

目录
一、重要提示
二、基金基本情况
三、主要财务数据和基金净值变动
四、管理人报告
五、报告期内基金的投资策略和业绩表现
六、投资组合报告
七、报告期末基金资产组合情况
八、报告期末基金行业分类

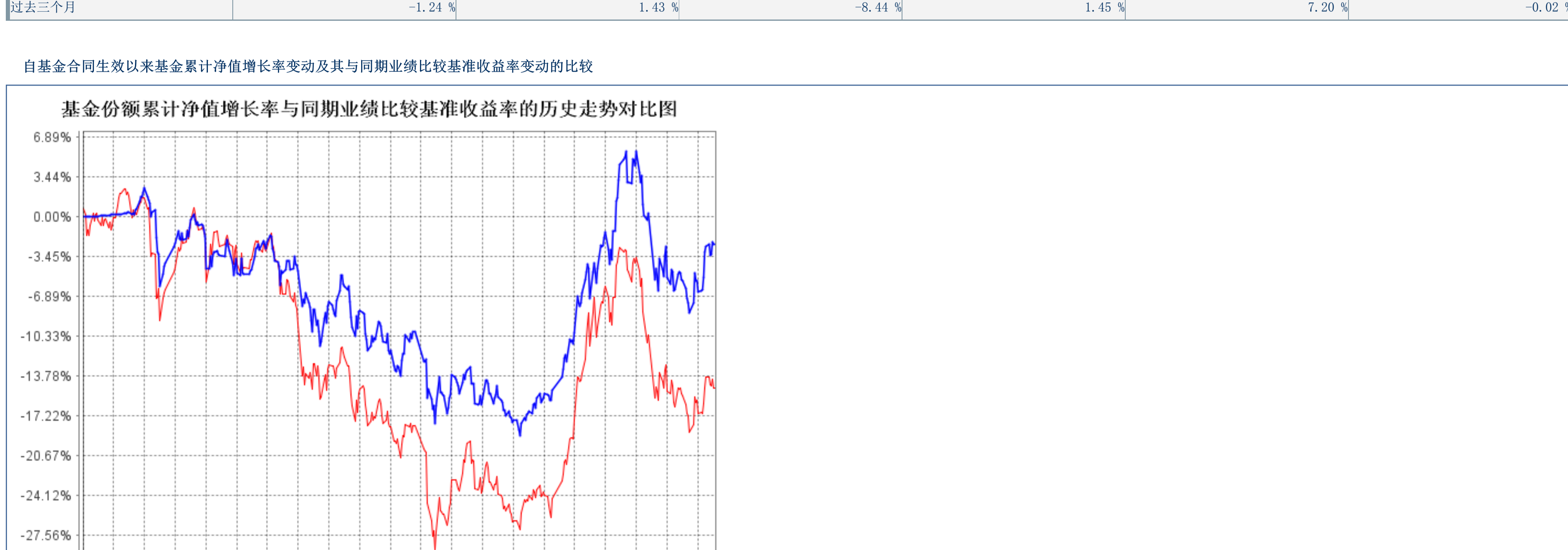
重要提示
基金管理人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金基本情况
项目 数值
基金名称 银河量化稳健混合
场内简称 银河量化
基金代码 900126
基金运作方式 契约型基金
基金合同生效日 2017-12-01
报告期末基金份额总额 96,632,425.81
投资目标 本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，在有效控制风险的前提下，力求基金资产长期、稳定的增值。

主要财务指标
单位：人民币元
本期已实现收益 8,943,294.63
本期利润 134,646.46
加权平均基金份额本期利润 0.0013
期末基金份额净值 94.313,313.98
期末基金份额净值 0.9760

注：1、本基金合同于2017年12月01日生效。
2、本期已实现收益及期末基金本期利息收入、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。
3、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。

基金净值表现
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
阶段 净值增长率① -1.24% 净值增长率标准差② 1.43% 业绩比较基准收益率③ -8.44% 业绩比较基准收益率标准差④ 1.43%



其他指标
单位：人民币元
其他指标 报告期（2019-04-01至2019-06-30）
其他指标 报告期（2019-06-30）

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
侯博涛 基金经理 2017-12-01 9 中共党员，硕士研究生学历，9年证券从业经历，先后就职于东方证券股份有限公司研究所分析师、光大证券股份有限公司信用业务高级经理、方正证券股份有限公司研究所分析师，2015年8月加入银河基金管理有限公司，现任数量与风控工作负责人、基金经理。2016年1月起担任银河定安中证消费主题100指数增强发起式证券投资基金的基金经理，2016年12月起担任银河沪深300成长量化混合证券投资基金的基金经理，2017年4月起担任银河量化稳健混合型证券投资基金的基金经理，2017年10月起担任银河量化稳健混合型证券投资基金的基金经理，2017年12月起担任银河量化稳健混合型证券投资基金的基金经理，2018年3月起担任银河沪深300成长量化增强型证券投资基金的基金经理，2018年6月起担任银河量化稳健混合型证券投资基金的基金经理。

管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下追求基金资产的保值和增值，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。基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。
报告期末基金资产组合情况
报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）
1 权益类投资 83,303,344.48 81.62
其中：股票 83,303,344.48 81.62
2 固定收益投资 5,081,220.06 4.98
其中：债券 5,081,220.06 4.98
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 4,000,000.00 3.92
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -
6 银行存款和结算备付金合计 9,365,392.04 9.37
7 其他资产 117,125.77 0.11
8 合计 102,067,182.41 100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
A 农、林、牧、渔业 1,357,152.00 1.44
B 采矿业 3,335,622.96 3.34
C 制造业 35,248,654.92 37.37
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,613,913.00 1.71
E 建筑业 232,497.00 0.25
F 批发和零售业 2,489,676.96 2.49
G 交通运输、仓储和邮政业 3,531,284.00 3.74
H 住宿和餐饮业 1,015,168.00 1.06
I 信息技术、软件和信息技术服务业 3,249,145.24 3.45
J 金融业 21,837,294.94 23.15
K 房地产业 3,630,948.00 3.85
L 租赁和商务服务业 2,056,880.00 2.18
M 科学研究和技术服务业 - -
N 水利、环境和公共设施管理业 - -
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 2,297,917.96 2.44
S 综合 1,498,290.00 1.49
合计 83,303,344.48 88.25

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 601318 中国平安 71,000 71,000 6,291,310.00 6.47
2 601166 兴业银行 150,000 1,500,000 2,743,500.00 2.91
3 601818 光大银行 673,690 673,690 2,386,416.00 2.72
4 601288 农业银行 400,000 400,000 2,531,284.00 2.69
5 601889 中国银行 23,290 23,290 2,058,680.00 2.18
6 600011 三一重工 151,460 151,460 1,980,312.00 2.10
7 600585 海螺水泥 46,300 46,300 1,921,450.00 2.04
8 600999 招商证券 102,000 102,000 1,743,180.00 1.83
9 600111 中国国航 178,100 178,100 1,704,412.00 1.81
10 603589 口子酒 26,200 26,200 1,687,804.00 1.79

报告期末按债券品种分类的债券投资组合
序号 债券品种 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）
1 国家债券 - -
2 央行票据 - -
3 金融债券 5,050,500.00 5.36
其中：政策性金融债 5,050,500.00 5.36
4 企业债券 - -
5 企业短期融资券 - -
6 中期票据 - -
7 可转债（可交换债） 36,720.06 6.03
8 同业存单 - -
9 其他 - -
10 合计 5,081,220.06 5.39

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
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 108802 国开1704 50,000 5,050,500.00 5.36
2 123022 长债转债 301 30,720.06 6.03

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：本基金本报告期末未有资产支持证券投资。
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：本基金本报告期末未有贵金属投资。
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有权证投资。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
代码 名称 持仓量（买/卖） 合约市值（元） 公允价值变动（元） 风险说明
公允价值变动总额合计（元） - -
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：本基金报告期内未有股指期货合约。

本基金投资股指期货的投资政策
本基金未对股指期货进行投资。
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
代码 名称 持仓量（买/卖） 合约市值（元） 公允价值变动（元） 风险指标说明
公允价值变动总额合计（元） - -
国债期货投资本期收益（元） - -
国债期货投资本期公允价值变动（元） - -
注：本基金未投资国债期货。

本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。

投资组合报告附注
受调查以及处罚情况
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情形，在编制报告日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。
申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
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。

其他资产构成
序号 名称 金额（元）
1 存出保证金 75,983.14
2 应收证券清算款 - -
3 应收股利 - -
4 应收利息 41,142.63
5 其他应收款 - -
6 其他费用 - -
7 预收费用 - -
8 其他 - -
9 合计 117,125.77

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。
报告期末前十名股票存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

开放式基金份额变动
单位：份
项目 数值
报告期初基金份额总额 127,886,103.73
报告期基金份额总额 96,632,425.81
减：报告期基金总申购份额 31,886,613.59
报告期基金份额净申购份额（份额减少以“-”填列） 96,632,425.81
报告期基金份额总额 96,632,425.81

基金管理人运用固有资金投资本基金情况
基金管理人持有本基金份额变动情况
单位：份
项目 基金份额
报告期末管理人持有的本基金份额 -
报告期管理人申购本基金份额 -
报告期管理人赎回本基金份额 -
报告期末管理人持有本基金份额 -
报告期末管理人持有本基金份额占基金份额总额比例(%) -
注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
序号 交易方式 交易日期 交易份额（份） 交易金额（元） 适用费率
注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。
报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
项目 持有份额总数 持有份额占基金份额总额比例 发起份额总数 发起份额占基金份额总额比例 发起份额承诺持有期限

报告期末单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
投资者类别 序号 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 期初份额 申购份额 赎回份额 持有份额 份额占比
机构 - - - - - -
个人 - - - - - -
注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

影响投资者决策的其他重要信息
无。

备查文件目录
1、中国证监会核准设立银河量化稳健混合型证券投资基金的文件
2、《银河量化稳健混合型证券投资基金基金合同》
3、《银河量化稳健混合型证券投资基金招募说明书》
4、中国证监会核准设立银河基金管理有限公司的文件
5、银河量化稳健混合型证券投资基金财务报表及报表附注
6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

存放地点
上海市浦东新区世纪大道1688号中银大厦13楼

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河基金管理有限公司。
咨询电话：(021)38568888 / 400-820-0860
公司网址：http://www.galaxyasset.com