

# 银河竞争优势成长混合型证券投资基金 2019年半年度报告

2019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：中国银行股份有限公司

送出日期：2019年 8月 26日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 08 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8 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贵金属投资明细.....	42
7.9 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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>50</b>

---

11.1 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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河竞争优势成长混合型证券投资基金
基金简称	银河成长混合
场内简称	-
基金主代码	519668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 5月 26日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	206,580,757.73份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中长期资本增值。
投资策略	本基金的投资策略主要体现在战略资产配置、股票投资策略、债券投资策略和其他品种投资策略（包括权证、资产支持证券等）四个层面。本基金主要根据个股精选结果决定股票资产配置。本基金管理人将从宏观、中观和微观面等多个角度综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势，分析股票、债券等资产的预期收益与风险的匹配关系，在此基础上，结合预期收益良好的可投资股票的数量，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券的比例。在股票投资策略上，本基金采用“自下而上”的选股策略，通过定性分析和定量分析相结合的方法，以企业可持续的竞争优势分析为核心，通过基本分析（Fundamental Analysis）和相对投资价值评估（Relative Evaluation），从竞争优势的角度，精选具有持续竞争优势和成长性的优质上市公司，在合理估值的基础上进行投资。本基金债券投资的主要策略包括利率预期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、单券选择策略、可转换债券投资策略。其他品种投资策略包括权证、资产支持证券投资等。
业绩比较基准	业绩基准收益率=沪深 300 指数收益率× 80%+ 上证国债指数收益率× 20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于风险水平相对较高的基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	王永民
	联系电话	021-38568989	010-66594896
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-820-0860	95566
传真		021-38568769	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200122	100818
法定代表人		刘立达	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.galaxyasset.com">http://www.galaxyasset.com</a>
基金半年度报告备置地点	1 上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼 2 托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2019年 1月 1日 - 2019年 6月 30日 )
本期已实现收益	24,926,284.28
本期利润	55,623,338.84
加权平均基金份额本期利润	0.2658
本期加权平均净值利润率	24.14%
本期基金份额净值增长率	28.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 ( 2019年 6月 30日 )
期末可供分配利润	2,721,656.08
期末可供分配基金份额利润	0.0132
期末基金资产净值	245,101,699.67
期末基金份额净值	1.1865
3.1.3 累计期末指标	报告期末 ( 2019年 6月 30日 )
基金份额累计净值增长率	330.38%

注：1 本期已实现收益是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。

3 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	7.59%	1.25%	4.41%	0.93%	3.18%	0.32%
过去三个月	-0.33%	1.63%	-0.71%	1.23%	0.38%	0.40%
过去六个月	28.13%	1.54%	21.89%	1.24%	6.24%	0.30%
过去一年	1.06%	1.46%	8.61%	1.22%	-7.55%	0.24%
过去三年	7.45%	1.14%	19.80%	0.89%	-12.35%	0.25%
自基金合同	330.38%	1.51%	19.51%	1.33%	310.87%	0.18%



生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 × 80%+ 上证国债指数收益率 × 20%，每日进行再平衡过程。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额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 本基金合同于 2008 年 5 月 26 日生效。

2 按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定：本基金投资的股票资产占基金资产的 60- 95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司成立于 2002 年 6 月 14 日，是经中国证券监督管理委员会按照市场化机制批准成立的第一家基金管理公司（俗称：“好人举手第一家”），是中央汇金公司旗下专业资产管理机构。

银河基金公司的经营范围包括发起设立、管理基金等，注册资本 2 亿元人民币，注册地中国上海。银河基金公司的股东分别为：中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团有限公司、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司管理的基金有：银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联系列证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金（LOF）、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河泰利纯债债券型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君欣纯债债券型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券

型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金、银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银河和美生活主题混合型证券投资基金、银河如意债券型证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金、银河中债 -1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、银河睿安纯债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
祝建辉	基金经理	2016年 2月 1日	-	13	中共党员，硕士研究生学历，13 年证券从业经历，曾就职于天治基金管理有限公司。2008 年 4 月加入银河基金管理有限公司，主要研究钢铁、煤炭、化工行业，历任研究员、高级研究员、研究部总监助理等职务，现担任基金经理。2015 年 12 月起担任银河灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 2 月起担任银河竞争优势成长混合型证券投资基金的基金经理。

注：1 上表中任职、离任日期均为我公司做出决定之日；

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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》及其各项管理办法、《基

金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚实信用、勤奋律己、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谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金持有人的利益，无损害基金持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤奋律己、创新图强”的理念，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定，进一步加强风险管理和完善内部控制体系，为基金份额持有人谋求长期稳健的风险回报。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司旗下管理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、行为监控等方面对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分投资类别（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），连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公开竞价交易的证券进行了价差分析，并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

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成交量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，由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、比例分配的原则对获配额度进行分配。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与其它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。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年 1季度基金仓位整体呈现小幅上升，主要增加了房地产、医药生物、计算机、通信、化工等行业的仓位，减持了食品饮料、建筑装饰、银行、汽车等行业，从增减持行业与行业涨跌幅对比来看，食品饮料的减持过早，电子行业增持偏少，计算机和通信增持效果不错。2019年 2季度整体来看，4月份由于市场在 3200平台附近震荡，考虑到组合的弹性偏大，适度降低了一些高贝塔的股票持仓，而随着 4月底贸易战的再度升级市场出现大幅下跌，由于跌速较快，并未来得及减仓，随着市场在 2900平台逐步企稳后，本基金开始调整持仓结构，整体仓位小幅下降。2季度本基金主要增加汽车、非银、机械、医药生物等行业的仓位，减持了房地产、计算机等行业。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1865元；本报告期基金份额净值增长率为 28.13%，业绩比较基准收益率为 21.89%

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019年 3季度，虽然中美贸易战貌似进入了缓和期，但是国内经济继续下行的压力并未缓解，同时由于 3季度末临近国庆 70周年大庆，因此货币政策继续宽松加码依旧可期，经济数据变化的趋势和节奏决定了政策加码的力度和节奏，海外经济也出现了下行的隐忧，海外主要经济体的货币政策从紧缩向中性宽松的方向发展，因此预期流动性依旧维持相对充裕，不过需要担心的是现在市场对全球宽松的预期是否过高，尤其是 7月份如果美联储没有降息，是否会低于预期的利空出现。

由于经济依旧处于下行寻底的过程中，因此 A股整体企业的盈利依旧看不到边际上的明显改善，因此只能根据具体行业的周期所处位置和库存变化中观选择，本基金将根据上市公司 2019年 2季报和相关行业基本面的情况进行评估衡量，择优选择行业景气环比改善和逐步见底的行业配置。

8月份 MSCI 将把 A股大盘和中盘股配置比例提升，因此如遇市场调整将适度布局相关公司；也正因为外资配资 A股的比例提升，中国市场与海外市场的联动性更加频繁和剧烈，海外投资者持有比率高的个股超过合理的估值或基本面发生坏的趋势就需要及时减持。

3季度科创板的公司将大量上市，机会与风险并存，因此掘金科创板优质公司将是一个具有高风险高收益的工作；上市公司中报也将在 3季度密集披露，盈利趋势继续向好的公司将继续获

得市场的追捧，本基金将继续寻找 3 季报相关公司机会。

综上所述，本基金对 3 季度市场整体偏乐观，但是需要提防 7 月份美联储加息落空的全球宽松预期修正的风险，将以下投资板块中寻找机会，( 1) 金融供给侧改革受益的非银板块，( 2) 受益科创主题投资和基本面向上的计算机、通信、医药行业，( 3) 基本面逐步见底回升的汽车、电子行业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了由公司相关领导、监察部投资风控岗、研究部数量研究员、行业研究员、支持保障部基金会计等相关人员组成的估值委员会，以上人员拥有丰富的风控、合规、证券研究、估值经验，根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但基金经理可以列席估值委员会会议提供估值建议，以便估值委员会决策。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金可分配收益为 2,721,656.08 元。本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对银河竞争优势成长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银河竞争优势成长混合型证券投资基金

报告截止日：2019年 6月 30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年 6月 30日	上年度末 2018年 12月 31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	43,743,936.74	62,483,482.88
结算备付金		118,500.71	846,286.64
存出保证金		108,031.88	94,683.56
交易性金融资产	6.4.7.2	202,626,886.33	130,714,385.88
其中：股票投资		202,626,886.33	130,714,385.88
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		864,030.13	3,385,612.25
应收利息	6.4.7.5	8,897.12	14,434.44
应收股利		-	-
应收申购款		58,190.53	52,514.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		247,528,473.44	197,591,399.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年 6月 30日</b>	<b>上年度末 2018年 12月 31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,220,545.31	-
应付赎回款		554,761.10	118,942.65
应付管理人报酬		286,524.59	265,401.95
应付托管费		47,754.07	44,233.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	225,139.99	398,647.32



应交税费		10,252.80	10,252.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,795.91	240,390.30
负债合计		2,426,773.77	1,077,868.67
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	206,580,757.73	212,207,697.49
未分配利润	6.4.7.10	38,520,941.94	-15,694,166.40
所有者权益合计		245,101,699.67	196,513,531.09
负债和所有者权益总计		247,528,473.44	197,591,399.76

注：报告截止日 2019年 6月 30日，基金份额净值 1.1865元，基金份额总额 206,580,757.73份。

## 6.2 利润表

会计主体：银河竞争优势成长混合型证券投资基金

本报告期：2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日
<b>一、收入</b>		58,983,246.48	-28,796,236.04
1.利息收入		177,989.70	194,536.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	152,811.48	194,414.35
债券利息收入		-	122.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		25,178.22	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,084,560.24	-27,941,905.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,935,051.37	-30,149,711.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	215,838.11
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,149,508.87	1,991,967.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	30,697,054.56	-1,131,411.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	23,641.98	82,544.85
<b>减：二、费用</b>		3,359,907.64	5,520,639.57

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,709,531.54	2,338,344.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	284,921.91	389,724.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,262,411.15	2,578,884.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.45
7. 其他费用	6.4.7.20	103,043.04	213,685.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		55,623,338.84	-34,316,875.61
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		55,623,338.84	-34,316,875.61

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河竞争优势成长混合型证券投资基金

本报告期：2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	212,207,697.49	-15,694,166.40	196,513,531.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	55,623,338.84	55,623,338.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-5,626,939.76	-1,408,230.50	-7,035,170.26
其中：1.基金申购款	18,694,389.02	2,015,834.81	20,710,223.83
2.基金赎回款	-24,321,328.78	-3,424,065.31	-27,745,394.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基	206,580,757.73	38,520,941.94	245,101,699.67

项目	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	203,632,729.90	89,941,624.75	293,574,354.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-34,316,875.61	-34,316,875.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	14,096,862.80	16,723,929.90	30,820,792.70
其中：1.基金申购款	78,093,455.91	32,248,464.70	110,341,920.61
2.基金赎回款	-63,996,593.11	-15,524,534.80	-79,521,127.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-34,442,397.23	-34,442,397.23
五、期末所有者权益(基金净值)	217,729,592.70	37,906,281.81	255,635,874.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

          刘立达                                          刘立达                                          廖理利            
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银河竞争优势成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河竞争优势成长股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2008]355号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 370,249,260.77份,经中瑞华恒信会计师事务所有限公

司验证，并出具了编号为中瑞华恒信验字 [2008]第 2066号验资报告。基金合同于 2008年 5月 26日正式生效。根据基金管理人于 2015年 7月 17日发布的《关于旗下部分基金更名并修改基金合同、托管协议等相关条款的公告》，自该日起，本基金由“银河竞争优势成长股票型证券投资基金”更名为“银河竞争优势成长混合型证券投资基金”。本次基金更名不改变基金投资范围。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新适用的基金合同及《银河竞争优势成长混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、债券回购、权证、中央银行票据、资产支持证券和现金等，以及法律法规或中国证监会允许的其它投资品种。本基金的投资组合为：股票资产占基金资产的 60%-95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。如果法律法规或中国证监会允许基金投资于其它品种，本基金在履行适当的程序后，可以将其纳入到基金的投资范围，并依据有关法律法规进行投资管理。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 × 80%+上证国债指数收益率 × 20%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定 (以下简称“企业会计准则”) 以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019年 6月 30日的财务状况以及自 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税 [2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 券投资基金 (封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内 (含 1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事 A股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日
活期存款	43,743,936.74
定期存款	-
其中：存款期限 1个月以内	-
存款期限 1-3个月	-
存款期限 3个月以上	-
其他存款	-
合计：	43,743,936.74

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	179,991,870.64	202,626,886.33	22,635,015.69
贵金属投资 -金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	179,991,870.64	202,626,886.33	22,635,015.69

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日
应收活期存款利息	8,792.48
应收定期存款利息	
应收其他存款利息	
应收结算备付金利息	53.30
应收债券利息	
应收资产支持证券利息	
应收买入返售证券利息	
应收申购款利息	2.74
应收黄金合约拆借孳息	
其他	48.60
合计	8,897.12

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日
交易所市场应付交易费用	225,139.99
银行间市场应付交易费用	
合计	225,139.99

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	946.32
预提审计费用	14,876.39
预提信息披露费	65,973.20
合计	81,795.91

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	212,207,697.49	212,207,697.49
本期申购	18,694,389.02	18,694,389.02
本期赎回(以“-”号填列)	-24,321,328.78	-24,321,328.78
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	206,580,757.73	206,580,757.73

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-22,354,564.06	6,660,397.66	-15,694,166.40
本期利润	24,926,284.28	30,697,054.56	55,623,338.84
本期基金份额交易产生的变动数	149,935.86	-1,558,166.36	-1,408,230.50
其中：基金申购款	-646,977.89	2,662,812.70	2,015,834.81
基金赎回款	796,913.75	-4,220,979.06	-3,424,065.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,721,656.08	35,799,285.86	38,520,941.94



**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
活期存款利息收入	145,261.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,682.66
其他	867.71
合计	152,811.48

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
卖出股票成交总额	414,237,262.97
减：卖出股票成本总额	387,302,211.60
买卖股票差价收入	26,935,051.37

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期末投资债券。

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金未进行贵金属投资。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
股票投资产生的股利收益	1,149,508.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,149,508.87

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
1 交易性金融资产	30,697,054.56
——股票投资	30,697,054.56
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	30,697,054.56

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
基金赎回费收入	22,025.47
基金转换费收入	1,616.51
合计	23,641.98

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
交易所市场交易费用	1,262,411.15
银行间市场交易费用	
交易基金产生的费用	
其中：申购费	
赎回费	
合计	1,262,411.15

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	65,973.20
其他	600.00
银行间账户维护费	18,000.00
银行费用	3,593.45

合计	103,043.04
----	------------

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司（“银河基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	同受基金管理人控股股东控制、基金代销机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例

中国银河证券股份有 限公司	280,512,959.23	33.36%	284,228,471.10	16.62%
------------------	----------------	--------	----------------	--------

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
中国银河证券股 份有限公司	26,000,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中国银河证券股 份有限公司	260,130.65	33.63%	24,097.99	10.70%
关联方名称	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中国银河证券股 份有限公司	264,702.30	16.79%	88,081.25	12.61%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券  
 结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包  
 括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,709,531.54	2,338,344.73
其中：支付销售机构的客户维护费	402,451.20	454,373.56

注：支付基金管理人银河基金的基金管理费按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	284,921.91	389,724.15

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	43,743,936.74	145,261.11	23,669,424.45	179,778.53

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本期间及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末进行利润分配。

**6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：(1) 员工自律；(2) 部门主管的检查监督；(3) 总经理领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督；(4) 董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。

公司设立独立的风险控制专员岗，专门负责对投资管理全过程进行监督，出具监督意见和风险建议；对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督；对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；同时，公司建立了内部评级体系和交易对手库，在进行银行间



同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式，以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，

控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年 6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	43,743,936.74						43,743,936.74
结算备付金	118,500.71						118,500.71
存出保证金	108,031.88						108,031.88
交易性金融资产						202,626,886.33	202,626,886.33
应收证券清算款						864,030.13	864,030.13
应收利息						8,897.12	8,897.12
应收申购款	5,162.82					53,027.71	58,190.53
其他资产							
资产总计	43,975,632.15					203,552,841.29	247,528,473.44
负债							
应付证券清算款						1,220,545.31	1,220,545.31
应付赎回款						554,761.10	554,761.10
应付管理人报酬						286,524.59	286,524.59
应付托管费						47,754.07	47,754.07

应付交易费用						225,139.99	225,139.99
应交税费						10,252.80	10,252.80
其他负债						81,795.91	81,795.91
负债总计						2,426,773.77	2,426,773.77
利率敏感度缺口	43,975,632.15					201,126,067.52	245,101,699.67
上年度末 2018年 12月 31日	1个月以内	1-3 个月	3 个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	62,483,482.88						62,483,482.88
结算备付金	846,286.64						846,286.64
存出保证金	94,683.56						94,683.56
交易性金融资产						130,714,385.88	130,714,385.88
应收证券清算款						3,385,612.25	3,385,612.25
应收利息						14,434.44	14,434.44
应收申购款	5,467.20					47,046.91	52,514.11
资产总计	63,429,920.28					134,161,479.48	197,591,399.76
负债							
应付赎回款						118,942.65	118,942.65
应付管理人报酬						265,401.95	265,401.95
应付托管费						44,233.65	44,233.65
应付交易费用						398,647.32	398,647.32
应交税费						10,252.80	10,252.80
其他负债						240,390.30	240,390.30
负债总计						1,077,868.67	1,077,868.67
利率敏感度缺口	63,429,920.28					133,083,610.81	196,513,531.09

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：至本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施

监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日		上年度末 2018年 12月 31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产 - 股票投资	202,626,886.33	82.67	130,714,385.88	66.52
交易性金融资产 - 基金投资				
交易性金融资产 - 债券投资				
交易性金融资产 - 贵金属投资				
衍生金融资产 - 权证投资				
其他				
合计	202,626,886.33	82.67	130,714,385.88	66.52

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1 估测组合市场价格风险的数据为沪深 300指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2 假定沪深 300指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3 测算时期为 3个月，对于交易少于 3个月的资产，默认其波动与指数同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年 6月 30日）	上年度末（2018年 12月 31日）
	沪深 300指数上升 5%	11,565,048.85	7,881,613.38
	沪深 300指数下降 5%	-11,565,048.85	-7,881,613.38

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	202,626,886.33	81.86
	其中：股票	202,626,886.33	81.86
2	基金投资		
3	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		
4	贵金属投资		
5	金融衍生品投资		
6	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	43,862,437.45	17.72
8	其他各项资产	1,039,149.66	0.42
9	合计	247,528,473.44	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	129,997.45	0.05
C	制造业	108,136,979.00	44.12
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	36,842,751.16	15.03
J	金融业	39,964,439.67	16.31
K	房地产业	3,735,022.05	1.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,386,090.40	1.38
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	-	-
Q	卫生和社会工作	10,408,500.00	4.25
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	202,626,886.33	82.67

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601799	星宇股份	254,731	20,113,559.76	8.21
2	600030	中信证券	703,886	16,759,525.66	6.84
3	000063	中兴通讯	464,600	15,113,438.00	6.17
4	600845	宝信软件	470,053	13,387,109.44	5.46
5	601318	中国平安	145,939	12,931,654.79	5.28
6	002230	科大讯飞	376,170	12,503,890.80	5.10
7	300347	泰格医药	135,000	10,408,500.00	4.25
8	601688	华泰证券	458,754	10,239,389.28	4.18
9	000725	京东方A	2,645,800	9,101,552.00	3.71
10	601633	长城汽车	1,028,700	8,507,349.00	3.47
11	002594	比亚迪	167,200	8,480,384.00	3.46
12	300009	安科生物	530,970	8,442,423.00	3.44

13	600332	白云山	192,600	7,890,822.00	3.22
14	300584	海辰药业	289,351	7,569,422.16	3.09
15	600196	复星医药	297,900	7,536,870.00	3.07
16	300559	佳发教育	292,596	6,937,451.16	2.83
17	000157	中联重科	1,000,968	6,015,817.68	2.45
18	300699	光威复材	166,100	5,431,470.00	2.22
19	603486	科沃斯	124,320	3,760,680.00	1.53
20	000002	万科A	134,305	3,735,022.05	1.52
21	603127	昭衍新药	70,280	3,386,090.40	1.38
22	000606	顺利办	454,100	2,756,387.00	1.12
23	600536	中国软件	22,700	1,218,309.00	0.50
24	600968	海油发展	36,619	129,997.45	0.05
25	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
26	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
27	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
28	603863	松炆资源	1,451	33,489.08	0.01
29	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
30	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
31	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002230	科大讯飞	17,526,697.70	8.92
2	000725	京东方A	11,793,788.00	6.00
3	300584	海辰药业	10,334,027.34	5.26
4	601688	华泰证券	10,273,054.24	5.23
5	000063	中兴通讯	9,909,305.00	5.04
6	600030	中信证券	9,406,141.00	4.79
7	002594	比亚迪	9,232,230.00	4.70
8	600196	复星医药	8,926,801.00	4.54
9	300009	安科生物	8,534,941.67	4.34

10	601628	中国人寿	8,413,999.00	4.28
11	601633	长城汽车	8,376,215.54	4.26
12	300073	当升科技	8,322,969.00	4.24
13	300347	泰格医药	8,260,008.16	4.20
14	300033	同花顺	8,251,532.50	4.20
15	600332	白云山	8,082,541.00	4.11
16	002410	广联达	7,506,741.00	3.82
17	000671	阳光城	7,380,961.00	3.76
18	600325	华发股份	7,145,991.51	3.64
19	000776	广发证券	7,017,073.00	3.57
20	300379	东方通	6,640,194.00	3.38
21	300144	宋城演艺	6,619,187.00	3.37
22	600104	上汽集团	6,135,910.36	3.12
23	000157	中联重科	6,040,120.60	3.07
24	300454	深信服	5,875,931.40	2.99
25	002555	三七互娱	5,810,279.73	2.96
26	002304	洋河股份	5,743,354.99	2.92
27	600383	金地集团	5,712,803.20	2.91
28	300699	光威复材	5,433,888.00	2.77
29	600570	恒生电子	5,241,851.02	2.67
30	300413	芒果超媒	4,974,136.00	2.53
31	300753	爱朋医疗	4,867,212.20	2.48
32	600315	上海家化	4,857,328.58	2.47
33	002572	索菲亚	4,796,560.00	2.44
34	000977	浪潮信息	4,766,123.00	2.43
35	300676	华大基因	4,712,073.00	2.40
36	002400	省广集团	4,694,162.00	2.39
37	000002	万科A	4,636,707.00	2.36
38	603456	九洲药业	4,613,252.00	2.35
39	002508	老板电器	4,576,696.00	2.33
40	600895	张江高科	4,492,814.00	2.29
41	600048	保利地产	4,371,406.02	2.22
42	600588	用友网络	4,011,749.00	2.04

注：本项及下项 7.4.2 7.4.3 的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。



**7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300595	欧普康视	13,911,005.28	7.08
2	600048	保利地产	13,238,815.41	6.74
3	600570	恒生电子	11,248,770.20	5.72
4	000002	万 科 A	10,525,265.87	5.36
5	000671	阳 光 城	9,801,013.65	4.99
6	300033	同 花 顺	9,387,997.35	4.78
7	601939	建设银行	9,075,822.90	4.62
8	601155	新城控股	8,708,041.72	4.43
9	600325	华发股份	8,593,965.98	4.37
10	600436	片 仔 癩	8,199,060.86	4.17
11	002410	广 联 达	8,046,654.82	4.09
12	300073	当升科技	7,995,663.83	4.07
13	601628	中国人寿	7,278,253.40	3.70
14	600383	金地集团	6,878,837.05	3.50
15	000776	广发证券	6,858,496.50	3.49
16	600600	青岛啤酒	6,725,839.41	3.42
17	300144	宋城演艺	6,528,518.62	3.32
18	600104	上汽集团	6,512,137.55	3.31
19	002230	科大讯飞	6,455,532.77	3.29
20	601318	中国平安	6,433,669.07	3.27
21	002304	洋河股份	6,211,088.13	3.16
22	300454	深 信 服	5,909,071.65	3.01
23	002555	三七互娱	5,882,368.07	2.99
24	300413	芒果超媒	5,858,979.44	2.98
25	300379	东 方 通	5,513,865.72	2.81
26	601186	中国铁建	5,340,484.29	2.72
27	002572	索 菲 亚	5,145,584.02	2.62
28	600895	张江高科	4,927,155.50	2.51
29	000977	浪潮信息	4,882,507.47	2.48
30	300676	华大基因	4,811,643.00	2.45
31	603456	九洲药业	4,687,851.72	2.39
32	600036	招商银行	4,626,022.52	2.35

33	002400	省广集团	4,622,809.00	2.35
34	600315	上海家化	4,553,579.68	2.32
35	601390	中国中铁	4,542,614.11	2.31
36	002508	老板电器	4,461,492.99	2.27
37	601238	广汽集团	4,419,144.56	2.25
38	600588	用友网络	4,358,914.58	2.22
39	300015	爱尔眼科	4,251,610.57	2.16
40	600845	宝信软件	4,235,650.95	2.16
41	600386	北巴传媒	4,117,646.63	2.10
42	002925	盈趣科技	4,086,937.65	2.08
43	002695	煌上煌	4,066,965.14	2.07
44	300753	爱朋医疗	4,030,480.00	2.05

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	428,517,657.49
卖出股票收入（成交）总额	414,237,262.97

注：买入股票成本及卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	108,031.88
2	应收证券清算款	864,030.13
3	应收股利	
4	应收利息	8,897.12
5	应收申购款	58,190.53
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,039,149.66

**7.12.4 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持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
13,691	15,088.80	21,025,135.86	10.18%	185,555,621.87	89.82%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	94,384.16	0.0457%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2008年 5月 26日 ）基金份额总额	370,249,260.77
本报告期期初基金份额总额	212,207,697.49
本报告期期间基金总申购份额	18,694,389.02
减 本报告期期间基金总赎回份额	24,321,328.78
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	206,580,757.73

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2019年 5月 30日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，原总经理范永武先生因个人原因辞职，经公司第四届董事会审议通过，由董事长刘立达先生代为履行总经理职务。

二、报告期内基金托管人的专门基金托管部门发生如下重大变动：

2019年 5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金未改变投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	335,864,668.71	39.94%	306,074.43	39.57%	
银河证券	2	280,512,959.23	33.36%	260,130.65	33.63%	
华泰证券	1	141,791,144.59	16.86%	132,048.47	17.07%	
西南证券	1	82,662,117.92	9.83%	75,330.06	9.74%	

注：选择证券公司专用席位的标准

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券						
银河证券			26,000,000.00	100.00%		



华泰证券						
西南证券						

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019年 3月 30日
2	银河创新成长混合型证券投资基金 2019年 1季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019年 4月 18日
3	银河基金管理有限公司关于银河创新成长混合型证券投资基金变更基金经理的公告	《中国证券报》、公司网站	2019年 5月 11日
4	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国中投证券有限责任公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019年 5月 21日
5	银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券日报》、公司网站	2019年 5月 30日
6	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019年 6月 21日
7	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有债券估值调整的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2019年 6月 26日
8	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2019年 6月 26日
9	关于调整我司旗下部分基金在中国银行渠道基金定投申购费率折扣标准的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2019年 6月 27日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准设立银河竞争优势成长混合型证券投资基金的文件
2. 《银河竞争优势成长混合型证券投资基金基金合同》
3. 《银河竞争优势成长混合型证券投资基金托管协议》
4. 中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
5. 银河竞争优势成长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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道 1568号中建大厦 15楼

### 12.3 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>

银河基金管理有限公司

2019年 8月 26日