

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

基金管理人承诺基金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。
基金管理人银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金合同规定，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，也不保证最低收益。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。
基金资产净值不承诺保本，也不保证最低收益。
本报告自2019年4月1日起至3月31日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金名称 (Fund Name), 场内简称 (Listed Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Total Shares at End of Report), 投资目标 (Investment Objective), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Profit), 加权平均基金份额本期利润 (Weighted Average Profit per Share), 期末基金资产净值 (Net Asset Value at End), 期末基金份额净值 (Net Asset Value per Share).

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 2 columns: 阶段 (Period) and 净值增长率① (Net Value Growth Rate). Includes 过去三个月 (Last 3 Months).

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



注：1、根据基金合同约定，本基金应自基金合同生效日起6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 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes 基金份额持有人户数 (Number of Shareholders).

注：无。

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date). Lists 陈磊 (Chen Lei) as the fund manager.

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年限计算。

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、勤勉尽责、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追求基金资产的保值增值，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约定。
随着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、勤业笃行、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。

公平交易专项说明

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。
针对向交易部分，本报告期内，公司对旗下管理的投资组合（完全复制的指数基金除外），逐笔逐笔逐笔期间内，不同时间段（日内、3日内、5日内）公平交易制度的进行了差异分析，并针对基金资产、仓位等情况及基金持仓检查结果进行了梳理和分析，未发现异常异常。
针对向交易部分，公司对旗下不同投资组合最近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现异常异常。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超过该交易日成交总量的0.5%的情况（《完全复制的指数基金除外》）。
对于公司公开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、比例分配的原则对申购额度进行分配。

异常交易行为的专项说明
本报告期内，未发现本基金与其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

二季度资金面偏紧性偏弱，资金价格中枢逐月下降，二季度利率债4月份各期限向上调整较多，后曲线整体逐月下降，曲线形态趋扁平。短端在4月份资金面收紧及月末同业现券冲击下调整较多，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，信用利差方面中高等级利差收窄明显，AA+等级信用利差先下后上，回到一季度末水平，反映了债市机构风险偏好进一步下降。
一季度仍以利率债和商业银行金融债为主，小幅调低组合久期，适度调整持仓期限结构。

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0.46%，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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Lists categories like 权益类投资 (Equity Investment), 固定收益投资 (Fixed Income Investment), 货币类投资 (Money Investment), etc.

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists industries like 农林牧渔 (Agriculture), 医药生物 (Pharmaceuticals), etc.

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 with 4 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists categories like 基础材料 (Basic Materials), 消费品 (Consumer Goods), etc.

注：本基金本报告期末未持有港股投资。

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 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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 with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists categories like 国家债券 (Government Bonds), 央行票据 (Central Bank Bills), etc.

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 6 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousands), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position Size), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

注：本基金未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

投资组合报告附注

受罚调查及处罚情况

18世纪绿色金融
兴业银行
银保监会处罚决定书【2018】1号
2018年5月1日，监管机构下发银保监会处罚决定书【2018】1号，涉及本行在绿色金融业务中存在的违法违规行为，包括未按规定开展绿色信贷业务、内控管理不完善导致违规开展业务、多家分支机构未开展绿色金融业务等。同时，银保监会还下发了行政处罚决定书，对本行在绿色金融业务中存在的违法违规行为进行了处罚。本行在收到处罚决定书后，立即开展了整改工作，并对相关责任人进行了处理。目前，整改工作已基本完成，相关责任人已受到相应处理。本行将进一步加强绿色金融业务的管理，确保合规经营。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库
报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

Table with 2 columns: 其他资产构成 (Other Assets Composition) and 金额 (元) (Amount in Yuan). Lists 应收证券清算款 (Receivable Securities Settlement), 应收股利 (Receivable Dividends), etc.

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。

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。

投资组合报告附注的其他文字描述部分
因四舍五入原因，投资组合报告中部分资产占净值比例之和与合计可能有误差。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 报告期末基金份额总额 (Total Shares at End of Report), 报告期间基金份额总额 (Total Shares during Report Period), etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Share Amount). Includes 报告期末管理人持有的基金份额 (Shares Held by Manager at End of Report), 报告期间管理人持有的基金份额 (Shares Held by Manager during Report Period), etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额 (元) (Transaction Amount in Yuan), 交易金额 (份) (Transaction Amount in Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 6 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额总数 (Total Shares Initiated), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Initiated), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Initiated Shares).

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

Table with 7 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval when Proportion Reached/Exceeded 20%), 期初份额 (Start Period Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 持有份额占比 (Proportion of Current Shares).

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超过基金总份额20%的情形。在市场流动性不足的情况下，如果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影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1. 中国证监会批准设立银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金的文件
2. 《银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《银河睿丰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睿丰基金管理有限公司的文件
5. 银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书及更新
6. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1568号15层

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 / 400-820-0880
公司网站：http://www.galaxyasset.com