

银河旺利灵活配置混合型证券投资基金 2018年第2季度报告

2018年6月30日

基金管理人:银河基金管理有限公司 基金托管人:北京银行股份有限公司

重要提示:基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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,也不保证最低收益。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大风险事件。

基金产品概况:基金名称:银河旺利混合;场内简称:旺利混合;基金代码:519610

投资目标:本基金在合理控制风险的前提下,在深入的基本面研究的基础上,通过灵活的资产配置,实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金通过合理的资产配置,将基金资产在权益资产和固定收益资产之间进行动态调整,同时采取积极主动的个股投资策略,把握中短期市场机会,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准是:中证500指数收益率*50%+沪深300指数收益率*50%

风险收益特征:本基金为混合型基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的品种,其风险收益水平高于货币市场和债券型基金,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:北京银行股份有限公司

基金合同生效日:2016年5月13日

主要财务指标和基金净值表现:截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析:四季度债市经历大幅调整,中债综合全价(总值)指数剧烈震荡,先在10月份上涨0.41%,创年内新高120.62,随后发生自13年以来的首次回调,从10月21日至12月19日,中债综合全价(总值)指数下跌3.68%,伴随央行降准降准,10-10年期收益率,该指数随后反弹7.022%。

四季度债市的调整,一方面是由于一些长期利空因素的支持,也是由于一些短期因素所致。长期因素包括:8月起央行通过降准,持续释放高杠杆货币市场的融资成本,同时发改委也相继推出限制债券投资,监管严控金融去杠杆,10月份央行发布《关于非银行金融机构“广义信贷”测算的通知》,引发市场对后续理财增速的担忧;特

别是,央行在10月15日降准,释放流动性,但降准的流动性冲击被央行在11月1日加息所抵消,流动性冲击被央行在11月1日加息所抵消,流动性冲击被央行在11月1日加息所抵消。

股票市场的调整,一方面是由于一些长期利空因素的支持,也是由于一些短期因素所致。长期因素包括:8月起央行通过降准,持续释放高杠杆货币市场的融资成本,同时发改委也相继推出限制债券投资,监管严控金融去杠杆,10月份央行发布《关于非银行金融机构“广义信贷”测算的通知》,引发市场对后续理财增速的担忧;特

别是,央行在10月15日降准,释放流动性,但降准的流动性冲击被央行在11月1日加息所抵消,流动性冲击被央行在11月1日加息所抵消,流动性冲击被央行在11月1日加息所抵消。

截至本报告期末,银河旺利混合A基金份额净值为1.039元,本报告期基金份额净值增长率为0.29%;截至本报告期末,银河旺利混合C基金份额净值为1.036元,本报告期基金份额净值增长率为0.29%;截至本报告期末,银河旺利混合I基金份额净值为1.028元,本报告期基金份额净值增长率为0.39%。同期业绩比较基准收益率为-4.28%。

4.6 报告期内基金持有人或基金资产净值变动说明:注:本基金报告期内未发生基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低于5,000万元的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况:5.1.1 报告期末按资产类别的资产组合情况:5.1.2 报告期末按行业分类的资产组合情况

Table with 3 columns: 资产类别, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的资产组合情况:5.2.1 报告期末按行业分类的资产组合情况:5.2.2 报告期末按行业分类的资产组合情况

Table with 3 columns: 行业名称, 公允价值(元), 占基金总资产的比例(%)

5.3 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:5.3.1 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 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:5.4.1 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.5 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资产支持证券投资明细:5.5.1 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资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.6 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贵金属投资明细:5.6.1 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贵金属投资明细

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细:5.7.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8 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:5.8.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9 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:5.9.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10 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:5.10.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11 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:5.11.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.12 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:5.12.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13 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:5.13.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 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:5.14.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.15 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:5.15.1 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

银河量化多策略混合型证券投资基金 2018年第2季度报告

2018年6月30日

基金管理人:银河基金管理有限公司 基金托管人:北京银行股份有限公司

重要提示:基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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,也不保证最低收益。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为,也未发生任何重大风险事件。

基金产品概况:基金名称:银河量化多策略混合;场内简称:量化多策混合;基金代码:005586

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,在严格控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期、稳定的增值。

投资策略:本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资,在严格控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期、稳定的增值。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*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:北京银行股份有限公司

基金合同生效日:2018年3月28日

主要财务指标和基金净值表现:截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

截至2018年6月30日,本基金资产净值为1,103.91亿元,基金份额净值为1.036元

4.5 报告期内基金的业绩表现:截至本报告期末,银河量化多策略混合A基金份额净值为1.0153元,本报告期基金份额净值增长率为1.52%,业绩比较基准收益率为-11.49%。

4.6 报告期内基金持有人或基金资产净值变动说明:注:本基金报告期内未发生基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低于5,000万元的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况:5.1.1 报告期末按资产类别的资产组合情况:5.1.2 报告期末按行业分类的资产组合情况

Table with 3 columns: 资产类别, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的资产组合情况:5.2.1 报告期末按行业分类的资产组合情况:5.2.2 报告期末按行业分类的资产组合情况

Table with 3 columns: 行业名称, 公允价值(元), 占基金总资产的比例(%)

5.3 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:5.3.1 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 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:5.4.1 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.5 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资产支持证券投资明细:5.5.1 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资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.6 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:5.6.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细:5.7.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8 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:5.8.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9 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:5.9.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10 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:5.10.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11 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:5.11.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.12 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:5.12.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13 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:5.13.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 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:5.14.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.15 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:5.15.1 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

Table with 5 columns: 序号, 名称,