

# 银河丰利纯债债券型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 7 月 21 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 07 月 19 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。

银河泽利保本混合型证券投资基金的保本周期为两年，自银河泽利保本混合型证券投资基金合同生效之日（即 2015 年 4 月 9 日）起至两个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，即 2017 年 4 月 10 日为银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期日。银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期，已根据银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同的规定变更为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变为“519654”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，根据银河泽利基金合同规定，本基金保本周期到期期间为保本周期到期日及其后三个工作日，即本基金的到期期间为（2017 年 4 月 10 日至 4 月 13 日）结束后，即 2017 年 4 月 14 日起，“银河泽利保本混合型证券投资基金”转型为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”。银河丰利纯债债券型证券投资基金基金合同及托管协议即日生效。

## §2 基金产品概况

转型后：

基金简称	银河丰利债券
场内简称	-

交易代码	519654
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 9 日
报告期末基金份额总额	223, 297, 066. 60 份
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。
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	本基金为债券型证券投资基金，属于中低风险收益预期的基金品种，其预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司

注：上表中“报告期末”指 2017 年 6 月 30 日。

转型前：

基金简称	银河泽利保本混合
场内简称	-
交易代码	519654
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 9 日
报告期末基金份额总额	332, 392, 064. 70 份
投资目标	本基金应用优化的恒定比例投资保险策略（优化的 CPPI 策略），并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。
投资策略	本基金运用优化的恒定比例组合保险原理，动态调整保本资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。
基金管理人	银河基金管理有限公司

基金托管人	北京银行股份有限公司
-------	------------

注：上表中“报告期末”指 2017 年 4 月 13 日。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 4 月 14 日 — 2017 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-846,073.67
2. 本期利润	495,747.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0022
4. 期末基金资产净值	227,703,999.25
5. 期末基金份额净值	1.0197

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、银河泽利保本混合型证券投资基金从 2017 年 4 月 14 日正式转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金。

#### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 4 月 1 日 — 2017 年 4 月 13 日）
1. 本期已实现收益	2,334,790.78
2. 本期利润	2,287,870.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0013
4. 期末基金资产净值	338,157,864.49
5. 期末基金份额净值	1.0170

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、银河泽利保本混合型证券投资基金从 2017 年 4 月 14 日正式转型为银河丰利纯债债券型证券

投资基金。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 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

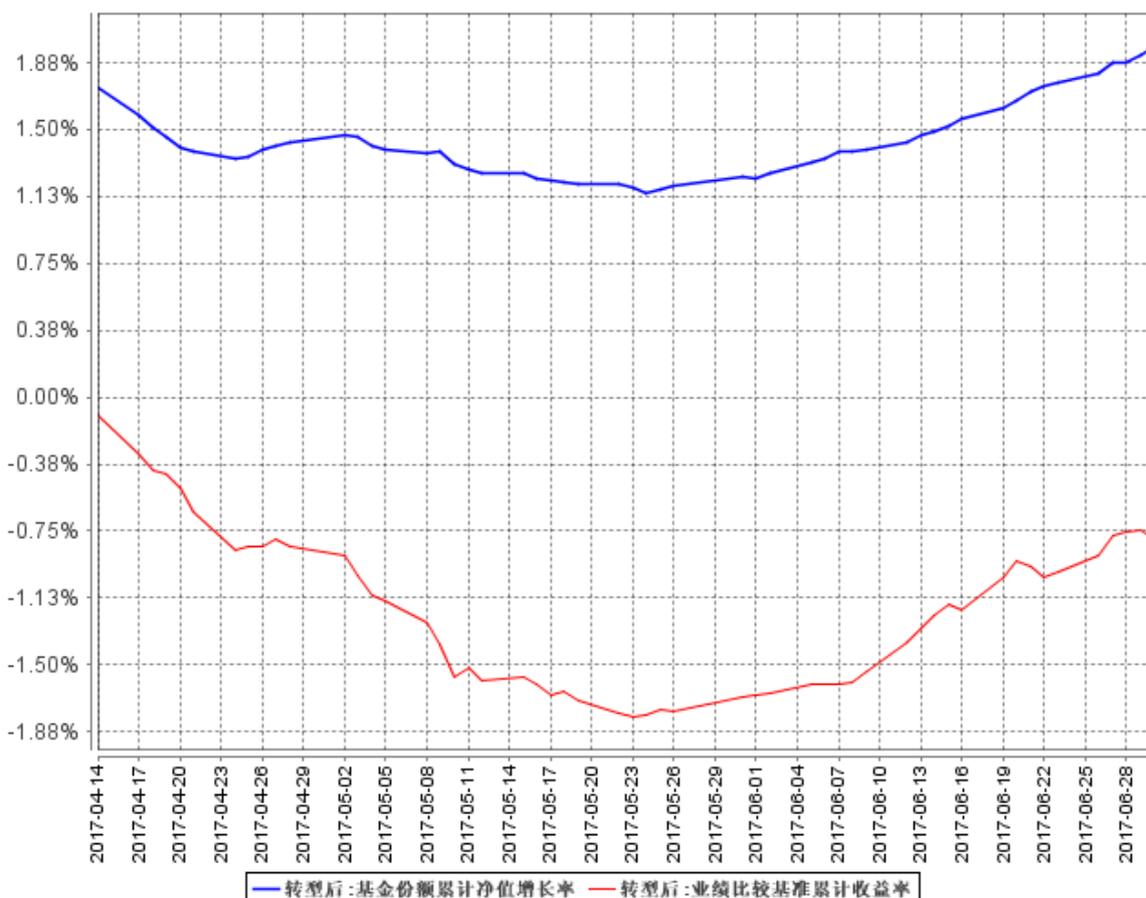
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.27%	0.04%	-0.79%	0.09%	1.06%	-0.05%

注：1、过去三个月指 2017 年 4 月 14 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

2、本基金（转型后）的整体业绩比较基准采用：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

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、本基金于 2017 年 4 月 14 日起转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金。

2、本基金自转型日（2017 年 4 月 14 日）起至 2017 年 6 月 30 日未满一年。

3、按基金合同规定，本基金应自本基金转型日，即 2017 年 4 月 14 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约定。本基金仍处于建仓期。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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

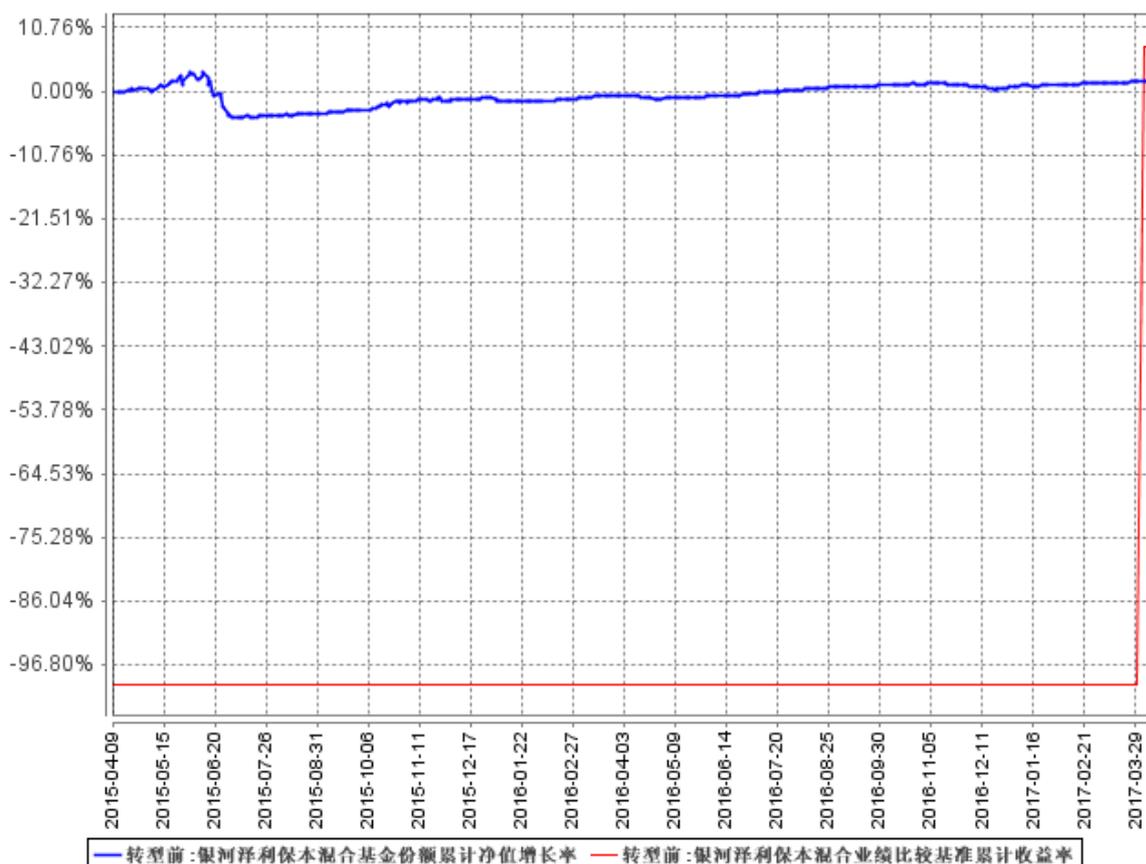
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.10%	0.04%	0.13%	0.02%	-0.03%	0.02%

注：1、业绩比较基准：三年期银行定期存款税后收益率。

2、过去三个月指 2017 年 4 月 1 日起至 2017 年 4 月 13 日止。

#### 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

银河泽利保本混合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、按照基金合同规定，银河泽利保本混合型证券投资基金自 2015 年 4 月 9 日合同生效日起六个月内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（转型前）

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		
韩晶	基金经理	2016年3月10日	-	15	<p>中共党员，经济学硕士，15年证券从业经历，曾就职于中国民族证券有限责任公司，期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。</p> <p>2008年6月加入银河基金管理有限公司，先后担任债券经理助理、债券经理等职务。现任固定收益部负责人、基金经理。</p> <p>2011年8月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理，2012年11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2014年7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理，2015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、银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2015年6月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年3月起担任银河泽利保本混合型</p>

				<p>证券投资基金、银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 5 月起担任银河旺利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 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，2016 年 9 月起担任银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月起担任银河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月起担任银河君怡纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 4 月起担任银河君辉纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河通利债券型证券投资基金 (LOF) 的基金经理、</p>
--	--	--	--	---

					银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理。
祝建辉	基金经理	2016 年 3 月 10 日	-	11	<p>硕士研究生学历，11 年证券从业经历，曾就职于天治基金管理有限公司。</p> <p>2008 年 4 月加入银河基金管理有限公司，主要研究钢铁、煤炭、化工行业，历任研究员、高级研究员、研究部总监助理等职务，现担任基金经理。</p> <p>2015 年 4 月起担任银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2015 年 12 月起担任银河灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，</p> <p>2016 年 2 月起担任银河竞争优势成长混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 3 月起担任银河泽利保本混合型证券投资基金的基金经理，</p> <p>2016 年 11 月起担任银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理。</p>

注：1、上表中任职，离任日期均为我公司做出决定之日。

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。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
韩晶	基金经理	2016 年 3 月 10 日	-	15	中共党员，经济学硕士，15 年证券从业经历，曾就职于中国

				<p>民族证券有限责任公司，期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。</p> <p>2008 年 6 月加入银河基金管理有限公司，先后担任债券经理助理、债券经理等职务。现任固定收益部负责人、基金经理。</p> <p>2011 年 8 月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理，2012 年 11 月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 7 月起担任银河收益证券投资基金的基金经理，2015 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、银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，</p> <p>2016 年 3 月起担任银河泽利保本混合型证券投资基金、银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理，</p> <p>2016 年 5 月起担任银河旺利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 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，</p> <p>2016 年 9 月起担任银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君荣</p>
--	--	--	--	---

					<p>灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月起担任银河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月起担任银河君怡纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 4 月起担任银河君辉纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河通利债券型证券投资基金 (LOF) 的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理。</p>
祝建辉	基金经理	2016 年 3 月 10 日	-	11	<p>硕士研究生学历，11 年证券从业经历，曾就职于天治基金管理有限公司。2008 年 4 月加入银河基金管理有限公司，主要研究钢铁、煤炭、化工行业，历任研究员、高级研究员、研</p>

				究部总监助理等职务，现担任基金经理。 2015 年 4 月起担任银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2015 年 12 月起担任银河灵活配置混合型证券投资基金的基金经理， 2016 年 2 月起担任银河竞争优势成长混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 3 月起担任银河泽利保本混合型证券投资基金的基金经理， 2016 年 11 月起担任银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、上表中任职，离任日期均为我公司做出决定之日。

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合规守信情况的说明

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》及其各项管理办法、《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，努力实现基金持有人的利益，无损害基金持有人利益的行为，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健的风险回报。

#### 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。

#### 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

报告期内，国内外主要经济体经济运行保持回暖态势。美联储推进资产负债表正常化，6 月份再次加息，并计划择机启动缩表，美元指数持续走弱。海外发达经济体股票市场均保持上涨态势，大宗商品普遍回调。国内房地产调控政策的效果已逐步显现，企业补库存动力开始下降，大宗商品价格走弱，PPI 增速按预期触顶回落。CPI 持续回升，但幅度要低于市场预期。二季度，金融去杠杆成为影响市场的主要因素。实体经济非标融资受阻，导致社会融资规模环比持续下滑，也导致非标信用派生骤降，企业中长期贷款出现了明显回落，M2 增速大幅低于预期，已开始跌入个位数区间。

货币政策维持中性稳健原则。但在金融去杠杆的政策指导下，银行收缩同业杠杆，导致中小银行负债压力巨大，同业存单呈现“量缩价升”态势，持续推升市场短端利率中枢。债券市场整个二季度收益率上行明显。尤其对信用品种来讲，二季度调整幅度较利率品种要大，信用利差走阔，受此影响信用债发行仍然持续萎缩。直至 6 月初流动性转好，才促成债券市场开始反弹。

转债市场除个别券种受益于正股的持续走强外，大多转债二季度前期走势整体表现较弱。后期转债品种亦受益于流动性改善预期，表现出一波系统性行情。新股期初仍保持发行节奏，后续开始明显缩量。股票市场出现较为明显地回调，加之监管对短期炒作行为的抑制措施，新股上市开板涨幅大幅回落，对打新收益造成挤压。打新收益对大规模资金来讲已成为鸡肋，该类产品的表现更多地依赖股票底仓及债券配置的贡献。

在监管趋严、流动性趋紧的背景下，权益市场回调，市场结构性分化。低估值、行业短期成

长性明确的龙头股持续上涨，小盘股继续杀估值，周期类行业回撤也非常明显。受政策规划影响，“雄安概念”成为二季度主题投资亮点，至季末也开始出现分化。

二季度，原银河泽利保本基金保本周期到期，顺利转型为银河丰利纯债基金。规模由原先 22 亿缩减为目前的 2.2 亿。转型后，银河丰利基金封闭运作 3 个月，在此期间基金以持续减持信用债为主，减持后的资产配置银行存款类资产，期限与 7 月封闭期打开相匹配。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

自 2017 年 4 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日银河丰利纯债债券型证券投资基金份额净值增长 0.27%，同期比较基准增长率为 -0.79%。

自 2017 年 4 月 1 日至 2017 年 4 月 13 日银河泽利保本混合型证券投资基金份额净值增长 0.10%，同期比较基准增长率为 0.13%。

#### 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

转型后：

#### 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	1,064,986.65	0.47
	其中：股票	1,064,986.65	0.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	133,094,640.60	58.33
	其中：债券	133,094,640.60	58.33
	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	79,435,329.15	34.81
	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	12,088,790.51	5.30
8	其他资产	2,491,170.41	1.09
9	合计	228,174,917.32	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,064,986.65	0.47
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,064,986.65	0.47

### 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沪港通股票。

## 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	603660	苏州科达	26,007	1,064,986.65	0.47

## 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	9,957,000.00	4.37
	其中：政策性金融债	9,957,000.00	4.37
4	企业债券	73,097,000.00	32.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,030,000.00	13.19
7	可转债（可交换债）	84,640.60	0.04
8	同业存单	19,926,000.00	8.75
9	其他	-	-
10	合计	133,094,640.60	58.45

## 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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	124249	13 大城投	700,000	42,658,000.00	18.73
2	101565005	15 水电物资 MTN001	300,000	30,030,000.00	13.19
3	1480507	14 抚顺城投小微债 01	200,000	20,366,000.00	8.94
4	111710282	17 兴业银行 CD282	200,000	19,926,000.00	8.75
5	1480546	14 攀城投小微债	100,000	10,073,000.00	4.42

## 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国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.10.2

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	148,632.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,342,537.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,491,170.41

### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603660	苏州科达	1,064,986.65	0.47	新股锁定

注：本基金持有的股票“苏州科达”为网下申购新股中签，中签部分为认购网下老股东的转让部分，自愿设定 12 个月锁定期，锁定期自本次公开发行的股票在上交所上市交易之日起开始计算。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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。

转型前：

#### 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	1,768,143.72	0.21
	其中：股票	1,768,143.72	0.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	186,329,784.80	21.73
	其中：债券	186,329,784.80	21.73
	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	665,729,561.44	77.63
8	其他资产	3,690,047.79	0.43
9	合计	857,517,537.75	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	857,450.79	0.25
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	910,692.93	0.27
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,768,143.72	0.52

### 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沪港通股票。

### 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	300508	维宏股份	10,383	910,692.93	0.27
2	603660	苏州科达	26,007	857,450.79	0.25

### 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	155,924,000.00	46.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,318,000.00	8.97
7	可转债（可交换债）	87,784.80	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	186,329,784.80	55.10

**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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1180065	11 沈国资债	600,000	62,346,000.00	18.44
2	124249	13 大城投	700,000	42,791,000.00	12.65
3	101565005	15 水电物资 MTN001	300,000	30,318,000.00	8.97
4	1480507	14 抚顺城投小微债 01	200,000	20,408,000.00	6.04
5	1180100	11 清河投资债	500,000	20,285,000.00	6.00

**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：本基金本报告期末进行股指期货投资。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

股指期货不在本基金投资范围之内，报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

**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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2

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	183,091.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,506,955.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,690,047.79

### 5.11.4 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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300508	维宏股份	910,692.93	0.27	新股锁定
2	603660	苏州科达	857,450.79	0.25	新股锁定

注：本基金持有的股票“苏州科达”和“维宏股份”为网下申购新股中签，中签部分为认购网下老股东的转让部分，自愿设定 12 个月锁定期，锁定期自本次公开发行的股票在上交所上市交易

之日起开始计算。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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（转型后）

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	223,297,066.60
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	223,297,066.60

注：1、此表中合同生效日指本基金的转型日，即本基金于 2017 年 4 月 14 日起转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金。

2、报告期期间指 2017 年 4 月 14 日起至 2017 年 6 月 30 日止。报告期期初指 2017 年 4 月 13 日，报告期期末指 2017 年 6 月 30 日。

## §6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,198,959,109.56
报告期期间基金总申购份额	4,098.42
减：报告期期间基金总赎回份额	1,866,571,143.28
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	332,392,064.70

注：报告期期间指 2017 年 4 月 1 起日至 2017 年 4 月 13 日止。报告期期初指 2017 年 3 月 31 日，报告期期末指 2017 年 4 月 13 日。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

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（转型后）

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

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（转型前）

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：本基金本报告期内无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

银河丰利纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由银河泽利保本混合型证券投资基金（以下简称“银河泽利保本混合”）转型而来。银河泽利保本混合于 2017 年 4 月 10 日保本周期到期，按照《银河泽利保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，于其保本周期到期期间截止日的次日，即 2017 年 4 月 14 日起转型为债券型基金，名称相应变更为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”，基金代码保持不变。

## §9 备查文件目录

### 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河丰利纯债债券型证券投资基金的文件
- 2、《银河丰利纯债债券型证券投资基金合同》
- 3、《银河丰利纯债债券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、银河丰利纯债债券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

## 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  
2017年7月21日