银河灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河灵活配置混合	
场内简称	-	
交易代码	519656	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年2月11日	
报告期末基金份额总额	76,894,386.42份	
投资目标	本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,在确保超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值的前提下,力求获取超额收益。	
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置,同时采取积极主动的股票投资和债券投资策略,把握中国经济增长和资本市场发展机遇,严格控制下行风险,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。 本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、个股精选策略、股指期货投资策略等。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:三年期定期存款利率(税后)+2.5%。 在基金合同生效日,业绩比较基准为中国人民银行公布的、该日适用的三年期银行定期存款利率(税后);并随着中国人民银行对三年期银行定期存款利率的调整而动态调整。	
风险收益特征	本基金为混合型投资基金,属于中高风险、中高收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	银河灵活配置混合A	银河灵活配置混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	519656	519657
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	40,186,443.61份	36,707,942.81份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	银河灵活配置混合A	银河灵活配置混合C
1. 本期已实现收益	-3,361,368.20	-3,103,467.79
2. 本期利润	-6,754,340.66	-6,069,361.73
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1654	-0.1642
4. 期末基金资产净值	69,714,587.58	62,179,150.90
5. 期末基金份额净值	1.735	1.694

注:1、本期已实现收益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 本报告期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

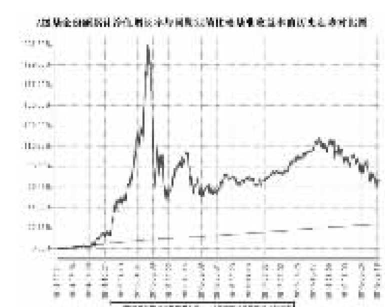
银河灵活配置混合A

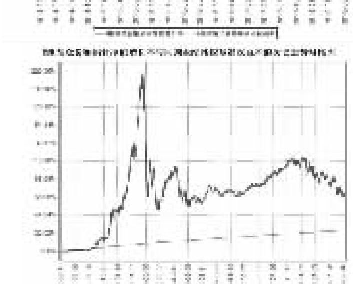
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.64%	1.28%	1.32%	0.01%	-9.96%	1.27%

银河灵活配置混合C

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	-8.83%	1.27%	1.32%	0.01%	-10.15%	1.26%

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:本基金合同生效日为2014年2月11日,根据《银河灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定,本基金应自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
祝建辉	基金经理	2015年12月28日	-	12	中共党员,硕士研究生学历,12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,2017年10月起担任银河君腾灵活配置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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度本基金仓位前高后低,整体呈现降仓趋势;从基金持仓结构的变化来看,3季度本基金主要减持了食品饮料、传媒、农林牧渔、机械设备、计算机、交通运输及化工,增持了非银、采掘、医药生物、有色。

本基金对4季度市场谨慎乐观,4季度预计市场存在阶段性反弹的可能和空间,主要基于以下理由:由于经济下行压力的逐步加大,货币政策边际上将逐步放松,政策利好逐步落实的累积效应,9月底美国加息结束后,有一个短暂的喘息期,其次中美贸易战的升级空间边际递减,美国中期大选也将在11月6日举行并结束,不管中美贸易谈判是否达成协议,在美国中期大选结束后也将迎来贸易战短暂的喘息期;进入10月份将进入上市公司3季报期,不少盈利下修的公司将逐步兑现,而盈利稳定的公司对2018年全年的业绩有相对可靠的预期,盈利稳定且趋势明确的公司可能存在估值切换的空间,而到2018年年报正式出来有3-5个月的空窗期,主题投资也将在3季报结束存在活跃的可能;市场的风险因素在于海外市场的波动、人民币的贬值;本基金将从下列投资机会中寻找配置标的,(1)淡化风格和行业自下而上寻找盈利稳定且趋势明确的个股机会,(2)市场下跌中被错杀的、与经济趋势相关性偏弱的消费类公司和医药生物类公司,(3)受益油价或海内外供给端收缩的周期类个股,主要从石化、油服和化工行业自下而上寻找,(4)阶段性配置受益于政策放松的高贝塔行业,(5)5G主题以及电动车主题投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河灵活配置混合A基金份额净值为1.735元,本报告期基金份额净值增长率为-8.64%;截至本报告期末银河灵活配置混合C基金份额净值为1.694元,本报告期基金份额净值增长率为-8.83%;同期业绩比较基准收益率为1.32%。

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	99,356,579.35	74.81
	其中:股票	99,356,579.35	74.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,719,038.00	5.81
	其中:债券	7,719,038.00	5.81
	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	13,842,784.98	10.42
8	其他资产	11,893,811.84	8.96
9	合计	132,812,214.17	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	-	-
B	采矿业	12,176,951.93	9.23
C	制造业	43,017,229.11	32.62
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	3,959,935.06	3.00
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	23,350,138.00	17.70
J	金融业	9,872,665.25	7.49
K	房地产业	1,667,290.00	1.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,312,370.00	4.03
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	99,356,579.35	75.33

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	300036	超图软件	413,415	9,157,142.25	6.94
2	601799	星宇股份	158,774	8,313,406.64	6.30
3	600585	海螺水泥	209,896	7,722,073.84	5.85
4	300595	欧普康视	176,765	6,283,995.75	4.76
5	600845	宝信软件	246,200	6,034,362.00	4.58
6	600519	贵州茅台	8,102	5,914,460.00	4.48
7	603259	药明康德	57,400	5,312,370.00	4.03
8	601318	中国平安	60,300	4,130,550.00	3.13
9	601398	工商银行	710,600	4,100,162.00	3.11
10	002422	科伦药业	146,176	3,898,513.92	2.96

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	7,719,038.00	5.85
	其中:政策性金融债	7,719,038.00	5.85
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,719,038.00	5.85

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	018005	国开1701	76,730	7,719,038.00	5.85

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

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

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。

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	223,397.95
2	应收证券清算款	11,497,677.24
3	应收股利	-
4	应收利息	145,525.51
5	应收申购款	27,211.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,893,811.84

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

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	银河灵活配置混合A	银河灵活配置混合C
报告期期初基金份额总额	40,917,443.45	37,284,476.69
报告期期间基金总申购份额	689,809.75	973,759.76
减:报告期期间基金总赎回份额	1,420,809.59	1,550,293.64
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	40,186,443.61	36,707,942.81

§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:基金管理人本报告期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:基金管理人本报告期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灵活配置混合型证券投资基金的文件
2、《银河灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3、《银河灵活配置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、银河灵活配置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号中建大厦15楼

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
2018年10月24日

银河君耀灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河君耀混合	
场内简称	-	
交易代码	519623	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月18日	
报告期末基金份额总额	463,983,865.71份	
投资目标	本基金在深入的基本面研究的基础上,通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理,力争实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金在综合分析多方面因素的基础上,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置,同时采取积极主动的股票投资和债券投资策略,严格控制下行风险,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×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投资品种,其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,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	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	银河君耀混合A	银河君耀混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	519623	519624
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	361,105,708.85份	102,878,156.86份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	银河君耀混合A	银河君耀混合C
1. 本期已实现收益	-2,179,253.20	-253,189.56
2. 本期利润	-3,529,084.22	-958,880.15
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0098	-0.0074
4. 期末基金资产净值	368,614,239.15	104,890,560.80
5. 期末基金份额净值	1.0208	1.0196

注:1、本期已实现收益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、基金合同生效日为2017年3月10日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

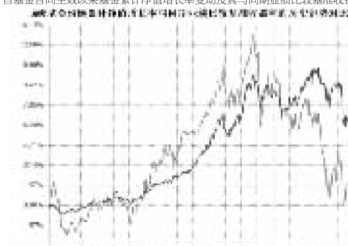
银河君耀混合A

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	-0.95%	0.46%	-0.45%	0.68%	-0.50%	-0.22%

银河君耀混合C

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	-0.97%	0.46%	-0.45%	0.68%	-0.52%	-0.22%

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



§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		
杨琪	基金经理	2017年7月1日	-	8	硕士研究生学历,8年金融行业相关从业经历。曾任职于上海原点资产管理有限公司研究部,2011年11月加入我公司,从事投资、研究相关工作。2017年1月起担任银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年4月起担任银河美丽优萃混合型证券投资基金的基金经理,2017年7月起担任银河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
刘铭	基金经理	2017年4月29日	-	6	硕士研究生学历,7年金融行业相关从业经历。曾任职于上海汽车集团财务有限责任公司固定收益部、上海银行股份有限公司资产管理部,从事固定收益交易、研究与投资相关工作,2016年7月加入我公司固定收益部。2016年12月起担任银河银富货币市场基金的基金经理,2017年4月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年6月起担任银河钱包货币市场基金的基金经理,2017年12月起担任银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年3月起担任银河庭芳3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、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的基金经理,2018年6月起担任银河景行3个月定期开放债券型发起式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

三季度,国内经济数据稳中有降,社融数据持续走弱,固定资产投资和工业增加值双双回落,PPI仍然保持缓慢下行趋势不变,CPI在原油、猪瘟、洪灾、房租价格等影响下出现一定程度的反弹。随着金融去杠杆的推进,去杠杆已明显传导至实体,企业融资环境恶化,债务违约事件频现;基建持续走弱,加之中美贸易战导致外需未来面临着较大不确定性。在此背景下,金融政策从上半年的"宽货币、紧信用"向"宽货币、宽信用"转变。政治局会议首次提出"六稳",资管新规的补充通知较之前监管态度明显偏松,央行MPA资本充足率指标调降,国常会释放基建项目要保证在建工程资金的接续等政策都指向信用政策的放松。

三季度债券市场主要矛盾由货币政策转换为信用政策和地方债供给。长端债券收益率先下后上,呈震荡上行趋势,10年期国开债到期收益率上行8BP。短端收益率在宽松的货币政策下震荡下行,1年期国开债到期收益率回落32BP。曲线呈现陡峭化趋势。信用债收益率跟随利率债向上调整。城投债受益于宽信用政策,与产业债利差收窄。

权益市场方面,在经济持续下行压力加大的情形下,企业盈利出现下滑。市场所期待的减费、降税等改革措施也不及预期,加之对居民杠杆高制约消费能力的担忧上升,权益市场出现了持续下跌的局面。但是持续下跌的市场也使得很多行业具备了估值底的特征,季末权益市场出现了明显的技术性反弹行情。

可转债方面,中证转债指数先涨后跌,整体表现很弱,转债市场平价整体下行,交易量持续萎缩,转债估值整体处于底部。转债市场无趋势性行情,仅有下修转股价的个券和银行转债存在结构性机会。

在本季度的运作期内,调整了同业存单和信用债的配置比例,积极参与了新股网下申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河君耀混合A基金份额净值为1.0208元,本报告期基金份额净值增长率为-0.95%;截至本报告期末银河君耀混合C基金份额净值为1.0196元,本报告期基金份额净值增长率为-0.97%;同期业绩比较基准收益率为-0.45%。

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	123,915,023.35	20.25
	其中:股票	123,915,023.35	20.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	452,728,213.60	73.98
	其中:债券	450,682,213.60	73.65
	资产支持证券	2,046,000.00	0.33
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	20,439,240.44	3.34
8	其他资产	14,880,007.70	2.43
9	合计	611,962,485.09	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	4,643,164.08	0.98
B	采矿业	-	-
C	制造业	104,323,259.27	22.03
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	8,062,000.00	1.70
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	5,525,000.00	1.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,361,600.00	0.29
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	123,915,023.35	26.17

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	603517	绝味食品	702,369	29,429,261.10	6.22
2	000651	格力电器	370,000	14,874,000.00	3.14
3	002304	洋河股份	100,000	12,800,000.00	2.70
4	300146	汤臣倍健	550,000	11,275,000.00	2.38
5	600519	贵州茅台	15,100	11,023,000.00	2.33
6	000661	长春高新	40,000	9,480,000.00	2.00
7	600009	上海机场	100,000	5,877,000.00	1.24
8	000858	五 粮 液	84,500	5,741,775.00	1.21
9	000001	平安银行	500,000	5,525,000.00	1.17
10	300498	温氏股份	199,964	4,643,164.08	0.98

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	131,678,800.00	27.81
	其中:政策性金融债	91,018,800.00	19.22
4	企业债券	15,129,500.00	3.20
5	企业短期融资券	151,941,000.00	32.09
6	中期票据	130,474,000.00	27.56
7	可转债(可交换债)	1,858,913.60	0.39
8	同业存单	19,600,000.00	4.14
9	其他	-	-
10	合计	450,682,213.60	95.18

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	180403	18农发03	490,000	50,822,800.00	10.73
2	1822008	18建信租赁债01	400,000	40,660,000.00	8.59
3	180404	18农发04	400,000	40,196,000.00	8.49
4	101800844	18柳州投资MTN002	400,000	40,024,000.00	8.45
5	101800843	18合川城投MTN001	400,000	39,504,000.00	8.34

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1789309	17苏誉1优先	100,000	2,046,000.00	0.43

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注: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

注: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

注:本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注: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

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	84,105.95
2	应收证券清算款	5,429,962.53
3	应收股利	-
4	应收利息	9,365,937.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1.39
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,880,007.70

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	123009	星源转债	1,110,700.00	0.23
2	132012	17巨化EB	110,062.00	0.02
3	113012	骆驼转债	56,851.60	0.01

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

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	银河君耀混合A	银河君耀混合C
报告期期初基金份额总额	361,107,001.59	202,906,324.26
报告期期间基金总申购份额	-	3,586.53
减:报告期期间基金总赎回份额	1,292.74	100,031,753.93
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	361,105,708.85	102,878,156.86

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180724-20180930	-	100,030,500.00	-	100,030,500.00	21.13%
	2	20180701-20180930	201,727,427.94	-	100,000,000.00	101,727,427.94	21.48%
	3	20180701-20180930	200,017,000.00	-	-	200,017,000.00	42.24%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。							

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君耀灵活配置混合型证券投资基金的文件
2、《银河君耀灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3、《银河君耀灵活配置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、银河君耀灵活配置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
2018年10月24日

银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河君辉3个月定开债券
场内简称	-
交易代码	519632
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月21日
报告期末基金份额总额	649,633,501.52份
投资目标	在一定程度上控制组合净值波动率的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以自上而下的分析方法为基础,依据国内外宏观经济、物价、利率、汇率、流动性、风险偏好等变化趋势,拟定债券资产配置策略。本基金依据各固定收益品种绝对收益率水平、流动性、供求关系、信用风险 环境和利差波动趋势、利率敏感性、机构投资者行为倾向等进行综合分析,在严 格控制风险的前提下,通过积极主动的管理构建及调整固定收益投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合 型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	6,830,966.78
2.本期利润	7,786,868.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0120
4.期末基金资产净值	655,236,365.38
5.期末基金份额净值	1.0086

注:1、本期已实现收益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。

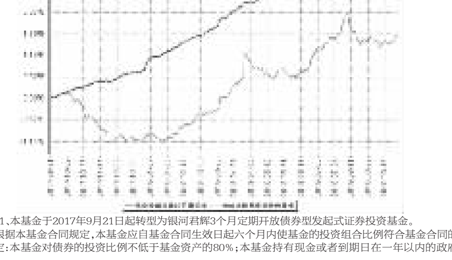
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	1.18%	0.03%	0.57%	0.07%	0.61%	-0.04%

注:本基金业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率,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:1、本基金于2017年9月21日起转型为银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

2、根据本基金合同规定,本基金应自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩晶	基金经理	2017年9月21日	-	16	中共党员,经济学硕士,16年证券从业经历,曾就职于中国民族证券有限责任公司,期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。2008年6月加入银河基金管理有限公司,先后担任债券经理助理、债券经理等职务,现任固定收益部总监、基金经理。2011年8月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理,2012年11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理,2014年7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理,2015年6月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年3月起担任银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理,2016年12月起担任银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年3月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年4月起担任银河通利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理,2017年9月起担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年2月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年3月起担任银河鑫月享6个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年8月起担任银河泰利纯债债券型证券投资基金的基金经理。
蒋磊	基金经理	2017年9月21日	-	12	硕士研究生学历,12年证券从业经历。曾先后在星展银行(中国)有限公司、中宏人寿保险有限公司工作。2016年4月加入银河基金管理有限公司,就职于固定收益部,2016年8月起担任银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理、银河领先债券型证券投资基金的基金经理,2017年1月起担任银河君怡纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年3月起担任银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理,2017年4月起担任银河通利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理,2017年9月起担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年2月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年6月起担任银河睿嘉纯债债券型证券投资基金的基金经理。

注:1、上表中任职日期均为基金合同生效之日。

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

三季度,国内经济数据稳中有降,社融数据持续走弱,固定资产投资和工业增加值双双回落,PPI仍然保持缓慢下行趋势不变,CPI在原油、猪瘟、洪灾、房租价格等影响下出现一定程度的反弹。随着金融去杠杆的推进,去杠杆已明显传导至实体,企业融资环境恶化,债务违约事件频现;基建持续走弱,加之中美贸易战导致外需未来面临着较大不确定性。在此背景下,金融政策从上半年的"宽货币、紧信用"向"宽货币、宽信用"转变。政治局会议首次提出"六稳",资管新规的补充通知较之前监管态度明显偏松,央行MPA资本充足率指标调降,国常会释放基建项目要保证在建工程资金的接续等政策都指向信用政策的放松。

三季度债券市场主要矛盾由货币政策转换为信用政策和地方债供给。长端债券收益率先下后上,呈震荡上行趋势,10年期国开债到期收益率上行8BP。短端收益率在宽松的货币政策下震荡下行,1年期国开债到期收益率回落32BP。曲线呈现陡峭化趋势。信用债收益率跟随利率债向上调整。城投债受益于宽信用政策,与产业债利差收窄。

三季度,主要是将到期资金再投资于1年内高评级短融,维持了较短的久期,并维持了约20%左右的杠杆水平。

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1.0086元;本报告期基金份额净值增长率为1.18%,业绩比较基准收益率为0.57%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	743,373,000.00	97.47
	其中:债券	693,478,000.00	90.93
	资产支持证券	49,895,000.00	6.54
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	4,729,627.61	0.62
8	其他资产	14,548,374.29	1.91
9	合计	762,651,001.90	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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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	404,222,000.00	61.69
	其中:政策性金融债	110,699,000.00	16.89
4	企业债券	10,073,000.00	1.54
5	企业短期融资券	181,028,000.00	27.63
6	中期票据	50,355,000.00	7.69
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	47,800,000.00	7.30
9	其他	-	-
10	合计	693,478,000.00	105.84

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	1820012	18渤海银行01	500,000	51,155,000.00	7.81
2	1428002	14浙商银行债	500,000	50,805,000.00	7.75
3	170307	17进出07	500,000	50,685,000.00	7.74
4	091302002	13中国华融债02	500,000	50,665,000.00	7.73
5	011800927	18中航租赁SCP003	500,000	50,390,000.00	7.69

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889176	18飞驰建融4A	500,000	49,895,000.00	7.61

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金不参与国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金不参与国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金不参与国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,548,374.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,548,374.29

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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	649,661,782.64
报告期期间基金总申购份额	1,694.11
减:报告期期间基金总赎回份额	29,975.23
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	649,633,501.52

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,841,535.43
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,841,535.43
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.51

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,841,535.43	1.51	9,841,535.43	1.51	自合同生效之日起不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,841,535.43	1.51	9,841,535.43	1.51	自合同生效之日起不低于三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	639,367,353.41	0.00	0.00	639,367,353.41	98.42%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的文件
2、《银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
3、《银河君辉3个月定期开放债券型发起式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、银河君辉3个月定期开放债券型发起式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

10.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层

10.3 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
2018年10月24日