银河润利保本混合型证券投资基金

【2015】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:北京银行股份有限公司
送出日期:2016年3月25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。
基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3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。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告中财务资料已经审计。
本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河润利保本	
场内简称	–	
基金主代码	519675	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年8月6日	
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	
报告期末基金份额总额	2,035,195,134.94份	
基金合同存续期	–	
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:	银河润利混合A	银河润利混合I
下属分级基金的场内简称:	–	–
下属分级基金的交易代码:	519675	519648
下属分级基金的前端交易代码	–	–
下属分级基金的后端交易代码	–	–
报告期末下属分级基金的份额总额	302,873,357.78份	1,732,321,777.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金应用优化的恒定比例投资保险策略,并引入保证人,在保证本金安全的基础上,本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下,力争实现基金资产在保本期上的稳定增值。
投资策略	本基金运用优化的恒定比例组合保险原理,动态调整保本资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保本基金在保本周期到期时的本金安全,并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金。

	银河润利混合A	银河润利混合I
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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	董伯儒	刘晓
	联系电话	021-38568888	010-66223586
	电子邮箱	dongboru@galaxyasset.com	liuye1@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95526
传真		021-38568769	010-66226045

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	1、上海市世纪大道1568号中建大厦15楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年		2014年8月6日(基金合同生效日)-2014年12月31日		2013年	
	银河润利混合A	银河润利混合I	银河润利混合A	银河润利混合I	银河润利混合A	银河润利混合I
本期已实现收益	183,270,842.90	10,038,453.94	31,194,873.82	–	–	–
本期利润	128,426,106.92	9,365,516.29	109,740,468.27	–	–	–
加权平均基金份额本期利润	0.2916	0.0057	0.1384	–	–	–
本期基金份额净值增长率	22.99%	0.70%	14.40%	–	–	–
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
期末可供分配基金份额利润	0.3724	0.0068	0.0406	–	–	–
期末基金资产净值	426,066,457.28	1,744,335,576.17	837,969,000.08	–	–	–
期末基金份额净值	1.407	1.007	1.144	–	–	–

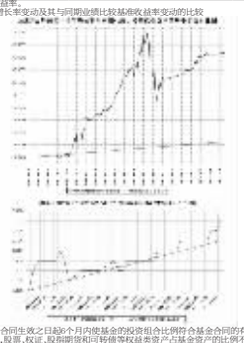
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
4.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
银河润利混合A

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
过去三个月	5.24%	0.34%	1.07%	0.01%	4.17%	0.33%
过去六个月	4.92%	0.55%	2.14%	0.01%	2.78%	0.54%
过去一年	22.99%	0.73%	4.25%	0.01%	18.74%	0.72%
自基金合同生效起至今	40.70%	0.69%	5.97%	0.01%	34.73%	0.68%

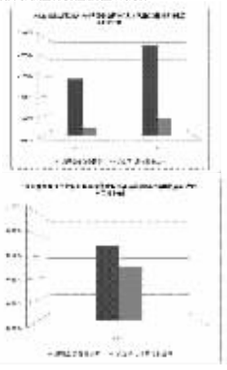
银河润利混合I

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
自基金合同生效起至今	0.70%	0.08%	0.50%	0.01%	0.20%	0.07%

注:业绩比较基准:三年期银行定期存款税后收益率。
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.按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定;本基金投资的债券、国债期货和证期存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于60%,股票、权证、股指期货和可转债等权益类资产占基金资产的比例不高于40%,且权证的投资比例不超过基金资产净值的3%,期金或者期货日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
2.截止2015年2月5日建仓期满,本基金各项资产配置符合合同约定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况
无

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其投资管理业务的经验
银河基金管理有限公司设立于2002年6月14日,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。
目前,除本基金外,银河基金管理有限公司分管理以封闭式基金与26只开放式证券投资基金,基本情况如下:
1.银丰证券投资基金
类型:契约型封闭式
成立日:2002年8月16日
基金投资目标:为平衡型基金,力求有机融合稳健型和进取型两种投资风格,在控制风险的前提下追求基金资产的长期稳定增值。
2.银河稳健系列证券投资基金
本系列基金为契约型开放式基金,由两只基金构成,包括银河稳健证券投资基金和银河收益证券投资基金,每只基金独立运作,并通过基金间相互转换构成一个统一的基金体系。
基金合同生效日:2003年8月4日
(1)银河稳健证券投资基金
基金投资目标: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。
(2)银河收益证券投资基金
基金投资目标:以债券投资为主,兼顾股票投资,在充分控制风险和保持较高流动性的前提下,实现基金资产的安全及长期稳定增值。
3.银河稳泰期分红证券投资基金
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
4.银河银富货币市场基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年12月20日
基金投资目标:在确保基金资产安全和高流动性的基础上,追求高于金债比较基准的回报。
5.银河稳定追利债券型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2007年3月14 日
基金投资目标:在满足本金稳妥与良好流动性的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
6.银河竞争优势成长混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2008年6月26日
基金投资目标:在有效控制风险,保持良好流动性的前提下,通过主动式管理,追求基金中长期资本增值。
7.银河行业优选混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年4月24日
基金投资目标:本基金将“自上而下”的资产配置以及动态行业配置策略与“自下而上”的个股优选策略相结合,优选景气行业或预期景气行业中的优势企业进行投资,在有效控制风险,保持良好流动性的前提下,通过主动式管理,追求基金中长期资本增值。
8.银河沪深300价值指数证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年12月28日
基金投资目标:通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段,追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。
9.银河策略精选混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2010年7月16日
基金投资目标:本基金投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司,在有效控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,力争在基金价值持有人分享中国经济持续发展的成果。
10.银河创新成长混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2010年12月29日
基金投资目标:本基金投资于具有较好成长性的创新类上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
11.银河强化收益债券型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年5月31日
基金投资目标:本基金主要投资于固定收益类品种,在控制风险,保持资产良好流动性的前提下,追求一定的当期收入和基金资产的长期稳健增值。
12.银河消费驱动混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年7月29日
基金投资目标:本基金通过深入研究,重点投资与居民消费密切相关的行业中具有竞争优势的上市公司,分享由于中国巨大的人口基数、收入增长和消费结构变革所带来的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求基金资产长期稳定增值。
13.银河通利债券型证券投资基金(LOF)
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年4月26日
基金投资目标:在合理控制风险的前提下,力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
14.银河主题策略混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年9月21日
基金投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,采用主题投资策略和精选个股策略的方法进行投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。
15.银河领先债券型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2012年11月29日
基金投资目标:在合理控制风险的前提下,力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
16.银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2013年3月29日
基金投资目标:本基金为增强型股票指数基金,力求对沪深300成长指数进行有效跟踪,在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下追求跟踪误差的最小化,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。
17.银河增利债券型发起式证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2013年7月17日
基金投资目标:本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具,辅助投资于精选的具有投资价值的股票,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求实现基金资产持续稳定增值。
18.银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式(本基金以定期开放的方式运作,运作周期和自由开放期相结合,以1年为一个运作周期,每个运作周期其包含为4个封闭期和3个受限开放期)。
基金合同生效日:2013年8月9日
基金投资目标:本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具,通过严谨的风险管理与主动管理,力求实现基金资产持续稳定增值。
19.银河灵活配置混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2014年2月11日
基金投资目标:本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,在确保超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值的前提下,力求获取超额收益。
20.银河定投宝中证精选价值100指数型发起式证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2014年3月14日
基金投资目标:本基金为股票型指数基金,力求对中证精选价值100指数进行有效跟踪,在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下追求跟踪误差的最小化,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
21.银河美丽优萃混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2014-05-29
基金投资目标:本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的美丽主题相关股票,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
22.银河康乐股票证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2014-11-18
基金投资目标:本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的健康快乐主题相关的股票,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
23.银河泽利保本混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2015-04-09
基金投资目标:本基金应用优化的恒定比例投资保险策略(优化的CPPI 策略),并引入保证人,在保证本金安全的基础上,本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下,力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。
24.银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2015-04-22
基金投资目标:本基金将充分把握内地经济转型持续发展过程中现代服务主题相关行业及子行业呈现出的投资机会,通过行业配置和精选个股,分享中国在加快转变经济发展方式的过程中现代服务主题相关行业及子行业的崛起所带来的投资机遇。在严格控制投资风险的条件下,力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
25.银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2015-04-22
基金投资目标: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,追求资产的持续稳定增值。
26.银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2015-05-12
基金投资目标:本基金将充分把握我国经济转型转型调整、产业结构优化升级等因素带来的经济结构转型、产业优化升级的过程,在严格控制投资风险的条件下,力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。
27.银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2015-06-19
基金投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,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,追求资产的持续稳定增值。
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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
索峰	银河润利保本债券型证券投资基金的基金经理、银河增利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理、银河泽利保本债券型证券投资基金的基金经理、总经理助理、固定收益部总监	2014年8月6日	–	21	中共党员,本科学历,曾就职于国庆期货公司,申银万国证券公司,原君安证券和中国银河证券有限责任公司,期间主要从事国际商品期货交易、登记结算业务管理业务和证券投资咨询工作。2004年6月加入银河基金管理有限公司,从事固定收益产品投资工作,历任银河银富货币市场基金的基金经理,银河收益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;2012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,2013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,2015年4月起担任银河泽利保本债券型证券投资基金的基金经理;现任总经理助理、固定收益部总监。
孙伟仓	银河润利保本债券型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、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理、银河泽利保本债券型证券投资基金的基金经理。	2014年8月6日	–	8	硕士研究生学历,2008年6月加入银河基金管理有限公司,历任数量研究员、债券经理,期间主要从事数量研究和债券投资工作。2012年12月起担任银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理;2013年7月起担任银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理,2013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;2015年4月起担任银河泽利保本债券型证券投资基金的基金经理。

§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
在本报告期内,本基金托管人在托管银河增利债券型发起式证券投资基金过程中,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,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、利润分配等情况的评价
在本报告期内,本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。
本基金本报告期未进行利润分配。
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容(“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内),保证复核内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	60821717_B23

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河润利保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的银河润利保本混合型证券投资基金财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表和2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银河基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了银河润利保本混合型证券投资基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	中国注册会计师郭杭翔 中国注册会计师濮晓达
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
审计报告日期	2016年3月21日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表
会计主体:银河润利保本混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		2,471,281.88	37,704,152.91
结算备付金		31,569,187.04	10,129,214.86
存出保证金		749,059.82	515,829.23
交易性金融资产		1,358,833,106.25	990,751,258.09
其中:股票投资		29,620,184.05	331,807,915.19
基金投资		–	–
债券投资		1,329,212,922.20	658,943,342.90
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		120,000,000.00	–
应收证券清算款		632,714,662.47	363,475.13
应收利息		27,492,898.96	11,202,707.03
应收股利		–	–
应收申购款		1,703,334.95	100,309.94
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		2,175,533,531.36	1,050,766,947.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		–	208,000,000.00
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		2,036,182.58	3,037,944.29
应付管理人报酬		2,219,505.09	832,410.04
应付托管费		369,917.51	138,735.03
应付销售服务费		74,143.26	–
应付交易费用		219,160.10	594,515.75
应交税费		–	–
应付利息		–	43,687.38
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		212,589.37	150,654.62
负债合计		5,131,497.91	212,797,947.11
所有者权益:			
实收基金		2,035,195,134.94	732,216,784.22
未分配利润		135,206,898.51	105,752,215.86
所有者权益合计		2,170,402,033.45	837,969,000.08
负债和所有者权益总计		2,175,533,531.36	1,050,766,947.19

注:1.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.006元,基金份额总额2,035,195,134.94份,银河润利混合A基金份额参考净值1.407元,份额总额302,873,357.78份;其中银河润利混合份额参考净值1.007元,份额总额1,732,321,777.16份。
2.本期金合同于2014年8月6日生效,上年度可比期间为2014年8月6日至2014年12月31日。
7.2 利润表
会计主体:银河润利保本混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年8月6日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入		157,246,783.18	117,695,780.61
1.利息收入		40,179,919.62	13,079,898.88
其中:存款利息收入		718,774.96	538,125.10
债券利息收入		38,522,366.71	9,725,460.82
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		938,777.95	2,816,312.96
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)		168,348,026.34	25,111,769.46
其中:股票投资收益		168,150,036.52	22,356,392.78
基金投资收益		–	–
债券投资收益		-923,916.38	2,755,376.68
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		1,121,906.20	–
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-55,517,673.63	78,545,594.45
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)		4,236,510.85	958,517.82
减:二、费用		19,455,159.97	7,955,312.34
1. 管理人报酬		9,176,060.39	3,911,728.28
2. 托管费		1,529,343.37	651,954.76
3. 销售服务费		95,997.30	–
4. 交易费用		3,356,900.09	1,092,803.39
5. 利息支出		5,090,472.82	2,175,064.31
其中:卖出回购金融资产支出		5,090,472.82	2,175,064.31
6. 其他费用		206,386.00	123,761.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		137,791,623.21	109,740,468.27
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		137,791,623.21	109,740,468.27

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:银河润利保本混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	732,216,784.22	105,752,215.86	837,969,000.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	137,791,623.21	137,791,623.21
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)	1,302,978,350.72	-108,336,940.56	1,194,641,410.16
其中:1.基金申购款	1,826,772,752.66	28,841,971.81	1,855,614,724.47
2.基金赎回款	-523,794,401.94	-137,178,912.37	-660,973,314.31
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)	2,035,195,134.94	135,206,898.51	2,170,402,033.45

项目	上年度可比期间 2014年8月6日(基金合同生效日)至2014年12月31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)	812,268,889.51	–	812,268,889.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	109,740,468.27	109,740,468.27
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)	-80,052,105.29	-3,988,252.41	-84,040,357.70
其中:1.基金申购款	2,271,264.56	151,105.07	2,422,369.63
2.基金赎回款	-82,323,369.85	-4,139,357.48	-86,462,727.33
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)	732,216,784.22	105,752,215.86	837,969,000.08

注:本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:
基金管理人负责人 陈勇 主管会计工作负责人 陈诚 会计机构负责人 秦长建
7.4 报表附注
7.4.1 基金基本情况
银河润利保本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[2014]532号《关于核准银河润利保本混合型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管理人向社会公开募集。基金合同于2014年8月6日生效,首次设立募集规模为812,268,889.51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,基金托管人为北京银行股份有限公司,保证人为中国投融资担保有限公司。本基金自2015年11月18日起增加出借基金份额,目增加类基金份额类别后,本基金分为A类和E类两类基金份额。对于A类基金份额,投资者申购时需缴纳申购费;对于E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1,000,000万元,投资者申购时无需缴纳申购费,而从E类基金资产中收取销售服务费。
根据《银河润利保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,在第一个保本周期内,本基金的保本金额为基金募集期内认购/申购基金的投资人认购并持有到期的基金份额的认购金额(募集期保本金额,包括该等基金份额的净认购金额,认购费用以及募集期间的认购利息),发生本基金转入下一保本周期的情形时,下一保本周期的保本金额为在过渡期内进行申购的投资人申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和(即过渡期申购保本金额),以及从本基金上一个保本周期结束后新认选转转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人在上一个保本周期持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值(即从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额保本金额),按照基金合同其他约定未获得申请保本条款确认的基金份额除外。
在保本周期到期日,如基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和计算的总金额低于其保本金额(包括的部分因为“保本条件”未满足,则基金管理人或保本义务人应补足该保本条件差额,并在保本周期到期日后20个工作日(含第20个工作日)内将该保本条件差额支付给基金份额持有人。但发生基金合同约定的不适用保本条款情形的,相应基金份额不适用本条款。
保本周期届满时,存在保本基金合同条款所下,本基金继续存续并转入下一保本周期,该保本周期的具体起止日期以本基金管理人届时公告为准。如保本周期到期后,本基金未能符合保本基金合同条件,则本基金合同规定的其他情况,则本基金合同规定的其他情况,则本基金合同规定的其他情况