银河证券纯债券型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-30

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：2019-07-18

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 审计报告
§7 财务指标、报告期末基金资产组合情况
§7.1 报告期末基金资产组合情况
§7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
§7.3 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
§7.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
§7.5 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
§7.6 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贵金属投资明细
§7.7 报告期末按照证券投资品种分类的金融衍生品投资明细
§7.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
§7.9 投资组合报告附注
§8 基金份额变动情况
§9 重大事件揭示
§10 管理人对报告期内基金运作遵守情况的说明
§11 影响投资者决策的其他重要信息
§12 备查文件目录

§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2019年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和利润分配情况的内容，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。

基金管理人过去一个会计年度的业绩表现、投资风险以及投资组合的主要内容请投资者认真阅读本报告全文。

本报告所载财务数据截至2019年6月30日。

本报告正文共分为§1重要提示、§2基金简介、§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况、§4管理人报告、§5托管人报告、§6审计报告、§7财务指标、报告期末基金资产组合情况、§7.1报告期末基金资产组合情况、§7.2报告期末按行业分类的股票投资组合、§7.3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、§7.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合、§7.5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、§7.6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贵金属投资明细、§7.7报告期末按照证券投资品种分类的金融衍生品投资明细、§7.8报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明、§7.9投资组合报告附注、§8基金份额变动情况、§9重大事件揭示、§10管理人对报告期内基金运作遵守情况的说明、§11影响投资者决策的其他重要信息、§12备查文件目录等内容，其中§1、§2、§3、§7.1、§7.2、§7.3、§7.4、§7.5、§7.6、§7.7、§7.8、§8、§9、§10、§11、§12为必须披露内容，§4、§5、§6、§7.9为选择性披露内容。

§2 基金简介

基金名称	银河证券纯债
基金简称	银河纯债
基金主代码	000701
交易代码	000701不限申购
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014-12-12
报告期末基金份额总额	198,991,556.12
投资目标	在保持较小风险的条件下，对于债券市场的波动进行积极的投资管理，在获取稳定收益的基础上，通过对利率走势的预测，积极调整组合久期，以期获得超越债券市场基准的收益。
投资策略	本基金将在以下方面进行积极的投资：1）久期调整策略；2）收益率曲线调整策略；3）信用债券投资策略；4）可转债投资策略；5）资产支持证券投资策略；6）国债期货投资策略。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中债综合指数（全价）×80%+一年期银行定期存款税后收益率×20%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、指数型基金、QDII基金、商品期货基金、黄金等基金。
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

§3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-04-01 至 2019-06-30）
本期已实现利润	2,705,105.42
本期利润	1,731,391.93
期末可供出售金融资产期初成本	0.00
期末可供出售资产产值	198,929,129.42
期末基金份额净值	1.000

注：注：1、本期已实现利润是基金本期利润减去、变动成分、公允价值变动收益的金额；本期期末利润是本期已实现利润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业务提示条款发生的变动。计入费用后实现的收益以及持有人申购赎回的损益。

3、根据证券监管规定，2019年6月17日公告。

§4 管理人报告

本报告期基金份额净值增长率及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	0.39 %	0.04 %	0.35 %	0.04 %	0.04 %	0.00 %

注释说明：图示日期为截至期末可参数字母的交易日与图表横坐标交易日期对应的日期。

管理人在报告期内履行职责情况的说明

本报告期内，本基金投资运作严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金合同》和其他有关法律法规规定，本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则管理和运用基金资产，在不违反相关规定的前提下，为基金持有人的利益谋取最大利益。本报告期内，基金运作合规、有序，没有发生损害基金持有人利益的行为。

本报告期内，本基金投资决策委员会、风险管理委员会、投资管理部门、监察稽核部门等部门，严格遵守公司内部控制制度，通过内部控制机制的建立、实施，对本基金的投资决策、风险管理、合规性监控、业绩评估等方面进行有效控制，保证了基金的合规运作和管理水平的不断提高。

托管人报告

托管人对报告期内基金运作遵守有关法律法规情况的说明

本报告期内，本基金管理人在投资运作、证券投资基金销售、基金会计核算、基金份额发售、赎回、基金份额登记、基金信息披露、基金投资关联方交易、基金管理人内部管理等方面，