

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。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年7月18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、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人保证以诚实守信、勤勉尽责为原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
本报告由基金托管人代表其本身发表，投资者有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2019年6月11日起至5月30日止。

项目	数量
基金简称	银河文体娱乐混合
场内简称	
基金主代码	005585
基金运作方式	契约的开放式
基金合同生效日	2018-04-19
报告期末基金份额总额	35,766,373.92
投资目标	本基金主要投资于文体娱乐主题相关行业中的优质上市公司，在控制风险、保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金在组合资产配置策略的基础上，详细研究个股基本面，优选高成长个股进行配置，跟踪基金资产，配置文体娱乐产业资产，力争实现基金资产净值长期平稳增长。
业绩比较基准	中证文体娱乐指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为权益类资产主要投资于文体娱乐主题的行业基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。
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

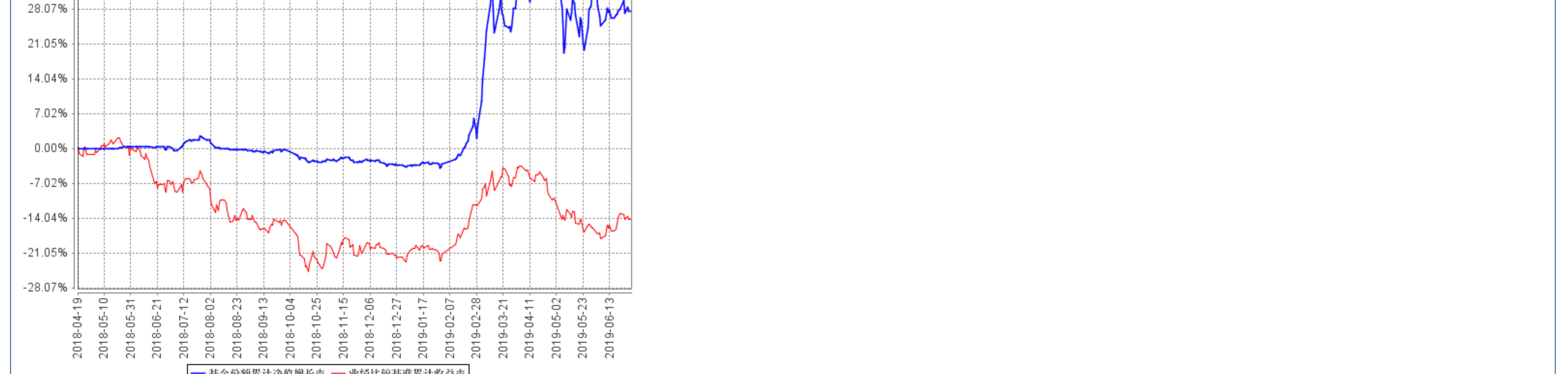
主要财务指标	报告期（2019-04-01至2019-06-30）
本期已实现收益	919,577.33
本期利润	-1,388,029.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0380
期末基金资产净值	45,636,037.93
期末基金份额净值	1.2763

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。

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

投资	净值增长率①	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	-0.43%	2.33%	-8.94%	1.24%	8.51%	1.09%



注：1、本基金合同于2018年4月19日生效。
2、本基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起每个月内将基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定；基金投资管理比例应符合基金合同的约定。其中：投资于本基金定义的文体娱乐主题相关行业证券的比例不低于非现金基金资产的60%，每个交易日终在扣除股指期货合约、国债期货合约后的交易资产后，保持不低于基金资产净值的60%或投资于过去一年以内的政府债券、权证、股指期货、国债期货等金融工具的投资比例不超过法律法规或监管机构的规定。截至2019年10月18日建仓期，本基金各项资产配置符合合同约定。

其他指标	报告期（2019-04-01至2019-06-30）
其他指标	报告期（2019-06-30）

姓名	职务	任本基金的基金经理期间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹庆舟	基金经理	2018-04-19	-	11	博士研究生学历，11年证券从业经历。曾就职于建设银行。2008年7月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金助理等职，现任基金经理。2012年12月起担任银河消费主题混合型证券投资基金的基金经理。2017年4月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年7月起担任银河天颐灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年10月起担任银河天颐灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。银河天颐灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起担任银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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“诚实守信、勤勉尽责、公开透明、维护基金份额持有人利益”的原则，规范运作基金管理业务，在合法合规的前提下谋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。基金投资组合投资符合有关法律法规及基金合同的约定。

报告期内，本基金管理人严格遵守《基金法》、《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、公开透明、维护基金份额持有人利益”的原则，规范运作基金管理业务，在合法合规的前提下谋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。基金投资组合投资符合有关法律法规及基金合同的约定。

报告期内，本基金管理人严格遵守《基金法》、《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、公开透明、维护基金份额持有人利益”的原则，规范运作基金管理业务，在合法合规的前提下谋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。基金投资组合投资符合有关法律法规及基金合同的约定。

公平交易制度的执行情况
本报告期内，公司公平交易的所有投资组合严格执行相关法律法规及公司制度，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面公平交易制度予以落实。确保公平对待不同投资组合。同时，公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及按投资组合（股票、债券）的收益率差异进行了分析。针对同向交易部分，本报告期内，公司对旗下管理的所有投资组合（完全复制的指数基金除外），连续四个季度内、不同时间段（日内、3日内、5日内）公开竞价交易的证券进行了价差分析，并针对价差金额、占比情况及其显著性进行了梳理和分析，未发现异常交易情况。针对反向交易部分，公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现重大异常交易情况。本报告期内，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况（完全复制的指数基金除外）。对于以公司名义进行的一级市场申购等交易，各投资组合经理均严格按照制度规定，事前确定好申购价格和数量，按照价格优先、比例分配的原则对其进行分配。

异常交易行为的专项说明
本报告期内，未发现本基金与其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

上证指数2019年二季度下跌了4.62%，波动区间在2825-3286点，高点后下跌了7.35%，中小板指数和创业板指数分别下跌了10.99%和10.75%。板块方面，二季度市场板块轮动明显，大消费板块持续得到资金流入，医药板块受境外市场关注度持续提升。

操作层面上，本基金侧重结构性投资机会，食品饮料、农业、传媒的持仓结构。我们认为随着经济基本面的企稳回升，文体娱乐消费需求将持续释放，其消费形式的体现也将多样化，多个文体娱乐消费子行业可能逐渐体现投资机会，首先集中在游戏、影视上。

报告期内基金的投资表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.2763元；本报告期基金份额净值增长率为-0.43%，业绩比较基准收益率为-8.94%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：本基金本报告期内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

报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产比例（%）
1	权益类投资	27,923,167.05	58.30
	其中：股票	27,923,167.05	58.30
2	固定收益投资	3,518,700.00	6.34
	其中：债券	3,518,700.00	6.34
	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	10,500,000.00	18.91
	其中：买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,528,812.99	13.56
7	其他资产	6,045,627.50	18.89
8	合计	55,514,307.44	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农林牧渔、渔业	2,608,068.00	5.71
B	采矿业	28,351.40	0.06
C	制造业	15,709,988.80	34.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,787,188.00	8.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,518.88	0.05
J	金融业	33,809.94	0.07
K	房地产业	2,711,400.00	5.94
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	60,300.00	0.13
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,961,600.00	6.49
S	综合	-	-
	合计	27,923,167.05	61.16

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费品	-	-
C 消费品-必需品	-	-
D 消费品-奢侈品	-	-
E 能源	-	-
F 金融	-	-
G 医疗保健	-	-
H 工业	-	-
I 信息技术	-	-
J 电信服务	-	-
K 公用事业	-	-
L 房地产	-	-

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	005511	中顺洁柔	230,000	2,824,400.00	6.19
2	002587	洽洽食品	110,000	2,777,500.00	6.08
3	002157	正邦科技	160,000	2,665,600.00	5.94
4	809977	中国电影	170,000	2,662,200.00	5.83
5	602714	松发股份	80,000	2,551,000.00	5.71
6	602711	特锐德	60,000	2,638,200.00	5.49
7	600754	浙江股份	90,000	1,971,500.00	4.32
8	600258	广汇物流	101,000	1,815,980.00	3.98
9	000043	中航泰达	130,000	1,777,500.00	3.89
10	002415	海康威视	50,000	1,379,000.00	3.02

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债（可交换债）	3,518,700.00	7.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,518,700.00	7.71

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	128056	金农转债	10,000	1,355,700.00	2.97
2	128059	天康转债	10,000	1,163,000.00	2.53
3	133018	C三转债1	10,000	1,000,000.00	2.19

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持有资产支持证券。

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（磅）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
				-	-

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

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
				-	-

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和品种明细

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
				-	

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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品种明细

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
				-	

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

受到调查及处罚情况

本基金投资的前十名证券中，没有发生主体监管部门立案调查的情形，在报告期内前一年之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

报告期末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	67,188.89
2	应收证券清算款	5,800,094.31
3	应收股利	-
4	应收利息	5,685.00
5	应收申购款	172,678.22
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	其他	-
9	合计	6,045,627.50

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128056	金农转债	1,355,700.00	2.97
2	128059	天康转债	1,163,000.00	2.55

报告期末前十名股票中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

因资金五人原因，投资组合报告中非公允价值比例的合之和合计可能存在误差。

开放式基金份额变动

项目	数量
报告期末基金份额总额	35,446,124.49
报告期基金总申购份额	41,665,363.57
减：报告期基金总赎回份额	39,385,104.14
报告期基金总申购份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	35,766,373.92

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有基金份额变动情况

项目	基金份额
报告期初管理人持有的本基金份额	-
报告期管理人申购基金份额	-
报告期管理人赎回基金份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

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	交易金额（份）	交易金额（元）	适用费率
合计	-	-	-	-	-

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	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人自有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金管理人基金	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

报告期内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	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	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	中购份额	赎回份额	持有份额	占份额比例
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金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

- 中国证监会批准设立银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金的文件
- 《银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金合同》
- 《银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
- 银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金基金募集说明书及摘要
- 报告期内按规定披露的各项公告

存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1688号18层

查阅方式

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。
咨询电话：021-38588888 / 400-820-0880
公司网址：<http://www.galaxyasset.com>