银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河文体娱乐混合
场内简称	-
交易代码	005585
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年4月19日
报告期末基金份额总额	35,766,373.92份
投资目标	本基金主要投资于文体娱乐主题相关行业中的优质上市公司,在控制风险、保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金在综合分析多方面因素的基础上,计划将基金资产在股票、债券等大类资产之间灵活配置,按照基金契约,配置文体娱乐产业资产,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。
业绩比较基准	中证文体休闲指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为权益类资产主要投资于文体娱乐主题的混合基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种,其风险收益水平高于货币基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	949,571.31
2.本期利润	-1,388,059.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0363
4.期末基金资产净值	48,656,037.93
5.期末基金份额净值	1.2765

注:1、本期已实现收益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。

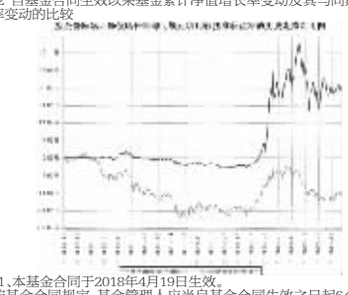
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	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	-0.43%	2.33%	-8.94%	1.24%	8.51%	1.09%

3.2.2 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、本基金合同于2018年4月19日生效。

2、按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定:基金股票投资比例为基金资产的0-95%,其中,投资于本基金定义的文体娱乐主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;权证、股指期货、国债期货等其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。截止2018年10月18日建仓期满,本基金各项资产配置符合合同约定。

3.3 其他指标

注:无

§4 管理人报告

4.1 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
		任职日期	离任日期		
卢秩荇	基金经理	2018年4月19日	-	11	博士研究生学历,11年证券从业经历。曾就职于建设银行,2008年7月加入银河基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理等职。现担任基金经理。2017年12月起担任银河消费驱动混合型证券投资基金的基金经理,2017年4月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年5月起担任银河君欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河新兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年10月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河比较灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起担任银河文体娱乐主题灵活配置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相关行业的从业经历累计年限计算。

4.2 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、勤奋律己、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谋求基金资产的保值和增值,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规定。

随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、勤奋律己、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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析。

针对同向交易部分,本报告期内,公司对旗下管理的所有投资组合(完全复制的指数基金除外),连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公开竞价交易的证券进行了价差分析,并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。

针对反向交易部分,公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易(包括股票和债券)的交易时间、交易价格进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。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量超过该证券当日成交量的5%的情况(完全复制的指数基金除外)。

对于以公司名义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、比例分配的原则对获配额度进行分配。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

上证指数在2019年二季度下跌了3.62 %,波动区间在2822-3288点,深成指下跌了7.35%,中小板指数和创业板指数分别下跌了10.99%和10.75%。

板块方面,二季度市场抱团现象明显,大消费板块持续得到资金流入,而文体娱乐板块市场关注度持续降低。

操作层面上,本基金继续坚持休闲服务、食品饮料、农业、传媒的持仓结构。我们认为随着经济基本面的主见稳定,文体娱乐消费需求将持续释放,其消费形式的体现也将多样化,多个文体娱乐消费子行业可能逐渐体现出机会,而非之前的集中在游戏、影视上。

4.5 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1.2765元;本报告期基金份额净值增长率为-0.43%,业绩比较基准收益率为-8.94%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注: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。

§5 投资组合报告

5.1 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	27,923,167.05	50.30
	其中:股票	27,923,167.05	50.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,518,700.00	6.34
	其中:债券	3,518,700.00	6.34
	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	10,300,000.00	18.91
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,326,812.89	13.56
8	其他资产	6,045,627.50	10.89
9	合计	55,514,307.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,608,060.00	5.71
B	采矿业	29,351.40	0.06
C	制造业	15,709,988.83	34.41
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	3,787,180.00	8.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,516.88	0.05
J	金融业	33,869.94	0.07
K	房地产业	2,711,400.00	5.94
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	60,200.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,961,600.00	6.49
S	综合	-	-
	合计	27,923,167.05	61.16

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 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

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	002511	中顺洁柔	230,000	2,824,400.00	6.19
2	002557	洽洽食品	110,000	2,777,500.00	6.08
3	002157	正邦科技	160,000	2,665,600.00	5.84
4	600977	中国电影	170,000	2,662,200.00	5.83
5	002714	牧原股份	40,000	2,351,600.00	5.15
6	603711	香飘飘	60,000	2,038,200.00	4.46
7	600754	锦江股份	80,000	1,971,200.00	4.32
8	600258	首旅酒店	101,000	1,815,980.00	3.98
9	000043	中航善达	150,000	1,777,500.00	3.89
10	002415	海康威视	50,000	1,379,000.00	3.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,518,700.00	7.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,518,700.00	7.71

5.5 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

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(%)
1	128036	金农转债	10,000	1,355,700.00	2.97
2	128030	天康转债	10,000	1,163,000.00	2.55
3	132018	G三峡EB1	10,000	1,000,000.00	2.19

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未对股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券中,没有发行主体被监管部门立案调查的情形,在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,158.89
2	应收证券清算款	5,800,094.31
3	应收股利	-
4	应收利息	5,695.08
5	应收申购款	172,679.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,045,627.50

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128036	金农转债	1,355,700.00	2.97
2	128030	天康转债	1,163,000.00	2.55

5.11.5 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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	33,486,124.49
报告期期间基金总申购份额	41,665,353.37
减:报告期期间基金总赎回份额	39,385,104.14
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	35,766,373.92

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注:本基金本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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金的文件

2、《银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件

5、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层

9.3 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 /400-820-0860

公司网址:http://www.galaxyasset.com

银河基金管理有限公司
2019年7月18日

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

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年7月18日

§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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银河睿丰定开债券
场内简称	-
交易代码	006086
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月20日
报告期末基金份额总额	2,009,999,000.00份
投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,为参与持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将结合封闭期和开放期的设置,采用不同的投资策略。 封闭期内本基金在债券配置上将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略。(1)久期偏离策略:久期偏离是指对利率水平的预期,在预期利率上升时,增加组合久期,以免承受债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。本基金通过对影响债券投资价值变化的经济因素的分析判断,形成对未来市场利率变动方向的预期,主动调整债券投资组合的久期,提高债券投资组合的收益水平。本基金主要考虑的主要经济因素包括:经济增长、固定资产投资、消费、进出口、货币供应量、通货膨胀率、财政政策、货币政策、汇率、国际收支、证券市场运行状况等宏观经济因素和市场资金面、利率走势、市场投机行为等微观因素。(2)收益率曲线配置策略:本基金通过对债券市场利率期限结构因素的分析判断,形成对未来收益率曲线形状变化的预期,相应地选择子组合久期分布的策略,即采取子组合久期哑铃型、子组合久期梯形或子组合久期子弹型的配置策略。(3)类属配置策略:本基金根据不同类别债券的信用风险、流动性风险、税赋水平、提前还款风险、利率风险、汇率风险、经济周期风险、货币政策风险、国际经济环境风险、证券市场风险、通货膨胀风险、债券发行人的经营状况、债券发行人的信用等级、债券发行人的财务状况、管理水平、债券本身的特性、债券发行人所在行业的发展前景、债券发行人所在地区的经济发展状况、国际、国内宏观经济形势等因素的变化可能带来的风险,发掘市场评级低估的、用债券收益率、久期比可以预测、比较确切地反映市场预期的品种,本基金将在考虑流动性、久期、信用等因素的基础上,对投资组合内的个券做出短期收益率下降和继续持有的决策。如果债券持有人行使回购权,本基金将该债券纳入基金的投资范围。3.资产动态增强策略:以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的变化,采取多种灵活策略,获取超额收益。主要包括:(1)骑乘策略:骑乘策略是指当预期收益率曲线在未来一段时间内保持不变,则通过卖出较短期限的债券,买入较长期限的债券,随着债券剩余期限的缩短,债券的收益率水平将会下降,投资期间内债券的收益率下降,获得资本利得收益。(2)息差策略:息差策略是指通过杠杆操作进行入债券的操作,在短债券会出现变动幅度远远大于长期利率,因此短债会成为低于债券收益率,最可以达到杠杆效应的目的利润。本基金将根据对市场短期利率走势的判断,适当地选择杠杆比率。(3)骑坡策略:骑乘坡策略,即当投资期内的收益率曲线一定时,当期限随时间推移,本基金通过对资产支持证券的资产池的资产种类进行分析,设计资产支持证券的现金流量,并对资产支持证券的现金流量进行预测,并对资产支持证券的现金流量和市场利率变动的关系进行分析,对资产支持证券的现金流量和市场利率变动的预测,在考虑投资资产支持证券时,选择支持流动性品种的风险补偿收益和市场流动性,控制资产支持证券投资的风险,获取较高的投资收益。

(二)封闭期内的投资策略

在开放期内,本基金为保持较高的流动性,在遵守基金合同中有关投资限制与投资比例的前提下,调整配置高流动性的投资品种,通过动态配置资产的期限结构等方式,积极的流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。

业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	20,453,202.56
2.本期利润	9,336,147.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0046
4.期末基金资产净值	2,033,971,276.25
5.期末基金份额净值	1.0129

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。

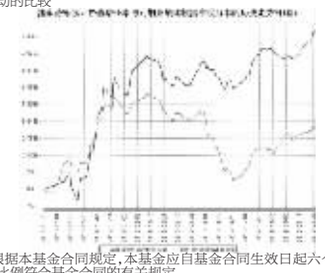
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	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	0.46%	0.04%	-0.24%	0.06%	0.70%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率

3.2.2 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、根据本基金合同规定,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,截至本报告期期末未满一年。

3、截至本报告期末,本基金建仓结束。

3.3 其他指标

注:无。

§4 管理人报告

4.1 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
		任职日期	离任日期		
蒋磊	基金经理	2018年11月20日	-	13	中共党员,硕士研究生学历,13年证券从业经历。曾先后在星辉银行(中国)有限公司、中非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,就职于固定收益部。2016年8月起担任银河兴乐回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理、2017年1月起担任银河招财纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河瑞先债券型证券投资基金的基金经理、2017年4月起担任银河瑞利纯债债券型证券投资基金的基金经理、2017年5月起担任银河稳健纯债债券型证券投资基金的基金经理、2017年7月起担任银河瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、2017年9月起担任银河睿利一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、2017年12月起担任银河稳健纯债债券型证券投资基金的基金经理、2018年2月起担任银河嘉益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿合灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、2018年4月起担任银河睿盛纯债债券型证券投资基金的基金经理、2018年11月起担任银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、2018年12月起担任银河如意债券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相关行业的从业经历累计年限计算。

4.2 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、勤奋律己、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谋求基金资产的保值和增值,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规定。

随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、勤奋律己、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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析。

针对同向交易部分,本报告期内,公司对旗下管理的所有投资组合(完全复制的指数基金除外),连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公开竞价交易的证券进行了价差分析,并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。

针对反向交易部分,公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易(包括股票和债券)的交易时间、交易价格进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。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量超过该证券当日成交量的5%的情况(完全复制的指数基金除外)。

对于以公司名义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、比例分配的原则对获配额度进行分配。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度资金面整体中性偏松,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,后曲线整体逐月下移,曲线形态稍稍走平。短端在4月份资金面收紧及5月末同业刚兑冲击下调整较多,整体小幅上行,长端利率受中美贸易摩擦升级、经济数据下行的影响小幅下行。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,反映了市场机构市场风险偏好进一步下降。

二季度仍以利率债和商业银行金融债为主,小幅降低组合久期,适度保持杠杆增厚收益。

4.5 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%。

4.6 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。

§5 投资组合报告

5.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,281,887,000.00	98.19
	其中:债券	2,281,887,000.00	98.19
	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:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,785,665.95	0.12
8	其他资产	39,222,221.03	1.69
9	合计	2,323,894,886.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,089,154,000.00	102.61
	其中:政策性金融债	659,364,000.00	32.39
4	企业债券	100,180,000.00	4.92
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	92,553,000.00	4.55
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,281,887,000.00	112.08

5.5 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

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(%)
1	170409	17农发09	2,000,000	204,680,000.00	10.05
2	018008	国开1802	2,000,000	203,540,000.00	10.00
3	160306	16进出06	2,000,000	200,140,000.00	9.83
4	1720085	17北京银行绿色金融债	1,900,000	195,339,000.00	9.59
5	1828014	18兴业绿色金融01	1,900,000	192,869,000.00	9.47

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未对股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券中,没有发行主体被监管部门立案调查的情形,在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	39,222,221.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,222,221.03

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,009,999,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	2,009,999,000.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	-	10,000,000.00	0.50	持有期限不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	-	10,000,000.00	0.50	持有期限不少于3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190610	1,999,999,000.00	-	-	1,999,999,000.00	99.50%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇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的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 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财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层

10.3 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