

银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金2019年第二季度报告

2019-06-30

基金管理人：银河基金管理有限公司
基金托管人：杭州银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-18

重要提示

基金管理人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。
基金管理人银河基金管理有限公司根据本基金合同约定，于2019年7月18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。
基金管理人保证以诚实信用、勤勉尽责的原则履行义务，但不保证基金一定盈利，也不保证基金最低收益。投资者须自行承担投资风险。
基金资产净值不代表未来表现，投资者有风险，投资需谨慎。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。
本报告期指2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with columns: Item (基金名称, 场内简称, 基金代码, etc.), Value (银河睿丰定期债券, etc.).

主要财务指标

Table with columns: Major Financial Indicators (本期已实现收益, 本期利润, etc.), Reporting Period (2019-04-01 to 2019-06-30), and Unit (人民币元).

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。

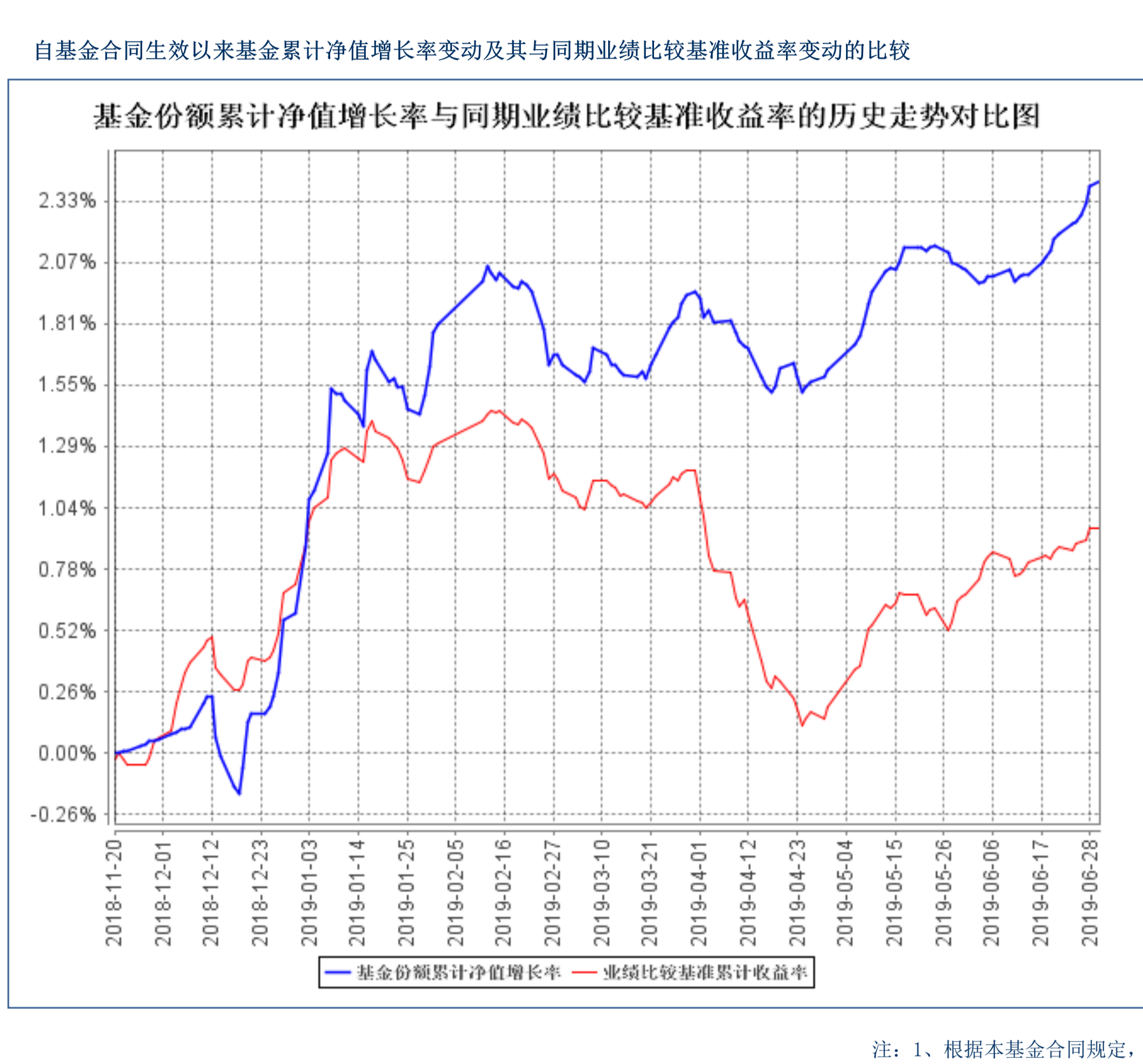
基金净值表现

Table with columns: Reporting Period (2019-04-01 to 2019-06-30), Net Value Growth Rate (0.66%), Benchmark Net Value Growth Rate (0.04%), etc.

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率

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

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、根据本基金合同约定，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。
2、本基金合同生效日为2018年11月20日，截至本报告期末未逾一年。
3、截至本报告期末，本基金建仓完毕。

其他指标

Table with columns: Other Indicators (其他指标, 报告期), Reporting Period (2019-04-01 to 2019-06-30), and Unit (人民币元).

注：无。

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with columns: Name (杨磊), Position (基金经理), Tenure (2018-11-20 to 2019-06-30), and Bio (杨磊，硕士，研究生学历，13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，旗下担任固定收益部。2016年起担任银河睿丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理。银河利灵灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河利灵混合型证券投资基金的基金经理、银河利安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河利安混合型证券投资基金的基金经理、银河利安混合型证券投资基金的基金经理、银河利安混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、上表中任职日期为基金合同生效之日。
2、证券从业年限按其从事证券行业的工作经历累计计算。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、勤勉尽责、维护基金份额持有人利益”的原则，勤勉尽责地履行了各项职责，本基金运作符合有关法律法规及基金合同的约定。
基金运作规范，投资比例及投资组合符合法律法规及基金合同的约定。
基金资产运作规范，基金管理人未发生任何违法违规行为，基金管理人未发生任何违法违规行为，基金管理人未发生任何违法违规行为。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
报告期内，公司严格遵照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，公司对不同投资组合的整体收益率差异及分投资类别（股票、债券）的收益差异进行了分析。

异常交易行为的专项说明
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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度权益市场整体偏弱，资金价格中枢进一步下降，二季度利率债4月份各期限利率调整后，后续曲线整体逐月下降，曲线形态趋扁平。短期在4月份权益市场表现不佳的情况下，整体小幅上行，长端利率受中美贸易摩擦升级、经济数据下行影响小幅下行。信用债曲线先上后下，曲线平坦化，信用利差在二季度中高等级利差收窄明显，AA+等级信用利差先下后上，回到一季度水平，反映了信用利差在二季度中高等级利差收窄明显，AA+等级信用利差先下后上，回到一季度水平，反映了信用利差在二季度中高等级利差收窄明显，AA+等级信用利差先下后上，回到一季度水平。

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1.0129元，本报告期基金份额净值增长率为0.66%，业绩比较基准收益率为0.24%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table showing asset composition: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry allocation: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table showing industry allocation: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注：本基金本报告期末未持有港股股票投资。

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

Table with columns: 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(%)

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 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(%)

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。

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。

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。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明