银河和美生活主题混合型证券投资基金 2020 年第3季度报告

2020年9月30日

基金管理人:银河基金管理有限公司

基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

报告送出日期: 2020年10月28日

§1 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 2020 年 10 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	银河和美生活混合
场内简称	-
交易代码	006128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月22日
报告期末基金份额总额	1,008,721,626.88份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,通过对投资市场的研究和上市企业的基本面、经营状况、成长性和投资价值进行深入研究,精选符合本基金定义的和美生活主题的质地优秀、成长性良好的上市公司进行投资,寻求基金资产的长期稳健增值,力争获得超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金管理人通过定量和定性的多因素分析,从宏、中、微观等多个层次研究国内外经济的发展趋势,结合宏观经济面、政策面、市场面等多种因素,综合研判A股市场的演化趋势,分析股票、债券等大类资产的预期收益风险的 匹配关系;进而在本基金的投资比例限制范围内,采用自下而上、辅以自上而下的策略,动态确定或调整投资组合中股票和债券的比例,以争取降低单一行业投资的系统性风险冲击。 本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券类资产投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略及权证投资策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准是:

	中证 800 指数收益率×70%+中证全债指数收益率
	×30%。
크 IV 1/2 24 1+ 77	本基金为混合型基金,其风险收益水平高于货币市场
风险收益特征	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	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2020年7月1日 - 2020年9月30日)
1. 本期已实现收益	167, 059, 235. 08
2. 本期利润	24, 500, 051. 23
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0200
4. 期末基金资产净值	1, 269, 296, 131. 72
5. 期末基金份额净值	1. 2583

- 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。

3.2 基金净值表现

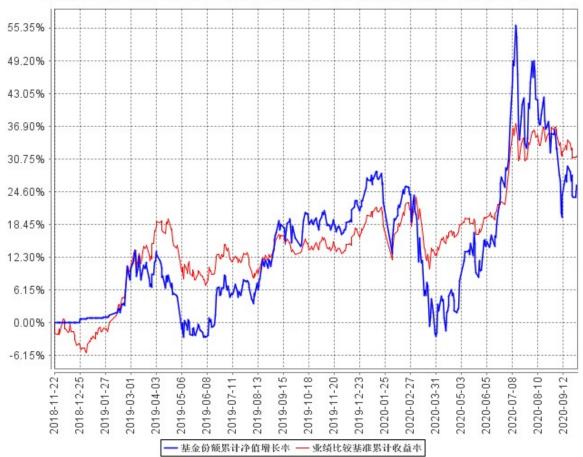
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-2.56%	2.44%	6. 19%	1. 12%	-8.75%	1.32%
过去六个月	29. 02%	2. 21%	16. 17%	0. 92%	12.85%	1.29%
过去一年	8.46%	2.01%	16. 27%	0. 98%	-7.81%	1.03%
自基金合同 生效起至今	25. 83%	1.68%	31.16%	0. 97%	-5.33%	0.71%

注:本基金的业绩比较基准是: 中证 800 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。 每日进行再平衡过程。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





注: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:股票投资占基金资产的比例为 60%-95%,其中,投资于本基金定义的和美生活主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,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%,股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。截止本报告期末,本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

注:无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基	生金经理期限	证券从业年限	说明
XI.石	りが	任职日期	离任日期	VIL OT IN IL THIN	ИL "Д
郑巍山	基金经理	2020年2月17日	_	12	硕士研究生,12 年年 新从业国际的工作,12 年生 新职公司。 新职心有管理。 大田,是管理。 一种理查管。 一种理查的。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查的基础。 一种理查。 一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一种是一
楼华锋	基金经理	2019年10月12日	_	10	中共党员,10年证券 中共党历,10年证券 中共党历,先后所,先后所, 东方研究所分有经历, 有完于所分析有限公理、 一个有级的有师。 一个有级的, 一个有级的, 一个有级的, 一个有级的, 一个有级的, 一个有级的, 一个有级的, 一个一个一个。 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一

4 月起担任银河量化 优选混合型证券投资 基金的基金经 理,2017年10月起担 任银河量化价值混合 型证券投资基金的基 金经理,2017年12月 担任银河量化稳进混 合型证券投资基金的 基金经理, 2018 年 3 月起担任银河中证沪 港深高股息指数型证 券投资基金(LOF)的 基金经理, 2019 年 8 月起担任银河沪深 300 指数增强型发起 式证券投资基金的基 金经理,2019年10月 起担任银河和美生活 主题混合型证券投资 基金的基金经理。

注: 1、上表中任职日期均为公司作出决定之日。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.2 管理人对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定的回报。

4.3 公平交易专项说明

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,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,未发现本基金与其他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 报告期内基金投资策略和运作分析

配置主要是科技领域和新能源,主要投资方向为新能源、云计算、金融 IT、安全可控、半导体、消费电子、5G 及应用等。

一季度由于全球疫情,对全球产业链的科技公司产生了一定的影响,但我们认为这一轮的科技周期没有改变,我们认为科技应用领域未来有广阔的空间。一季度我们加大了科技应用领域的配置。二季度我们加大了科技应用领域的配置,例如软件应用、5G应用、新能源。

三季度科技股的基本面是比较好的,但由于国际因素的影响,对整个板块产生了一定的压力, 我们依然坚持科技股的投资策略,对持仓进行了部分调整,对于长期看好的品种依然坚持。三季 度新能源板块的基本面持续向好,我们也相应的增加了部分新能源配置。对于科技应用和新能源 未来的投资我们依然看好。

4.5 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. 2583 元;本报告期基金份额净值增长率为-2. 56%,业绩比较基准收益率为 6. 19%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 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	权益投资	1, 178, 238, 683. 14	88. 82
	其中: 股票	1, 178, 238, 683. 14	88. 82
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资		-
	其中:债券	1	_
	资产支持证券		_
4	贵金属投资	l	_
5	金融衍生品投资	ı	_
6	买入返售金融资产	1	_
	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	98, 043, 071. 32	7. 39
8	其他资产	50, 313, 139. 19	3. 79
9	合计	1, 326, 594, 893. 65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1, 107, 040. 00	0.09
В	采矿业	-	-
С	制造业	1, 031, 557, 590. 37	81.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	-	_
Е	建筑业	13, 029. 12	0.00
F	批发和零售业	1, 302, 683. 15	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	21, 430. 32	0.00
Н	住宿和餐饮业	=	
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	137, 188, 130. 00	10.81
J	金融业	5, 654, 775. 29	0.45
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	358, 674. 09	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	988, 262. 06	0.08
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	47, 068. 74	0.00
S	综合	-	
	合计	1, 178, 238, 683. 14	92.83

5.2.2 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。

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

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	300750	宁德时代	516,000	107, 947, 200. 00	8. 50
2	300751	迈为股份	290,000	98, 249, 100. 00	7. 74
3	600570	恒生电子	929, 966	91, 685, 347. 94	7. 22
4	002475	立讯精密	1, 599, 971	91, 406, 343. 23	7. 20
5	603019	中科曙光	2,000,000	75, 440, 000. 00	5. 94
6	600584	长电科技	2,000,000	71, 580, 000. 00	5. 64
7	600438	通威股份	2,600,000	69, 108, 000. 00	5. 44
8	000725	京东方 A	14, 000, 000	68, 740, 000. 00	5. 42
9	300679	电连技术	1, 799, 908	66, 740, 588. 64	5. 26
10	600703	三安光电	2, 300, 000	56, 189, 000. 00	4.43

5.4 报告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。

- **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债券投资明细** 注:本基金本报告期末未持有债券。
- 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。
- **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贵金属投资明细**注:本基金未进行贵金属投资。
- **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**注:本基金本报告期末未持有权证。
 - 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 - 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
- 注:本基金报告期内未持有股指期货合约。
 - 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本期没有股指期货投资。

- 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金没有投资国债期货的安排。

- 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
- 注: 本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

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,在报告编制目前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	520, 560. 25
2	应收证券清算款	48, 908, 165. 43
3	应收股利	_
4	应收利息	15, 888. 53
5	应收申购款	868, 524. 98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	50, 313, 139. 19

5.11.4 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持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位: 份

报告期期初基金份额总额	1, 748, 761, 615. 47
报告期期间基金总申购份额	277, 030, 603. 26
减:报告期期间基金总赎回份额	1, 017, 070, 591. 85
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	_
报告期期末基金份额总额	1, 008, 721, 626. 88

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河和美生活主题混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河和美生活主题混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河和美生活主题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、银河和美生活主题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

9.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

9.3 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 2020年10月28日