

银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证  
券投资基金  
2020 年第 2 季度报告

2020 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

报告送出日期：2020 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 07 月 15 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 银河中债央企 20 债券指数  |
| 场内简称       | -   |
| 交易代码       | 007155  |
| 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    | 2019 年 4 月 10 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 987,627,562.49 份  |
| 投资目标       | 本基金通过指数化投资，通过数量化的风险管理手段，以实现对标指数的有效跟踪。   |
| 投资策略       | <p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份债券和备选成份债券，或选择非成份债券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，将年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当预期成份券发生调整时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因市场流动性不足时，或因债券交易特性及交易惯例等因素影响跟踪标的指数效果时，或其他原因导致无法</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，构建替代组合。由于本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响，本基金组合中个券权重和券种与标的指数成份券和券种间将存在差异。</p> <p>1、优化抽样复制策略 本基金通过对标的指数中各成份券的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的债券构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>2、替代性策略 对于市场流动性不足、因法律法规原因个别成份债券被限制投资等情况，本基金无法获得对个别成份债券足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份债券、非成份债券等方式进行替代。</p> <p>3、其他债券投资策略 为了在一定程度上弥补基金费用，基金管理人还可以在控制风险的前提下，使用其他投资策略。例如，基金管理人可以利用银行间市场与交易所市场，或债券一、二级市场间的套利机会进行跨市场套利；还可以使用事件驱动策略，即通过分析重大事件发生对投资标的定价的影响而进行套利；也可以使用公允价值策略，即通过对债券市场价格与模型价格偏离度的研究，采取相应的增、减仓操作；或运用杠杆原理进行回购交易等。未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定并履行适当程序后，相应调整或更新投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债-1-3 年久期央企 20 债券指数收益率×95%+同期银行活存款利率（税后）×5%   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其风险收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。   |
| 基金管理人  | 银河基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 杭州银行股份有限公司   |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标     | 报告期（2020 年 4 月 1 日 — 2020 年 6 月 30 日） |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 12,346,856.43                         |

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 2. 本期利润         | 1,847,097.43     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0018           |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,012,314,985.42 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0250           |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

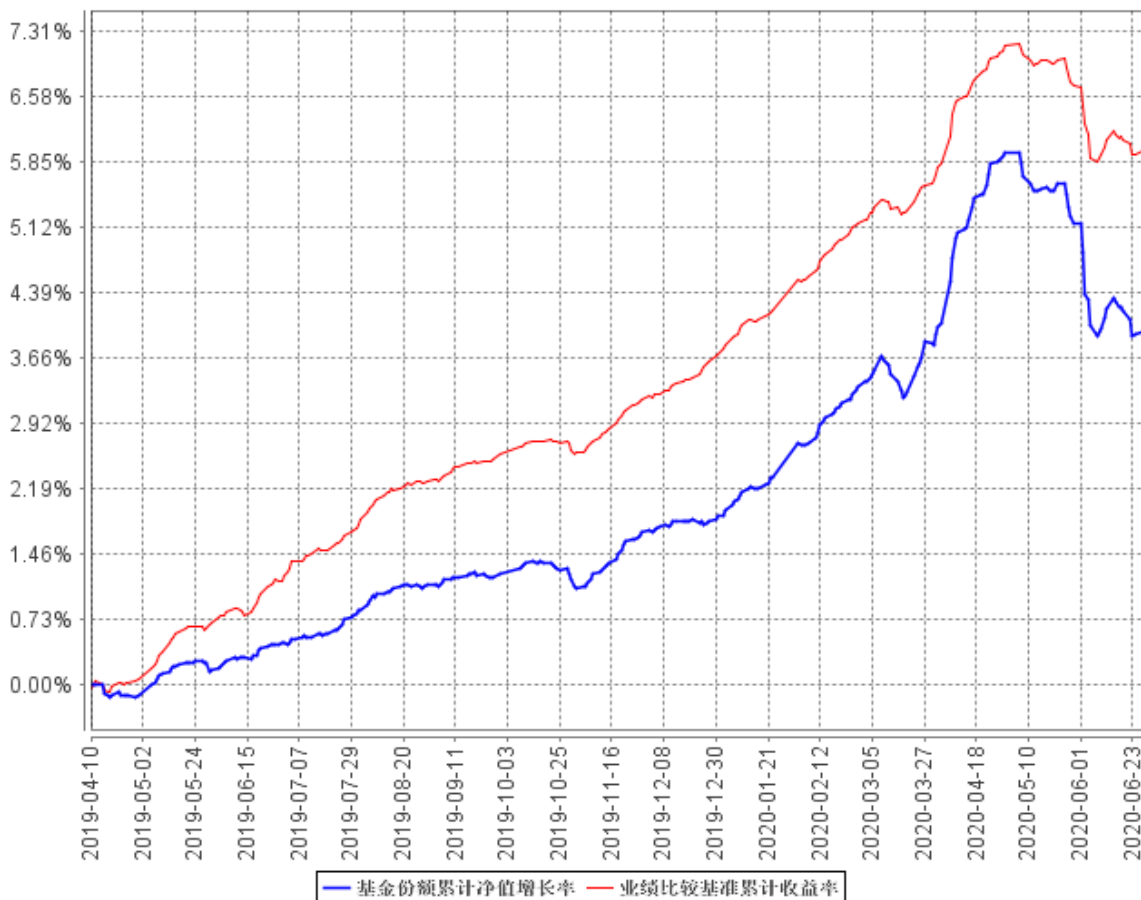
### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.16%      | 0.13%         | 0.33%          | 0.09%                 | -0.17% | 0.04% |
| 过去六个月          | 2.05%      | 0.11%         | 2.21%          | 0.07%                 | -0.16% | 0.04% |
| 过去一年           | 3.49%      | 0.07%         | 4.77%          | 0.05%                 | -1.28% | 0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 3.98%      | 0.07%         | 5.99%          | 0.05%                 | -2.01% | 0.02% |

注：本基金的业绩比较基准为：中债-1-3 年久期央企 20 债券指数收益率×95%+同期银行活存款利率（税后）×5%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2019 年 4 月 10 日，根据《银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金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。截至建仓期结束，本基金各项资产配置符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|--------|----|
|----|----|-------------|--------|----|

|    |      | 任职日期            | 离任日期            |    |  |
|----|------|-----------------|-----------------|----|--|
| 何晶 | 基金经理 | 2019 年 4 月 16 日 | -               | 11 | 硕士研究生，11 年金融行业相关从业经历。曾任职于上海东证期货有限公司研究部，江海证券有限公司研究部、德邦基金管理有限公司投资研究部、恒越基金管理有限公司固定收益部从事固定收益、数量化和大宗商品等研究及固定收益投资相关工作，2017 年 5 月加入我公司。2019 年 1 月起担任银河如意债券型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月起担任银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起担任银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 12 月起担任银河通利债券型证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2020 年 4 月起担任银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 刘铭 | 基金经理 | 2019 年 4 月 10 日 | 2020 年 5 月 23 日 | 9  | 硕士研究生学历，9 年金融行业相关从业经历。曾任职于上海汽车集团财务有限责任公司固定收益部、上海银行股份有限公司资产管理部，从事固定收益交易、研究与投资相关工作，2016 年 7 月加入我公司固  |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>定收益部。2017 年 4 月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 12 月起担任银河铭忆 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 3 月起担任银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 6 月起担任银河景行 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 9 月起担任银河沃丰纯债债券型证券投资基金的基金经理, 2018 年 12 月起担任银河嘉裕纯债债券型证券投资基金的基金经理, 2019 年 4 月起担任银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 金的基金经理，2019 年 6 月起担任银河睿安纯债债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 9 月起担任银河久泰纯债债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 12 月起担任银河睿鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 1 月起担任银河久悦纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、上表中刘铭的任职日期为基金合同生效之日，其余日期为公司做出决定之日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

3、本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

#### 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》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚实信用、勤奋律己、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金份额持有人的利益，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤奋律己、创新图强”的理念，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定，进一步加强风险管理和完善内部控制体系，为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司旗下管理的所有投资组合严格执行相关法律法规及公司制度，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保公平对待不同投资组合。同时，公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析。

针对同向交易部分，本报告期内，公司对旗下管理的所有投资组合（完全复制的指数基金除外），连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公开竞价交易的证券进行了



价差分析，并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

针对反向交易部分，公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易，各投资组合经理均严格按照制度规定，事前确定好申购价格和数量，按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

由于本基金采用被动式指数投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数跟踪方法，按照成份股在中债 1-3 年久期央企 20 债券全价指数中的基准权重构建债券投资组合，并原则上根据标的指数成份债的变化或其权重的变动而进行相应调整，本报告期未发现重大异常情况，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）。

#### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度债券市场波动加剧，4 月份收益率快速下行，但 5-6 月份连续调整上行，整个季度各期限收益率相较季初上行 25-45BP。

经济数据方面，经济基本面延续修复趋势，反弹速度略有放缓。5 月工业增加值同比增速为 4.4%，较前值回升 0.5 个百分点，增幅较 4 月份缩窄；投资方面，1-5 月固定资产投资增速为-6.3%，降幅较上月缩窄 4 个百分点，其中地产、制造业和基建的累计同比增速分别为-0.3%、-14.8%、-3.31%，分别较上月回升 3、4、5.47 个百分点，基建投资仍是支撑投资增速回升的主要动力，地产投资较前期放缓但仍保持在较高位置；消费方面，5 月份消费增速继续回升，当月同比增速为-2.8%，较上月回升 4.7 个百分点，从累计增速看，1-5 月社会消费品零售总额累计增速为-13.5%，各分项 1-5 月总消费基本为去年同期的 80%~85%；进出口方面，受海外疫情冲击较大，进口增速的下降主要集中在 4、5 月份，海外生产受疫情制约，出口增速随着 5 月份欧美日疫情逐渐得到控制而有所回升，但对主要发展中国家，如印度、巴西等的增速继续大幅下滑，总体上进出口随着疫情逐步控制会有回升，但预计维持在低位；通胀方面，5 月 CPI 同比增速为 2.4%，PPI 同比增速为-3.7%，均较上月有所回落，从环比看，PPI 5 月份降幅较 4 月份大都缩窄，显示工业生产进

一步恢复，市场需求有所改善；金融数据方面，5 月 M2 同比增 11.1%，新增人民币贷款 1.48 万亿，新增社融 3.19 万亿，宽信用仍在发力。

资金利率方面，二季度整体相对于一季度继续下行，R001 二季度均值在 1.39%附近，下行 30BP 左右，R007 均值在 1.73%，下行 50BP 左右。在二季度内，资金价格先下后上，4 月至 5 月中旬，由于国内经济处于恢复阶段，海外疫情的恶化加大了国内经济的下行压力，央行通过定向降准，再贷款再贴投放，维持了流动性的很充裕状态；5 月下旬，1 万亿专项债 额度集中发行，加之缴税等因素使得资金面边际走紧至适度；6 月后，随着国内经济逐步恢复，海外发达经济体经济的逐步重启，以及监管层致力于整治套利行为，央行推出直达实体经济的再贷款政策推动宽信用，资金面则继续维持适度状态。二季度公开市场操作总体净回笼 2400 亿，其中 TMLF 缩量 2100 亿，MLF 缩量 7400 亿，价格方面未继续下调；6 月单月来看，6 月 R001 月均值为 1.80%，较 5 月均值上行 50BP；R007 月均值为 2%，较 5 月均值上行 38BP。

债券方面，二季度债市走出了先牛后熊的“V”型行情，流动性泛滥随后阶段性边际收紧使得短端走势幅度更大，全季度 1 年国开上行 35BP，3 年上行 46BP，5 年上行 35BP，10 年上行 17BP，曲线呈现熊平走势。二季度债市走势主要因为四月初央行定向降准同时调降超储利率引发流动性宽松充裕带动现券收益率迅速下行，短端下行幅度大于长端；五月以来央行阶段性边际收紧流动性，引导利率回到合理区间；此外政策严管资金空转套利，并指导调降结构性存款规模，货币政策进入观察期，流动性泛滥行情结束，现券收益率大幅上调。信用债方面，整体上行幅度与利率债接近，短端上行 40BP，3-5Y 上行 30BP，信用利差由于利率债上行小幅收窄。

本运作期内，本基金调整了债券仓位，适当增加杠杆以覆盖跟踪成本。

#### 4.5 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 1.0250 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.16%，业绩比较基准收益率为 0.33%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -            |
|    | 其中：股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,280,260,000.00 | 97.73        |
|    | 其中：债券             | 1,280,260,000.00 | 97.73        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 8,861,525.34     | 0.68         |
| 8  | 其他资产              | 20,853,618.77    | 1.59         |
| 9  | 合计                | 1,309,975,144.11 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | -             | -            |
| 2  | 央行票据 | -             | -            |
| 3  | 金融债券 | 60,054,000.00 | 5.93         |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
|    | 其中：政策性金融债 | 60,054,000.00    | 5.93   |
| 4  | 企业债券      | 750,729,000.00   | 74.16  |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -      |
| 6  | 中期票据      | 469,477,000.00   | 46.38  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | -                | -      |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 1,280,260,000.00 | 126.47 |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 101771016 | 17 中铝业 MTN005  | 800,000 | 84,344,000.00 | 8.33         |
| 2  | 122244    | 12 大唐 01       | 800,000 | 84,048,000.00 | 8.30         |
| 3  | 101900929 | 19 中航集 MTN002  | 800,000 | 81,984,000.00 | 8.10         |
| 4  | 101901584 | 19 中化工 MTN006  | 800,000 | 80,968,000.00 | 8.00         |
| 5  | 155512    | 19 铁工 05       | 800,000 | 80,880,000.00 | 7.99         |
| 6  | 102000330 | 20 鞍钢 MTN001   | 800,000 | 79,736,000.00 | 7.88         |
| 7  | 163458    | 20 新际 02       | 800,000 | 79,040,000.00 | 7.81         |
| 8  | 163133    | 20 中电 01       | 700,000 | 70,616,000.00 | 6.98         |
| 9  | 101900214 | 19 鞍钢集 MTN001  | 600,000 | 60,936,000.00 | 6.02         |
| 10 | 200401    | 20 农发 01       | 600,000 | 60,054,000.00 | 5.93         |
| 11 | 163312    | 20 中铝 02       | 600,000 | 59,778,000.00 | 5.91         |
| 12 | 163124    | 20 中航 01       | 500,000 | 50,515,000.00 | 4.99         |
| 13 | 136734    | 16 大唐 01       | 500,000 | 49,890,000.00 | 4.93         |
| 14 | 112678    | 18 蛇口 01       | 400,000 | 41,860,000.00 | 4.14         |
| 15 | 101901023 | 19 蓝星 MTN001   | 400,000 | 40,552,000.00 | 4.01         |
| 16 | 1380075   | 13 中化股<br>债 01 | 300,000 | 31,344,000.00 | 3.10         |
| 17 | 112737    | 18 侨集 01       | 300,000 | 30,492,000.00 | 3.01         |
| 18 | 155552    | 19 鲁能 01       | 300,000 | 30,297,000.00 | 2.99         |
| 19 | 155677    | 19 中铝 G4       | 300,000 | 30,261,000.00 | 2.99         |
| 20 | 143670    | 18 中煤 03       | 200,000 | 20,366,000.00 | 2.01         |
| 21 | 112922    | 19 蛇口 02       | 200,000 | 20,270,000.00 | 2.00         |
| 22 | 155726    | 19 北方 03       | 200,000 | 20,214,000.00 | 2.00         |
| 23 | 163453    | 20 中化 01       | 200,000 | 19,582,000.00 | 1.93         |

|    |           |                  |         |               |      |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| 24 | 112643    | 18 侨城 04         | 100,000 | 10,636,000.00 | 1.05 |
| 25 | 112613    | 17 蛇口 01         | 100,000 | 10,518,000.00 | 1.04 |
| 26 | 101554043 | 15 中煤<br>MTN001  | 100,000 | 10,337,000.00 | 1.02 |
| 27 | 101801263 | 18 鞍钢<br>MTN001  | 100,000 | 10,262,000.00 | 1.01 |
| 28 | 101801053 | 18 中色<br>MTN001  | 100,000 | 10,232,000.00 | 1.01 |
| 29 | 101901168 | 19 中化工<br>MTN003 | 100,000 | 10,126,000.00 | 1.00 |
| 30 | 155392    | 19 新际 01         | 100,000 | 10,122,000.00 | 1.00 |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金未进行贵金属投资。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂未参与股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂未参与国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券中，没有发行主体被监管部门立案调查的情形，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 215,894.57    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 20,637,724.20 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 20,853,618.77 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 989,717,769.05 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 97,479,896.39  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 99,570,102.95  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 987,627,562.49 |

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额。

2、总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |        |
|-------|----------------|--------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额           | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 20200401-20200630        | 890,163,713.81 | -    | -    | 890,163,713.81 | 90.13% |
| 个人    | -              | -                        | -              | -    | -    | -              | -      |

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金的文件
- 2、《银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金基金合同》
- 3、《银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
- 5、银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 9.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

### 9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38568888 /400-820-0860

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司

2020 年 7 月 21 日