银河银信添利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：中信银行股份有限公司

基金合同生效日：2016-07-08

重要提示

本基金管理人的董事会、董事及其高级管理人员保证报告内容的真实性、准确性和完整性，并对报告内容的虚假、误导性陈述或重大遗漏承担个别和连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年07月05日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，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，但不保证投资一定盈利。

投资者应认真阅读本产品风险收益特征、投资范围、投资策略及投资限制等相关内容，根据自己的投资目标、投资期限、投资经验、资产状况等进行投资决策。

投资者应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同等信息披露文件，对于投资决策、风险承担等事项作出独立判断。

投资者投资于本基金前，请认真阅读本报告全文。

本报告中财务数据和投资组合报告等内容，除特别说明外，均为人民币（元）金额。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	银河银信添利债券
交易代码	519968
基金合同生效日	2016-07-08
报告期末基金份额总额	2017-03-31
下属两类基金的交易代码	519968
报告期末下属两类基金的份额总额	15,988,455.72

主要财务指标

主要财务指标	人民币（元）	银河银信添利债券A(元) 2019-01-01 - 2019-06-30	银河银信添利债券C(元) 2019-01-01 - 2019-06-30
本期已实现利息		101,931.19	31,330.21
期末可供分配利润		0.0000	0.0000
期末可供分配利润比例		0.00%	0.00%
期末资产净值		17,455,494.90	16,191,786.93
期末基金份额净值		1.0920	1.0132

注：上表列示期末基金份额净值高于0.9元的开放式基金的主要财务指标。

注：本期已实现利息是指本期利息收入，扣除税金、证券交易费用、证券结算费用、证券出借业务支出、应付管理费、应付托管费、应付销售服务费、应付利息、应付交易费用、其他费用后的余额，不计入当期损益的金额。期末可供分配利润是指本期末可供分配利润扣除公允价值变动损益后的余额，本期末可供分配利润为负时，以零填列。

基金业绩指标

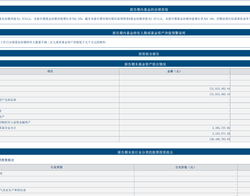
本期报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.21 %	0.25 %	0.98 %	0.06 %	-0.77 %	0.19 %

本期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	0.21 %	0.25 %	0.98 %	0.06 %	-0.77 %	0.19 %

注：业绩比较基准收益率=债券型证券投资业绩比较基准收益率(中债综合指数)



管理人报告

基金经理	基金经理(助理)期限
姓名	任职日期
陈磊	2017-03-23

注：1、上表中的任职日期为本基金合同生效日；

2、证券从业年限按照证券业协会发布的证券从业人员年限计算方法计算。

管理人对报告期内本基金运作遵守有关法规的说明

本报告期内，本基金运作遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号—定期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第1号—定期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第2号—年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号—半年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第4号—季度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号—招募说明书内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第6号—基金合同内容与格式》等法律法规的规定，本报告期内本基金管理人的董事会、董事及其高级管理人员未发生损害基金份额持有人利益的行为。

托管人报告

托管人对报告期内基金运作情况的说明

报告期内，中信银行股份有限公司根据《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号—定期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第1号—定期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第2号—年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号—半年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第4号—季度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号—招募说明书内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第6号—基金合同内容与格式》等法律法规的规定，本报告期内本基金管理人的董事会、董事及其高级管理人员未发生损害基金份额持有人利益的行为。

托管人复核财务指标的意见

经复核，本报告期内，本基金管理人的财务指标计算和净值表现的真实、准确、完整。

财务指标与净值表现情况

主要财务指标和净值表现

报告期末本基金可供分配利润为0.00元，其中：银行间市场债券利息收入0.00元，期末可供分配利润比例为0.00%，期末资产净值为33,646,281.83元，期末基金份额净值为1.0920元。

报告期内，本基金管理人在对本基金日常管理的过程中，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定，以及《银河银信添利债券型证券投资基金合同》、《银河银信添利债券型证券投资基金招募说明书》等有关基金文件的规定，在充分考虑市场情况、合理安排资产配置、谨慎操作、注重风险控制的原则下，为基金持有人谋求利益。

管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明

公平交易执行情况

公平交易制度的执行情况

报告期内，公司按照证券投资基金管理人内部公平交易控制流程及公平交易系统控制要求，对投资决策、交易执行、交易结果分配、交易结果事后监控、异常交易监控及报告等各环节进行了有效的控制。

报告期内公司旗下组合，根据投资策略，公司采取了集中交易、公平分配的交易流程，在日常投资管理过程中，公司根据各组合的投资目标、投资策略、资产配置情况、现金流情况、风险控制等因素，对各组合进行合理的资产配置，并在满足各组合投资目标、投资策略、资产配置、现金流情况、风险控制等因素的前提下，公平地对待各组合的投资机会，以期为各组合带来公平合理的投资回报。

报告期内，公司旗下组合采用了公平交易系统进行交易，公平交易系统对不同组合的交易指令进行了公平、合理的分配，并对交易结果进行事后监控，对异常交易进行监控、报告。

报告期内，公司旗下组合未发生违反相关法律法规的情况，未发生因违反公平交易制度而被监管机构处罚的情况。

异常交易行为的专项说明

报告期内，未发生异常交易行为。

报告期内基金投资策略和业绩表现说明

报告期内，公司旗下所管理的各类基金投资策略均按照公司投资决策委员会、投资管理部、风险管理部、监察稽核部、交易部等部门的有效运作，投资决策委员会根据宏观经济、证券市场、利率水平、市场资金状况、各类资产的风险收益特征等因素，对各类资产的配置比例、久期、杠杆率、组合风险等方面进行了有效的决策，投资管理部根据决策委员会的决策意见，结合各组合的投资目标、投资策略、资产配置、现金流情况、风险控制等因素，对各组合进行合理的资产配置，并在满足各组合投资目标、投资策略、资产配置、现金流情况、风险控制等因素的前提下，公平地对待各组合的投资机会，以期为各组合带来公平合理的投资回报。

报告期内，公司旗下组合采用了公平交易系统进行交易，公平交易系统对不同组合的交易指令进行了公平、合理的分配，并对交易结果进行事后监控，对异常交易进行监控、报告。

报告期内，公司旗下组合未发生违反相关法律法规的情况，未发生因违反公平交易制度而被监管机构处罚的情况。

报告期内，公司旗下组合采用了公平交易系统进行交易，公平交易系统对不同组合的交易指令进行了公平、合理的分配，并对交易结果进行事后监控，对异常交易进行监控、报告。

报告期内，公司旗下组合未发生违反相关法律法规的情况，未发生因违反公平交易制度而被监管机构处罚的情况。

投资组合报告

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	-	-
2	固定收益投资	33,455,801.45	98.58
3	其中：债券	33,455,801.45	98.58
	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：买断式逆回购	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,389,707.40	4.09
8	其他资产	1,200,000.00	3.53
9	合计	35,045,508.85	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	教育业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

注：1、本基金未投资股票及权证等权益资产。

报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国债	9,555,394.00	28.40
2	地方政府债	-	-
3	金融债券	19,189,300.00	57.04
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,711,107.45	16.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债（可交换债）	0.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	33,455,801.45	99.42

注：1、本基金未投资股票及权证等权益资产。

报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益类投资明细

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	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资股票及权证等权益资产。

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

序号	品种代码	品种名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资贵金属。

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

序号	权证代码	权证名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资权证。

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资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资资产支持证券。

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开放式基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资开放式基金。

报告期末按照各项投资比例和市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资股票。

报告期末按照各项投资比例和市值占基金资产净值比例大小排序的所有债券投资明细

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国债	9,555,394.00	28.40
2	地方政府债	-	-
3	金融债券	19,189,300.00	57.04
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,711,107.45	16.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债（可交换债）	0.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	33,455,801.45	99.42

注：1、本基金未投资股票及权证等权益资产。

报告期末按照各项投资比例和市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（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资资产支持证券。

报告期末按照各项投资比例和市值占基金资产净值比例大小排序的前五名开放式基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资开放式基金。

报告期末投资组合平均剩余期限

	报告期末	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	报告期内投资组合平均剩余期限最低值
平均剩余期限（天）	1	1	1
报告期内投资组合平均剩余期限超过397天的债券投资情况			
报告期内投资组合平均剩余期限超过397天的资产支持证券投资情况			

注：1、本基金不投资股票及可转换债券。

报告期末按照各项投资比例和市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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	120014	17公司债	1,198,500.00	3.56
2	120406	国债转债	1,011,375.00	3.00
3	136470	16万科债	992,500.00	2.95
4	120021	17中信债	991,400.00	2.95
5	120204	12国开08	990,000.00	2.94
6	120012	国开转债	990,200.00	2.94
7	120016	16国开债	989,900.00	2.94
8	120008	国开转债	989,800.00	2.94
9	120011	16工行债	988,900.00	2.94
10	120013	17工行债	988,800.00	2.94
11	120010	国开转债	988,700.00	2.94
12	120009	16广核债	988,600.00	2.94
13	120018	17国开债	988,500.00	2.94
14	120017	17进出债	987,400.00	2.93
15	120015	国开转债	985,900.00	2.93
16	120203	12国开08	985,800.00	2.93
17	120207	12国开10	984,900.00	2.93
18	120202	12国开07	984,800.00	2.93
19	120019	国开转债	984,600.00	2.93
20	120205	12国开09	984,500.00	2.93
21	120004	国开转债	983,900.00	2.92
22	120205	12国开09	983,800.00	2.92
23	120202	12国开07	983,700.00	2.92
24	120207	12国开10	983,600.00	2.92
25	120203	12国开08	983,500.00	2.92
26	120204	12国开08	983,400.00	2.92
27	120004	国开转债	983,300.00	2.92
28	120203	12国开08	983,200.00	2.92
29	120204	12国开08	983,100.00	2.92
30	120004	国开转债	982,900.00	2.92

报告期末按照各项投资比例和市值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资资产支持证券。

报告期末按照各项投资比例和市值占基金资产净值比例大小排序的前五名开放式基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金未投资开放式基金。

报告期末投资组合平均剩余期限

	报告期末	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	报告期内投资组合平均剩余期限最低值
平均剩余期限（天）	1	1	1
报告期内投资组合平均剩余期限超过397天的债券投资情况			
报告期内投资组合平均剩余期限超过397天的资产支持证券投资情况			

注：1、本基金不投资股票及可转换债券。

报告期末按照各项投资比例和市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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	120014	17公司债	1,198,500.00	3.56
2	120406	国债转债	1,011,375.00	3.00
3	136470	16万科债	992,500.00	2.95
4	120021	17中信债	991,400.00	2.95
5	120204	12国开08	990,000.00	2.94
6	120012	国开转债	990,200.00	2.94
7	120016	16国开债	989,900.00	2.94
8	120008	国开转债	989,800.00	2.94
9	120011	16工行债	988,900.00	2.94
10	120013	17工行债	988,800.00	2.94
11	120010	国开转债	988,700.00	2.94
12	120009	16广核债	988,600.00	2.94
13	120018	17国开债	988,500.00	2.94
14	120017	17进出债	987,400.00	2.93
15	120015	国开转债	985,900.00	2.93
16	120203	12国开08	985,800.00	2.93
17	120207	12国开10	984,900.00	2.93
18	120202	12国开07	984,800.00	2.93
19	120019	国开转债	984,600.00	2.93
20	120205	12国开09	984,500.00	2.93
21	120004	国开转债	983,900.00	2.92
22	120205	12国开09	983,800.00	2.92
23	120202	12国开07	983,700.00	2.92
24	120207	12国开10	983,600.00	2.92
25	120203	12国开08	983,500.00	2.92
26	120204	12国开08	983,400.00	2.92
27	120004	国开转债	983,300.00	2.92
28	120203	12国开08	983,200.00	2.92
29	120204	12国开08	983,100.00	2.92
30	120004	国开转债	982,900.00	2.92

报告期末按照各项投资比例和市值占基金资产净值比例大小排序的前五名开放式基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：1、本基金不