银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-09-30

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：2019-10-25

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现和利润分配情况
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 报告期内基金投资组合情况
§7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
§8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
§9 报告期末本基金投资的前十名股票明细
§10 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
§11 投资组合报告附注
§12 开放式基金份额变动
§13 重大事件揭示
§14 备查文件目录

§1 重要提示

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、误导性陈述或者重大遗漏，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10月25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，但不保证本基金一定盈利。

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。

本报告期自2019年07月01日起至09月30日止。

§2 基金简介

基金简介

基金名称	银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银河现代服务混合
基金主代码	519003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015-04-22
报告期末基金份额总额	1,195,545,195.46
投资目标	本基金将为投资者分享国民经济转型发展过程中所蕴含的主题投资机会，在较为稳定的风险水平下，力争获取资产的高增值潜力和长期稳健回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将根据宏观经济、证券市场的基本面状况，在严格控制风险的前提下，动态调整股票、债券、现金等资产的投资比例，以期实现资产的长期稳健增值。 2、股票投资策略 本基金将采用自上而下的方法，在宏观经济、证券市场、政策导向、市场情绪等因素分析的基础上，结合国内经济结构调整、产业升级、技术进步、消费升级等方面的主题投资机会，以期获取超额收益。 3、债券投资策略 本基金将根据宏观经济、证券市场、政策导向、市场情绪等因素分析的基础上，结合国内经济结构调整、产业升级、技术进步、消费升级等方面的主题投资机会，以期获取超额收益。 4、资产支持证券投资策略 本基金将根据宏观经济、证券市场、政策导向、市场情绪等因素分析的基础上，结合国内经济结构调整、产业升级、技术进步、消费升级等方面的主题投资机会，以期获取超额收益。 5、权证投资策略 本基金将根据宏观经济、证券市场、政策导向、市场情绪等因素分析的基础上，结合国内经济结构调整、产业升级、技术进步、消费升级等方面的主题投资机会，以期获取超额收益。 6、股指期货投资策略 本基金将根据宏观经济、证券市场、政策导向、市场情绪等因素分析的基础上，结合国内经济结构调整、产业升级、技术进步、消费升级等方面的主题投资机会，以期获取超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型资产管理基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金和保本基金，低于股票型基金。
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分类基金的基金简称	银河现代服务混合A
下属分类基金的交易代码	519003
报告期末下属分类基金的份额总额	1,195,545,195.46
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

§3 主要财务指标、基金净值表现和利润分配情况

主要财务指标

主要财务指标	报告期（2019-07-01 至 2019-09-30）
本期已实现收益	29,933,321.49
本期利润	-21,985,103.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0090
期末基金资产净值	1,196,394,370.15
期末基金份额净值	0.9963

注：1、本期已实现收益指基金本期利润扣除公允价值变动损益后的余额。2、表格内数值保留小数点后两位，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

注：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。

本基金业绩表现

本基金业绩表现情况根据本基金合同规定，以沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%为业绩比较基准。

阶段	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	-1.00 %	0.80 %	-1.38 %	0.80 %	0.37 %	0.01 %

注：1、本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。每日进行收益率计算。

注：2、本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。每日进行收益率计算。

自基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注：1、本基金于2015年5月22日成立，以2015年5月22日为本基金合同生效日。

注：2、本基金自合同生效日起，一年内未开放申购、赎回，并在一年内进行封闭运作。

§4 管理人报告

其他指标

其他指标	报告期（2019-08-01至2019-08-30）
其他指标	报告期（2019-08-30）

注：1、

注：2、

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		
刘承胤	基金经理	2015-04-22		18	硕士研究生学历，2005年参加证券从业，曾先后担任中国证券投资基金业协会会员，中国国际证券有限责任公司工作，2005年03月入职银河基金管理有限公司，历任交易主管，基金经理助理等职务，现任基金经理。曾担任银河稳健证券投资基金经理，基金经理，2009年07月起担任银河稳健证券投资基金经理及银河基金经理，2015年5月起担任银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、上表中的任职日期为本基金合同生效之日。

注：2、证券从业年限计算方法按照基金业协会颁布的《证券从业人员管理规定》执行。

管理人对报告期内本基金运作遵守情况的说明

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“诚实信用、勤勉尽责”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下为基金持有人的利益谋取最大利益，以期实现基金资产的长期稳定增值。本报告期内，本基金运作合规，无违反法律法规和基金合同的情况。

报告期内我国宏观经济稳中有进，经济结构调整和转型升级的趋势进一步明确，证券市场在经历了一季度的大幅上涨后，二季度呈现震荡调整的格局。本报告期内，本基金在坚持价值投资理念的基础上，通过自下而上的个股精选策略，在适当控制组合风险的前提下，积极参与市场的结构性机会，通过个股选择，在一定程度上获取了较为稳定的超额收益。

§5 托管人报告

托管人对报告期内本基金运作遵守有关法律法规、基金合同、托管协议等情况的说明

本报告期内，本基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、信息披露、申购赎回、基金费用开支等方面，按照《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、基金合同、托管协议等有关规定进行了托管。

§6 报告期内基金投资组合情况

报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净比例（%）
1	权益投资	1,100,096,070.14	91.57
	其中：股票	1,100,096,070.14	91.57
2	固定收益投资	67,501,600.00	5.62
	其中：债券	67,501,600.00	5.62
	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	100,000,000.00	7.49
	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	28,382,302.32	2.36
7	其他资产	5,000,000.00	0.38
8	合计	1,300,997,970.32	100.00

报告期末按行业分类的权益投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,101,770.00	0.09
B	采矿业	801,151.22	0.07
C	制造业	557,473,199.00	46.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,498,993.00	0.96
F	批发和零售业	25,146,490.00	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	30,998,400.00	2.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	148,898,357.02	12.44
J	金融业	107,007,300.30	8.94
K	房地产业	26,200,305.00	2.19
L	租赁和商务服务业	95,132,165.72	7.95
M	科学研究和技术服务业	4,501,995.00	0.38
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	11,452,000.00	0.96
Q	卫生和社会工作	39,838,300.00	3.33
R	文化、体育和娱乐业	22,300.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,100,096,070.14	91.92

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	300146	汤臣倍健	4,500,000	127,980,000.00	10.70
2	300015	爱尔眼科	81,117	61,747,158.42	5.16
3	002110	三钢闽光	920,000	61,521,200.00	5.14
4	002180	纳思达	1,400,000	51,520,000.00	4.31
5	600763	通策医疗	1,000,000	50,320,400.00	4.21
6	002027	分众传媒	5,100,000	45,492,120.00	3.80
7	600570	恒生电子	700,000	51,786,000.00	3.46
8	300601	康泰生物	920,000	38,088,800.00	3.18
9	300558	贝瑞和康	1,100,000	38,280,000.00	3.20
10	300682	朗新科技	1,200,000	42,504,000.00	3.55

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	国债	67,501,600.00	5.64
	其中：买断式回购的买入返售国债	-	-
2	政策性金融债	-	-
3	地方政府债	-	-
4	企业债券	-	-
5	公司债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,501,600.00	5.64

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

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	300146	汤臣倍健	4,500,000	127,980,000.00	10.70
2	300015	爱尔眼科	81,117	61,747,158.42	5.16
3	002110	三钢闽光	920,000	61,521,200.00	5.14
4	002180	纳思达	1,400,000	51,520,000.00	4.31
5	600763	通策医疗	1,000,000	50,320,400.00	4.21
6	002027	分众传媒	5,100,000	45,492,120.00	3.80
7	600570	恒生电子	700,000	51,786,000.00	3.46
8	300601	康泰生物	920,000	38,088,800.00	3.18
9	300558	贝瑞和康	1,100,000	38,280,000.00	3.20
10	300682	朗新科技	1,200,000	42,504,000.00	3.55

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交易明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约价值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
注：股指期货投资的具体情况，请参阅财务报告。					

本基金投资股指期货的目的说明

报告期末本基金投资的股指期货的投资评估方法和依据

报告期末本基金投资的股指期货的会计核算说明

§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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

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交易明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约价值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
注：股指期货投资的具体情况，请参阅财务报告。					

本基金投资股指期货的目的说明

报告期末本基金投资的股指期货的投资评估方法和依据

报告期末本基金投资的股指期货的会计核算说明

§8 报告期末按照国民经济行业分类的权益投资组合情况

报告期末按照国民经济行业分类的权益投资组合情况

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	557,473,199.00	46.59
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	557,473,199.00	46.59

§9 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	国债	67,501,600.00	5.64
	其中：买断式回购的买入返售国债	-	-
2	政策性金融债	-	-
3	地方政府债	-	-
4	企业债券	-	-
5	公司债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,501,600.00	5.64

§10 报告期末按照国民经济行业分类的权益投资组合情况

报告期末按照国民经济行业分类的权益投资组合情况

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	557,473,199.00	46.59
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	557,473,199.00	46.59

§11 投资组合报告附注

1、中国证监会稽查或证券交易所处罚本基金或其投资对象的发行人或其投资对象的证券发行人的情况

2、报告期内投资本基金或其投资对象的发行人的证券的决策程序说明

3、报告期内投资本基金或其投资对象的证券发行人的证券的情况

4、中国证监会稽查或证券交易所处罚本基金管理人的情况

5、报告期内管理人对本基金投资的内部监控制度及内部监控情况

6、报告期内管理人对本基金投资的内部审计情况

7、报告期内基金投资组合的流动性风险分析

§12 开放式基金份额变动

开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	1,385,229,101.21
报告期期间基金总申购份额	1,186,000.00
报告期期间基金总赎回份额	191,870,095.75
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	1,195,545,195.46

§13 重大事件揭示

基金管理人运用固有资金投资情况

报告期期初管理人持有的本基金份额变动情况	报告期末管理人持有的本基金份额变动情况
报告期期间买入/申购总额	-
报告期期间卖出/赎回总额	-
报告期末持有的本基金份额合计	-
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

§14 备查文件目录

备查文件目录

1、中国证监会批准设立银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金的文件

2、《银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、中国证监会规定的其它银行业务资格证明文件以及其它

5、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书及其更新的文件

6、报告期内发布公开披露的各种公告

存放地点

中国上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

查阅方式

投资者可本报告书备查地点、银河基金管理有限公司网站www.yinhejj.com

咨询电话：021-38996580 400-888-0988

公司网址：http://www.yinhejj.com