

银河丰利纯债债券型证券投资基金清算报 告

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2026年5月12日

§ 1 基金情况

1.1 基金产品概况

基金名称	银河丰利纯债债券型证券投资基金	
基金简称	银河丰利债券	
基金主代码	519654	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年4月14日	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
最后运作日(2026年3月4日) 基金的份额总额	9,689,568.46份	
投资目标	本基金在保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。	
业绩比较基准	中债-金融债券总指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
下属分级基金的基金简称	银河丰利债券 A	银河丰利债券 C
下属分级基金的交易代码	519654	022968
基金最后运作日(2026年3月4日)下属分级基金的份额总额	9,469,764.23份	219,804.23份

1.2 基金运作情况概述

银河丰利纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由银河泽利保本混合型证券投资基金转型而成。银河泽利保本混合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》、《银河泽利保本混合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[2015]389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2,988,454,525.12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(2015)验字第60821717_B02号的验资报告。原基金合同于2015年4月9

日正式生效。基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据银河泽利保本混合型证券投资基金基金管理人于 2017 年 3 月 31 日发布的《银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为银河丰利纯债债券型证券投资基金后运作的相关业务规则公告》，自 2017 年 4 月 14 日起，“银河泽利保本混合型证券投资基金”转型为“银河丰利纯债债券型证券投资基金”，《银河丰利纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下或简称“基金合同”、“《基金合同》”）及托管协议亦于该日同时生效。

根据《银河基金管理有限公司关于旗下银河丰利纯债债券型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，本基金自 2024 年 12 月 18 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并对本基金的基金合同作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的 C 类基金份额后，原有的基金份额将全部自动转换为本基金 A 类基金份额。对投资者收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；对投资者不收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额，C 类基金份额仅在场外申购、赎回。本基金 A 类和 C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。

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《银河丰利纯债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，包括债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债等）、上述债券作为质押物的债券回购、银行存款等，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）。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券、可交换债券。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。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，每个交易日日终，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债-金融债券总指数收益率。

根据《银河丰利纯债债券型证券投资基金基金合同》以及银河基金管理有限公司 2026 年 3 月 4 日发布的《银河基金管理有限公司关于银河丰利纯债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》，本基金于 2026 年 3 月 5 日进入基金财产清算期。自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

1.3 清算原因

银河丰利纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由银河泽利保本混合型证券投资基金保本周期到期依原基金合同约定转型而成，转型前依据中国证监会证监许可[2015]389号文注册募集，转型后银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金合同于2017年4月14日生效。依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《银河丰利纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金出现了基金合同终止情形，根据《基金合同》约定进入清算程序并终止。

根据《基金合同》第五部分 基金的存续的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。”

根据《基金合同》以及银河基金管理有限公司于2026年3月4日发布的《银河基金管理有限公司关于银河丰利纯债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》，本基金自2026年3月5日起进入基金财产清算程序。

由基金管理人银河基金管理有限公司、基金托管人北京银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2026年3月5日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

1.4 最后运作日期及清算期间

本基金最后运作日为2026年3月4日，清算期为2026年3月5日（清算开始日）起至2026年3月15日（清算结束日）止期间。

§ 2 清算报表编制基础

本基金的清算报表仅为供本基金基金管理人用以本基金清算相关监管报送或公告之目的而编制，清算报表以非持续经营为基础编制。因此，清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债，期末资产项目以预计可收回金额列报，负债项目按照需要偿付的金额列报。清算报表仅列示了2026年3月4日（最后运作日）的清算资产负债表和2026年3月5日（清算开始日）起至2026年3月15日（清算结束日）止清算期间的清算损益表及重要报表项目说明，除上述内容外，本基金遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《银河基金管理有限公司关于银河丰利纯债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》及基金合同的有关规定。

§ 3 财务报告

3.1 资产负债表

会计主体：银河丰利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2026年3月4日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2026年3月4日
资 产：	
货币资金	1,448,897.78
结算备付金	70,584.24
存出保证金	5,940.92
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资（若有）	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资（若有）	-
其他权益工具投资（若有）	-
应收清算款	7,525,476.04
应收股利	-
应收申购款	1,078,771.50
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	10,129,670.48
负债和净资产	最后运作日 2026年3月4日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	15,533.74
应付管理人报酬	298.14

应付托管费	99.38
应付销售服务费	0.30
应付投资顾问费	-
应交税费	370.12
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	-
负债合计	16,301.68
净资产：	
实收基金	9,689,568.46
其他综合收益（若有）	-
未分配利润	423,800.34
净资产合计	10,113,368.80
负债和净资产合计	10,129,670.48

注：1、报告截止日 2026 年 3 月 4 日，银河丰利债券 A 基金份额净值 1.0436 元，基金份额总额 9,469,764.23 份；银河丰利债券 C 基金份额净值 1.0506 元，基金份额总额 219,804.23 份。银河丰利债券份额总额合计为 9,689,568.46 份。

2、财务报表已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师王国蓓、韩一鸣签字出具了毕马威华振审字第 2607972 号无保留意见带强调事项段和其他事项段的审计报告。

§ 4 基金财产分配

自 2026 年 3 月 5 日至 2026 年 3 月 15 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

4.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4.2 资产处置情况

4.2.1 本基金最后运作日货币资金余额为人民币 1,448,897.78 元。

4.2.1.1 其中活期存款本金为人民币 1,448,076.02 元；应计活期存款利息为人民币 821.76 元，将于 2026 年 3 月 21 日结息到账。

4.2.2 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 70,584.24 元。

4.2.2.1 其中人民币 70,566.00 元为存放于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金，将于 2026 年 4 月 9 日全部到账；其应计利息人民币 18.24 元，将于 2026 年 3 月 23 日结息到账。

4.2.3 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 5,940.92 元。

4.2.3.1 其中人民币 5,938.32 元为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金，根据中

国证券登记结算有限责任公司的调整规则规定，将于 6 个月内陆续调回至托管户；其应计利息人民币 2.60 元，将于 2026 年 3 月 23 日结息到账。

4.2.4 本基金最后运作日应收清算款为人民币 7,525,476.04 元。截至 2026 年 3 月 5 日已全部到账。

4.2.5 本基金最后运作日应收申购款为人民币 1,078,771.50 元。截至 2026 年 3 月 6 日已全部到账。

4.3 负债清偿情况

4.3.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 15,533.74 元，已分别于 2026 年 3 月 5 日、2026 年 3 月 6 日支付完毕。

4.3.2 本基金最后运作日应付管理人报酬余额为人民币 298.14 元，已于 2026 年 3 月 6 日支付完毕。

4.3.3 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 99.38 元，已于 2026 年 3 月 6 日支付完毕。

4.3.4 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 0.30 元，已于 2026 年 3 月 6 日支付完毕。

4.3.5 本基金最后运作日应交税费为人民币 370.12 元，为截至终止运作日 2026 年 3 月 4 日的应交增值税费及应交增值税附加税，已于 2026 年 3 月 6 日支付完毕。

4.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算报告期间
	2026 年 3 月 5 日至 2026 年 3 月 15 日
一、清算期间收入	1,066.61
1. 利息收入	1,066.41
其中：存款利息收入	1,066.41
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-

其他投资收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	0.20
减：二、清算总支出	16.00
1. 管理人报酬	-
其中：暂估管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 信用减值损失	-
7. 税金及附加	-
8. 其他费用	16.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,050.61
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,050.61
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	1,050.61

注：1、根据《银河基金管理有限公司关于银河丰利纯债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》，本次召开基金份额持有人大会的费用（公证费及律师费）由基金管理人支付。

2、利息收入为2026年3月5日（含）至2026年3月15日（含）期间计提的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息。

3、其他费用为银行划款手续费人民币16.00元。

4、其他收入包括赎回费归资产人民币0.20元。

4.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日（2026年3月4日）基金净资产	10,113,368.80
加：清算期间净收益	1,050.61
基金申购转入总金额	10,531.30
减：基金赎回转出总金额	84,651.77
清算期利润分配	-
二、2026年3月15日基金净资产	10,040,298.94

注：基金管理人将根据本基金的基金合同及《银河基金管理有限公司关于银河丰利纯债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》，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，各类基金份额按基金份额持有人持有

的该类基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2026 年 3 月 15 日的剩余财产为人民币 10,040,298.94 元，其中银河丰利债券 A 剩余财产为人民币 9,835,275.30 元，银河丰利债券 C 剩余财产为人民币 205,023.64 元。

截至 2026 年 3 月 15 日，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户货币资金余额（不含利息）共人民币 10,018,155.86 元。

清算起始日（2026 年 3 月 5 日）至清算款划出日前一自然日的收益和费用由基金份额持有人享有和承担。该款项未结息部分由基金管理人垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

4.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§ 5 备查文件目录

5.1 备查文件目录

- 1、银河丰利纯债债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告；
- 2、关于《银河丰利纯债债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

5.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

5.3 查阅方式

投资者对本报告如有疑问，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.cgf.cn>

银河丰利纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2026 年 3 月 15 日