混合C	221	13,165.17	0.00	0.00%	2,909,501.91	100.00%
银河鸿利混合I	1	548,567,598.83	548,567,598.83	100.00%	0.00	0.00%
合计	843	694,961.14	548,567,598.83	93.64%	37,284,642.86	6.36%

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	银河鸿利混合A	0.00	0.0000%
	银河鸿利混合C	9.85	0.0003%
	银河鸿利混合I	0.00	0.0000%
	合计	9.85	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	银河鸿利混合A	0
	银河鸿利混合C	0
	银河鸿利混合I	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银河鸿利混合A	0
	银河鸿利混合C	0
	银河鸿利混合I	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	银河鸿利混合A	银河鸿利混合C	银河鸿利混合I
基金合同生效日(2015年6月19日)基金份额总额	557,970,796.89	73,483,590.05	-
本报告期期初基金份额总额	42,650,613.99	3,325,279.27	745,440,306.67
本报告期基金总申购份额	52,770.19	3,581.90	-
减:本报告期基金总赎回份额	8,328,243.23	419,359.26	196,872,707.84
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	34,375,140.95	2,909,501.91	548,567,598.83

§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:

2018年6月21日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理的公告》,增聘余科苗担任本基金的基金经理,蒋磊与韩晶共同担任本基金的基金经理。

二、本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内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
中信建投	1	79,794,267.17	50.90%	74,312.86	51.44%	-
银河证券	3	76,976,773.41	49.10%	70,149.03	48.56%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	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
中信建投	501,670.00	99.77%	1,193,400,000.00	100.00%	-	-
银河证券	1,157.80	0.23%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	745,440,306.67	-	196,872,707.84	548,567,598.83	93.64%
个人	-	-	-	-	-	-	-

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

2018年8月28日