

银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资 基金 2019年半年度报告摘要

2019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：杭州银行股份有限公司

送出日期：2019年 8月 26日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河睿丰定开债券
场内简称	-
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	2,009,999,000.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

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，力争为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。在债券资产久期、期限和类属配置的基础上，本基金根据债券市场收益率 数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的内外部信用评级 结果、流动性、信用利差水平、息票率、税赋政策等因素，选择具有良好投资 价值的债券品种进行投资。在以上债券投资策略的基础上，本基金还将根据债券市场的动态变化，采 取骑乘策略、息差策略等多种灵活策略，获取超额收益。 在开放期内，本基金为保持较高的流动性，在遵守本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，通过合理配置组合 期限结构等方式，积极防范流动性风险，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	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。
--	----------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	杭州银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	陈凯伦
	联系电话	021-38568989	0571-87253683
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	chenkailun@hzbank.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95398
传真		021-38568769	0571-86475525

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金半年度报告备置地点	1 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568号 15层 2 北京市东城区朝阳门北大街 9号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2019年 1月 1日 - 2019年 6月 30日)
本期已实现收益	41,968,618.00
本期利润	36,723,385.13
加权平均基金份额本期利润	0.0183
本期基金份额净值增长率	1.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2019年 6月 30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0129
期末基金资产净值	2,035,971,276.25
期末基金份额净值	1.0129

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 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

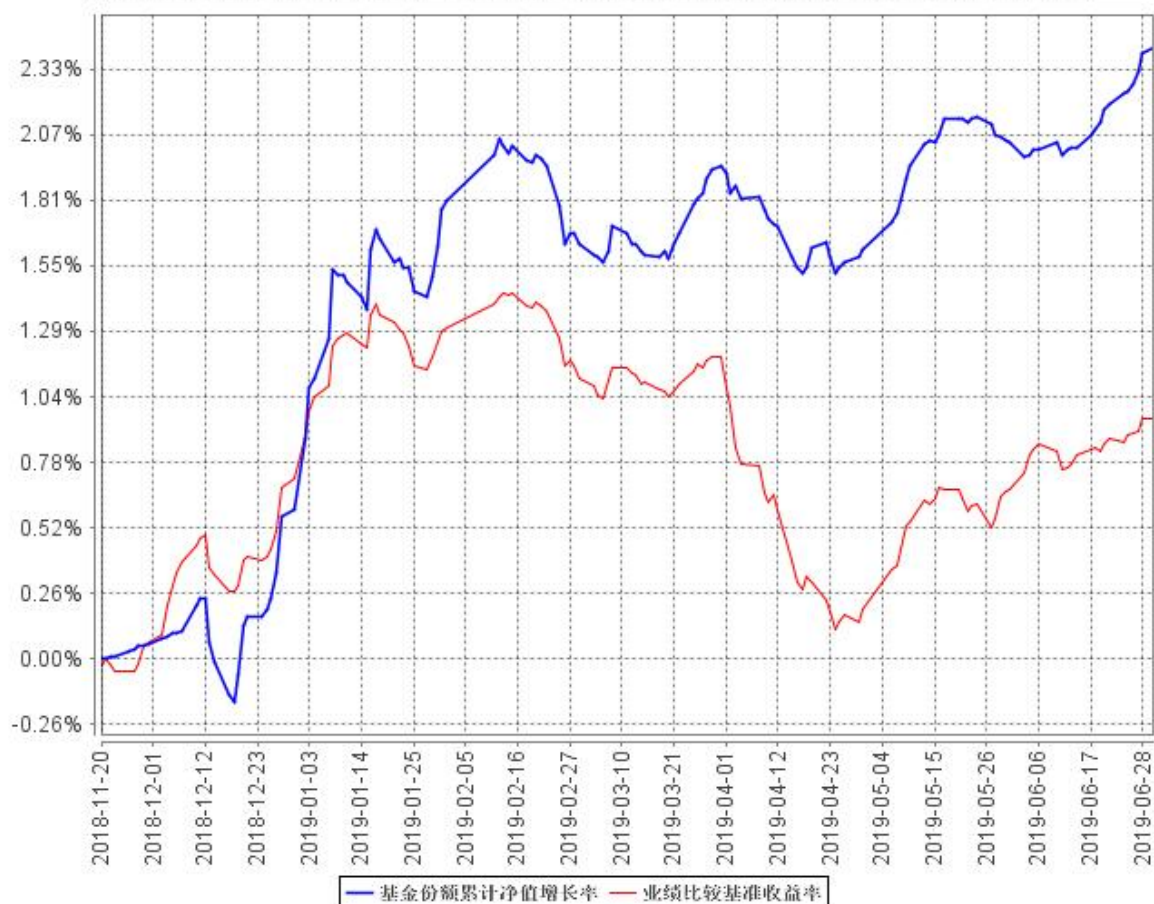
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率	份额净值 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	-	-
过去一个月	0.37%	0.03%	0.28%	0.03%	0.09%	0.00%
过去三个月	0.46%	0.04%	-0.24%	0.06%	0.70%	-0.02%
过去六个月	1.82%	0.07%	0.24%	0.06%	1.58%	0.01%
自基金合同 生效起至今	2.42%	0.07%	0.95%	0.06%	1.47%	0.01%

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份额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 根据《银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金合同》规定，本基金应自基金合同生效日起的 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓结束时各项资产配置符合合同规定。2 本基金合同生效日为 2018 年 11 月 20 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司成立于 2002 年 6 月 14 日，是经中国证券监督管理委员会按照市场化机制批准成立的第一家基金管理公司（俗称：“好人举手第一家”），是中央汇金公司旗下专业资产管理机构。

银河基金公司的经营范围包括发起设立、管理基金等，注册资本 2 亿元人民币，注册地中国上海。银河基金公司的股东分别为：中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团有限公司、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司管理的基金有：银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联系列证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金（LOF）、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河泰利纯债债券型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君欣纯债债券型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券

型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金、银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银河和美生活主题混合型证券投资基金、银河如意债券型证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金、银河中债 -1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、银河睿安纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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6月起担任银河睿嘉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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，由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，未发现本基金与其它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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内经济开局良好，2019年一季度 GDP 同比增长 6.4%，各项数据超出市场一致预期，但二季度增长动能再度减弱。1-5月，全国固定资产投资规模同比增长 5.6%，较前四个月累计增速下滑 0.5%。前 5个月，出口同比增长 6.1%，进口同比增长 1.8%，贸易顺差 8933.6亿元，扩大 45%。1-5月社会消费品零售总额同比 8.1%，连续下滑，比去年同期下降 1.4%。1-5月工业增加值

同比 6.0%，连续下滑，比去年同期下降 0.9%。海外方面，受国际贸易摩擦升级影响，全球经济景气度回落。今年上半年货币政策整体中性偏松，年初央行降准对冲 1 季度的 MLF 到期，2 月份央行在公开市场的操作日趋谨慎，月末资金面出现超预期收紧，3 月和 4 月资金面整体仍不宽松，但 5 月份中美贸易摩擦升级叠加同业刚兑打破的影响，央行除宣布对中小银行降准外，两次超量续作 MLF，并在公开市场不断投放资金，带来了较为宽松的资金面。

上半年债券市场收益率整体走势震荡，受资金面影响较大，先下后上再下，中债综合财富指数上半年上涨 1.82%。利率债方面，10 年国开在 3.47-3.88 区间震荡，10 年国债在 3.06-3.43 区间震荡。信用债方面，高评级信用利差较为平稳，低评级信用品种信用利差上行。

上半年基金以利率债、高等级信用债和商业银行金融债投资为主，并积极通过杠杆策略增厚组合回报。

4.4.2 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 1.82%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济将呈稳中向下的趋势。投资方面，制造业投资受贸易摩擦升级、企业盈利回落影响，向下压力较大；短期房地产投资仍能受益于补库动力较强以及去年下半年以来融资环境的放宽，保持偏稳定的增速，但在销售同比增速回落、融资再次边际收紧的情况下或将重回下行通道；唯有基建投资受益于财政政策刺激，对经济有一定的托底。消费方面，汽车销售仍然偏弱，下半年社零增速仍有压力；进出口方面，全球贸易摩擦升级，经济景气度下行，下半年出口增速影响较大。从中长期角度来讲，贸易摩擦有长期化的倾向，国内经济的发展仍然需要内生动力，经济结构调整、国有企业改革、民企融资环境的改善需持续推进，这都需要良好的资本环境支持。经济基本面及政策面都将支持无风险利率不会大幅上行，利率债将呈现震荡慢牛行情。信用债在市场风险偏好降低的背景下，信用利差预计将继续分化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基

金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了由公司相关领导、监察部投资风控岗、研究部数量研究员、行业研究员、支持保障部基金会计等相关人员组成的估值委员会，以上人员拥有丰富的风控、合规、证券研究、估值经验，根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但基金经理可以列席估值委员会会议提供估值建议，以便估值委员会决策。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》有关规定，“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次收益分配比例不低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”。

本基金截止 2019 年 3 月 19 日，本基金可分配收益 26,126,228.97 元，于 2019 年 3 月 28 日进行利润分配，每单位分配收益 0.0112 元，超过可分配收益的 10%

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。本基金本报告期于 2019 年 3 月 28 日进行利润分配，每单位分配收益 0.0112 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年 6月 30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年 6月 30日	上年度末 2018年 12月 31日
资 产：			
银行存款		1,435,627.45	6,852,436.36
结算备付金		1,350,038.50	14,568,181.82
存出保证金		-	-
交易性金融资产		2,281,887,000.00	2,350,230,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,281,887,000.00	2,350,230,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		39,222,221.03	61,210,035.27
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,323,894,886.98	2,432,860,653.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年 6月 30日	上年度末 2018年 12月 31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		286,999,775.00	410,009,064.98
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		500,519.29	512,897.56
应付托管费		166,839.77	170,965.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		13,347.93	17,409.36

应交税费		15,605.51	3,231.21
应付利息		143,868.18	387,204.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		83,655.05	-
负债合计		287,923,610.73	411,100,773.53
所有者权益：			
实收基金		2,009,999,000.00	2,009,999,000.00
未分配利润		25,972,276.25	11,760,879.92
所有者权益合计		2,035,971,276.25	2,021,759,879.92
负债和所有者权益总计		2,323,894,886.98	2,432,860,653.45

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0129 元，基金份额总额 2,009,999,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		45,262,229.18
1.利息收入		44,484,605.20
其中：存款利息收入		67,076.73
债券利息收入		44,358,012.76
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		59,515.71
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,022,856.85
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		6,022,856.85
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-5,245,232.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、费用		8,538,844.05

1. 管理人报酬		3,026,310.59
2. 托管费		1,008,770.23
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		14,850.00
5. 利息支出		4,389,234.97
其中：卖出回购金融资产支出		4,389,234.97
6. 税金及附加		5,223.21
7. 其他费用		94,455.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,723,385.13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,723,385.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,009,999,000.00	11,760,879.92	2,021,759,879.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,723,385.13	36,723,385.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-22,511,988.80	-22,511,988.80
五、期末所有者权益(基	2,009,999,000.00	25,972,276.25	2,035,971,276.25

金净值)			
------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘立达	_____ 刘立达	_____ 廖理利
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金 (以下简称“本基金”)系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]904号文批准公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为2,009,999,000.00份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第00466号的验资报告。基金合同于2018年11月20日正式生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,基金托管人为杭州银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新适用的基金合同及《银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制;在开放期内,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,封闭期内不受上述5%的限制。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资

范围。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2)金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得

的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1)对于银行间市场交易的固定收益品种,以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2)对存在活跃市场的其他投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值;对于发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3)对存在活跃市场的其他投资品种,如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

4)当投资品种不再存在活跃市场,基金管理人估值委员会认为必要时,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且目前可执行该种法定权利,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转入、转出、类别调整等引起的基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配 (未分配利润) 已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配 (未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息 (若有) 后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

- 投资收益

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息 (若有) 后

的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息 (若有) 后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

- 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4)每一基金份额享有同等分配权；

5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4)每一基金份额享有同等分配权；

5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24 号), 在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外), 采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖债券的差价收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的

个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日
活期存款	1,435,627.45
定期存款	-
其中：存款期限 1个月以内	-
存款期限 1-3个月	-
存款期限 3个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,435,627.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	304,982,846.58	303,720,000.00
	银行间市场	1,977,104,001.50	1,978,167,000.00
	合计	2,282,086,848.08	2,281,887,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,282,086,848.08	2,281,887,000.00	-199,848.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日
应收活期存款利息	122.36
应收定期存款利息	
应收其他存款利息	
应收结算备付金利息	607.50
应收债券利息	39,221,491.17
应收资产支持证券利息	
应收买入返售证券利息	
应收申购款利息	
应收黄金合约拆借孳息	
其他	
合计	39,222,221.03

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年 6月 30日
交易所市场应付交易费用	
银行间市场应付交易费用	13,347.93
合计	13,347.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019年 6月 30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	83,655.05
合计	83,655.05

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,009,999,000.00	2,009,999,000.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,009,999,000.00	2,009,999,000.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,715,495.13	5,045,384.79	11,760,879.92
本期利润	41,968,618.00	-5,245,232.87	36,723,385.13
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-22,511,988.80	-	-22,511,988.80
本期末	26,172,124.33	-199,848.08	25,972,276.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
活期存款利息收入	22,873.77

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	44,202.96
其他	-
合计	67,076.73

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	6,022,856.85
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	6,022,856.85

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,048,084,158.03
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,002,702,752.74
减：应收利息总额	39,358,548.44
买卖债券差价收入	6,022,856.85

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金未进行贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
1 交易性金融资产	-5,245,232.87
——股票投资	-
——债券投资	-5,245,232.87
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-5,245,232.87

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
交易所市场交易费用	100.00
银行间市场交易费用	14,750.00
交易基金产生的费用	
其中：申购费	
赎回费	
合计	14,850.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	58,859.86
其他	300.00
银行间账户维护费	10,500.00
合计	94,455.05

6.4.7.21 分部报告

-

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系没有发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
杭州银行股份有限公司（“杭州银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本期无应付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日
----	-----------------------------	--------------------------------------

	30日	
当期发生的基金应支付的管理费	3,026,310.59	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	上年度可比期间 2018年 1月 1日至 2018年 6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,008,770.23	-

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.9.2.3 销售服务费

注：本基金不设销售服务费。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金报告期末与关联方进行银行间同业债券（含回购）交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	
基金合同生效日（ 2018 年 11月 20日 ）持有的基金份额		10,000,000.00
期初持有的基金份额		10,000,000.00
期间申购/买入总份额		-
期间因拆分变动份额		-
减：期间赎回/卖出总份额		-
期末持有的基金份额		10,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例		0.5000%

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2019年 1月 1日至 2019年 6月 30日	
	期末余额	当期利息收入
杭州银行	1,435,627.45	22,873.77

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期间无其他关联交易事项。

6.4.10 期末（ 2019 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 69,999,775.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1720085	17北京银行绿色金融债	2019年 7月 4日	102.81	740,000	76,079,400.00
合计				740,000	76,079,400.00

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 217,000,000.00 元，分别于 2019 年 07 月 03 日、2019 年 07 月 04 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	39,222,221.03	1.69
9	合计	2,323,894,886.98	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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股票。

7.2.2 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。

7.3 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：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

7.10.2 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。

7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

18兴业绿色金融 01

兴业银行：

银保监银罚决字〔2018〕1号

2018年 5月 4日，发行人因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；非真实转让信贷资产；无授信额度或超授信额度办理同业业务；内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；债券卖出回购业务违规出表；个人理财资金违规投资；提供日期倒签的材料；部分非现场监管统计数据与事实不符；个别董事未经任职资格核准即履职；变相批量转让个人贷款；向四证不全的房地产项目提供融资，被银保监会罚款 5870万元。

报告期内基金投资的前十名证券除以债券以外其他九只证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	39,222,221.03
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

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2	1,004,999,500.00	2,009,999,000.00	100.00%	0.00	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 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	0.50	10,000,000.00	0.50	自基金合同生效之日起持有期限不少于 3 年。
基金管理人高级管理人员	-	0.00	-	0.00	-
基金经理等人员	-	0.00	-	0.00	-
基金管理人股东	-	0.00	-	0.00	-
其他	-	0.00	-	0.00	-

合计	10,000,000.00	0.50	10,000,000.00	0.50	自基金合同 生效之日起 持有期限不 少于 3 年。
----	---------------	------	---------------	------	------------------------------------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2018年 11月 20日 ）基金份额总额	2,009,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,009,999,000.00
本报告期期间基金总申购份额	-
减：本报告期期间基金总赎回份额	-
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,009,999,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2019年 5月 30日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，原总经理范永武先生因个人原因辞职，经公司第四届董事会审议通过，由董事长刘立达先生代为履行总经理职务。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	2					

注：本基金席位均为新增。

选择证券公司专用席位的标准：

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
太平洋证券	99,973,805.48	100.00%	1,293,000,000.00	100.00%		

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20190101-20190630	1,999,999,000.00	0.00	0.00	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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

银河基金管理有限公司

2019年 8月 26日