

银河产业动力混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 20 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 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	银河产业动力混合
基金主代码	010898
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 25 日
报告期末基金份额总额	728,794,131.49 份
投资目标	本基金通过深度优选新经济周期下受益于产业升级和结构调整的优质企业，分享因产业升级和结构转型的投资机遇，在控制风险的前提下，通过主动组合管理，力争获取超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的投资范围主要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（含主板，中小板，创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票），内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），债券（包括国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，中期票据，短期融资券，超短期融资券，政府支持债券，地方政府债券，可转换债券，可交换债券，次级债等），资产支持证券，债券回购，银行存款，同业存单，货币市场工具，股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的 60%–95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；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，本基金应当保持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。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限制，基金

	管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似市场波动风险外,本基金还面临港股通机制下的诸如环境、市场波动风险、投资标的、市场制度以及交易规则等差异因素带来的特有风险。
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

§ 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	7,452,559.73
2. 本期利润	-82,816,460.41
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1127
4. 期末基金资产净值	601,501,354.41
5. 期末基金份额净值	0.8253

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、所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。

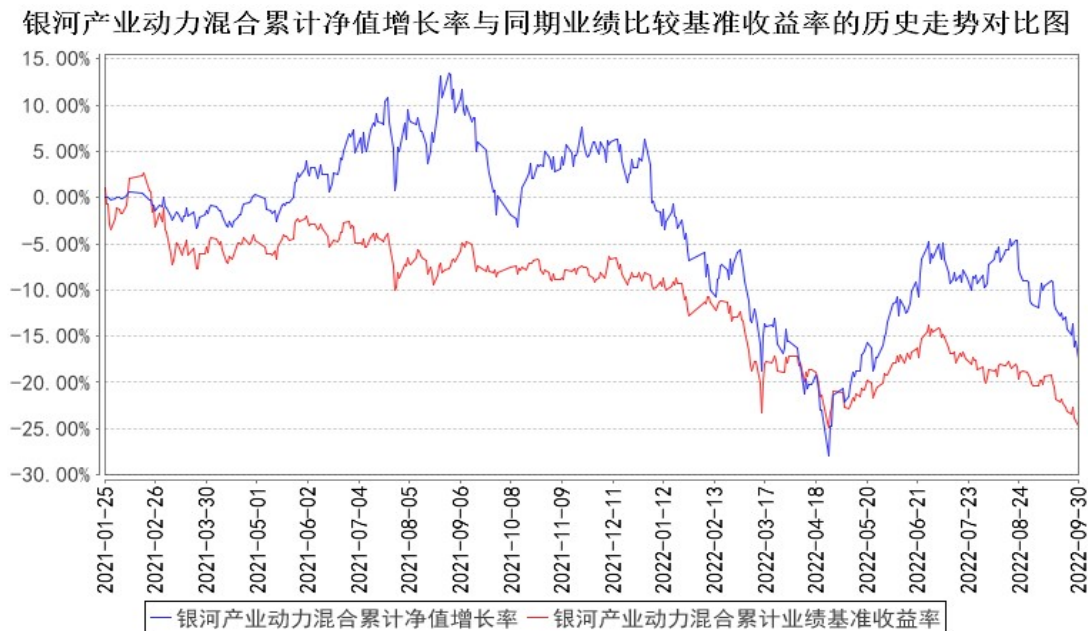
3.2 基金净值表现

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	-12.07%	1.17%	-12.15%	0.73%	0.08%	0.44%
过去六个月	-2.24%	1.48%	-8.28%	0.94%	6.04%	0.54%
过去一年	-17.64%	1.45%	-18.08%	0.95%	0.44%	0.50%
自基金合同 生效起至今	-17.47%	1.34%	-24.70%	0.94%	7.23%	0.40%

注：中证 800 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债综合全价指数收益率*20%

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，本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；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，本基金应当保持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。截至本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑巍山	本基金的基金经理	2022年3月17日	-	14年	硕士研究生，14年证券从业经历。曾先后就职于国元证券研究中心、景顺长城基金管理有限公司、兴业基金管理有限公司，从事投资、研究等工作。2018年10月加入我公司股票投资部，现任股票投资部副总监、基金经理。2019年5月起担任银河创新成长混合型证券投资基金的

					基金经理，2020 年 2 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，2022 年 3 月起担任银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河产业动力混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上表中任职日期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

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》、《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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金严格执行基金合同的配置范围，切合主题，主要围产业升级的概念范畴展开。

三季度产业动力配置相对均衡分散，增加了高端装备、光伏、新材料、信息技术的配置比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河产业动力混合基金份额净值为 0.8253 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.07%；同期业绩比较基准收益率为-12.15%。

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	542,830,787.70	89.60
	其中：股票	542,830,787.70	89.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,804,255.21	0.63
	其中：债券	3,804,255.21	0.63
	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	46,609,420.52	7.69
8	其他资产	12,570,639.64	2.07
9	合计	605,815,103.07	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 20,322,042.89 元，占期末净值比

例 3.38%。

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	7,183,045.10	1.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	405,965,669.39	67.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,186,552.58	1.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	74,968.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	8,316,969.40	1.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,864,267.82	14.11
J	金融业	17,249.67	0.00
K	房地产业	9,000,000.00	1.50
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	823,636.53	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	25,725.53	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,397.44	0.00
R	文化、体育和娱乐业	38,262.91	0.01
S	综合	-	-
	合计	522,508,744.81	86.87

5.2.2 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（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非周期性消费品	12,751,880.09	2.12
周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	7,570,162.80	1.26
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-

合计	20,322,042.89	3.38
----	---------------	------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

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	000733	振华科技	288,000	33,402,240.00	5.55
2	002025	航天电器	430,000	30,960,000.00	5.15
3	300750	宁德时代	50,000	20,044,500.00	3.33
4	002738	中矿资源	210,000	19,320,000.00	3.21
5	688187	时代电气	350,000	18,970,000.00	3.15
6	600845	宝信软件	494,000	18,174,260.00	3.02
7	688111	金山办公	87,663	17,629,905.93	2.93
8	600406	国电南瑞	660,000	16,414,200.00	2.73
9	300395	菲利华	240,000	14,371,200.00	2.39
10	600150	中国船舶	630,000	14,269,500.00	2.37

5.4 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	可转债（可交换债）	3,804,255.21	0.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,804,255.21	0.63

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

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	123107	温氏转债	28,995	3,804,255.21	0.63

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

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

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

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

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

本基金未对股指期货进行投资。

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

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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是否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

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，在报告编制日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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	204,728.91
2	应收证券清算款	12,365,910.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	0.19

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,570,639.64

5.11.4 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	123107	温氏转债	3,804,255.21	0.63

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	742,092,118.59
报告期期间基金总申购份额	5,556,153.31
减：报告期期间基金总赎回份额	18,854,140.41
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	728,794,131.49

§ 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

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

本报告期基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的交易。

§ 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

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基金管理有限公司银河产业动力混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河基金管理有限公司银河产业动力混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河基金管理有限公司银河产业动力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、银河基金管理有限公司银河产业动力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.cgf.cn>

银河基金管理有限公司

2022 年 10 月 25 日