银河聚优选混合型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-04-30

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-18

§1重要提示
§2基金简介
§3主要财务指标和基金净值表现
§4管理人报告
§5托管人报告
§6审计报告
§7投资组合报告
§8基金份额持有人户数及持有人结构情况
§9开放式基金持有人大额赎回情况
§10重大事件揭示
§11影响投资决策的其他重要信息
§12备查文件目录

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月30日对银河聚优选混合型证券投资基金的投资运作进行了复核，在本报告中所载财务指标、净值表现和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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告的期间为2019-01-01至2019-03-31。

§2 基金简介

基金基本情况

项目	简介
基金简称	银河聚优选混合
场内简称	-
基金主代码	004330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017-04-27
报告期末基金份额总额	95,100,392.32
投资目标	本基金以股票选优策略确定行业产业配置和投资比例，产业配置时风险收益比较高，行业配置合理产品，稳定控制收益。
投资策略	本基金以定量分析为主，定性分析为辅，通过对宏观经济、证券市场发展趋势、市场资金流向、市场风险等多方面的分析，合理安排股票、债券、现金等资产的配置比例，以期在保证基金资产安全性、流动性的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-01 至 2019-03-31）
本期已实现收益	4,472,395.13
本期利润	-1,916,409.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0201
期末基金资产净值	101,106,508.76
期末基金份额净值	1.0630

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（不含公允价值变动损益）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损益。

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或亏损将低于或高于所列数字。

基金净值表现

本期末基金份额净值收益率与其同期业绩比较基准收益率的比较

业绩比较基准	本期末基金份额净值收益率	业绩比较基准收益率标准差	业绩比较基准收益率与本期末基金份额净值收益率之差	①-②	②-③	①-③
过去三个月	-4.12 %	0.59 %	-5.59 %	-1.46 %	1.31 %	-0.15 %

注：业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×20%+中证500指数收益率×80%。

自基金合同生效日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：根据本基金合同规定，本基金自合同生效日起三个月内为建仓期，在建仓期内投资组合比例符合本基金合同的有关规定。本基金投资组合比例为股票资产0%-80%，每个交易日日终持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，投资期限在1年以内（含1年）的国债的投资比例不低于基金资产净值的5%。

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-01-01至2019-03-31）
其他指标	0.00
其他指标	报告期（2019-01-01）

注：无。

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	说明
		任职日期	离任日期		
赵令海	基金经理	2017-04-27	-	9	经济管理，硕士研究生学历。10年证券从业经历。先后在国泰君安证券股份有限公司研究所从事研究、投资工作。2007年7月至2009年6月任国泰君安证券股份有限公司研究所分析师，2009年7月至今任银河证券基金管理有限公司。现任银河证券基金管理有限公司基金经理。2016年12月起担任银河证券基金管理有限公司基金经理小组组长。2017年4月起担任银河聚优选混合型证券投资基金的基金经理。2017年5月起担任银河聚优选混合型证券投资基金的基金经理小组组长。2017年12月起担任银河聚优选混合型证券投资基金的基金经理。2019年1月起担任银河聚优选混合型证券投资基金的基金经理小组组长。2019年6月起担任银河聚优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年6月起担任银河聚优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理小组组长。

注：1、上表中任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限按本表填写规则计算，证券从业年限自开始从事证券业务之日起开始计算。

管理人对报告期内本基金运作遵守有关法规的说明

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》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚信为本、稳健操作”的原则开展证券投资业务，严格控制投资风险，为持有人利益实现最大化。

报告期内，基金管理人的运作合法、合规，没有违反法律、法规的行为，也没有违反基金合同的行为。

报告期内，公司旗下所有开放式基金的投资组合比例均以当期有效的证券投资基金管理人内部风控标准，未发现重大违规情况。

报告期内，公司旗下开放式基金的投资组合比例均符合证券投资基金管理人内部风控标准，不存在因投资比例原因导致的被动超标情况。

公司旗下开放式基金的投资组合比例

序号	基金名称	投资组合比例是否符合证券投资基金管理人内部风控标准
1	银河聚优选灵活配置混合型证券投资基金	是
2	银河聚利灵活配置混合型证券投资基金	是
3	银河聚优选混合型证券投资基金	是

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》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚信为本、稳健操作”的原则开展证券投资业务，严格控制投资风险，为持有人利益实现最大化。

报告期内，基金的投资运作合法、合规，没有违反法律、法规的行为，也没有违反基金合同的行为。

报告期内，公司旗下开放式基金的投资组合比例均以当期有效的证券投资基金管理人内部风控标准，未发现重大违规情况。

报告期内，公司旗下开放式基金的投资组合比例均符合证券投资基金管理人内部风控标准，不存在因投资比例原因导致的被动超标情况。

异常交易行为的专门说明

报告期内，公司旗下管理的开放式投资组合严格执行公平交易制度，在投资管理、研究支持、投资决策、交易执行等环节实施公平交易制度的有效控制，同时，公司研究员对投资组合的投资决策及交易情况实施监控，通过事后分析公平性的检查方式，对异常交易行为进行监控。

报告期内，公司旗下开放式基金的投资组合不存在违反公平交易制度的情况。

报告期内，本基金与其他基金的投资决策相互独立，投资决策遵循内部风控制度，事前确定投资申请的有效性，事中实施交易指令的公平分配，事后进行交易记录的合规性检查，以保证公平交易制度的有效实施。

报告期内，公司旗下开放式基金的投资组合不存在违反公平交易制度的情况。

报告期内，公司旗下开放式基金的投资组合不存在违反公平交易制度的情况。

报告期内，本基金与其他基金的投资决策相互独立，投资决策遵循内部风控制度，事前确定投资申请的有效性，事中实施交易指令的公平分配，事后进行交易记录的合规性检查，以保证公平交易制度的有效实施。

报告期内基金投资策略和业绩表现

报告期内，本基金本期净值增长率为1.0630%，业绩比较基准收益率为-4.12%，超额业绩基准收益率为5.18%。

报告期内基金持有资产预期收益率变动情况

本基金本期内预期收益变动原因：一个月内市场风格金融产业配置上个月又有所回落。

§7 投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
1	权益投资	65,704,085.20	62.70
	其中：股票	65,704,085.20	62.70
2	固定收益投资	1,920,200.00	1.83
	其中：债券	1,920,200.00	1.83
	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	3,000,000.00	2.86
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算保证金合计	1,835,800.36	1.75
7	其他资产	31,939.50	0.03
8	合计	32,491,533.12	30.99

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按申万行业分类的权益类投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	农、林、牧、渔业	1,401,866.00	1.37
2	采矿业	1,643,000.00	1.59
3	制造业	35,206,574.40	34.15
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	488,000.00	0.47
5	建筑业	-	-
6	批发和零售业	2,328,309.00	2.26
7	交通运输、仓储和邮政业	2,496,960.00	2.42
8	住宿和餐饮业	480,300.00	0.46
9	信息传输、软件和信息技术服务业	1,992,920.47	1.93
10	金融业	7,000,000.00	6.79
11	房地产业	1,901,000.00	1.84
12	租赁和商务服务业	980,155.00	0.95
13	科学研究和技术服务业	-	-
14	水利、环境和公共设施管理业	-	-
15	居民服务、修理和其他服务业	-	-
16	教育	-	-
17	卫生和社会工作	-	-
18	文化、体育和娱乐业	2,195,002.00	2.13
19	综合	995,153.80	0.97
20	合计	65,704,085.20	63.80

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	原材料	-	-
2	消费者非必需品	-	-
3	消费者必需品	-	-
4	能源	-	-
5	金融	-	-
6	医疗保健	-	-
7	工业	-	-
8	信息技术	-	-
9	电信服务	-	-
10	公用事业	-	-
11	房地产	-	-

注：1、本基金本期末未投资港股通。

2、本基金本期末未投资股票。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002299	圣农发展	36,900	931,506.00	0.92
2	000858	五粮液	155,300	921,931.40	0.91
3	002415	海康威视	67,200	914,422.08	0.90
4	300015	爱尔眼科	251,300	896,086.40	0.89
5	600000	浦发银行	103,900	894,979.00	0.88
6	002028	思源电气	33,100	892,987.00	0.88
7	600082	海新能科	66,900	842,808.00	0.83
8	600500	胜利股份	66,300	833,113.80	0.82
9	002142	宁波银行	66,000	832,656.00	0.82
10	603711	香飘飘	25,900	826,586.00	0.81

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债券投资明细

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	108002	国开行24	20,000	2,020,200.00	1.99

注：报告期末持有的债券品种数量不超过前十名。

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资产支持证券投资明细

注：报告期末持有的资产支持证券品种数量不超过前十名。

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（盎司）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-

注：报告期末持有的贵金属投资的品种数量不超过前五名。

报告期末按照风险分类的股票投资组合

序号	风险分类	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	-	-
3	基金投资	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算保证金合计	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	-	-

注：报告期末按照风险分类的股票投资组合未发生变动。

报告期末按照风险分类的债券投资组合

序号	风险分类	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	政府债券	1,920,200.00	1.90
2	政府机构债券	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债（可交换债）	-	-
9	其他债券	-	-
10	合计	1,920,200.00	1.90

注：报告期末按照风险分类的债券投资组合未发生变动。

报告期末按照风险分类的资产支持证券投资组合

注：报告期末按照风险分类的资产支持证券投资组合未发生变动。

报告期末按照风险分类的贵金属投资组合

注：报告期末按照风险分类的贵金属投资组合未发生变动。

报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末基金投资的股指期货交易的持仓情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约价值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
合约市值有效证券比例（%）				-	
股指期货投资本期收益（元）				-60,300.00	
股指期货投资本期公允价值变动（元）				-	

注：报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

本基金投资股指期货的目的及效果

本基金不参与股指期货投资。

本期股指期货投资策略

本基金不参与股指期货投资。

报告期末基金投资的股指期货持仓合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约价值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
合约市值有效证券比例（%）				-	
股指期货投资本期收益（元）				-	
股指期货投资本期公允价值变动（元）				-	

注：本基金不参与股指期货投资。

本期股指期货投资评价

本基金不参与股指期货投资。

§9 报告期内基金投资情况

国债期货投资情况

本基金不参与国债期货投资。

报告期末本基金国债期货投资情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约价值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
合约市值有效证券比例（%）				-	
股指期货投资本期收益（元）				-	
股指期货投资本期公允价值变动（元）				-	

注：本基金不参与国债期货投资。

本期国债期货投资评价

本基金不参与国债期货投资。

§10 投资组合报告附注

报告期内投资的前十名证券发行主体未被监管部门处以谨慎性监管措施或监管处罚的情况

本报告期内投资的前十名证券发行主体没有被监管部门采取谨慎性措施，也没有被监管部门进行监管处罚的情况。

报告期内投资的前十名证券中除1家发行主体外，其他发行主体在报告编制日前一年内均没有受到公开谴责、监管调查、处罚的情况。

报告期内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

报告期内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。

其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,398.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股息	-
4	应收利息	19,131.80
5	应收申购款	394.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,939.50

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：报告期末持有的处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明。

投资组合报告附注其他事项说明

无。

§11 影响投资决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件

2、《银河聚优选混合型证券投资基金合同》

3、《银河聚优选混合型证券投资基金招募说明书》

4、中国证监会要求的其他法律文件

5、银河聚优选混合型证券投资基金托管协议

6、银河聚优选混合型证券投资基金财务报表和审计报告

7、报告期内投资组合公告

§13 联系方式

管理人：银河基金管理有限公司

客户服务电话：021-20280000，400-820-0860

公司网址：http://www.galaxyasset.com

§14 其他

本报告以上部分内容可能因四舍五入原因而与其他报告内容不一致。

投资有风险

投资者应根据自己的风险承受能力、投资期限和投资目的，结合自己的财务状况，谨慎决策。