

# 银河泰利纯债债券型证券投资基金 2018年第 3季度报告

2018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：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2018年 10月 24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 2018 年 10 月 22 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。

银河润利保本混合型证券投资基金于 2016 年 8 月 4 日第一个保本周期到期，第一个保本周期到期后基金符合进入下一保本周期的条件，经与托管人协商一致，基金进入第二个保本周期，保本周期为二年，自 2016 年 8 月 16 日起至 2018 年 8 月 16 日止（如该日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日）。根据银河润利基金合同及相关法律法规规定，“如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金在到期期间截止日次日起转型为非保本的债券型证券投资基金，基金名称相应变更为‘银河泰利纯债债券型证券投资基金’。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。”，本基金在第二个保本周期届满时，未能符合本基金基金合同及相关法律法规规定的存续条件；在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经与基金托管人北京银行股份有限公司协商，我公司研究决定（相关详见附件），根据基金合同规定及相关法规要求，本基金将转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”（以下简称“银河泰利”）。转型后基金托管人及基金登记机构不变，本基金两类基金代码保持不变。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法及基金费率等按照《银河泰利纯债债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。其中，本基金保本周期到期期间（自 2018 年 8 月 16 日起至 2018 年 8 月 21 日止）截止日的次日，即 2018 年 8 月 22 日起“银河润利保本混合型证券投资基金”转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”，银河泰利纯债债券型证券投资基金的基金合同及托管协议于该日生效。

## § 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	银河泰利债券	
场内简称	-	
交易代码	519675	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年 8月 22日	
报告期末基金份额总额	293,233,924.54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:三年期银行定期存款税后收益率。	
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	
下属分级基金的基金简称	银河泰利债券 A	银河泰利债券 I
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	519675	519648
报告期末下属分级基金的份额总额	142,409,348.34份	150,824,576.20份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

转型前：

基金简称	银河润利混合
场内简称	-
交易代码	519675
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 8月 6日
报告期末基金份额总额	305,358,085.26份
投资目标	本基金应用优化的恒定比例投资保险策略,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,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,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	北京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	银河润利混合 A	银河润利混合 I
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	519675	519648
报告期末下属分级基金的份额总额	154,533,509.06份	150,824,576.20份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

注：基金保证人：中合中小企业融资担保股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2018年 8月 22日 - 2018年 9月 30日 ）	
	银河泰利债券 A	银河泰利债券 I
1.本期已实现收益	374,056.46	384,837.68
2.本期利润	507,336.09	525,156.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0036	0.0035
4.期末基金资产净值	146,128,200.23	153,849,179.98
5.期末基金份额净值	1.0261	1.0201

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。

#### 3.1主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 ( 2018年 7月 1日 - 2018年 8月 21日 )	
	银河润利混合 A	银河润利混合 I
1 本期已实现收益	70,754.53	-433,552.38
2 本期利润	335,827.98	-58,139.76
3 加权平均基金份额本期利润	0.0009	-0.0002
4 期末基金资产净值	158,017,818.44	153,324,023.31
5 期末基金份额净值	1.0225	1.0166

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（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

##### 银河泰利债券 A

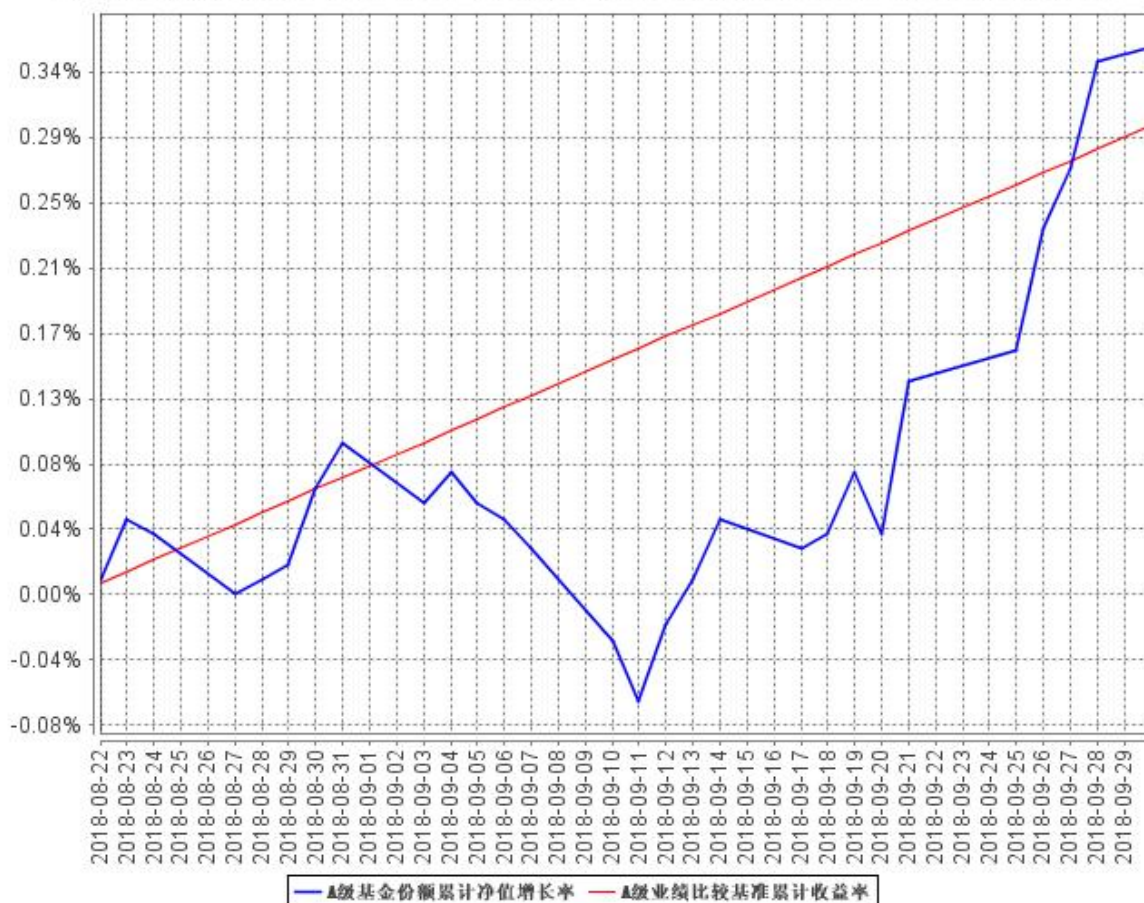
阶段	净值增长率	净值增长率 标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基准收 益率标准差	-	-
过去三个月	0.35%	0.04%	0.30%	0.01%	0.05%	0.03%

##### 银河泰利债券 I

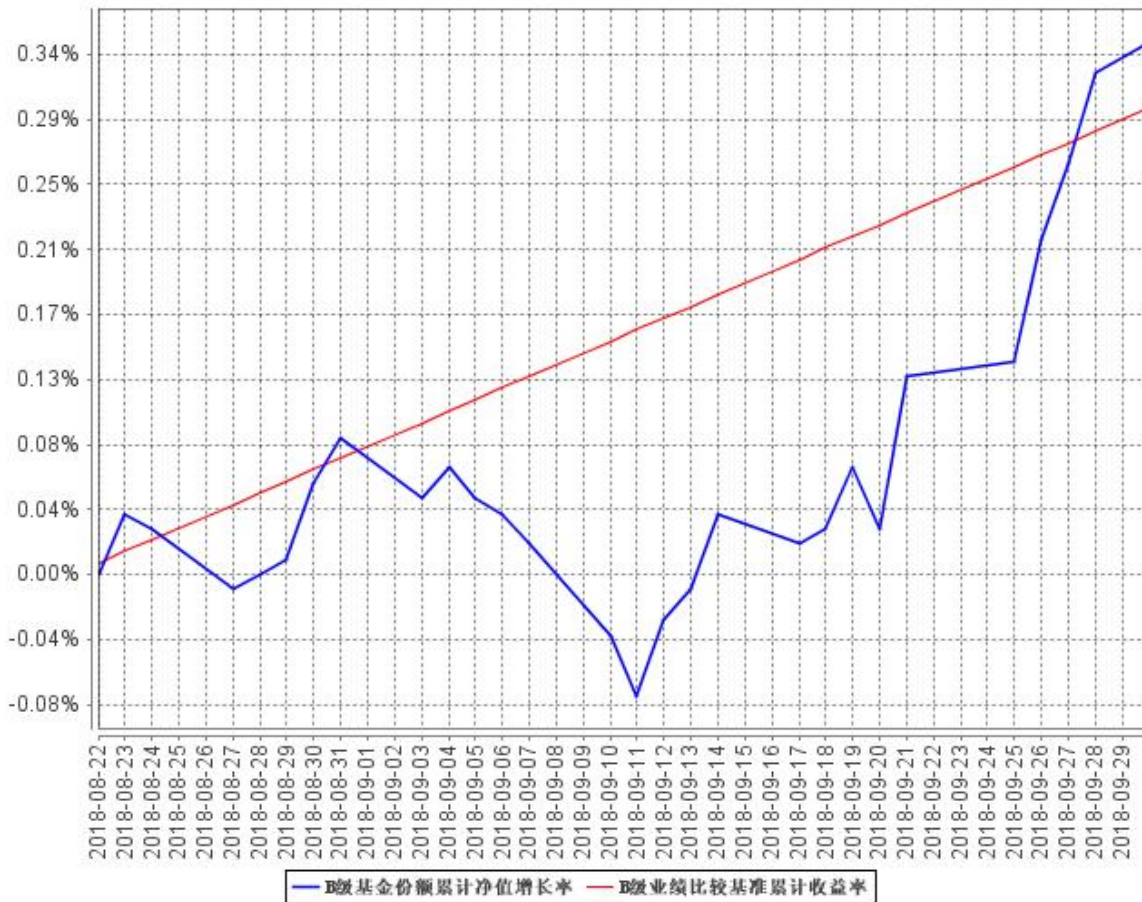
阶段	净值增长率	净值增长率 标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基准收 益率标准差	-	-
过去三个月	0.34%	0.04%	0.30%	0.01%	0.04%	0.03%

### 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

A级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



B级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 本基金由“银河润利保本混合型证券投资基金”转型而来。“银河润利保本混合型证券投资基金”于 2018 年 8 月 16 日保本到期，于 2018 年 8 月 22 日转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”。

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：本基金投资的债券等固定收益类资产占基金资产的不低于 60%，股票等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，全部权证市值不得超过基金资产的 3%，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。截至本季度末仍处于建仓期。

### 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

银河润利混合 A

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	0.10%	0.09%	0.39%	0.01%	-0.29%	0.04%

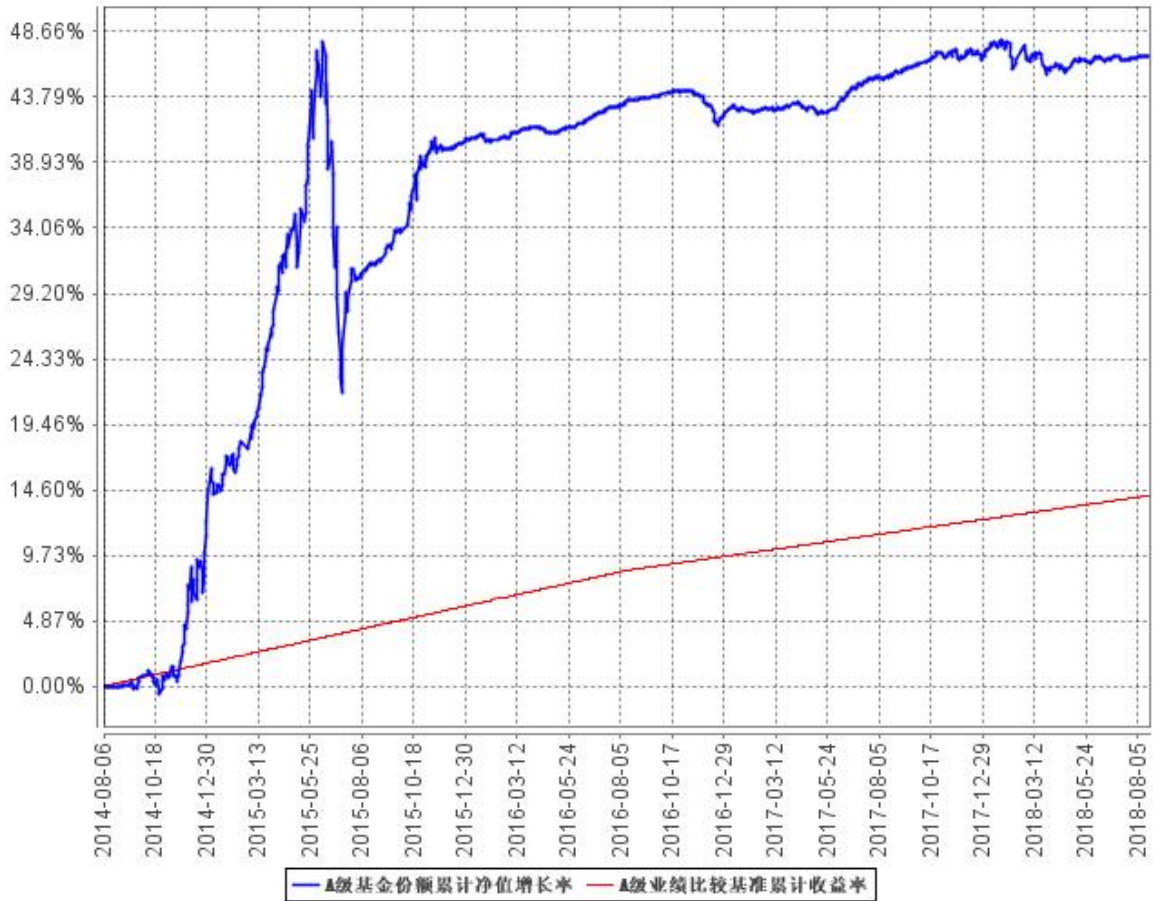
银河润利混合 I

阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	-	-

	率	标准差	准收益率	益率标准差		
过去三个月	0.08%	0.05%	0.39%	0.01%	-0.31%	0.04%

### 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

A级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





I级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 2015 年 11 月 19 日 I 类级别开始持有份额，基金分为 A 级和 I 级。

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：本基金投资的债券等固定收益类资产占基金资产的不低于 60%，股票等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，全部权证市值不得超过基金资产的 3%，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。截止 2014 年 2 月 6 日建仓期满，本基金各项资产配置符合合同约定。

3 本基金于 2018 年 8 月 16 日保本到期，于 2018 年 8 月 22 日转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”。

### 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	-	16	中共党员，经济学硕士，16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、银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016年12月起担任银河君润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、银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018年2月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年3月起担任银河鑫月享6个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
祝建辉	基金经理	2016年11月17日	-	12	硕士研究生学历，12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、研究部总监助理等职务，现担任基金经理。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，2017年10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。

注：1 上表中任职日期均为公司作出决定之日。

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	2018年8月22日	-	16	中共党员，经济学硕士，16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月起担任银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016年12月起担任银河君润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、银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018年2月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年3月起担任银河鑫月享6个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年8月起担任银河泰利纯债债券型证券投资基金的基金经理。
祝建辉	基金经理	2018年8月22日	2018年9月13日	12	中共党员，硕士研究生学历，12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、研究部总监助理等职务，现担任基金经理。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，2017年10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。

注：1 上表中任职日期均为公司作出决定之日。

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》、《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

三季度，国内经济数据稳中有降，社融数据持续走弱，固定资产投资和工业增加值双双回落，PPI 仍然保持缓慢下行趋势不变，CPI 在原油、猪瘟、洪灾、房租价格等影响下出现一定程度的反弹。随着金融去杠杆的推进，去杠杆已明显传导至实体，企业融资环境恶化，债务违约事件频现；基建持续走弱，加之中美贸易战导致外需未来面临着较大不确定性。在此背景下，金融政策从上半年的“宽货币、紧信用”向“宽货币、宽信用”转变。政治局会议首次提出“六稳”，资管新规的补充通知较之前监管态度明显偏松，央行 MPA 资本充足率指标调降，国常会释放基建项目要保证在建工程资金的接续等政策都指向信用政策的放松。

三季度债券市场主要矛盾由货币政策转换为信用政策和地方债供给。长端债券收益率先下后上，呈震荡上行趋势，10 年期国开债到期收益率上行 8BP。短端收益率在宽松的货币政策下震荡下行，1 年期国开债到期收益率回落 32BP。曲线呈现陡峭化趋势。信用债收益率跟随利率债向上调整。城投债受益于宽信用政策，与产业债利差收窄。

权益市场方面，在经济持续下行压力加大的情形下，企业盈利出现下滑。市场所期待的减费、降税等改革措施也不及预期，加之对居民杠杆高制约消费能力的担忧上升，权益市场出现了持续下跌的局面。但是持续下跌的市场也使得很多行业具备了估值底的特征，季末权益市场出现了明显的技术性反弹行情。

可转债方面，中证转债指数先涨后跌，整体表现很弱，转债市场平价整体下行，交易量持续萎缩，转债估值整体处于底部。转债市场无趋势性行情，仅有下修转股价的个券和银行转债存在结构性机会。

报告期内，基金从保本型基金正式过渡到纯债型基金，基金固定收益资产配置主要以变现长久期债券，置换成与保本周期相吻合的存款类资产为主。基金季初将股票资产全部清仓。基金转型后，主要配置方向为 3-5 年利率品种和中短期 AAA 信用品种；基金还适度配置转债资产，主要以银行类转债为主，并波段操作了个别基本面较好的弹性转债品种。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期转型前期间（自 2018 年 7 月 1 日至 2018 年 8 月 21 日）银河润利混合 A 基金份额净值增长率为 0.10%，银河润利混合 I 基金份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.39%；

本报告期转型后期间（自 2018 年 8 月 22 日至 2018 年 9 月 30 日）银河泰利债券 A 基金份额

净值增长率为 0.35%，银河泰利债券 I 基金份额净值增长率为 0.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.30%

#### 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	313,972,249.60	98.47
	其中：债券	313,972,249.60	98.47
	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	1,717,281.92	0.54
8	其他资产	3,149,006.83	0.99
9	合计	318,838,538.35	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,032,000.00	56.68
	其中：政策性金融债	170,032,000.00	56.68
4	企业债券	30,255,000.00	10.09
5	企业短期融资券	70,137,000.00	23.38
6	中期票据	30,145,000.00	10.05
7	可转债（可交换债）	13,403,249.60	4.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	313,972,249.60	104.67

#### 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	180208	18国开 08	600,000	60,618,000.00	20.21
2	180211	18国开 11	500,000	49,600,000.00	16.53
3	180209	18国开 09	400,000	40,068,000.00	13.36
4	011801685	18华能水电 SCP007	200,000	20,034,000.00	6.68
5	180210	18国开 10	200,000	19,746,000.00	6.58

#### 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

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	145,001.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,004,005.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,149,006.83

### 5.10.4 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	113011	光大转债	6,950,210.40	2.32
2	123009	星源转债	2,489,078.70	0.83
3	110043	无锡转债	1,664,320.50	0.55
4	113018	常熟转债	1,129,200.00	0.38
5	128029	太阳转债	662,040.00	0.22



### 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。

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	-	-
	其中：债券	-	-
	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	409,033,493.80	99.94
8	其他资产	265,298.62	0.06
9	合计	409,298,792.42	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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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	201,304.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	63,993.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	265,298.62

**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

项目	银河泰利债券 A	银河泰利债券 I
基金合同生效日（ 2018年 8月 22日 ） 基金份额总额	142,409,348.34	150,824,576.20
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	142,409,348.34	150,824,576.20

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	银河润利混合 A	银河润利混合 I
报告期期初基金份额总额	382,457,247.85	401,099,434.93
报告期期间基金总申购份额	108,523.15	-
减 报告期期间基金总赎回份额	228,032,261.94	250,274,858.73
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	154,533,509.06	150,824,576.20

## § 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 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

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	20180701-20180930	200,549,717.47	-	100,000,000.00	100,549,717.47	34.29%
	2	20180701-20180712	200,049,717.46	-	200,049,717.46	-	-
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。							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 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润利保本混合型证券投资基金的文件
- 2 《银河泰利纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 3 《银河泰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 银河泰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  
2018年 10月 24日