

银丰证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	355,021,827.87	7.94
B	采矿业	116,115,573.03	2.60
C	制造业	1,573,000,050.29	35.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	153,436,234.24	3.43
F	批发和零售业	134,264,306.46	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	95,449,427.30	2.14
H	住宿和餐饮业	219,009,669.70	4.90
I	信息技术、软件和信息服务业	404,489,512.00	9.05
J	金融业	-	-
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	2,362,988.88	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	100,545,494.28	2.25
S	综合	-	-
	合计	3,153,695,086.29	70.56

序号	经济类型	企业名称	数量(部)	公允价值(元)	公允价值/资产总额(%)
1	002458	南昌农商	3,740,958	176,023,028.52	3.94
2	000026	山东高速	13,149,000	167,267,276.72	3.74
3	000074	山东国信	4,000,000	163,000,000.00	3.60
4	002717	山能集团	1,000,000	153,460,000.00	3.43
5	300036	招商银行	3,500,000	145,775,000.00	3.26
6	600836	界龙实业	4,300,000	127,200,000.00	2.85
7	002299	圣农发展	4,999,915	121,002,714.35	2.71
8	002407	和顺鑫	5,000,000	104,400,000.00	2.34



4	160412	15年12月	50,000	51,360,000	1.15
5	09913	15年10月	50,000	50,665,000	1.15
5.6	报告期内本基金资产净值前十大排序的前十名资产无证券质押说明 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
5.7	报告期内本基金资产净值前十大排序的前五名金融资产质押说明 注:本基金未持有金融资产质押。				
5.8	报告期内本基金资产净值前十大排序的前五名权证质押说明 注:本基金本报告期末未持有权证。				
5.9	报告期内本基金资产净值前十大排序的前五名交易对手方说明 注:本基金本报告期末未持有交易对手。				
5.9.1	报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细 注:本基金报告期末未持有股指期货合约。				
5.9.2	本基金投资股指期货的投资政策 注:本基金未投资股指期货。				
5.9.3	报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细 注:本基金本报告期投资国债期货。 5.9.3.1 本期国债期货投资政策 注:本基金未投资国债期货。 5.9.3.2 报告期内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。 5.9.3.3 本期国债期货投资评价 注:本基金未投资国债期货。				

5.11 投资组合报告附注

本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,在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,433,830.65
2	应收证券清算款	55,021,393.74
3	应收利息	—
4	应收股利	14,352,133.72
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	50,867,358.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券名称	债券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110001	航发转债	355,308,000.00	3.49

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002717	岭南园林	353,400,000.00	3.45	筹划重大事项

5.1 基金管理人和基金托管人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人持有本基金份额无变动。

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金变动情况

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

57 影响投资者决策的其他重要信息

8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准设立银华证券投资基金的文件

2、《银华证券投资基金基金合同》

3、《银华证券投资基金托管协议》

4、中国证监会核准设立银华基金管理有限公司的文件

5、银华证券投资基金基金招募说明书及说明性文件

6、报告期内按规定在指定信息披露网站上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦15楼

北京市西城区广内大街1号院1号楼

8.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人银华基金管理有限公司。

咨询电话:(021)38568888 / 400-820-0860

公司网址:<http://www.gdscn.com>

银华基金管理有限公司
2016年4月21日

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	160201	16国债 01	1,000,000	99,758,000.00	4.37
2	019515	15国债 15	990,000	99,118,800.00	4.35
3	011598131	15国债 13	800,000	80,296,000.00	3.52
4	011699482	16国债 18	790,000	79,952,000.00	3.51
5	041564012	15 年国开 01	500,000	50,480,000.00	2.21

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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:本基金未进行贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金暂不参与股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金暂不参与国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金未进行国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

注:本基金投资的前十名证券中,没有发生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发生过公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

注:本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	196,717.28
2	应收证券清算款	47,002,713.31
3	应收股利	-
4	应收利息	14,636,568.58

6	应收票据款				
7	其他应收款				
8	其他				
9	合计			61,835,098.91	
11.4 报告期末持有的低于持股比例的可转债融资明细					
注：截至本报告期末无持有低于持股比例的可转债融资					
5.11.5 报告期末前十名流通股股东存在流通受限情况的说明					
序号	股票代码	股票名称	流通股股东持有的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600271	航天信息	7,567,552.04	0.33	未知重大事项
2	002314	南山铝业	1,697,681.70	0.07	未知重大事项
5.11.6 报告期末持有的其他上市公司流通股部分					
注：无					

5. 开放式基金净值变动				单位:元
项目	银河利鑫组合A	银河利鑫组合C	银河利鑫组合B	
报告期期初基金份额总额	2,332,292,984.82	30,609,959.06	1,415,000,000.00	
报告期期末基金份额总额	54,850.43	146,412.79	—	
报告期内基金份额净增加额	33,618,150.22	6,776,306.15	1,415,000,000.00	
报告期内基金份额净变动额 (份额减少以“-”填写)	—	—	—	
报告期期末基金份额总额	2,198,729,085.03	23,980,065.70	—	

注1:以上数据经银河利鑫再投资、转换转入。
注2:总份额为转换转出份额。
3. 基金合同生效日为:2015年4月22日。

5.1 基金管理人持有其基金净值变动情况
注:基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。
5.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
无。

5.9 备查文件目录
5.9.1 备查文件目录
1、中国证监会核准设立银河利鑫沃灵资产配置证券投资基金的文件
2、《银河利鑫沃灵资产配置证券投资基金基金合同》
3、《银河利鑫沃灵资产配置证券投资基金托管协议》
4、中国证监会核准设立银河利鑫沃灵资产配置证券投资基金文件
5、银河利鑫沃灵资产配置证券投资基金财务报表及审计报告
6、基金合同在指定性信息披露的各项公告
7、存放地点
上海市浦东新区世纪大道1568号15楼A15楼
8、查阅方式
投资者对本报告如有任何疑问,可向本基金管理人银河利鑫资产管理有限公司、
投资者:地址:021350088888 400-620-6000
或网站:www.galaxyasset.com

银河基金管理有限公司
2016年4月21日