

## 银河通利债券型证券投资基金(LOF)

## [2015] 第二季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司  
基金托管人:北京银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年7月20日§ 1 重要提示  
基金管理人的董事、监事及本基金的基金经理不存在虚假记载、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法律责任。  
基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2015年7月17日核对了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息，保证复核后不存在虚假记载、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。  
本基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

特别提示

本报告附录财务数据未经审计。

报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	银河通利债券(LOF)
场内简称	银河通利
交易代码	161505
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
报告期末基金份额总额	88,377,805.00份
报告期天数	2012年4月1日至2015年6月30日
报告期末基金份额总额	33,303,803.70份
报告期天数	2015年4月1日至6月30日
报告期末基金的份额总额	65,074,001.80份
报告期天数	2015年4月1日至6月30日
报告期末基金的份额净值	-

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日—2015年6月30日)																			
	银河通利	通利债C																		
1.本期已实现收益	5,708,704.74	2,326,418.07																		
2.本期利润	8,183,691.30	3,078,869.92																		
3.期初平均基金份额净值	0.3124	0.3137																		
4.期末基金份额净值	0.3053	0.3043																		
5.期末可供分配基金份额净值	0.3053	0.3043																		
6.期末可供分配利润	1.382	0.524																		
注:1.本期已实现收益按基金本期收入、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申购费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。 3.银河通利分级债券型证券投资基金已于2014年4月26日转型为银河通利债券型证券投资基金基金(161505),其基金净值表现与银河通利分级债券型证券投资基金(161505)一致。 4.2.1 基金净值表现 4.2.1.1 报告期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 银河通利 <table border="1"> <tr><th>阶段</th><th>净值增长率为①</th><th>净值增长率为②</th><th>业绩比较基准收益率为③</th><th>业绩比较基准收益率为④</th></tr> <tr><td>过去三个月</td><td>12.25%</td><td>1.36%</td><td>1.35%</td><td>0.10%</td></tr> <tr><td>①-③</td><td>10.90%</td><td>1.26%</td><td></td><td></td></tr> <tr><td>②-④</td><td></td><td></td><td>10.75%</td><td>1.26%</td></tr> </table> 注:本基金的业绩比较基准为从美国国债计算并算术平均后编制并发布的中债综合全价指数,每日进行再平衡计算。 3.2.2 基金合同生效以来基金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 	阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④	过去三个月	12.25%	1.36%	1.35%	0.10%	①-③	10.90%	1.26%			②-④			10.75%	1.26%
阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④																
过去三个月	12.25%	1.36%	1.35%	0.10%																
①-③	10.90%	1.26%																		
②-④			10.75%	1.26%																

注:银河通利分级债券型证券投资基金基金合同生效日为2012年4月25日,于2014年4月26日正式转型为银河通利分级债券型证券投资基金(LOF),根据《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金应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有关规定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介																				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限																	
银河通利债券型证券投资基金(LOF)	基金经理	2014年7月1日	7																	
周唯唯	基金经理	-	-																	
注:1.上表中短期限、离职日期均为公司做出决定之日。 2.银河通利基金经理由公司决定之日起从事证券相关业务的从业经历累计年限计算。 3.2.1 本报告期内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 银河通利 <table border="1"> <tr><th>阶段</th><th>净值增长率为①</th><th>净值增长率为②</th><th>业绩比较基准收益率为③</th><th>业绩比较基准收益率为④</th></tr> <tr><td>过去三个月</td><td>12.08%</td><td>1.36%</td><td>1.35%</td><td>0.10%</td></tr> <tr><td>①-③</td><td>10.98%</td><td>1.26%</td><td></td><td></td></tr> <tr><td>②-④</td><td></td><td></td><td>10.75%</td><td>1.26%</td></tr> </table> 注:本基金的业绩比较基准为从美国国债计算并算术平均后编制并发布的中债综合全价指数,每日进行再平衡计算。 3.2.2 基金合同生效以来基金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 	阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④	过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%	①-③	10.98%	1.26%			②-④			10.75%	1.26%
阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④																
过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%																
①-③	10.98%	1.26%																		
②-④			10.75%	1.26%																

注:银河通利分级债券型证券投资基金基金合同生效日为2012年4月25日,于2014年4月26日正式转型为银河通利分级债券型证券投资基金(LOF),根据《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金应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有关规定。

4.2 管理人报告

4.3 公司治理情况																				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限																	
银河通利债券型证券投资基金(LOF)	基金经理	2014年7月1日	7																	
周唯唯	基金经理	-	-																	
注:1.上表中短期限、离职日期均为公司做出决定之日。 2.银河通利基金经理由公司决定之日起从事证券相关业务的从业经历累计年限计算。 3.2.1 本报告期内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 银河通利 <table border="1"> <tr><th>阶段</th><th>净值增长率为①</th><th>净值增长率为②</th><th>业绩比较基准收益率为③</th><th>业绩比较基准收益率为④</th></tr> <tr><td>过去三个月</td><td>12.08%</td><td>1.36%</td><td>1.35%</td><td>0.10%</td></tr> <tr><td>①-③</td><td>10.98%</td><td>1.26%</td><td></td><td></td></tr> <tr><td>②-④</td><td></td><td></td><td>10.75%</td><td>1.26%</td></tr> </table> 注:本基金的业绩比较基准为从美国国债计算并算术平均后编制并发布的中债综合全价指数,每日进行再平衡计算。 3.2.2 基金合同生效以来基金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 	阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④	过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%	①-③	10.98%	1.26%			②-④			10.75%	1.26%
阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④																
过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%																
①-③	10.98%	1.26%																		
②-④			10.75%	1.26%																

注:银河通利分级债券型证券投资基金基金合同生效日为2012年4月25日,于2014年4月26日正式转型为银河通利分级债券型证券投资基金(LOF),根据《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金应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有关规定。

4.3 公司治理情况

4.4 公司内部核算、投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、合规监督及风险管理、内部控制情况																				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限																	
银河通利债券型证券投资基金(LOF)	基金经理	2014年7月1日	7																	
周唯唯	基金经理	-	-																	
注:1.上表中短期限、离职日期均为公司做出决定之日。 2.银河通利基金经理由公司决定之日起从事证券相关业务的从业经历累计年限计算。 3.2.1 本报告期内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 银河通利 <table border="1"> <tr><th>阶段</th><th>净值增长率为①</th><th>净值增长率为②</th><th>业绩比较基准收益率为③</th><th>业绩比较基准收益率为④</th></tr> <tr><td>过去三个月</td><td>12.08%</td><td>1.36%</td><td>1.35%</td><td>0.10%</td></tr> <tr><td>①-③</td><td>10.98%</td><td>1.26%</td><td></td><td></td></tr> <tr><td>②-④</td><td></td><td></td><td>10.75%</td><td>1.26%</td></tr> </table> 注:本基金的业绩比较基准为从美国国债计算并算术平均后编制并发布的中债综合全价指数,每日进行再平衡计算。 3.2.2 基金合同生效以来基金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 	阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④	过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%	①-③	10.98%	1.26%			②-④			10.75%	1.26%
阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④																
过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%																
①-③	10.98%	1.26%																		
②-④			10.75%	1.26%																

注:银河通利分级债券型证券投资基金基金合同生效日为2012年4月25日,于2014年4月26日正式转型为银河通利分级债券型证券投资基金(LOF),根据《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金应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有关规定。

4.4 公司治理情况

4.5 企业内部核算、投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、合规监督及风险管理、内部控制情况																				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限																	
银河通利债券型证券投资基金(LOF)	基金经理	2014年7月1日	7																	
周唯唯	基金经理	-	-																	
注:1.上表中短期限、离职日期均为公司做出决定之日。 2.银河通利基金经理由公司决定之日起从事证券相关业务的从业经历累计年限计算。 3.2.1 本报告期内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 银河通利 <table border="1"> <tr><th>阶段</th><th>净值增长率为①</th><th>净值增长率为②</th><th>业绩比较基准收益率为③</th><th>业绩比较基准收益率为④</th></tr> <tr><td>过去三个月</td><td>12.08%</td><td>1.36%</td><td>1.35%</td><td>0.10%</td></tr> <tr><td>①-③</td><td>10.98%</td><td>1.26%</td><td></td><td></td></tr> <tr><td>②-④</td><td></td><td></td><td>10.75%</td><td>1.26%</td></tr> </table> 注:本基金的业绩比较基准为从美国国债计算并算术平均后编制并发布的中债综合全价指数,每日进行再平衡计算。 3.2.2 基金合同生效以来基金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 	阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④	过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%	①-③	10.98%	1.26%			②-④			10.75%	1.26%
阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④																
过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%																
①-③	10.98%	1.26%																		
②-④			10.75%	1.26%																

注:银河通利分级债券型证券投资基金基金合同生效日为2012年4月25日,于2014年4月26日正式转型为银河通利分级债券型证券投资基金(LOF),根据《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金应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有关规定。

4.5 企业内部核算、投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、合规监督及风险管理、内部控制情况

4.6 企业内部核算、投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、合规监督及风险管理、内部控制情况																				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限																	
银河通利债券型证券投资基金(LOF)	基金经理	2014年7月1日	7																	
周唯唯	基金经理	-	-																	
注:1.上表中短期限、离职日期均为公司做出决定之日。 2.银河通利基金经理由公司决定之日起从事证券相关业务的从业经历累计年限计算。 3.2.1 本报告期内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 银河通利 <table border="1"> <tr><th>阶段</th><th>净值增长率为①</th><th>净值增长率为②</th><th>业绩比较基准收益率为③</th><th>业绩比较基准收益率为④</th></tr> <tr><td>过去三个月</td><td>12.08%</td><td>1.36%</td><td>1.35%</td><td>0.10%</td></tr> <tr><td>①-③</td><td>10.98%</td><td>1.26%</td><td></td><td></td></tr> <tr><td>②-④</td><td></td><td></td><td>10.75%</td><td>1.26%</td></tr> </table> 注:本基金的业绩比较基准为从美国国债计算并算术平均后编制并发布的中债综合全价指数,每日进行再平衡计算。 3.2.2 基金合同生效以来基金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 	阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④	过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%	①-③	10.98%	1.26%			②-④			10.75%	1.26%
阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④																
过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%	0.10%																
①-③	10.98%	1.26%																		
②-④			10.75%	1.26%																

注:银河通利分级债券型证券投资基金基金合同生效日为2012年4月25日,于2014年4月26日正式转型为银河通利分级债券型证券投资基金(LOF),根据《银河通利分级债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金应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有关规定。

4.6 企业内部核算、投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、合规监督及风险管理、内部控制情况

4.7 企业内部核算、投资决策、研究分析、投资决策、交易执行、风险管理、合规监督及风险管理、内部控制情况									
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限						
银河通利债券型证券投资基金(LOF)	基金经理	2014年7月1日	7						
周唯唯	基金经理	-	-						
注:1.上表中短期限、离职日期均为公司做出决定之日。 2.银河通利基金经理由公司决定之日起从事证券相关业务的从业经历累计年限计算。 3.2.1 本报告期内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 银河通利 <table border="1"> <tr><th>阶段</th><th>净值增长率为①</th><th>净值增长率为②</th><th>业绩比较基准收益率为③</th><th>业绩比较基准收益率为④</th></tr> <tr><td>过去三个月</td><td>12.08%</td><td>1.36%</td><td>1.35%&lt;/td</td></tr></table>	阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④	过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%</td
阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率为③	业绩比较基准收益率为④					
过去三个月	12.08%	1.36%	1.35%</td						