

**银河君辉 3个月定期开放债券型发起式证  
券投资基金  
2017年第 3季度报告**

2017年 9月 30日

**基金管理人：银河基金管理有限公司**

**基金托管人：交通银行股份有限公司**

**报告送出日期：2017年 10月 26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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 24 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。

银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由银河君辉纯债债券型证券投资基金转型而来。上述基金转型获中国证监会《关于准予银河君辉纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2017】1464号），并经银河君辉纯债债券型证券投资基金份额持有人大会决议通过。

自 2017 年 9 月 21 日起，《银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，原《银河君辉纯债债券型证券投资基金基金合同》同日失效。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

转型后：

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 银河君辉 3 个月定开债券   |
| 场内简称       | -   |
| 交易代码       | 519632  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2017 年 9 月 21 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 101,167,329.87 份  |
| 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。   |
| 投资策略       | 本基金以自上而下的分析方法为基础，依据国内外宏观经济、物价、利率、汇率、流动性、风险偏好等变化趋势，拟定债券资产配置策略。本基金依据各固定收益品种绝对收益率水平、流动性、供求关系、信用风险环境和利差波动趋势、利率敏 |

|        |  |
|--------|--|
|        | 感性、机构投资者行为倾向等进行综合分析,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的管理构建及调整固定收益投资组合。  |
| 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,属于较低风险/收益的产品。 |
| 基金管理人  | 银河基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司   |

注:上表中“报告期末”指 2017 年 9 月 30 日。

转型前:

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 银河君辉债券   |
| 场内简称       | -  |
| 交易代码       | 519632   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2017 年 4 月 20 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 101,396,030.55 份   |
| 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。  |
| 投资策略       | 本基金以自上而下的分析方法为基础,依据国内外宏观经济、物价、利率、汇率、流动性、风险偏好等变化趋势,拟定债券资产配置策略。本基金依据各固定收益品种绝对收益率水平、流动性、供求关系、信用风险环境和利差波动趋势、利率敏感性、机构投资者行为倾向等进行综合分析,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的管理构建及调整固定收益投资组合。 |
| 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,属于较低风险/收益的产品。   |
| 基金管理人      | 银河基金管理有限公司   |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司   |

注:上表中“报告期末”指 2017 年 9 月 20 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 9月 21日 - 2017年 9月 30日 ) |
|----------------|------------------------------------|
| 1 本期已实现收益      | 64,471.56                          |
| 2 本期利润         | 63,271.56                          |
| 3 加权平均基金份额本期利润 | 0.0006                             |
| 4 期末基金资产净值     | 102,559,358.53                     |
| 5 期末基金份额净值     | 1.0138                             |

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 银河君辉纯债债券型证券投资基金从 2017年 9月 21日正式转型为银河君辉 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

4 上表中“期末”指 2017年 9月 30日。

#### 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 7月 1日 - 2017年 9月 20日 ) |
|----------------|-----------------------------------|
| 1 本期已实现收益      | 723,947.62                        |
| 2 本期利润         | 749,147.62                        |
| 3 加权平均基金份额本期利润 | 0.0065                            |
| 4 期末基金资产净值     | 102,727,897.98                    |
| 5 期末基金份额净值     | 1.0131                            |

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 银河君辉纯债债券型证券投资基金从 2017年 9月 21日正式转型为银河君辉 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

4 上表中“期末”指 2017年 9月 20日。

### 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

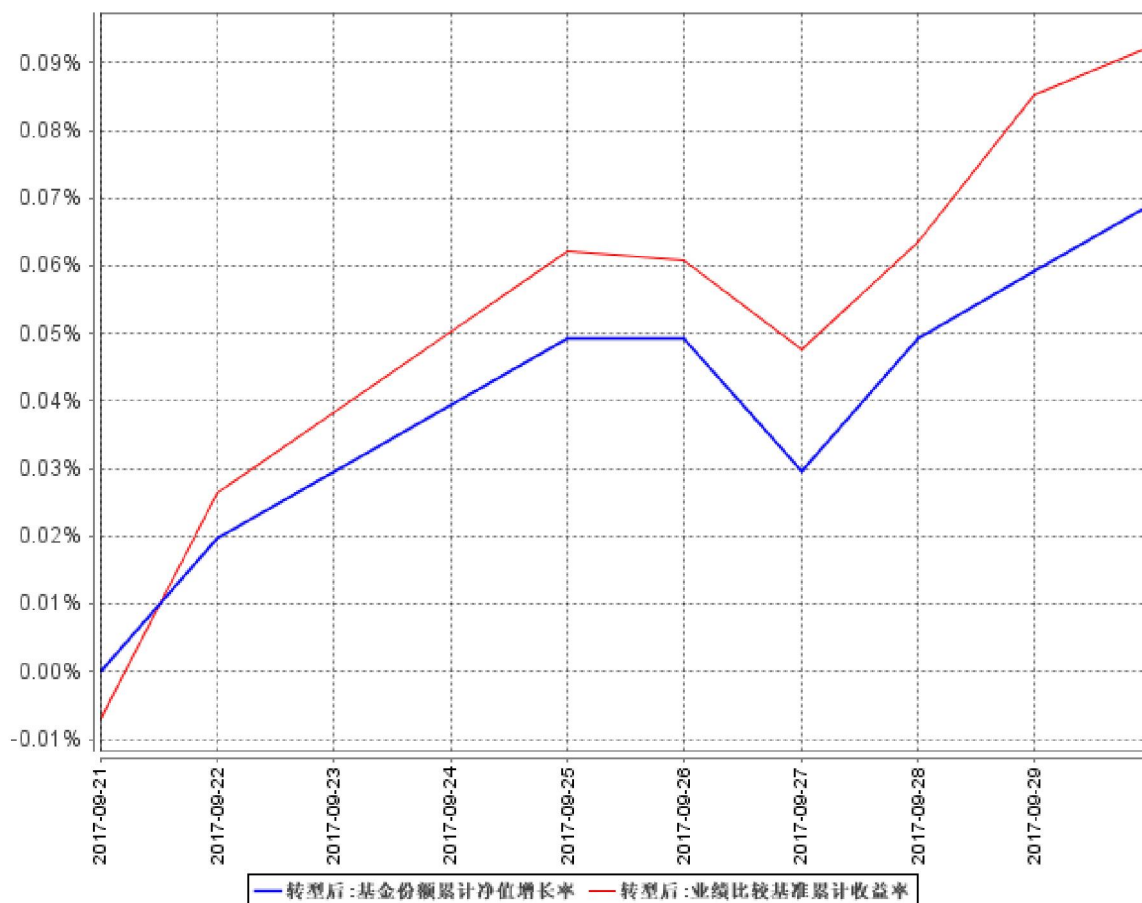
| 阶段    | 净值增长率 | 净值增长率<br>标准差 | 业绩比较基<br>准收益率 | 业绩比较基<br>准收益率标准差 | -      | -     |
|-------|-------|--------------|---------------|------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.07% | 0.02%        | 0.09%         | 0.02%            | -0.02% | 0.00% |

注：1 过去三个月指 2017 年 9 月 21 日起至 2017 年 9 月 30 日止。

2 本基金业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率，每日进行再平衡过程。

#### 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 9 月 21 日起转型为银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

2 本基金自转型日（2017 年 9 月 21 日）起至 2017 年 9 月 30 日未满一年。

3 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：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。报告期末仍处建仓期。

### 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

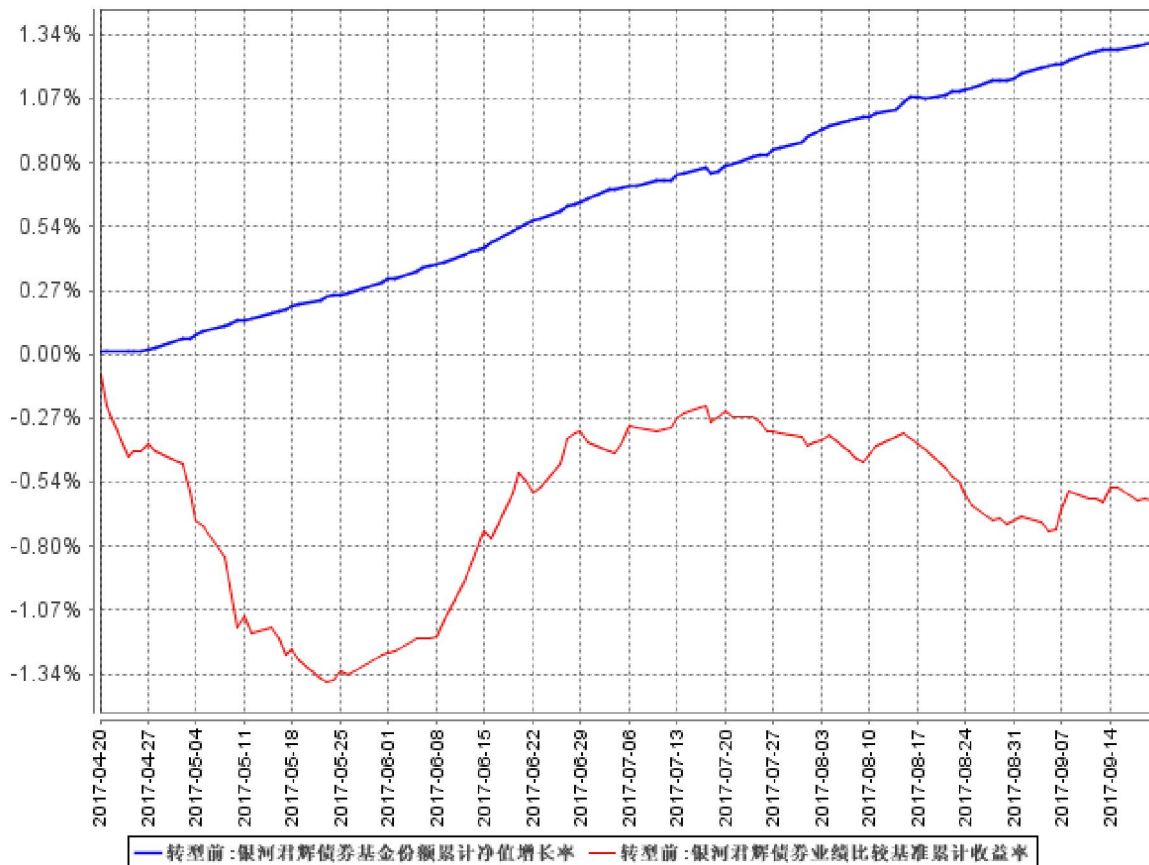
| 阶段    | 净值增长率 | 净值增长率<br>标准差 | 业绩比较基<br>准收益率 | 业绩比较基准<br>收益率标准差 | -     | -      |
|-------|-------|--------------|---------------|------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.66% | 0.01%        | -0.24%        | 0.04%            | 0.90% | -0.03% |

注：1 本基金业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率，每日进行再平衡过程。

2 过去三个月指 2017 年 7 月 1 日起至 2017 年 9 月 20 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

银河君辉债券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 本基金合同生效于 2017 年 4 月 20 日，自 2017 年 9 月 21 日起转型为银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

2 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：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。报告期末仍处建仓期。

### 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 |        |   |
| 蒋磊 | 基金经理 | 2017年 4月<br>20日 | -    | 11     | 硕士研究生学历，11年证券从业经历。曾先后在星展银行(中国)有限公司、中宏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月起担任银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理、银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2017年1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月起担任银河君欣纯债债券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，2017 年 9 月起担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。   |
| 韩晶 | 基金经理 | 2017 年 4 月 20 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。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。现任固定收益部总监、基金经理。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 |



|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>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、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，2017年 9月起担任银河嘉祥</p> |
|--|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |                     |
|--|--|--|--|--|---------------------|
|  |  |  |  |  | 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------|

注：1 上表中任职日期均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。

#### 4.1 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 | 2017年 4月<br>20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。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。现任固定收益部总监、基金经理。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 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>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、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，2017年 9月起担任银河嘉祥</p> |
|--|--|--|--|--|

|    |      |            |   |    |   |
|----|------|------------|---|----|---|
|    |      |            |   |    | 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。   |
| 蒋磊 | 基金经理 | 2017年4月20日 | - | 11 | <p>硕士研究生学历，11年证券从业经历。曾先后在星展银行(中国)有限公司、中宏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月起担任银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理、银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2017年1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月起担任银河君欣纯债债券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，2017年9月起担任银河嘉</p> |

|  |  |  |  |  |                      |
|--|--|--|--|--|----------------------|
|  |  |  |  |  | 祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|----------------------|

注：1 上表中任职日期均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》、《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

整体来看债券市场三季度呈现震荡格局。

六月初债市收益率触及高点，3个月同业存单上行至5.0%，10年国债达到3.7%，10年国开达到4.35%，但央行随后开始释放了一定的放松信号，随后债券收益率从6月初的高位逐步回落，收益率曲线逐步陡峭化下行，到7月中旬降到阶段性低点，3个月存单利率回落到4.15%，10年国债回落到3.55%，但随后因为财政存款的大幅上升（7月份财政存款上市1.1万亿，创历史单月最高升幅），导致超储率降至年内新低，资金面再度收紧，而央行担忧债券杠杆回升较快，也没有进一步引导放松，资金面收紧重新推升货币市场利率，加上8、9月份同业存单到期高峰来临，同业存单利率再度快速回升。6月以来大宗商品价格的强势上涨也引起了市场对通胀的隐忧，商品和国债期货联动，又进而影响到债券现货，10年国债收益率在9月初回升到3.67%，10年国开债收益率最高触及4.35%。在收益率逼近6月初高点的时候，央行再度加大MLF投放力度，且3个月存单发行利率被窗口指导后回落，再度确立了利率的顶部特征，因此利率水平再度掉头向下，存单和债券收益率再度回落。

信用债方面，收益率随利率债波动，但受流动性溢价影响，波动幅度更大。AAA信用债收益率在5月率先下行，AA和AA+收益率在6、7月随后下行，至7月上旬，AAA累计下行约50bp，AA累计下行约100bp。但7月中旬至9月初利率债收益率反弹时，信用债收益率上行幅度较小，整体上行约30bp。随着9月份利率债收益率再度回落，信用债收益率又下行10到20bp。目前，信用债的期限利差和评级利差都压缩至历史地位，

三季度中证转债上涨9.78%，平价指数上涨3.2%。转债市场又经历了一轮“双轮驱动”。行情目前转债估值已经不低，随9月初股市调整，转债市场也迎来一波调整。

三季度主要是到期资产的再投资，维持短久期的票息策略。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

自2017年9月21日至2017年9月30日银河3个月定期开放债券型发起式证券投资基金份额净值增长0.07%，同期比较基准增长率为0.09%。

自2017年7月1日至2017年9月20日银河君辉纯债债券型证券投资基金份额净值增长

0.66%，同期比较基准增长率为 -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

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              | -              | -            |
|    | 其中：股票             | -              | -            |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 11,977,200.00  | 11.57        |
|    | 其中：债券             | 11,977,200.00  | 11.57        |
|    | 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          | 89,000,000.00  | 85.99        |
|    | 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      | 2,350,454.78   | 2.27         |
| 8  | 其他资产              | 177,239.74     | 0.17         |
| 9  | 合计                | 103,504,894.52 | 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：本基金本报告期末持有股票投资。

#### 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

注：本基金本报告期末持有股票投资。

#### 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      | 11,977,200.00 | 11.68        |
| 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) | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 11,977,200.00 | 11.68        |

#### 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  | 019557 | 17国债03 | 120,000 | 11,977,200.00 | 11.68        |

#### 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

本基金不参与国债期货投资。

##### 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:本基金不参与国债期货投资。

##### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金不参与国债期货投资。



## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1

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

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   | 850.78     |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 176,388.96 |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 177,239.74 |

### 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

无。

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   | -             | -            |
|    | 其中：股票  | -             | -            |
| 2  | 基金投资   | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 11,978,400.00 | 11.61        |
|    | 其中：债券  | 11,978,400.00 | 11.61        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 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          | 88,000,000.00  | 85.26  |
|   | 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      | 2,970,181.75   | 2.88   |
| 8 | 其他资产              | 268,813.25     | 0.26   |
| 9 | 合计                | 103,217,395.00 | 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：本基金本报告期末持有股票投资。

### 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

注：本基金本报告期末持有股票投资。

## 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      | 11,978,400.00 | 11.66        |
| 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） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 11,978,400.00 | 11.66        |

## 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  | 019557 | 17国债 03 | 120,000 | 11,978,400.00 | 11.66        |

## 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

注：本基金本报告期末进行股指期货投资。

## 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

本基金不参与国债期货投资。

### 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：本基金不参与国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金不参与国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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

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   | 850.78     |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 267,962.47 |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 268,813.25 |

**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**

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（转型后）**

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（ 2017年 9月 21日 ）基金份额总额      | 101,396,030.55 |
| 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            | 228,700.68     |
| 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                        | 101,167,329.87 |

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 9月 21日起转型为银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

2 报告期期间指 2017年 9月 21日起至 2017年 9月 30日止。报告期期初指 2017年 9月 20日，

报告期期末指 2017 年 9 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               | 136,479,531.56 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 9.82           |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 35,083,510.83  |
| 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               | 101,396,030.55 |

注：报告期期间指 2017 年 7 月 1 起日至 2017 年 9 月 20 日止。报告期期初指 2017 年 6 月 30 日，报告期期末指 2017 年 9 月 20 日。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 7.1 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 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   | -      | -               | -      | -               | -          |
| 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          | -      | -               | -      | -               | -          |

注：2017年 9月 21日《银河君辉 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，《银河君辉纯债债券型证券投资基金基金合同》同时失效，银河君辉纯债债券型证券投资基金正式变更为银河君辉 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金。自《银河君辉 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效日（含生效日当日）起进入首个开放期，自 2017年 9月 21日（含该日）至 2017年 10月 25日（含该日）期间的工作日的交易时间，银河君辉 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金接受投资人的申购、赎回申请。自 2017年 10月 26日起银河君辉 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金将进入第一个封闭期并暂停申购、赎回。

## § 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              | 20170701-20170930       | 98,021,050.00 | -    | -    | 98,021,050.00 | 96.89% |
|   | 2              | 20170701-20170930       | 30,008,450.00 | -    | -    | 30,008,450.00 | 29.66% |
| 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

银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由银河君辉纯债债券型证券投资基金转型而来。上述基金转型获中国证监会《关于准予银河君辉纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2017】1464号），并经银河君辉纯债债券型证券投资基金份额持有人大会决议通过。

自 2017 年 9 月 21 日起，《银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，原《银河君辉纯债债券型证券投资基金基金合同》同日失效。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

转型前：

- 1 中国证监会批准设立银河君辉纯债债券型证券投资基金的文件

- 2 《银河君辉纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 3 《银河君辉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 银河君辉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

转型后：

- 1 中国证监会批准设立银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的文件
- 2 《银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3 《银河君辉 3 个月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 银河君辉 3 个月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 10 月 26 日