

# 银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券 投资基金证券投资基金 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。本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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 20 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。

经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，我司研究决定（详见相关附件）银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金变更注册为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”。转型后基金托管人及基金登记机构不变，本基金简称不变，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《银河久益回报 6 个月定期开放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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中自 2019 年 6 月 25 日起“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”，银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金合同及托管协议于该日生效。

本半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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

|                  |                    |                |
|------------------|--------------------|----------------|
| 基金简称             | 银河回报债券             |                |
| 场内简称             | —                  |                |
| 基金主代码            | 519662             |                |
| 基金运作方式           | 契约型开放式             |                |
| 基金合同生效日          | 2019 年 6 月 25 日    |                |
| 基金管理人            | 银河基金管理有限公司         |                |
| 基金托管人            | 中国邮政储蓄银行股份有限公司     |                |
| 报告期末基金份额总额       | 1,949,380,365.00 份 |                |
| 基金合同存续期          | —                  |                |
| 基金份额上市的证券交易所（若有） | —                  |                |
| 上市日期（若有）         | —                  |                |
| 下属分级基金的基金简称      | 银河回报债券 A           | 银河回报债券 C       |
| 下属分级基金的场内简称      | —                  | —              |
| 下属分级基金的交易代码      | 519662             | 519663         |
| 下属分级基金的前端交易代码    | —                  | —              |
| 下属分级基金的后端交易代码    | —                  | —              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额  | 1,939,565,170.30 份 | 9,815,194.70 份 |

### 2.1 基金基本情况（转型前）

|                 |                    |                |
|-----------------|--------------------|----------------|
| 基金简称            | 银河回报债券             |                |
| 场内简称            | —                  |                |
| 基金主代码           | 519662             |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                |
| 基金合同生效日         | 2013 年 8 月 9 日     |                |
| 基金管理人           | 银河基金管理有限公司         |                |
| 基金托管人           | 中国邮政储蓄银行股份有限公司     |                |
| 报告期末基金份额总额      | 1,972,135,832.14 份 |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 银河回报债券 A           | 银河回报债券 C       |
| 下属分级基金的场内简称     | —                  | —              |
| 下属分级基金的交易代码     | 519662             | 519663         |
| 下属分级基金的前端交易代码   | —                  | —              |
| 下属分级基金的后端交易代码   | —                  | —              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,962,455,575.80 份 | 9,680,256.34 份 |

## 2.2 基金产品说明（转型后）

|      |   |
|------|---|
| 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持续稳定的投资回报，实现基金资产持续稳定增值。   |
| 投资策略 | <p>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。</p> <p>（一）封闭期内的投资策略 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。</p> <p>1、久期选择 本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。考虑信用溢价对久期的影响，若经济下行，预期利率将持续下行的同时，长短期产品比短久期产品将面临更多的信用风险，信用溢价要求更高。因此应缩短久期，并尽量配置更多的信用级别较高的产品。</p> <p>2、收益率曲线分析 本基金除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响之外，还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响，如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成一定阶段内的收益率曲线变动趋势的预期，并适时调整基金的债券投资组合。</p> <p>3、债券类属选择 本基金依据宏观经济层面的信用风险周期和代表性行业的信用风险结构变化，做出信用风险收缩或扩张的基本判断。根据对金融债、企业债、公司债、中期票据等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期，主动调整债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>4、个债选择 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，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。</p> <p>5、债券回购杠杆策略 本基金将密切跟踪债券市场收益率情况及资金成本水平，实时把握不同市场和不同期限品种之间的收益率差异，在控制流动性风险的基础上，采取适度的回购杠杆操作，有效增厚基金资产收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券的资产池的资产特征进行分析，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。本基金投资资产支持证券时，还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市</p> |

|               |  |          |
|---------------|--|----------|
|               | 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）开放期内的投资策略 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        | 本基金是债券型基金，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。   |          |
|               | 银河回报债券 A   | 银河回报债券 C |
| 下属分级基金的风险收益特征 | —  | —        |

## 2.2 基金产品说明（转型前）

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，通过严谨的风险管理与主动管理，力求实现基金资产持续稳定增值。  |
| 投资策略 | <p>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。</p> <p>1、久期选择 本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。考虑信用溢价对久期的影响，若经济下行，预期利率将持续下行的同时，长周期产品比短周期产品将面临更多的信用风险，信用溢价要求更高。因此应缩短久期，并尽量配置更多的信用级别较高的产品。</p> <p>2、收益率曲线分析 本基金除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响之外，还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响，如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成一定阶段内的收益率曲线变动趋势的预期，并适时调整基金的债券投资组合。</p> <p>3、债券类属选择 本基金依据宏观经济层面的信用风险周期和代表性行业的信用风险结构变化，做出信用风险收缩或扩张的基本判断。根据对金融债、企业债、公司债、中期票据等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期，主动调整债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>4、个债选择 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，并结合债券的信用评级、</p> |

|               |  |          |
|---------------|--|----------|
|               | <p>流动性、息票率、税赋等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。对于含权类债券品种，如可转债等，本基金还将结合公司基本面分析，综合运用衍生工具定价模型分析债券的内在价值。</p> <p>5、债券回购杠杆策略 本基金将密切跟踪债券市场收益率情况及资金成本水平，实时把握不同市场和不同期限品种之间的收益率差异，在控制流动性风险的基础上，采取适度的回购杠杆操作，有效增厚基金资产收益。</p> <p>6、附权债券投资 附权债券指对债券发行体授予某种期权，或者赋予债券投资者某种期权，从而使债券发行体或投资者有了某种灵活的选择余地，从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性，也增强对各类投资者的吸引力。</p> <p>7、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券的资产池的资产特征进行分析，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。本基金投资资产支持证券时，还将充分考虑该投资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。</p> |          |
| 业绩比较基准        | 每个封闭期起始日的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%   |          |
| 风险收益特征        | 本基金是以债券等固定收益类资产投资为主的债券型投资基金，属于中低风险、中低收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  |          |
|               | 银河回报债券 A   | 银河回报债券 C |
| 下属分级基金的风险收益特征 | -  | -        |

### 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                   | 中国邮政储蓄银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 秦长建                          | 田东辉                  |
|         | 联系电话 | 021-38568989                 | 010-68858113         |
|         | 电子邮箱 | qinchangjian@galaxyasset.com | tiandonghui@psbc.com |
| 客户服务电话  |      | 400-820-0860                 | 95580                |
| 传真      |      | 021-38568769                 | 010-68858120         |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.galaxyasset.com">http://www.galaxyasset.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 1、中国(上海)自由贸易试验区世纪大道<br>1568 号 15 层                                  |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2019 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|---|---------------|
|               | 银河回报债券 A                                  | 银河回报债券 C      |
| 本期已实现收益       | 99,899.73                                 | -183.39       |
| 本期利润          | 1,538,206.89                              | 6,898.08      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0008                                    | 0.0007        |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.04%                                     | 0.05%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年 6 月 30 日                           |               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2945                                    | 0.2646        |
| 期末基金资产净值      | 2,549,577,224.40                          | 12,609,237.08 |
| 期末基金份额净值      | 1.3145                                    | 1.2847        |

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）。

4、本基金由“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”转型而来。“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”于 2019 年 6 月 24 日到期，并于次日（即 2019 年 6 月 25 日）转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”。

转型前

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 24 日 |               |
|---------------|---------------------------------|---------------|
|               | 银河回报债券 A                        | 银河回报债券 C      |
| 本期已实现收益       | 21,761,626.55                   | 140,370.80    |
| 本期利润          | 10,329,284.30                   | 46,758.21     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0069                          | 0.0041        |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.48%                           | 0.28%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年 6 月 24 日                 |               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4424                          | 0.4127        |
| 期末基金资产净值      | 2,868,561,247.93                | 13,861,736.60 |
| 期末基金份额净值      | 1.462                           | 1.432         |

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）。

4、本基金于 2019 年 6 月 24 日到期，并于次日（即 2019 年 6 月 25 日）转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 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

银河回报债券 A

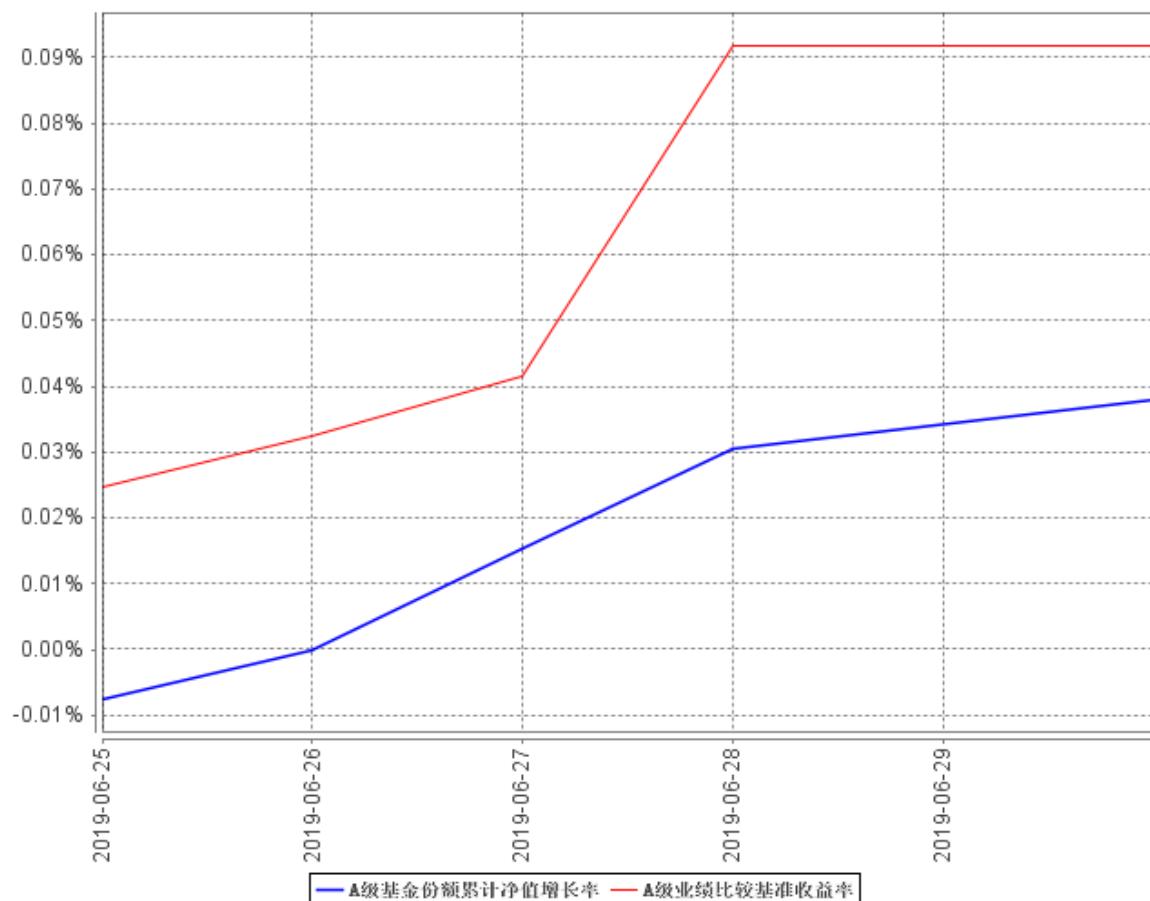
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.04%    | 0.01%       | 0.09%      | 0.02%         | -0.05% | -0.01% |

银河回报债券 C

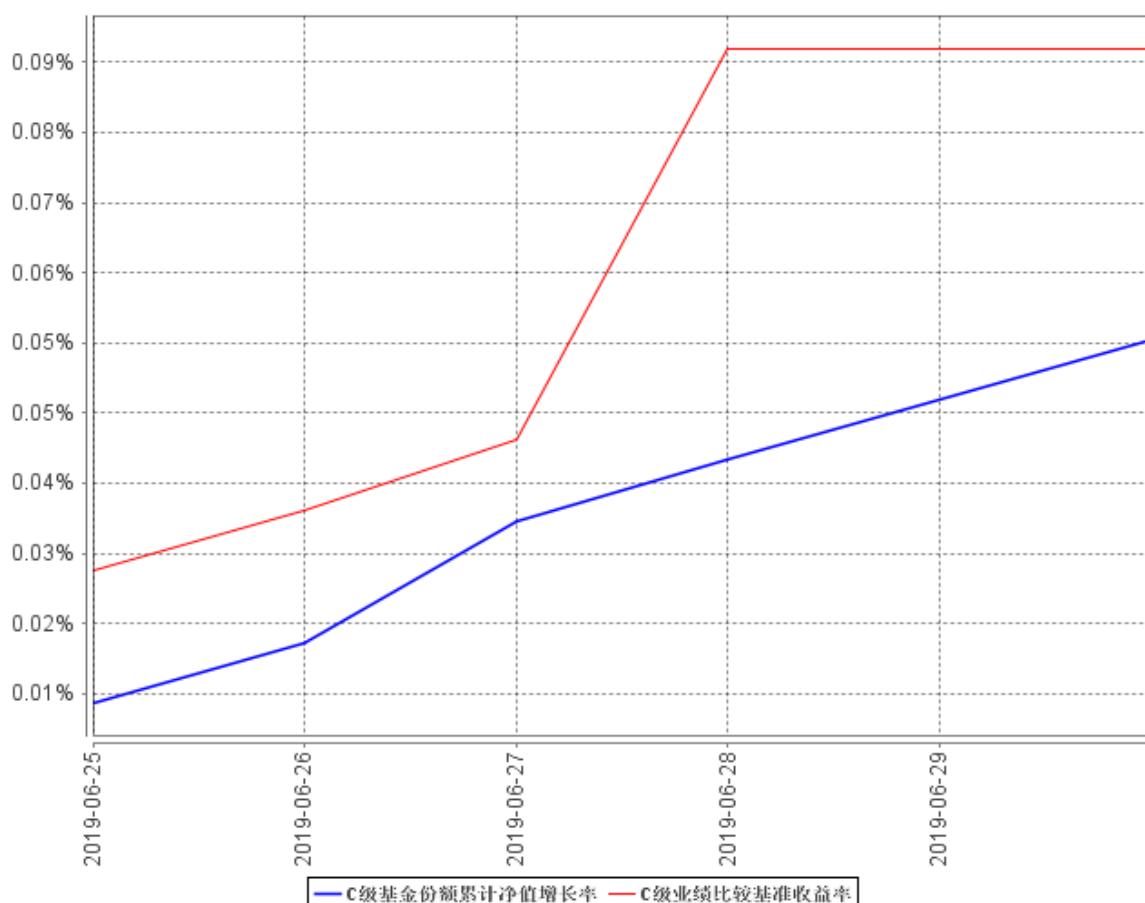
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.05%    | 0.00%       | 0.09%      | 0.02%         | -0.04% | -0.02% |

### 3.2.2 自基金转型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

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



### C 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“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”转型而来。“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”于 2019 年 6 月 24 日到期，并于次日（即 2019 年 6 月 25 日）转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”。
2. 根据基金合同规定，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合计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。截至本季度末本基金仍处于建仓期。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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

银河回报债券 A

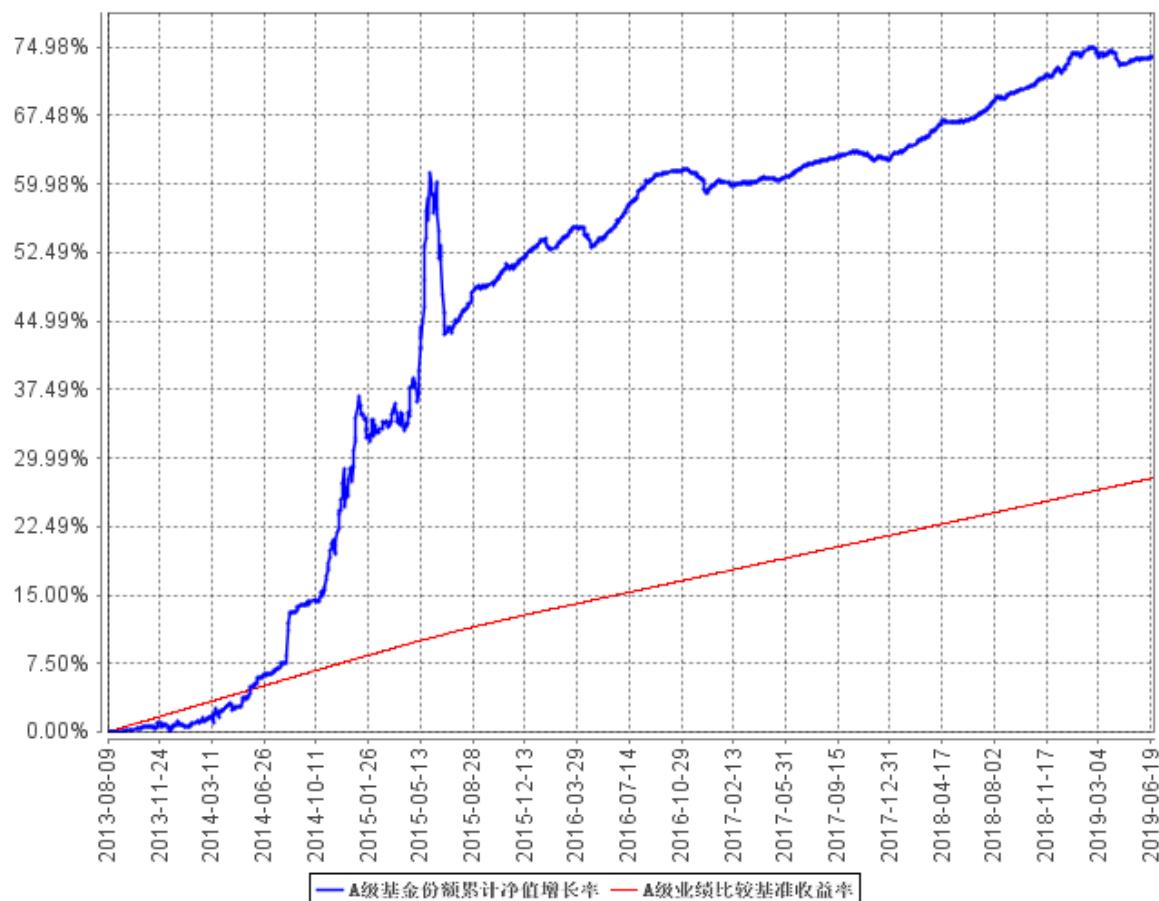
| 阶段                | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 20190531-20190624 | 0.21%    | 0.03%       | 0.22%      | 0.01%         | -0.01% | 0.02% |
| 20190331-20190624 | -0.34%   | 0.06%       | 0.78%      | 0.01%         | -1.12% | 0.05% |
| 20181231-20190624 | 0.48%    | 0.07%       | 1.62%      | 0.01%         | -1.14% | 0.06% |
| 20180630-20190624 | 3.90%    | 0.06%       | 3.38%      | 0.01%         | 0.52%  | 0.05% |
| 20160630-20190624 | 11.27%   | 0.06%       | 11.01%     | 0.01%         | 0.26%  | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今        | 74.03%   | 0.31%       | 27.83%     | 0.01%         | 46.20% | 0.30% |

## 银河回报债券 C

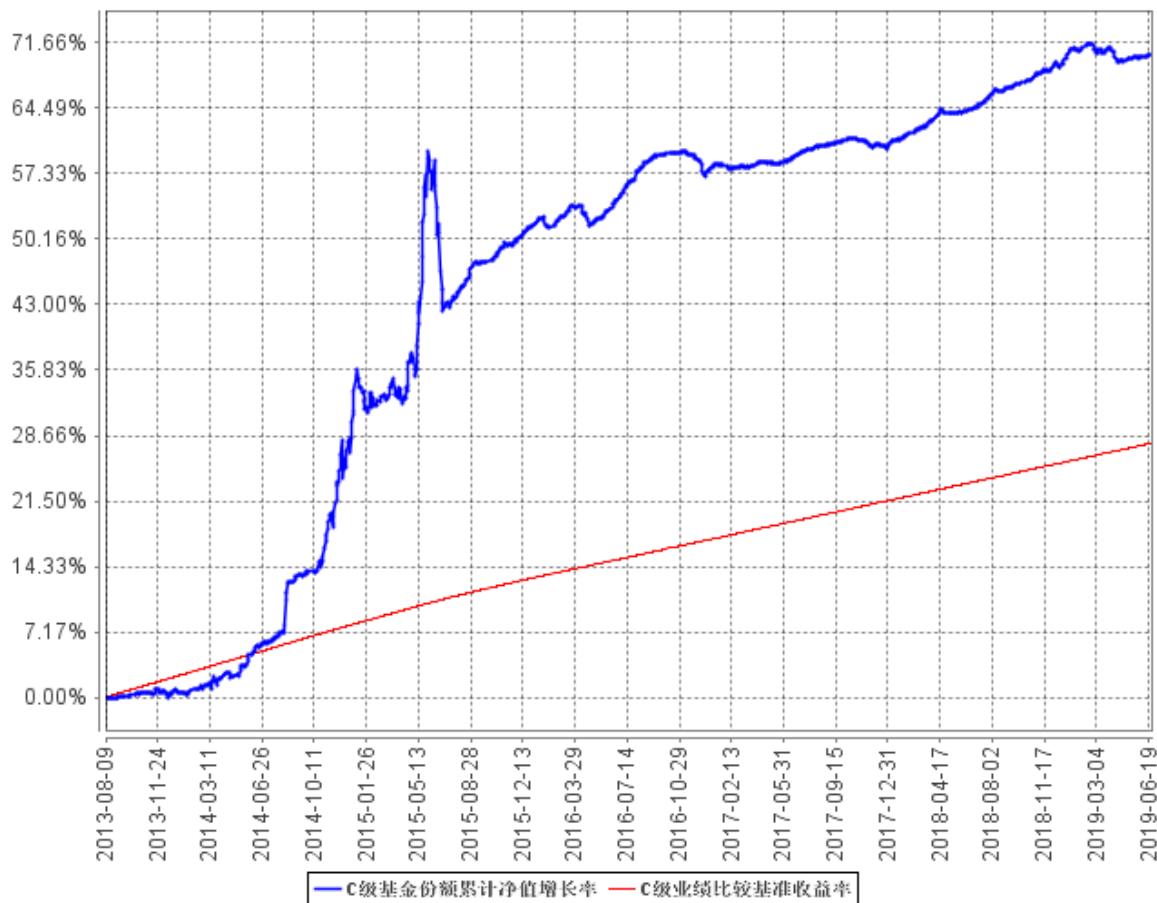
| 阶段                | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 20190531-20190624 | 0.14%    | 0.02%       | 0.22%      | 0.01%         | -0.08% | 0.01% |
| 20190331-20190624 | -0.49%   | 0.06%       | 0.78%      | 0.01%         | -1.27% | 0.05% |
| 20181231-20190624 | 0.28%    | 0.07%       | 1.62%      | 0.01%         | -1.34% | 0.06% |
| 20180630-20190624 | 3.51%    | 0.06%       | 3.38%      | 0.01%         | 0.13%  | 0.05% |
| 20160630-20190624 | 9.99%    | 0.06%       | 11.01%     | 0.01%         | -1.02% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今        | 70.37%   | 0.30%       | 27.83%     | 0.01%         | 42.54% | 0.29% |

### 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

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



## C 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. 本基金合同生效日为 2013 年 8 月 9 日，根据《银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》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：本基金债券的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，可转债投资比例不高于基金资产净值的 30%。截止本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

2. 本基金于 2019 年 6 月 24 日到期，并于次日（即 2019 年 6 月 25 日）转型为“银河久益回报 6 个月定期开放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、银河量化稳健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（转型后）

| 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 | 银河旺利灵活配置混合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、银河银信添利债券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、银河岁岁回报定期开放债券型证 | 2016 年 8 月 26 日 | -    | 10     | 硕士研究生学历。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，2016 年 8 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、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理、银河领先债券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，现就职于固定收益部。 |

|  |            |  |  |  |  |
|--|------------|--|--|--|--|
|  | 券投资基金的基金经理 |  |  |  |  |
|--|------------|--|--|--|--|

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

| 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 | 2016 年 8 月 26 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。 |
|--|--|--|--|--|--|

## 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》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。

在组合运作上，一季度大幅降低了长端利率仓位后，仅择机参与长端利率的波段交易机会。信用债方面，采取平衡的久期策略，信用分布仍以高评级为主。

5 月份本基金有一年定开产品转型为 6 个月定期开放型债券型基金，并更名为银河久益回报，为配合转型本基金二季度大幅降低久期和杠杆水平，投资策略以中短久期高评级信用债投资为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期转型前期间（自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 24 日），银河回报债券 A 基金份额净值为 1.4620 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.48%；截至本报告期末银河回报债券 C 基金份额净值为 1.4320 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.28%；同期业绩比较基准收益率为 1.62%。

本报告期转型后期间（自 2019 年 6 月 25 日至 2019 年 6 月 30 日），银河回报债券 A 基金份额净值为 1.3145 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.04%；截至本报告期末银河回报债券 C 基金份额净值为 1.2847 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.05%；同期业绩比较基准收益率为 0.09%。

#### 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。权益和转债市场有一定的上涨预期，但空间不会太大，行情将结构性分化。

#### 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

转型后：本基金《基金合同》于 2019 年 6 月 25 日生效，根据《基金合同》有关约定，“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。”截至本报告期末本基金未进行利润分配。

转型前：本基金《基金合同》于 2013 年 8 月 9 日生效，根据《基金合同》有关约定，“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 20%，在运作周期期满之前进行基金分红，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。”本基金截至 2019 年 6 月 14 日，A 类可分配收益为 600,542,001.45 元，C 类可分配收益为 4,038,138.82 元，于 2019 年 6 月 25 日进行利润分配，A 类每单位分配收益 0.148 元，C 类每单位分配收益 0.148 元，超过可分配收益的 20%。

#### 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

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 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

作为本基金的托管人，邮储银行严格遵守了《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，对银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金 2019 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何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

本托管人认为，银河基金管理有限公司在银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，银河基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金

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<br>2019 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |
| 银行存款            |            | 150,202,776.61                 |
| 结算备付金           |            | 10,105,074.03                  |
| 存出保证金           |            | 87,191.37                      |
| 交易性金融资产         |            | 1,932,698,245.20               |
| 其中：股票投资         |            | —                              |
| 基金投资            |            | —                              |
| 债券投资            |            | 1,932,698,245.20               |
| 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        |            | 728,000,000.00                 |
| 应收证券清算款         |            | —                              |
| 应收利息            |            | 22,782,284.39                  |
| 应收股利            |            | —                              |
| 应收申购款           |            | —                              |
| 递延所得税资产         |            | —                              |
| 其他资产            |            | 45,681.06                      |
| 资产总计            |            | 2,843,921,252.66               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |
| 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       |            | 132,000,000.00                 |
| 应付证券清算款         |            | 147,981,502.74                 |
| 应付赎回款           |            | —                              |
| 应付管理人报酬         |            | 942,813.72                     |
| 应付托管费           |            | 282,844.10                     |
| 应付销售服务费         |            | 4,578.70                       |

|               |  |                  |
|---------------|--|------------------|
| 应付交易费用        |  | 40,922.42        |
| 应交税费          |  | 274,179.73       |
| 应付利息          |  | 118,474.59       |
| 应付利润          |  | —                |
| 递延所得税负债       |  | —                |
| 其他负债          |  | 89,475.18        |
| 负债合计          |  | 281,734,791.18   |
| <b>所有者权益:</b> |  |                  |
| 实收基金          |  | 1,949,380,365.00 |
| 未分配利润         |  | 612,806,096.48   |
| 所有者权益合计       |  | 2,562,186,461.48 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 2,843,921,252.66 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，银河回报债券 A 基金份额净值 1.3145 元，基金份额  
1,939,565,170.30 份；银河灵活配置混合 C 基金份额净值 1.2847 元，基金份额总额  
9,815,194.70 份。银河回报债券份额总额合计为 1,949,380,365.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号 | 本期   |
|----------------------------|-----|--|
|                            |     | 2019 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至<br>2019 年 6 月 30 日 |
| <b>一、收入</b>                |     | 1,887,654.27                                 |
| 1. 利息收入                    |     | 1,253,886.91                                 |
| 其中：存款利息收入                  |     | 23,930.61                                    |
| 债券利息收入                     |     | 956,805.07                                   |
| 资产支持证券利息收入                 |     | —  |
| 买入返售金融资产收入                 |     | 273,151.23                                   |
| 其他利息收入                     |     | —  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |     | -811,770.00                                  |
| 其中：股票投资收益                  |     | —  |
| 基金投资收益                     |     | —  |
| 债券投资收益                     |     | -811,770.00                                  |
| 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<br>填列） |     | 1,445,388.63                                 |

|                             |  |              |
|-----------------------------|--|--------------|
| 4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)         |  | -            |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列)         |  | 148.73       |
| <b>减: 二、费用</b>              |  | 342,549.30   |
| 1. 管理人报酬                    |  | 214,782.17   |
| 2. 托管费                      |  | 64,434.65    |
| 3. 销售服务费                    |  | 839.93       |
| 4. 交易费用                     |  | 1,625.00     |
| 5. 利息支出                     |  | 54,680.58    |
| 其中: 卖出回购金融资产支出              |  | 54,680.58    |
| 6. 税金及附加                    |  | 2,071.57     |
| 7. 其他费用                     |  | 4,115.40     |
| <b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b> |  | 1,545,104.97 |
| <b>减: 所得税费用</b>             |  | -            |
| <b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>   |  | 1,545,104.97 |

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期: 2019 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目   | 本期<br>2019 年 6 月 25 日(基金合同生效日)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)                           | 1,972,135,832.14                                | 910,287,152.39  | 2,882,422,984.53 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)                  | -   | 1,545,104.97    | 1,545,104.97     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)      | -22,755,467.14                                  | -11,748,866.07  | -34,504,333.21   |
| 其中: 1. 基金申购款                               | 8,366,516.31                                    | 2,626,231.49    | 10,992,747.80    |
| 2. 基金赎回款 (以“-”号填列)                         | -31,121,983.45                                  | -14,375,097.56  | -45,497,081.01   |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以“-”号填列) | -   | -287,277,294.81 | -287,277,294.81  |
| 五、期末所有者权益 (基金净值)                           | 1,949,380,365.00                                | 612,806,096.48  | 2,562,186,461.48 |

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

银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金转型而成。银河岁岁回报定期开放债券型证券投资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》、《银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)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[2013]786 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 346,272,572.08 份，经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为安永华明(2013)验字第 60821717\_B06 号的验资报告。原基金合同于 2013 年 8 月 9 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金的基金管理人于 2019 年 5 月 25 日发布的《银河基金管理有限公司关于银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2019 年 6 月 25 日起，“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”，《银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及托管协议亦于该日同时生效。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为 A 类基金份额(以下简称“银河回报债券 A”)和 C 类基金份额(以下简称“银河回报债券 C”)两类份额。其中，银河回报债券 A 是指在投资人申购基金时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；银河回报债券 C 是指在投资人申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券(含国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、

短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具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相关规定）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、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合计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。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。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关于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 2019 年 6 月 25(基金合同生效日)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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 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。本财务报表的实际编制期间为 2019 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间。

##### 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。
- 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、基金托管费和销售服务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。

#### 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, 本基金可进行收益分配, 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相应类别的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) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值; 即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类别基金份额收益分配金额后不能低于面值;
- 4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, 而 C 类基金份额收取销售服务费, 各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同, 本基金同一类别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。

## 6.4.8 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、基金销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 中国银河证券股份有限公司 | 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

##### 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：本基金本报告期未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：本基金本报告期未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：本基金本报告期末余额均为零。

###### 6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未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：本基金本期末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<br>2019年6月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 214,782.17                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,809.40                             |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划款指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系

基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期  |
|----------------|---|
|                | 2019 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 64,434.65                                 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划款指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期  |          |        |
|----------------|---|----------|--------|
|                | 2019 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |          |        |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |          |        |
|                | 银河回报债券 A                                  | 银河回报债券 C | 合计     |
| 邮储银行           | -   | 484.33   | 484.33 |
| 银河基金管理有限公司     | -   | 27.67    | 27.67  |
| 银河证券公司         | -   | 4.08     | 4.08   |
| 合计             | -   | 516.08   | 516.08 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。本基金

C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送

基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

注：本基金本期基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 | 当期利息收入    |
| 邮储银行  | 150,202,776.61                            | 21,178.71 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 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：本基金本报告期未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。

#### 6.4.12.17 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。

#### 6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款。

##### 6.4.12.18.2 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 132,000,000.00 元，于 2019 年 07 月 01 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。

#### 6.4.13 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。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金

报告截止日： 2019 年 6 月 24 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2019年6月24日         | 上年度末<br>2018年12月31日         |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                           |                             |
| 银行存款            |            | 315,115,041.26            | 3,825,405.29                |
| 结算备付金           |            | 10,105,074.03             | 6,666,796.37                |
| 存出保证金           |            | 87,191.37                 | 51,335.97                   |
| 交易性金融资产         |            | 2,162,464,654.60          | 2,243,269,135.60            |
| 其中：股票投资         |            | —                         | —                           |
| 基金投资            |            | —                         | —                           |
| 债券投资            |            | 2,162,464,654.60          | 2,243,269,135.60            |
| 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        |            | 630,000,000.00            | 22,442,233.66               |
| 应收证券清算款         |            | —                         | —                           |
| 应收利息            |            | 27,943,432.68             | 35,281,519.20               |
| 应收股利            |            | —                         | —                           |
| 应收申购款           |            | —                         | —                           |
| 递延所得税资产         |            | —                         | —                           |
| 其他资产            |            | 47,170.62                 | —                           |
| 资产总计            |            | 3,145,762,564.56          | 2,311,536,426.09            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019年6月24日</b> | <b>上年度末<br/>2018年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                           |                             |
| 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       |            | 132,000,000.00            | —                           |
| 应付证券清算款         |            | 59,967,583.52             | —                           |
| 应付赎回款           |            | 69,978,600.28             | —                           |
| 应付管理人报酬         |            | 728,031.55                | 1,073,188.36                |
| 应付托管费           |            | 218,409.45                | 321,956.49                  |
| 应付销售服务费         |            | 3,738.77                  | 6,922.01                    |
| 应付交易费用          |            | 39,297.42                 | 27,310.28                   |
| 应交税费            |            | 253,275.69                | 119,351.74                  |

|               |  |                  |                  |
|---------------|--|------------------|------------------|
| 应付利息          |  | 63,794.01        | -                |
| 应付利润          |  | -                | -                |
| 递延所得税负债       |  | -                | -                |
| 其他负债          |  | 86,849.34        | 210,000.00       |
| 负债合计          |  | 263,339,580.03   | 1,758,728.88     |
| <b>所有者权益:</b> |  |                  |                  |
| 实收基金          |  | 1,972,135,832.14 | 1,587,379,840.59 |
| 未分配利润         |  | 910,287,152.39   | 722,397,856.62   |
| 所有者权益合计       |  | 2,882,422,984.53 | 2,309,777,697.21 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 3,145,762,564.56 | 2,311,536,426.09 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 24 日，银河回报债券 A 基金份额净值 1.4620 元，基金份额 1,962,455,575.80 份；银河回报债券 C 基金份额净值 1.4320 元，基金份额总额 9,680,256.34 份。银河回报债券份额总额合计为 1,972,135,832.14 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 24 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 24 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|------------------------|-----|--|---|
| <b>一、收入</b>            |     | 22,184,639.79                            | 26,809,814.95                                 |
| 1. 利息收入                |     | 49,724,935.45                            | 18,690,116.82                                 |
| 其中：存款利息收入              |     | 469,304.74                               | 144,805.90                                    |
| 债券利息收入                 |     | 48,803,580.39                            | 18,523,965.38                                 |
| 资产支持证券利息收入             |     | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入             |     | 452,050.32                               | 21,345.54                                     |
| 其他利息收入                 |     | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |     | -16,015,602.74                           | -2,071,019.00                                 |
| 其中：股票投资收益              |     | -  | -   |
| 基金投资收益                 |     | -  | -   |
| 债券投资收益                 |     | -16,015,602.74                           | -2,071,019.00                                 |
| 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） |     | -11,525,954.84                           | 10,188,322.07                                 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号        |     | -  | -   |

|                            |  |                  |                  |
|----------------------------|--|------------------|------------------|
| 填列)                        |  |                  |                  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         |  | 1, 261. 92       | 2, 395. 06       |
| <b>减：二、费用</b>              |  | 11, 808, 597. 28 | 11, 403, 264. 77 |
| 1. 管理人报酬                   |  | 5, 326, 169. 81  | 1, 808, 769. 92  |
| 2. 托管费                     |  | 1, 597, 850. 89  | 516, 791. 45     |
| 3. 销售服务费                   |  | 31, 728. 46      | 62, 427. 46      |
| 4. 交易费用                    |  | 56, 682. 30      | 1, 220. 74       |
| 5. 利息支出                    |  | 4, 572, 425. 92  | 8, 761, 488. 49  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |  | 4, 572, 425. 92  | 8, 761, 488. 49  |
| 6. 税金及附加                   |  | 115, 461. 18     | 65, 365. 21      |
| 7. 其他费用                    |  | 108, 278. 72     | 187, 201. 50     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |  | 10, 376, 042. 51 | 15, 406, 550. 18 |
| <b>减：所得税费用</b>             |  | -                | -                |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |  | 10, 376, 042. 51 | 15, 406, 550. 18 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 24 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 24 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）                        | 1, 587, 379, 840. 59                  | 722, 397, 856. 62  | 2, 309, 777, 697. 21  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 10, 376, 042. 51   | 10, 376, 042. 51      |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | 384, 755, 991. 55                     | 177, 513, 253. 26  | 562, 269, 244. 81     |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1, 553, 572, 616. 23                  | 715, 333, 790. 70  | 2, 268, 906, 406. 93  |
| 2. 基金赎回款                               | -1, 168, 816, 624. 68                 | -537, 820, 537. 44 | -1, 706, 637, 162. 12 |
| 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） | -                                     | -                  | -                     |

|  |                                 |                |                  |
|--|---------------------------------|----------------|------------------|
| ”号填列)  |                                 |                |                  |
| 五、期末所有者权益(基<br>金净值)                                | 1,972,135,832.14                | 910,287,152.39 | 2,882,422,984.53 |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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<br>金净值)                                | 340,235,759.74                  | 212,594,294.15 | 552,830,053.89   |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本期利<br>润)                   | -                               | 15,406,550.18  | 15,406,550.18    |
| 三、本期基金份额交易产<br>生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)          | -37,432,703.66                  | -24,115,210.89 | -61,547,914.55   |
| 其中: 1. 基金申购款                                       | 559,805.06                      | 373,117.21     | 932,922.27       |
| 2. 基金赎回款   | -37,992,508.72                  | -24,488,328.10 | -62,480,836.82   |
| 四、本期向基金份额持有<br>人分配利润产生的基金净<br>值变动(净值减少以“-”<br>号填列) | -                               | -              | -                |
| 五、期末所有者权益(基<br>金净值)                                | 302,803,056.08                  | 203,885,633.44 | 506,688,689.52   |

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

银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金(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》、《银河岁岁回报定期开放债券型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[2013]786号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为346,272,572.08份,经安永华明会计师

事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为安永华明(2013)验字第 60821717\_B06 号的验资报告。基金合同于 2013 年 8 月 9 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2019 年 5 月 25 日发布的《银河基金管理有限公司关于银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2019 年 6 月 25 日起，“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”，《银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》及托管协议亦于该日同时生效。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为 A 类基金份额(以下简称“银河回报债券 A”)和 C 类基金份额(以下简称“银河回报债券 C”)两类份额。其中，银河回报债券 A 是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；银河回报债券 C 是指在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于固定收益类品种，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、中期票据、分离交易可转债、中小企业集合债、资产支持证券、债券回购、银行定期存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股，仅可持有因可转债形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。本基金的投资组合为：本基金债券的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%；可转债投资比例不高于基金资产净值的 30%；但在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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。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：每个封闭期起始日的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。

#### 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关于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。

2019 年 6 月 25 日本基金变更为银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金并继续运作,故而本财务报表仍按持续经营假设编制。

#### 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 24 日(新基金合同生效日前日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 24 日(新基金合同生效日前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财

税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
- 4) 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。
- 5) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

#### 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、基金销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 中国银河证券股份有限公司 | 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

### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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：本基金本报告期及上年可比区间均无应付关联方佣金。

### 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>6 月 24 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月<br>30 日 |
|------------------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费               | 5,326,169.81                             | 1,808,769.92                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup> | 110,834.48                               | 287,104.86                                    |

注：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 10 月 30 日，支付基金管理人银河基金的基金管理费按前一日基金资产净值  $\times 0.70\%$  的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费 = 前一日基金资产净值  $\times 0.70\% \div$  当年天数；2018 年 10 月 31 日至本报告期末，支付基金管理人银河基金的基金管理费按前一日基金资产净值  $\times 0.50\%$  的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费 = 前一日基金资产净值  $\times 0.50\% \div$  当年天数。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目                 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>6 月 24 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月<br>30 日 |
|--------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付<br>的托管费 | 1,597,850.89                             | 516,791.45                                    |

注：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 10 月 30 日，支付基金托管人邮储银行的基金托管费按前一日基金资产净值  $\times 0.20\%$  的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值  $\times 0.20\% \div$  当年天数；2018 年 10 月 31 日至本报告期末，支付基金托管人邮储银行的基金托管费按前一日基金资产净值  $\times 0.15\%$  的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值  $\times 0.15\% \div$  当年天数。

#### 6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 24 日      |           |           |
|--------------------|--|-----------|-----------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |           |
|                    | 银河回报债券 A                                   | 银河回报债券 C  | 合计        |
| 邮储银行               | -  | 17,476.38 | 17,476.38 |
| 银河基金管理有限公司         | -  | 1,268.08  | 1,268.08  |
| 银河证券公司             | -  | 129.77    | 129.77    |
| 合计                 | -  | 18,874.23 | 18,874.23 |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |           |           |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |           |
|                    | 银河回报债券 A                                   | 银河回报债券 C  | 合计        |
| 邮储银行               | -  | 28,652.22 | 28,652.22 |
| 银河基金管理有限公司         | -  | 1,722.69  | 1,722.69  |
| 银河证券公司             | -  | 758.71    | 758.71    |
| 合计                 | -  | 31,133.62 | 31,133.62 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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：本基金报告期及上一报告期末均未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

注：本基金本期与上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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：本基金本期末与上年度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<br>名称 | 本期                              |            | 上年度可比期间                         |           |
|-----------|---------------------------------|------------|---------------------------------|-----------|
|           | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 24 日 | 期末余额       | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 当期利息收入    |
| 邮储银行      | 315,115,041.26                  | 343,146.10 | 7,040,649.90                    | 18,663.48 |

注：本基金的银行存款由基金托管人邮储银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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 24 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，本基金无从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款。

##### **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 24 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 132,000,000.00 元，于 2019 年 07 月 01 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（转型后）

### 7.3 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            | 1,932,698,245.20 | 67.96        |
|    | 其中：债券             | 1,932,698,245.20 | 67.96        |
|    | 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          | 728,000,000.00   | 25.60        |
|    | 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      | 160,307,850.64   | 5.64         |
| 8  | 其他各项资产            | 22,915,156.82    | 0.81         |
| 9  | 合计                | 2,843,921,252.66 | 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投资股票。

#### 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。

#### 7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未投资股票。

### 7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末投资股票。

### 7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末投资股票。

### 7.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末投资股票。

## 7.4 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      | 109,912,000.00   | 4.29         |
| 2  | 央行票据      | —                | —            |
| 3  | 金融债券      | —                | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —                | —            |
| 4  | 企业债券      | 148,232,245.20   | 5.79         |
| 5  | 企业短期融资券   | 951,521,000.00   | 37.14        |
| 6  | 中期票据      | 283,828,000.00   | 11.08        |
| 7  | 可转债（可交换债） | —                | —            |
| 8  | 同业存单      | 439,205,000.00   | 17.14        |
| 9  | 其他        | —                | —            |
| 10 | 合计        | 1,932,698,245.20 | 75.43        |

## 7.5 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  | 111909198 | 19 浦发银行 CD198 | 2,000,000 | 195,580,000.00 | 7.63         |
| 2  | 111918211 | 19 华夏银行 CD211 | 1,500,000 | 146,685,000.00 | 5.72         |
| 3  | 019611    | 19 国债 01      | 1,100,000 | 109,912,000.00 | 4.29         |
| 4  | 011900788 | 19 中建材 SCP001 | 1,000,000 | 100,040,000.00 | 3.90         |
| 5  | 111810594 | 18 兴业银行       | 1,000,000 | 96,940,000.00  | 3.78         |

|  |  |       |  |  |
|--|--|-------|--|--|
|  |  | CD594 |  |  |
|--|--|-------|--|--|

## 7.6 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。

## 7.7 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.8 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。

## 7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.9.2 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。

### 7.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.10 投资组合报告附注

### 7.10.1 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

【111918211】19 华夏银行 CD211:

根据 2018 年 6 月 12 日发布的相关公告，该证券发行人未严格区分相关银行账户属性，将开立在爱建证券名下的客户交易结算资金账户上传至查控系统，造成证券公司客户交易结算资金被冻结，该行发现上述情况后，亦未及时向监管部门报告。中国证监会责令该行予以改正，完善技术系统，强化资金存管责任，杜绝此类问题再次发生。

本基金投资的前十名证券中其余九只证券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。

### 7.10.2 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中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.10.3 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   | 87,191.37     |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 22,782,284.39 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | 45,681.06     |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 22,915,156.82 |

### 7.10.4 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。

### 7.10.5 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。

### 7.10.6 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。

## §7 投资组合报告（转型前）

### 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, 162, 464, 654. 60 | 68. 74        |
|    | 其中：债券             | 2, 162, 464, 654. 60 | 68. 74        |
|    | 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          | 630, 000, 000. 00    | 20. 03        |
|    | 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      | 325, 220, 115. 29    | 10. 34        |
| 8  | 其他资产              | 28, 077, 794. 67     | 0. 89         |
| 9  | 合计                | 3, 145, 762, 564. 56 | 100. 00       |

注：本基金于 2019 年 6 月 24 日到期，并于次日（即 2019 年 6 月 25 日）转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”。此处及以下各项所指“本期末”均为 2019 年 6 月 24 日。

### 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投资股票。

#### 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所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未投资股票。

## 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：本基金本报告期未投资股票。

### 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：本基金本报告期未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期未投资股票。

## 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      | 109,879,000.00   | 3.81         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 191,963,000.00   | 6.66         |
|    | 其中：政策性金融债 | 191,963,000.00   | 6.66         |
| 4  | 企业债券      | 148,145,654.60   | 5.14         |
| 5  | 企业短期融资券   | 891,125,000.00   | 30.92        |
| 6  | 中期票据      | 283,732,000.00   | 9.84         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 537,620,000.00   | 18.65        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 2,162,464,654.60 | 75.02        |

## 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  | 111909198 | 19 浦发银行 CD198 | 2,000,000 | 195,480,000.00 | 6.78         |
| 2  | 111918211 | 19 华夏银行 CD211 | 1,500,000 | 146,610,000.00 | 5.09         |
| 3  | 100411    | 10 农发 11      | 1,400,000 | 141,148,000.00 | 4.90         |
| 4  | 019611    | 19 国债 01      | 1,100,000 | 109,879,000.00 | 3.81         |
| 5  | 011900788 | 19 中建材        | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 3.47         |

|  |  |        |  |  |
|--|--|--------|--|--|
|  |  | SCP001 |  |  |
|--|--|--------|--|--|

## 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

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

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

【111918211】19 华夏银行 CD211:

根据 2018 年 6 月 12 日发布的相关公告，该证券发行人未严格区分相关银行账户属性，将开立在爱建证券名下的客户交易结算资金账户上传至查控系统，造成证券公司客户交易结算资金被冻结，该行发现上述情况后，亦未及时向监管部门报告。中国证监会责令该行予以改正，完善技术系统，强化资金存管责任，杜绝此类问题再次发生。

本基金投资的前十名证券中其余九只证券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。

#### 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   | 87,191.37     |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 27,943,432.68 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | 47,170.62     |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 28,077,794.67 |

#### 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。

#### 7.12.5 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。

#### 7.11.5 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（转型后）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别            | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 银河<br>回报<br>债券<br>A | 944              | 2,054,624.12  | 1,909,140,557.57 | 98.43%     | 30,424,612.73 | 1.57%      |
| 银河<br>回报<br>债券<br>C | 612              | 16,037.90     | -                | -          | 9,815,194.70  | 100.00%    |
| 合计                  | 1,556            | 1,252,815.14  | 1,909,140,557.57 | 97.94%     | 40,239,807.43 | 2.06%      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 份额级别         | 持有份额总数（份） | 占基金总份额<br>比例 |
|----------------------|--------------|-----------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 银河回报<br>债券 A | 0.00      | 0.0000%      |
|                      | 银河回报<br>债券 C | 0.00      | 0.0000%      |
|                      | 合计           | 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                                     | 份额级别     | 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<br>金投资和研究部门负责人<br>持有本开放式基金 | 银河回报债券 A | 0                 |
|  | 银河回报债券 C | 0                 |
|  | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开                            | 银河回报债券 A | 0                 |

|       |          |   |
|-------|----------|---|
| 开放式基金 | 银河回报债券 C | 0 |
|       | 合计       | 0 |

## §8 基金份额持有人信息（转型前）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别            | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 银河<br>回报<br>债券<br>A | 955              | 2,054,927.30  | 1,931,988,006.38 | 98.45%     | 30,467,569.42 | 1.55%      |
| 银河<br>回报<br>债券<br>C | 646              | 14,984.92     | -                | -          | 9,680,256.34  | 100.00%    |
| 合计                  | 1,601            | 1,231,815.01  | 1,931,988,006.38 | 97.96%     | 40,147,825.76 | 2.04%      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 份额级别         | 持有份额总数（份） | 占基金总份额<br>比例 |
|----------------------|--------------|-----------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 银河回报<br>债券 A | 0.00      | 0.0000%      |
|                      | 银河回报<br>债券 C | 0.00      | 0.0000%      |
|                      | 合计           | 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                                     | 份额级别     | 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<br>金投资和研究部门负责人<br>持有本开放式基金 | 银河回报债券 A | 0                 |
|  | 银河回报债券 C | 0                 |
|  | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开<br>放式基金                    | 银河回报债券 A | 0                 |
|  | 银河回报债券 C | 0                 |
|  | 合计       | 0                 |



## § 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位: 份

| 项目                                  | 银河回报债券 A             | 银河回报债券 C        |
|-------------------------------------|----------------------|-----------------|
| 基金合同生效日基金份额总额                       | 1, 962, 455, 575. 80 | 9, 680, 256. 34 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额               | 8, 122, 952. 37      | 243, 563. 94    |
| 减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 31, 013, 357. 87     | 108, 625. 58    |
| 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) | -                    | -               |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 1, 939, 565, 170. 30 | 9, 815, 194. 70 |

注: 1. 红利再投资和基金转换转入和因分级导致的基金份额强增作为本期申购资金的来源, 统一计入本期总申购份额, 基金转换转出和因分级导致的基金份额强减作为本期赎回资金的支付, 统一计入本期总赎回份额, 可不单独列示。

2. 本基金由“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”转型而来。“银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金”于 2019 年 6 月 24 日到期, 并于次日 (即 2019 年 6 月 25 日) 转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”。本基金合同生效日即为 2019 年 6 月 25 日。

## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位: 份

| 项目                          | 银河回报债券 A             | 银河回报债券 C          |
|-----------------------------|----------------------|-------------------|
| 基金合同生效日基金份额总额               | 141, 080, 884. 10    | 205, 191, 687. 98 |
| 本报告期期初基金份额总额                | 1, 574, 606, 433. 74 | 12, 773, 406. 85  |
| 本报告期期间基金总申购份额               | 1, 553, 364, 272. 99 | 208, 343. 24      |
| 减: 本报告期期间基金总赎回份额            | 1, 165, 515, 130. 93 | 3, 301, 493. 75   |
| 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                | 1, 962, 455, 575. 80 | 9, 680, 256. 34   |

注: 1. 红利再投资和基金转换转入和因分级导致的基金份额强增作为本期申购资金的来源, 统一计入本期总申购份额, 基金转换转出和因分级导致的基金份额强减作为本期赎回资金的支付, 统一计入本期总赎回份额, 可不单独列示。

2. 本基金于 2019 年 6 月 24 日到期, 并于次日 (即 2019 年 6 月 25 日) 转型为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”。本基金本报告期期末即为 2019 年 6 月 24 日。

## §10 重大事件揭示

### 10.5 基金份额持有人大会决议

银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金管理人经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，分别于 2019 年 4 月 24 日、4 月 25 日和 4 月 26 日发布《银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》、《银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》，审议银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金变更注册为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”，并对《基金合同》进行修订的有关事项。本次基金份额持有人大会于 2019 年 5 月 24 日表决通过了《关于银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金变更注册事项的议案》，并发布《银河基金管理有限公司关于银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，并于 2019 年 6 月 25 日正式实施相关变更事项。

### 10.6 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。

### 10.7 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。

## 10.8 基金投资策略的改变

回报封闭期内整体投资策略方向无变化，仍以久期选择、收益率曲线分析、债券类属选择、个债选择、债券回购杠杆策略、资产支持证券投资策略等投资策略为主，但考虑到封闭期限由一年变更为半年，为与封闭期限相匹配，组合整体久期降低。

## 10.9 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。

## 10.10 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。

## 10.11 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

### 10.11.1 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<br>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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 财通证券 | 1          | -    | -                    | -         | -              | -  |
| 华创证券 | 1          | -    | -                    | -         | -              | -  |
| 国海证券 | 2          | -    | -                    | -         | -              | -  |

注：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。

### 10.11.2 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 |
| 财通证券 | -    | -            | 815,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 华创证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国海证券 | -    | -            | -              | -              | -    | -            |

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

#### 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 |    |
| 财通证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国海证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：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 |
| 财通证券 | 197,154,284.52 | 25.85%       | 4,904,600,000.00 | 51.06%         | -    | -            |
| 华创证券 | 20,747,620.26  | 2.72%        | -                | -              | -    | -            |
| 国海证券 | 544,762,006.77 | 71.43%       | 4,701,100,000.00 | 48.94%         | -    | -            |

### 10.9 其他重大事件（转型后）

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式      | 法定披露日期          |
|----|--|-------------|-----------------|
| 1  | 银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | 《证券时报》、公司网站 | 2019 年 4 月 25 日 |
| 2  | 银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告 | 《证券时报》、公司网站 | 2019 年 4 月 26 日 |
| 3  | 银河基金管理有限公司关于旗  | 《中国证券报》、    | 2019 年 5 月 21 日 |

|   |  |   |                 |
|---|--|---|-----------------|
|   | 下部分基金在中国中投证券有限责任公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告                 | 《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《证券日报》、公<br>司网站  |                 |
| 4 | 银河基金管理有限公司关于银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告 | 《证券时报》、公<br>司网站                         | 2019 年 5 月 25 日 |
| 5 | 银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                              | 《证券日报》、公<br>司网站                         | 2019 年 5 月 30 日 |
| 6 | 银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告           | 《证券时报》、公<br>司网站                         | 2019 年 6 月 21 日 |
| 7 | 银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金分红公告                              | 《证券时报》、公<br>司网站                         | 2019 年 6 月 22 日 |
| 8 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有债券估值调整的提示性公告                      | 《中国证券报》、<br>《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>公司网站 | 2019 年 6 月 26 日 |
| 9 | 银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告               | 《中国证券报》、<br>《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>公司网站 | 2019 年 6 月 26 日 |

## 10.9 其他重大事件（转型前）

| 序号 | 公告事项                               | 法定披露方式                          | 法定披露日期          |
|----|------------------------------------|---------------------------------|-----------------|
| 1  | 银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告 | 《中国证券报》、<br>《证券时报》、<br>《上海证券报》、 | 2019 年 1 月 22 日 |

|   |  |  |                 |
|---|--|--|-----------------|
|   |  | 《证券日报》公司<br>网站                                     |                 |
| 2 | 银河岁岁回报定期开放债券型<br>证券投资基金受限开放日申购<br>赎回结果公告                       | 《证券时报》、公<br>司网站                                    | 2019 年 3 月 6 日  |
| 3 | 银河岁岁回报定期开放债券型<br>证券投资基金招募说明书（更<br>新摘要）                         | 《证券时报》、公<br>司网站                                    | 2019 年 3 月 23 日 |
| 4 | 银河岁岁回报定期开放债券型<br>证券投资基金 2018 年年度报<br>告                         | 《中国证券报》、<br>《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《证券日报》、公<br>司网站 | 2019 年 3 月 29 日 |
| 5 | 关于旗下部分基金继续参加交<br>通银行手机银行基金申购及定<br>期定额投资手续费率优惠活动<br>的公告         | 《中国证券报》、<br>《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《证券日报》、公<br>司网站 | 2019 年 3 月 30 日 |
| 6 | 银河岁岁回报定期开放债券型<br>证券投资基金 2019 年 1 季度<br>报告                      | 《中国证券报》、<br>《证券时报》、<br>《上海证券报》、<br>《证券日报》、公<br>司网站 | 2019 年 4 月 18 日 |
| 7 | 银河基金管理有限公司关于以<br>通讯方式召开银河岁岁回报定<br>期开放债券型证券投资基金基<br>金份额持有人大会的公告 | 《证券时报》、公<br>司网站                                    | 2019 年 4 月 24 日 |

## §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              | 20190620~20190630       | 0.00 | 684,462,012.32 | -    | 684,462,012.32 | 35.29% |
|   | 2              | 20190528~20190619       | 0.00 | 287,790,116.28 | -    | 287,790,116.28 | 14.84% |
|   | 3              | 20190530~20190619       | 0.00 | 311,666,134.70 | -    | 311,666,134.70 | 16.07% |
| 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

银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金管理人经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，分别于 2019 年 4 月 24 日、4 月 25 日和 4 月 26 日发布《银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》、《银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》，审议银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金变更注册为“银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”，并对《基金合同》进行修订的有关事项。本次基金份额持有人大会于 2019 年 5 月 24 日表决通过了《关于银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金变更注册事项的议案》，并发布《银河基金管理有限公司关于银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，于 2019 年 6 月 25 日正式实施相关变更事项。

银河基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日