

银河铭亿3个月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

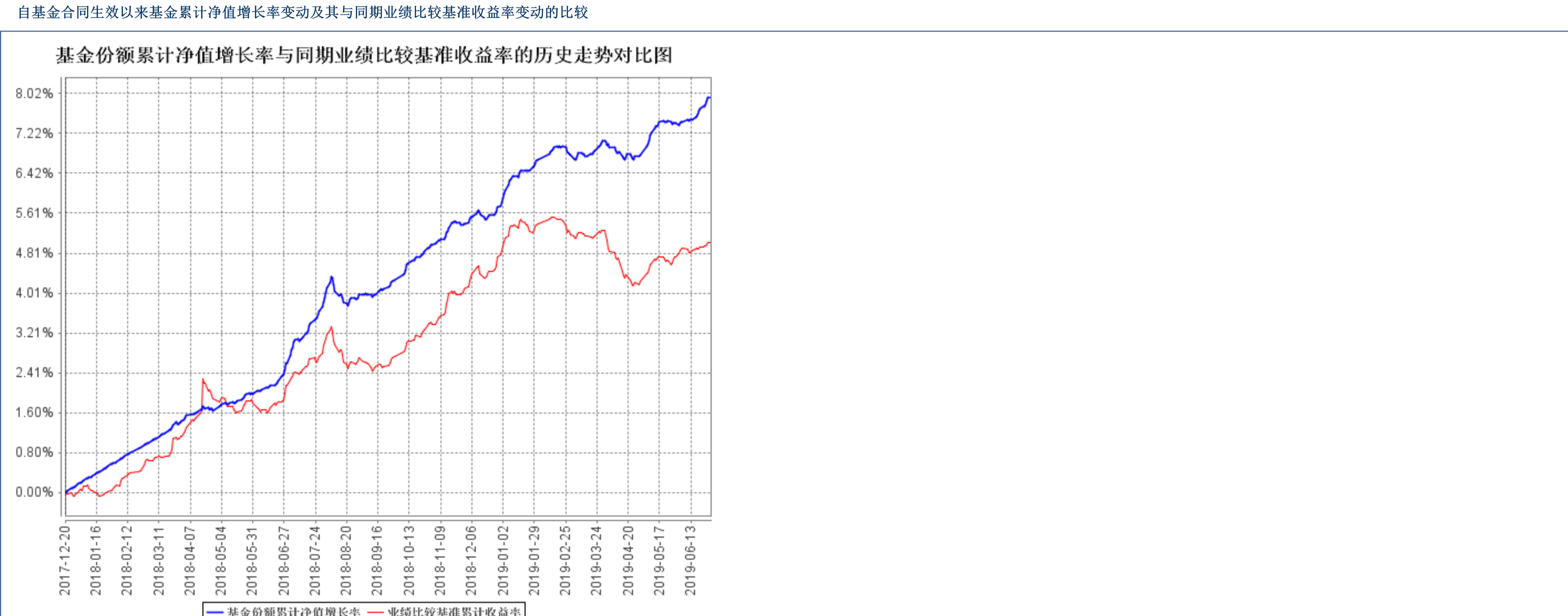
重要提示

基金管理人及基金托管人承诺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。
基金管理人承诺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。
基金管理人承诺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。

基金基本情况
项目 数值
基金名称 银河铭亿3个月定期开放债券
基金代码 005381
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2017-12-20
报告期末基金份额总额 3,114,983,723.47
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。

主要财务指标
主要财务指标 报告期末(2019-06-30) 单位：人民币元
本期已实现收益 40,287,038.41
本期利润 25,634,077.00
加权平均基金份额本期利润 0.0083
期末基金资产净值 3,167,428,983.88
期末基金份额净值 1.0188

基金净值表现
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 业绩比较基准收益率② 净值增长率偏离度③



注：1、本基金合同生效日为2017年12月20日。根据《银河铭亿3个月定期开放债券型发起式证券投资基金合同》规定，本基金自基金合同生效日起6个月内使用建仓期的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至建仓期结束，本基金各项资产配置符合基金合同及招募说明书有关投资比例的规定。

其他指标
其他指标 报告期末(2019-06-30) 单位：人民币元
其他指标 报告期末(2019-06-30)

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

管理人对本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、维护投资者利益”的原则，依照法律法规的规定，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、投资比例和投资组合符合基金合同的约定。

公平交易专项说明
公平交易制度的执行情况
本报告期内，公司旗下管理的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个体收益率差异及分散投资分析(股票、债券)的收益率差异进行了分析。

报告期内基金的投资策略和运作分析
二季度市场波动进一步加剧，债市在央行降准前进一步承压，货币政策边际收紧，经济数据超预期提振各期限国债收益率上行较多，但进入6月份，中美贸易摩擦升温，财政支出在前期透支后开始收缩，经济数据如期下行，加上包商银行事件导致资金面出现紧张，使得债市风险偏好进一步下降，总体债市收益率有所回调，债市收益率整体震荡下行。

报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末基金资产净值为1.0188元，本报告期基金份额净值增长率为50.81%，业绩比较基准收益率为-0.21%。

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(%)

报告期末按行业分类的境内股票投资组合
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
行业类别 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(%)

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(%)

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贵金属投资明细
序号 贵金属代码 贵金属名称 数量(份) 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权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末基金投资的股指期货交易情况说明
注：本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末基金投资的国债期货交易情况说明
注：本基金本报告期末未持有国债期货。

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
国债期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
国债期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)

报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)