银河稳健证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称中国农业银行)根据本基金合同规定,于2018年8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	银河稳健混合
场内简称	–
基金主代码	151001
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	2003年8月4日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	409,170,539.37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	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
投资策略	采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,动态配置资产,精选个股进行投资。在正常情况下本基金的资产配置比例变化范围是:股票投资的比例范围为基金资产净值的35%至75%;债券投资的比例范围为基金资产净值的20%至45%;现金的比例范围为基金资产净值的5%至20%。
业绩比较基准	上证A股指数涨跌幅×75% + 上证国债指数涨跌幅×25%
风险收益特征	银河稳健基金属证券投资基金中风险中度品种(在股票型基金中属风险中度偏低),力争使长期的平均单位风险收益超越业绩比较基准。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	贺倩
	联系电话	021-38568989	010-66060069
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-820-0860	95599
传真		021-38568769	010-68121816

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、上海市世纪大道1568号中建大厦15楼 2、北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

§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	22,379,961.33
本期利润	-21,955,843.50
加权平均基金份额本期利润	-0.0550
本期基金份额净值增长率	-3.66%
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	0.7212
期末基金资产净值	592,597,247.12
期末基金份额净值	1.4483

注:1、本期已实现收益是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、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列示。

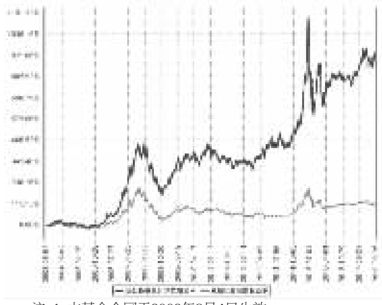
3.2 基金净值表现

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	-4.59%	1.16%	-5.95%	0.87%	1.36%	0.29%
过去三个月	-0.44%	1.06%	-7.30%	0.79%	6.86%	0.27%
过去六个月	-3.66%	1.06%	-9.86%	0.81%	6.20%	0.25%
过去一年	6.50%	0.94%	-7.35%	0.64%	13.85%	0.30%
过去三年	2.38%	1.38%	-23.78%	1.10%	26.16%	0.28%
自基金合同生效起至今	876.73%	1.32%	98.89%	1.21%	777.84%	0.11%

注:本基金业绩比较基准:上证A股指数涨跌幅×75% + 上证国债指数涨跌幅×25%

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2003年8月4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:本基金股票投资比例为基金资产的35%-75%,保持不低于基金资产净值的5%的现金,国债投资比例不低于20%,权证、股指期货、国债期货等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发起式证券投资基金、银河鑫月享6个月定期开放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
钱睿南	基金经理	2008年2月27日	–	17	硕士研究生学历,17年证券从业经历。曾先后在中国华融信托投资公司、中国银河证券有限责任公司工作。2002年6月加入银河基金管理有限公司,历任交易主管、基金经理助理等职务,现任总经理助理、股票投资部总监、基金经理。2008年2月起担任银河稳健证券投资基金的基金经理,2015年4月起担任银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年12月起担任银河犇利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

本基金管理人在年初判断如下:外部经济环境依然较为有利,全球经济仍然在回升的过程之中,美联储货币政策的变化需要跟踪,但从过去几年的历史来看收紧慢于预期,欧洲量化宽松货币政策则会更晚。美股估值处于历史高位是一个风险点,但企业盈利向好趋势未变,仍然难言泡沫会很快破裂。在此背景下,综合考虑国内投资、消费和进出口等领域,我们倾向于认为经济有回落压力,但仍在可控范围之内,不会造成系统性风险。投资方面,明年房地产投资增长仍不容乐观;基建则存在不确定因素,换届之后投资热情是否会再度高涨还需要观察;相对而言企业投资支出尤其是设备投资增长较为明显,是确定性较高的方向。消费领域依然看好,消费升级能够受到居民收入增长、房地产投资资金溢出和政策引导等因素支持,仍将保持较快的增长。在全球贸易复苏的大背景下,进出口应当能够保持平稳,但对经济的正面影响作用在减小。货币政策方面,本届政府的定力和执行力令人印象深刻,从"管住货币"、"去杠杆"、"化解重大风险"等一系列表述来看,预计仍然难以看到货币政策的明显放松,需要提防监管过严以及部分信用风险引爆造成的短期流动性冲击。

2018年A股市场值得期待,但全面牛市概率较低,依然会是结构性行情主导。由于经济可能趋于更加平缓,行业轮动特征也将弱化,更多需要自下而上发掘投资标地。我们仍将围绕消费升级、企业设备投资加速、创新及进口替代和占领全球市场等方向寻找估值合理的好企业。

从市场实际表现来看,A股市场表现明显弱于预期,上半年基本上是震荡下跌,万得全A指数跌幅接近-15%。与去年相比,上半年行情结构性特征更加明显,仅有休闲服务、医药生物和食品饮料三个行业获得正收益,且涨幅远超其他行业,相当一批股票下跌惨烈程度超过2017年。市场表现低迷的主要原因一是去杠杆力度超过预期,严重影响了股市的供求关系,二是与美国的贸易摩擦不断加剧,投资者信心受挫。

回顾本基金上半年的操作,一季度基金股票仓位维持在较高水平,在2月和3月的二次调整中回撤较大,二季度降低了股票仓位,表现相对较为抗跌。行业配置有对有错,重点配置的行业中,金融在年初曾经快速冲高,但随后持续回落,持仓较重的银行保险成为拖累;配置比例较高的医药和食品饮料对于基金净值则做出了正面的贡献;此外上半年较好的回避了地雷股,控制住了风险。

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1.4483元;本报告期基金份额净值增长率为-3.66%,业绩比较基准收益率为-9.86%。

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,我们认为去杠杆的方向不会改变,但是节奏上较上半年会有缓和,因此尽管经济增长速度可能会出现下滑,但投资者预期有所好转。中国与美国的贸易摩擦仍有反复的可能,仍要做好出现较坏情景的准备。在此背景下,A股可能会从下跌转入震荡筑底的阶段,结构性机会逐渐增多。行业配置主要还是基于防御,力争抓住部分行业的反弹机会。消费性行业如食品饮料和医药尽管处于高位,但下半年可以依靠估值切换提供支撑,预计仍然能够表现出较好的抗跌性。大金融板块估值创新低,较为安全,存在较为确定的投资机会,但受到基本面不佳的制约,预计明显上涨的机会不大。周期类行业多数估值很低,但长期前景不乐观,预计随着业绩公告和政策刺激预期变化会有阶段性机会。成长性行业经过前期回调普遍处于相对低位,部分行业和个股业绩向好,预计下半年有较为确定的反弹机会。

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

本基金管理人以截至2017年12月31日的可分配收益为准,于2018年1月29日向基金份额持有人实施了利润分配,发放总额为3,959,631.43元。

根据《证券投资基金法》有关规定及本基金《基金合同》的有关约定,经本基金管理人计算并经基金托管人中国农业银行股份有限公司确认,利润分配方案符合上述约定。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—银河基金管理有限公司2018 年1月1日至 2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事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本基金的投资运作、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本基金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:银河稳健证券投资基金

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		26,313,848.00	23,658,006.91
结算备付金		1,570,498.09	1,349,643.80
存出保证金		408,527.32	747,230.26
交易性金融资产		522,733,276.89	563,910,832.17
其中:股票投资		366,977,938.33	433,886,499.37
基金投资		–	–
债券投资		155,755,338.56	130,024,332.80
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		60,000,000.00	–
应收证券清算款		–	19,198,095.30
应收利息		3,148,940.43	3,150,170.29
应收股利		–	–
应收申购款		150,790.28	242,641.03
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		614,325,881.01	612,256,619.76
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		18,875,255.77	–
应付赎回款		464,560.09	404,062.37
应付管理人报酬		734,231.96	858,176.11
应付托管费		122,371.97	143,029.33
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		856,377.09	924,461.65
应交税费		260,695.00	260,695.00
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		415,142.01	451,216.29
负债合计		21,728,633.89	3,041,640.75
所有者权益:			
实收基金		297,509,871.77	292,777,456.08
未分配利润		295,087,375.35	316,437,522.93
所有者权益合计		592,597,247.12	609,214,979.01
负债和所有者权益总计		614,325,881.01	612,256,619.76

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.4483元,基金份额总额409170539.37份。

6.2 利润表

会计主体:银河稳健证券投资基金

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		-13,626,176.72	47,847,321.51
1.利息收入		2,856,882.99	6,428,037.40
其中:存款利息收入		171,601.44	461,942.51
债券利息收入		2,552,327.22	5,156,896.86
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		132,954.33	809,198.03
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		27,761,434.58	-4,826,819.10
其中:股票投资收益		24,211,909.23	-7,633,706.59
基金投资收益		–	–
债券投资收益		13,690.14	-3,167,604.62
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		3,535,835.21	5,974,492.11
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-44,335,804.83	45,792,744.00
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		91,310.54	453,359.21
减:二、费用		8,329,666.78	15,082,397.55
1. 管理人报酬		4,408,748.72	8,518,975.50
2. 托管费		734,791.41	1,419,829.25
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	–	–
4. 交易费用		3,048,210.67	4,987,925.54
5. 利息支出		–	–
其中:卖出回购金融资产支出		–	–
6. 其他费用		137,907.54	155,667.26
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-21,955,843.50	32,764,923.96
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-21,955,843.50	32,764,923.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银河稳健证券投资基金

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)	292,777,456.08	316,437,522.93	609,214,979.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	-21,955,843.50	-21,955,843.50
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)	4,732,415.69	4,565,327.35	9,297,743.04
其中:1.基金申购款	29,797,149.94	31,280,729.38	61,077,879.32
2.基金赎回款	-25,064,734.25	-26,715,402.03	-51,780,136.28
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)	–	-3,959,631.43	-3,959,631.43
五、期末所有者权益(基金净值)	297,509,871.77	295,087,375.35	592,597,247.12
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)	635,677,888.97	528,403,816.85	1,164,081,705.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	32,764,923.96	32,764,923.96
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)	-56,571,593.26	-50,219,318.19	-106,790,911.45
其中:1.基金申购款	68,003,309.59	55,795,553.26	123,798,862.85
2.基金赎回款	-124,574,902.85	-106,014,871.45	-230,589,774.30
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)	579,106,295.71	510,949,422.62	1,090,055,718.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 – 至 – 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

银河银联系列证券投资基金—银河稳健证券投资基金(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")证监基金字字[2003]65号文《关于同意银河银联系列证券投资基金设立的批复》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2003年8月4日正式生效,首次设立募集规模为1,186,651,618.30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为银河基金管理有限公司,注册登记机构为银河基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。2008年2月28日,本基金管理人银河基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前,本基金的基金份额净值为人民币1.3753元,根据基金份额拆分公式,计算精确到小数点后第9位(第9位以后舍去)为人民币1.375340290元。本基金管理人于拆分日,按照1:1.375340290的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后,基金份额净值为人民币1.0000元,基金份额面值为人民币0.7271元。

本基金投资于在国内依法公开发行、具有良好流动性的金融工具,以及法律、法规及中国证监会允许的其他金融工具。本基金的投资组合遵循以下规定:(1)投资于股票和债券的比例不低于本基金资产总值的80%;(2) 投资于股票的比例在正常情况下不低于基金资产净值的35%,不高于基金资产净值的75%;(3)投资组合中现金比例不低于5%;(4)投资于国家债券的比例,不低于本基金资产总值的20%;(5)持有一家上市公司的股票,不超过本基金资产净值的10%;(6)与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;(7)中国证监会规定的其他比例限制。

本基金的业绩比较基准为:上证A股指数涨跌幅×75% +中信国债指数涨跌幅×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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(以下统称"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并发布的《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。

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年度上半年的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("农业银行")	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
银河证券	–	–	142,667,346.97	4.29%

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
银河证券	–	–	19,607,118.50	6.57%

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	–	–	320,000,000.00	7.28%

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内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	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	132,865.28	4.33%	132,865.28	7.96%

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	4,408,748.72	8,518,975.50
其中:支付销售机构的客户维护费	773,504.39	749,912.45

注:本基金应支付基金管理人管理费,按前一日基金资产净值的1.5%年费率逐日计提,累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数

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	734,791.41	1,419,829.25

注:本基金应支付基金托管人托管费,按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提,累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数

6.4.8.2.3 销售服务费

注:无。

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:本基金本报告期末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:本报告期及上年度可比期间基金管理人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:本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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
农业银行	26,313,848.00	152,687.37	82,166,777.52	370,687.44

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。

6.4.9 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	新股流通受限	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	新股流通受限	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	新股流通受限	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11日	新股限售	78.73	56.94	37,756	2,972,529.88	2,149,826.64	注1
300713	英可瑞	2017年10月23日	2018年10月31日	新股限售	40.29	39.07	7,008	282,352.32	273,802.56	注1
603156	养元饮品	2018年5月8日	2019年2月11日	新股限售-派送	–	56.94	15,102	–	859,907.88	注2
300713	英可瑞	2018年6月19日	2018年10月31日	新股限售-转增	–	39.07	5,606	–	219,026.42	注2

注:1.本基金持有的股票"养元饮品""英 可 瑞"为网下申购新股中签,中签部分为认购网下老股东的转让部分,自愿设定12个月锁定期,锁定期自本次公开发行的股票在交易所上市交易之日起开始计算。

2.本基金持有的非公开发行股票"养元饮品"于2018年5月8日实施2017年度权益分派方案(每10股派送4股),因派送所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。;"英 可 瑞"于2018年6月19日实施2017年度权益分派方案(每10股转增8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

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
002171	楚江新材	2018年6月7日	重大事项停牌	6.78	–	–	400,000	2,711,629.65	2,712,000.00	–

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

截至到本报告期末,本基金无因从事证券银行间债券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,本基金无因从事证券交易所债券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362944963.24元,属于第二层次的余额为人民币209967070.15元,属于第三层次余额为人民币3502563.50元.

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。

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	366,977,938.33	59.74
	其中:股票	366,977,938.33	59.74
2	固定收益投资	155,755,338.56	25.35
	其中:债券	155,755,338.56	25.35
	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	60,000,000.00	9.77
	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	27,884,346.09	4.54
7	其他各项资产	3,708,258.03	0.60
8	合计	614,325,881.01	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	187,523,934.38	31.64
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	32,719,681.17	5.52
G	交通运输、仓储和邮政业	23,695,808.51	4.00
H	住宿和餐饮业	22,980,471.36	3.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,454,556.80	5.81
J	金融业	38,166,343.25	6.44
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	20,957,256.87	3.54
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	6,327,100.00	1.07
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	366,977,938.33	61.93

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	603579	荣泰健康	362,400	25,353,504.00	4.28
2	600754	锦江股份	621,766	22,980,471.36	3.88
3	000963	华东医药	450,000	21,712,500.00	3.66
4	002027	分众传媒	2,189,891	20,957,256.87	3.54
5	600036	招商银行	760,000	20,094,400.00	3.39
6	600436	片仔癀	170,000	19,028,100.00	3.21
7	300450	先导智能	606,205	18,331,639.20	3.09
8	300365	恒华科技	855,800	17,655,154.00	2.98
9	000089	深圳机场	2,299,979	17,594,839.35	2.97
10	603517	绝味食品	400,000	16,980,000.00	2.87

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	002027	分众传媒	40,811,879.36	6.70
2	300365	恒华科技	37,886,446.56	6.22
3	600352	浙江龙盛	34,367,727.77	5.64
4	601166	兴业银行	27,124,678.98	4.45
5	600754	锦江股份	23,636,866.61	3.88
6	603579	荣泰健康	22,809,766.00	3.74
7	600570	恒生电子	22,786,597.30	3.74
8	601688	华泰证券	21,863,451.00	3.59
9	300149	量子生物	21,645,318.65	3.55
10	600419	天润乳业	21,530,944.30	3.53
11	000963	华东医药	20,828,817.40	3.42
12	600426	华鲁恒升	20,718,436.42	3.40
13	600436	片仔癀	20,570,831.50	3.38
14	300036	超图软件	19,599,384.74	3.22
15	600298	安琪酵母	19,574,642.94	3.21
16	000089	深圳机场	18,590,298.29	3.05
17	600585	海螺水泥	18,582,237.00	3.05
18	000063	中兴通讯	18,267,238.39	3.00
19	603517	绝味食品	17,874,080.15	2.93
20	601939	建设银行	16,833,995.35	2.76
21	300388	国祯环保	16,833,843.62	2.76
22	300138	晨光生物	16,370,473.62	2.69
23	600606	绿地控股	14,906,308.05	2.45
24	300422	博 世 科	14,711,697.97	2.41
25	601155	新城控股	13,611,607.28	2.23
26	002304	洋河股份	12,634,025.00	2.07
27	000059	华锦股份	12,257,854.55	2.01

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	57,404,405.33	9.42
2	600176	中国巨石	56,154,622.80	9.22
3	601318	中国平安	43,286,154.11	7.11
4	601166	兴业银行	40,268,391.00	6.61
5	600352	浙江龙盛	35,983,387.07	5.91
6	600585	海螺水泥	28,784,080.42	4.72
7	600703	三安光电	28,468,091.30	4.67
8	000063	中兴通讯	28,006,086.96	4.60
9	600419	天润乳业	23,548,576.58	3.87
10	600570	恒生电子	21,768,207.25	3.57
11	601688	华泰证券	20,519,219.00	3.37
12	601600	中国铝业	20,361,327.00	3.34
13	300365	恒华科技	20,348,323.00	3.34
14	002008	大族激光	19,619,212.45	3.22
15	000858	五 粮 液	18,871,645.25	3.10
16	000661	长春高新	17,364,646.01	2.85
17	002027	分众传媒	17,351,463.00	2.85
18	300388	国祯环保	17,314,730.84	2.84
19	600779	水井坊	16,716,195.96	2.74
20	600426	华鲁恒升	16,524,017.06	2.71
21	300138	晨光生物	15,803,083.44	2.59
22	300422	博 世 科	15,318,243.95	2.51
23	300450	先导智能	14,626,786.90	2.40
24	600606	绿地控股	13,853,334.27	2.27
25	300036	超图软件	13,600,149.34	2.23
26	002142	宁波银行	13,213,094.80	2.17
27	000059	华锦股份	12,970,568.40	2.13
28	600529	山东药玻	12,785,427.67	2.10

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	983,194,936.15
卖出股票收入(成交)总额	1,025,488,413.03

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	99,804,400.00	16.84
2	央行票据	–	–
3	金融债券	53,681,320.00	9.06
	其中:政策性金融债	53,681,320.00	9.06
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)	2,269,618.56	0.38
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	155,755,338.56	26.28

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	018002	国开1302	528,880	53,681,320.00	9.06
2	010107	21国债(7)	487,000	49,771,400.00	8.40
3	019311	13国债11	200,000	19,972,000.00	3.37
4	019315	13国债15	100,000	10,030,000.00	1.69
5	019205	12国债05	100,000	10,026,000.00	1.69

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:本基金本报告期末未持有股指期货.

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货.

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

注: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

注:本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

银河稳健基金投资的前十名股票中,没有超出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	408,527.32
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,148,940.43
5	应收申购款	150,790.28
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,708,258.03

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128024	宁行转债	2,269,618.56	0.38

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
25,354	16,138.30	70,648,027.38	17.27%	338,522,511.99	82.73%

8.2 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	141,992.49	0.0347%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2003年8月4日)基金份额总额	1,186,651,618.30
本报告期期初基金份额总额	402,662,273.33
本报告期基金总申购份额	40,980,375.54
减:本报告期基金总赎回份额	34,472,109.50
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	409,170,539.37

§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:

无

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动:

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
国泰君安	2	972,666,001.27	48.63%	900,505.53	48.82%	–
招商证券	1	640,065,845.28	32.00%	583,293.34	31.62%	–
申银万国	1	387,339,277.13	19.37%	360,729.46	19.56%	–
华宝证券	1	–	–	–	–	–
中银国际	2	–	–	–	–	–
安信证券	2	–	–	–	–	–
光大证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
江海证券	1	–	–	–	–	–
银河证券	1	–	–	–	–	–

注:1、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。

2、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
国泰君安	44,755,691.00	59.28%	833,000,000.00	100.00%	–	–
招商证券	17,594,654.50	23.30%	–	–	–	–
申银万国	13,152,377.30	17.42%	–	–	–	–
华宝证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
江海证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–

§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