

银河大智造主题灵活配置混合型证券投资基金2019年第二季度报告

2019-06-30
基金管理人：银河基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-18

重要提示

基金管理人及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责任。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fund name (银河智造混合), code (319642), and other details.

主要财务指标

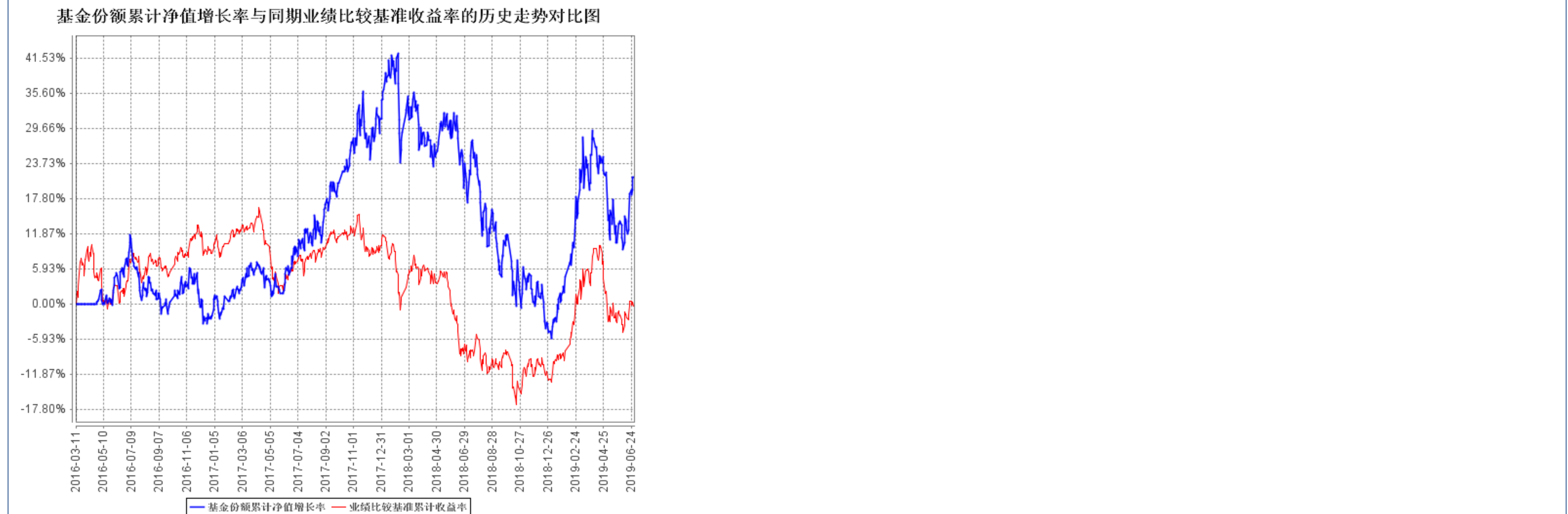
Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes metrics like net income and net assets.

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可能低于所列数字。
3、基金合同生效日为2016年3月11日。

基金净值表现

Table showing performance metrics: 本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. Includes columns for 阶段 (Period) and 净值增长率 (Net Value Growth Rate).

注：注：1、本基金的业绩比较基准是：中证装备产业指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
自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



注：注：1、截止本报告期末，建仓已完成。
2、本基金合同于2016年3月11日生效。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes metrics like 基金份额持有人数量 (Number of Shareholders).

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience), and 说明 (Remarks).

注：1、上表中任职日期为基金合同生效之日。
2、证券从业年限按从事证券相关行业的从业经历计算。

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，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、勤勉尽责、创新进取”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、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
本报告期，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规定，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，公司对不同投资组合的整体收益率差异及分投资类（股票、债券）的收益率差异进行了分析。

异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金与其他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。
报告期内基金的投资策略和运作分析
2019年二季度市场出现探底，二季度上证指数下跌3.82%，创业板指数下跌10.73%，上证50上涨了3.24%。1季度市场出现了超跌反弹，同时，政策力度不断体现，管理层对资本市场有更高的定价推升了市场信心，而在贸易摩擦的背景下，2季度市场震荡下跌，题材股投资收益，市场有明显的避险情绪。

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1.214元；本报告期基金份额净值增长率为-2.98%，业绩比较基准收益率为-5.29%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末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。

投资组合报告

Table showing 报告期末基金资产组合情况 (Report End Fund Asset Portfolio Situation) with columns for 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), and 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets).

Table showing 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 (Report End Domestic Equity Investment Portfolio by Industry Classification) with columns for 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

Table showing 报告期末按行业分类的港股股票投资组合 (Report End Hong Kong Equity Investment Portfolio by Industry Classification) with columns for 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

Table showing 报告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 (Report End Top 10 Stocks by Fair Value as a Percentage of Net Asset Value).

Table showing 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 (Report End Bond Investment Portfolio by Bond Type Classification) with columns for 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

Table showing 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债券投资明细 (Report End Top 5 Bonds by Fair Value as a Percentage of Net Asset Value).

Table showing 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 (Report End Top 10 Asset-Backed Securities by Fair Value as a Percentage of Net Asset Value).

Table showing 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 (Report End Top 5 Precious Metals by Fair Value as a Percentage of Net Asset Value).

Table showing 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 (Report End Top 5 Warrants by Fair Value as a Percentage of Net Asset Value).

Table showing 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 (Report End Fund's Futures Trading Situation).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).

Table showing 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 (Report End Fund's Treasury Futures Holdings and P/L Details).