

# 银河康乐股票型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料已经会计师事务所审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
8.6 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.....	54

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	54
8.8 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 .....	54
8.9 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 .....	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
9.3 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 .....	57
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4 基金投资策略的改变 .....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
12.1 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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河康乐股票型证券投资基金
基金简称	银河康乐股票基金
场内简称	-
基金主代码	519673
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	2014 年 11 月 18 日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	262,955,523.74 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的健康快乐主题相关的股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金为主动管理的股票型基金，投资策略主要包括但不限于资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略等。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人在大类资产配置过程中，结合定量和定性分析，从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势，重点分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系，在此基础上，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券的比例，以争取降低单一行业投资的系统性风险冲击。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过对本基金定义的健康快乐主题相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型股票的投资价值。</p> <p>（1）健康快乐主题下的配置策略</p> <p>（2）精选个股策略</p> <p>1) 定性分析</p> <p>2) 定量分析</p> <p>3、债券投资策略</p>

	<p>本基金债券投资以久期管理为核心，采取久期配置、利率预期、收益率曲线估值、类属配置、单券选择等投资策略。</p> <p>4、股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的。</p> <p>5、权证投资策略 本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算，并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果，选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：申银万国医药生物行业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的基金产品。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	田青
	联系电话	021-38568989	010-67595096
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	010-67595096
传真		021-38568769	010-66275853
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		刘立达	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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 1568 号 15 层 2. 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	97,952,068.98	7,153,522.14	9,419,434.26
本期利润	215,400,563.35	-87,338,234.34	57,840,832.31
加权平均基金份额本期利润	0.7079	-0.2440	0.1236
本期加权平均净值利润率	45.61%	-18.10%	9.31%
本期基金份额净值增长率	59.06%	-17.77%	9.92%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	160,254,179.23	58,387,174.29	114,405,817.26
期末可供分配基金份额利润	0.6094	0.1746	0.2756
期末基金资产净值	491,429,353.49	392,775,796.03	593,421,551.01
期末基金份额净值	1.869	1.175	1.429
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	86.90%	17.50%	42.90%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

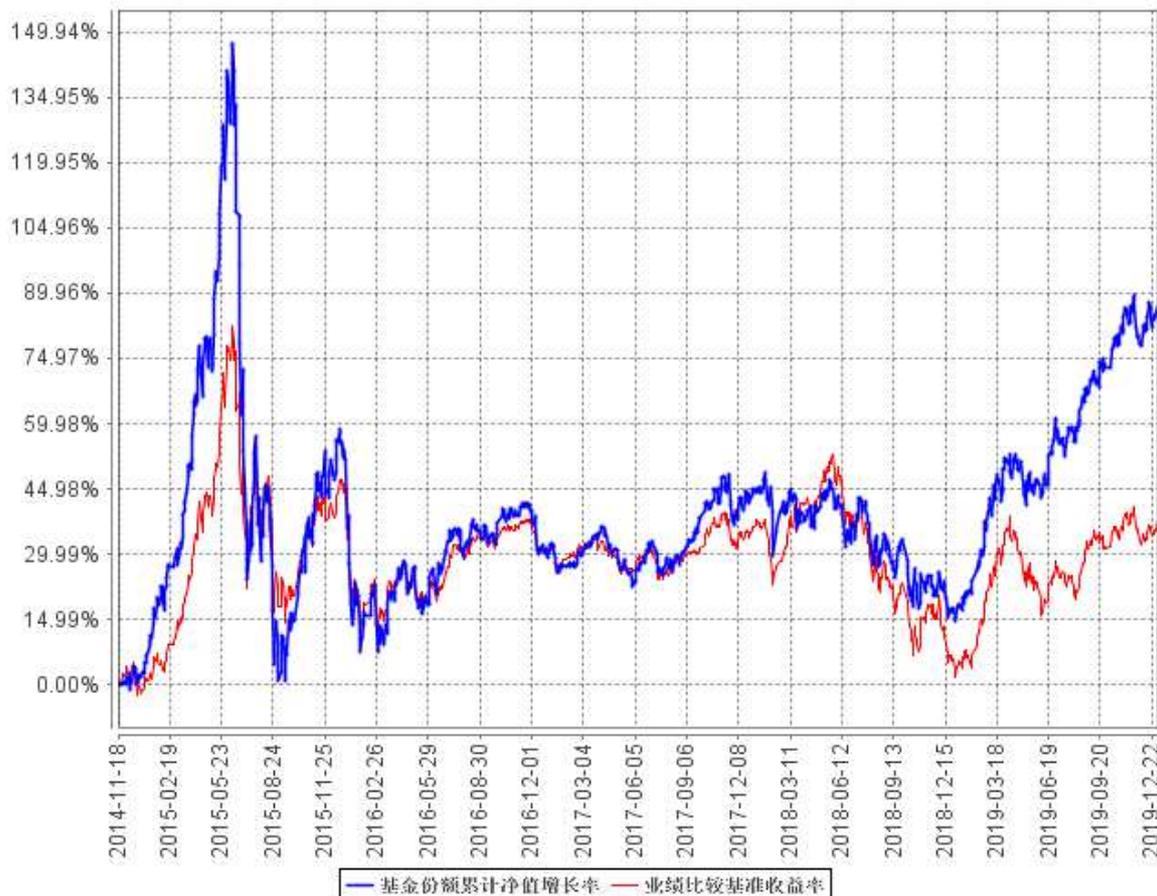
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.16%	0.94%	5.04%	0.88%	3.12%	0.06%
过去六个月	19.65%	0.94%	10.71%	0.88%	8.94%	0.06%
过去一年	59.06%	1.18%	30.15%	1.15%	28.91%	0.03%
过去三年	43.77%	1.17%	5.29%	1.09%	38.48%	0.08%
过去五年	81.63%	1.79%	39.64%	1.42%	41.99%	0.37%
自基金合同生效起至今	86.90%	1.78%	37.78%	1.41%	49.12%	0.37%

注：本基金的业绩比较基准为：申银万国医药生物行业指数收益率×80%+上证国债指数收益率

×20%

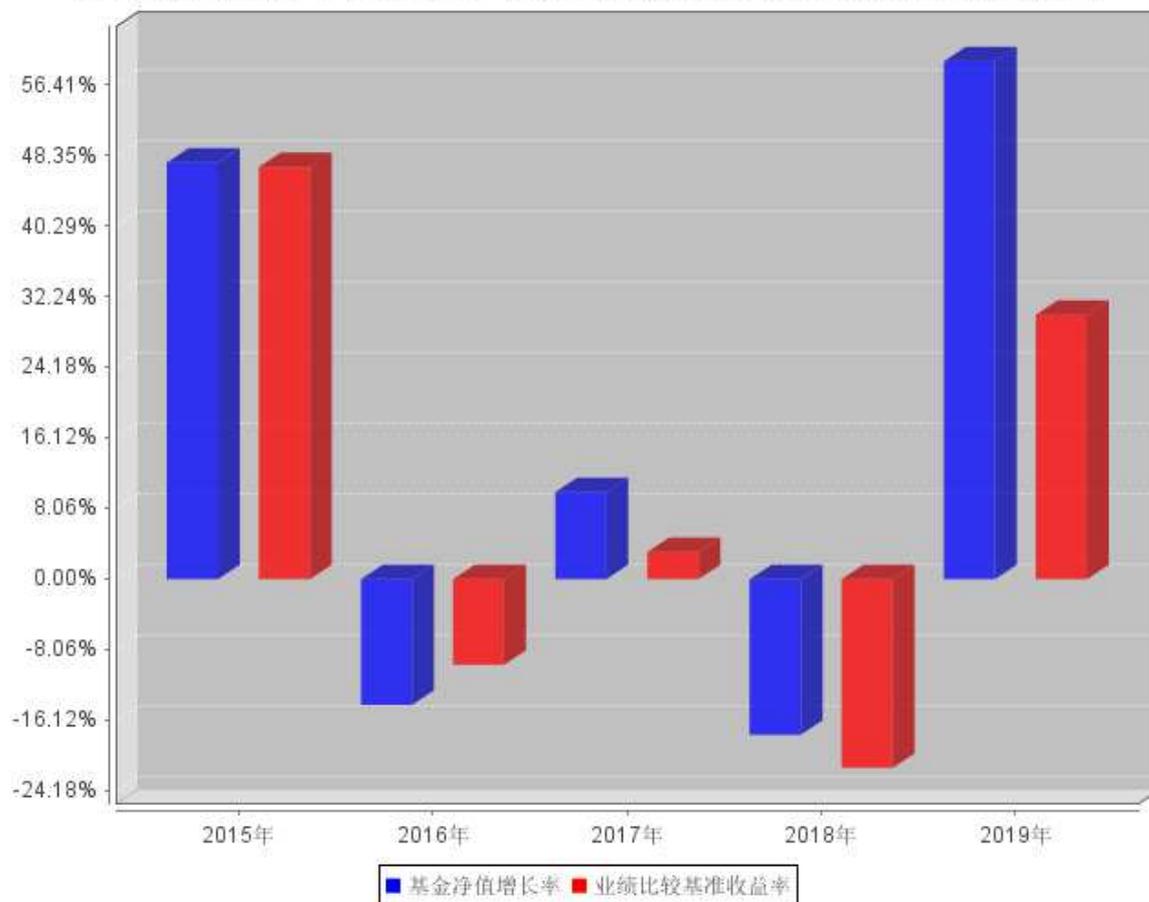
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：截至本报告期末，过去三年均未分配利润。

## § 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 12 月 31 日，公司管理的基金有：银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联系列证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金（LOF）、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河泰利纯债债券型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君欣纯债债券型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型

证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金 (LOF)、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金、银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银河和美生活主题混合型证券投资基金、银河如意债券型证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金、银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、银河乐活优萃混合型证券投资基金、银河丰泰 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿安纯债债券型证券投资基金、银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、银河久泰纯债债券型证券投资基金、银河天盈中短债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余科苗	基金经理	2018 年 3 月 23 日	-	9	硕士研究生学历，9 年金融行业从业经历。曾任职于天治基金管理有限公司，2011 年 4 月加入银河基金管理有限公司，从事投资、研究相关工作。现担任基金经理。2018 年 3 月起担任银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河康乐股票型证券投资基金的基金经理，2018 年 6 月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、上表中任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项管理办法、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚实信用、勤奋律己、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金持有人的利益，无

损害基金持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过制定严格的公平交易管理制度、投资管理制度，投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等一系列制度，从授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控和分析评估等各个环节予以落实，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

在投资决策环节，公司实行统一研究平台和统一的授权管理，所有投资组合经理在获取研究成果及投资建议等方面享有均等机会。公司分不同投资组合类别分别建立了投资备选库，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行方面，本基金管理人旗下管理的所有投资组合指令均执行集中交易制度，遵循“时间优先、价格优先”的原则，在满足系统公平交易的条件时自动进入公平交易程序，最大程度上确保公平对待各投资组合。在同日反向交易方面，除法规规定的特殊情况外，公司原则上禁止不同投资组合（完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合除外）之间的同日反向交易。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

针对同向交易部分，本报告期内，公司对旗下管理的所有投资组合（完全复制的指数基金除外），连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公开竞价交易的证券进行了价差分析，并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

针对反向交易部分，公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。本报告期内，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况（完全复制的指数基金除外）。

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

### 4.3.3 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

2019 年，市场全线上涨，万得全 A 上涨 30.96%，其中，沪深 300 指数、中小板指数、创业板综合指数分别上涨 33.6%、38.2%、37.3%。结构上，科技股和消费股均有很好的表现，涨幅前三的行业分别是电子、食品饮料、家电，分别上涨 73.2%、69.1%、54.5%；而建筑装饰、钢铁和公用事业是表现最差的三个行业，分别下跌 4.0%、下跌 3.9%和上涨 4.1%。

本基金在年初开始加仓，后续整体维持在较高仓位水平。结构上，全年增加了科技股的配置比例，降低了金融股的配置比例，全年在医药、食品饮料、建材、科技等板块取得了较好的收益率。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.869 元；本报告期基金份额净值增长率为 59.06%，业绩比较基准收益率为 30.15%。

## 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 2020 年，贸易战对美国的影响可能逐步显现，但美联储宽松的货币政策有助于美国经济保持稳定。伴随着英国硬脱欧风险的消除，欧元区经济增速虽然可能放缓，但整体风险消除。

国内来看，伴随着存量浮动利率贷款定价基准转化为 LPR，企业融资成本有望进一步降低，同时伴随着地产竣工周期拉长，2020 年地产投资韧性依然有望维持。此外，2020 年国内稳增长政策有望发力，基建有望发挥逆周期调节作用；制造业投资伴随着企业融资成本下降，预计将保持稳定。

流动性角度，2020Q1 伴随着猪肉价格上涨，CPI 存在较大压力，但由于本轮 CPI 上涨主要由供给推动，货币因素相对较小，同时在稳增长背景下，流动性预计依然维持宽松局面。

我们看好 2020 年市场的结构性机会，科技股受益于基本面上行及流动性宽松，中期依然具备投资价值，消费股及医药股在需求拉动下中长期投资价值有望逐步显现。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照现代企业制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，认真贯彻了独立董事制度，重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意，保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

#### 4.7 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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《基金合同》有关规定，“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不低于该次可供分配利润的 20%。

截止 2019 年 12 月 31 号，本基金可供分配利润 160,254,179.23 元，本报告期末进行利润分配。

#### **4.9 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(20)第 P00384 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河康乐股票型证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了银河康乐股票型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了银河康乐股票型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银河康乐股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银河基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括银河康乐股票型证券投资基金 2019 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银河康乐股票型证</p>

	<p>券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算银河康乐股票型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银河康乐股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银河康乐股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银河康乐股票型证券投资基金不能持续经营。</p>

	<p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	孙维琦	冯适
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2020 年 4 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银河康乐股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	51,640,033.65	27,008,511.20
结算备付金		996,055.29	1,104,149.86
存出保证金		89,964.34	113,817.82
交易性金融资产	7.4.7.2	444,575,530.93	343,778,513.31
其中：股票投资		424,563,530.93	318,668,513.31
基金投资		-	-
债券投资		20,012,000.00	25,110,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,590,378.44	25,065,948.77
应收利息	7.4.7.5	453,726.48	700,195.96
应收股利		-	-
应收申购款		79,782.25	21,868.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		501,425,471.38	397,793,005.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,659,442.94	3,845,676.93
应付赎回款		1,095,726.05	47,556.91
应付管理人报酬		624,080.97	513,146.92
应付托管费		104,013.47	85,524.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	352,737.52	275,289.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	160,116.94	250,014.93
负债合计		9,996,117.89	5,017,209.42
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	262,955,523.74	334,388,621.74
未分配利润	7.4.7.10	228,473,829.75	58,387,174.29
所有者权益合计		491,429,353.49	392,775,796.03
负债和所有者权益总计		501,425,471.38	397,793,005.45

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.869 元，基金份额总额 262,955,523.74 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银河康乐股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		226,531,768.74	-73,288,010.63
1. 利息收入		1,057,227.73	1,542,021.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	416,600.20	402,256.79
债券利息收入		445,881.64	195,470.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		194,745.89	944,294.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		107,963,968.54	19,615,257.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	104,200,079.66	15,512,778.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-19,292.63	-93.27
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,783,181.51	4,102,572.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	117,448,494.37	-94,491,756.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	62,078.10	46,466.58
<b>减：二、费用</b>		11,131,205.39	14,050,223.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,071,057.30	7,236,207.45
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,178,509.54	1,206,034.60
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	2,712,051.03	5,229,372.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.37	0.91
7. 其他费用	7.4.7.20	169,587.15	378,608.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		215,400,563.35	-87,338,234.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		215,400,563.35	-87,338,234.34

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河康乐股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	334,388,621.74	58,387,174.29	392,775,796.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	215,400,563.35	215,400,563.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-71,433,098.00	-45,313,907.89	-116,747,005.89
其中：1. 基金申购款	16,777,800.35	9,493,678.61	26,271,478.96
2. 基金赎回款	-88,210,898.35	-54,807,586.50	-143,018,484.85
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	262,955,523.74	228,473,829.75	491,429,353.49
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	415,168,759.64	178,252,791.37	593,421,551.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-87,338,234.34	-87,338,234.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-80,780,137.90	-32,527,382.74	-113,307,520.64
其中：1. 基金申购款	17,154,628.05	6,045,414.38	23,200,042.43
2. 基金赎回款	-97,934,765.95	-38,572,797.12	-136,507,563.07
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	334,388,621.74	58,387,174.29	392,775,796.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘立达</u>	<u>刘立达</u>	<u>陈勇</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银河康乐股票型证券投资基金(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》、《银河康乐股票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[2014]624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2,138,183,959.49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(2014)验字第60821717\_B18号的验资报告。基金合同于2014年11月18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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《银河康乐股票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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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)。本基金的投资组合为: 本基金股票资产投资比例为基金资产的 80%-95%, 其中, 投资于本基金定义的健康快乐主题相关股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者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。权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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: 申银万国医药生物行业指数收益率 $\times$ 80%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 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。

### 7.4.4.4 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。

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

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

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无

市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

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

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

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

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。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

#### - 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。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

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

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配

比例不得低于该次可供分配利润的 20%，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按除权日当天的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4) 每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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股票投资和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：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《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》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续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的公告》、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; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	51,640,033.65	27,008,511.20
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	51,640,033.65	27,008,511.20

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	332,061,628.74	424,563,530.93	92,501,902.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	20,012,000.00	30,177.20
	银行间市场	-	-
	合计	20,012,000.00	30,177.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	352,043,451.54	444,575,530.93	92,532,079.39
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	343,561,099.09	318,668,513.31	-24,892,585.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	25,110,000.00	-23,829.20
	银行间市场	-	-
	合计	25,110,000.00	-23,829.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	368,694,928.29	343,778,513.31	-24,916,414.98
----	----------------	----------------	----------------

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	11,437.53	5,703.31
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	493.13	546.59
应收债券利息	441,747.95	699,041.10
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-5,152.04
应收申购款利息	3.32	0.68
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	44.55	56.32
合计	453,726.48	700,195.96

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	352,737.52	275,289.23
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	352,737.52	275,289.23
----	------------	------------

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	116.94	14.93
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	160,000.00	250,000.00
合计	160,116.94	250,014.93

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	334,388,621.74	334,388,621.74
本期申购	16,777,800.35	16,777,800.35
本期赎回（以“-”号填列）	-88,210,898.35	-88,210,898.35
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	262,955,523.74	262,955,523.74

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	93,802,891.04	-35,415,716.75	58,387,174.29
本期利润	97,952,068.98	117,448,494.37	215,400,563.35
本期基金份额交易产生的变动数	-31,500,780.79	-13,813,127.10	-45,313,907.89
其中：基金申购款	6,803,788.42	2,689,890.19	9,493,678.61
基金赎回款	-38,304,569.21	-16,503,017.29	-54,807,586.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	160,254,179.23	68,219,650.52	228,473,829.75

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	389,184.28	343,931.90
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	25,402.89	54,855.77
其他	2,013.03	3,469.12
合计	416,600.20	402,256.79

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	921,547,226.77	1,781,027,768.39
减：卖出股票成本总额	817,347,147.11	1,765,514,990.27
买卖股票差价收入	104,200,079.66	15,512,778.12

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-19,292.63	-93.27
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-19,292.63	-93.27

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	26,639,911.94	681,478.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	25,767,429.20	681,200.00
减：应收利息总额	891,775.37	371.77
买卖债券差价收入	-19,292.63	-93.27

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,783,181.51	4,102,572.51
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,783,181.51	4,102,572.51

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	117,448,494.37	-94,491,756.48
——股票投资	117,394,487.97	-94,467,927.28
——债券投资	54,006.40	-23,829.20
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	117,448,494.37	-94,491,756.48

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	60,944.52	42,987.07
基金转换费收入	1,133.58	3,479.51
合计	62,078.10	46,466.58

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	2,712,051.03	5,229,372.02
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,712,051.03	5,229,372.02

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	320,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	9,587.15	8,608.73
合计	169,587.15	378,608.73

**7.4.7.21 分部报告**

无。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司（“银河基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银	基金托管人、基金代销机构

行”)	
中国银河金融控股有限责任公司(“银河金控”)	基金管理人的控股股东
中国石油天然气集团有限公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海城投(集团)有限公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司(“银河证券”)	同受基金管理人控股股东控制、基金代销机构

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
银河证券	245,449,353.37	14.36%	81,393,980.05	2.38%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
银河证券	302,000,000.00	18.11%	426,000,000.00	8.46%

#### 7.4.10.1.4 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。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
银河证券	225,976.54	14.39%	128,812.35	36.52%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
银河证券	74,668.50	2.37%	74,668.50	27.12%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	7,071,057.30
其中：支付销售机构的客户维护费	3,383,134.74	3,469,096.90

注：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×1.50%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×1.50%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
	当期发生的基金应支付的托管费	1,178,509.54

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%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×0.25%÷当年天数。

数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不设销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	51,640,033.65	389,184.28	27,008,511.20	343,931.90

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 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。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	新股流通受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688333	铂力特	2019年7月12日	2020年1月22日	新股锁定	33.00	53.70	7,359	242,847.00	395,178.30	-
688036	传音控股	2019年9月23日	2020年3月30日	新股锁定	35.15	43.33	23,066	810,769.90	999,449.78	-
688310	迈得医疗	2019年11月22日	2020年6月3日	新股锁定	24.79	27.87	3,276	81,212.04	91,302.12	-
688101	三达膜	2019年11月8日	2020年5月15日	新股锁定	18.26	18.93	13,483	246,199.58	255,233.19	-
688128	中国电研	2019年10月29日	2020年5月6日	新股锁定	18.79	18.30	9,027	169,617.33	165,194.10	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督；（4）董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。

公司设立独立的风险控制专员岗，专门负责对投资管理全过程进行监督，出具监督意见和风险建议；对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督；对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；同时，公司建立了内部评级体系和交易对手库，在进行银行间同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式，以控制相应的信用风险。

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,012,000.00	-
合计	20,012,000.00	-

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	25,110,000.00
合计	-	25,110,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧

烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							

银行存款	51,640,033.65	-	-	-	-	-	51,640,033.65
结算备付金	996,055.29	-	-	-	-	-	996,055.29
存出保证金	89,964.34	-	-	-	-	-	89,964.34
交易性金融资产	20,012,000.00	-	-	-	-	-424,563,530.93	444,575,530.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,590,378.44	3,590,378.44
应收利息	-	-	-	-	-	453,726.48	453,726.48
应收申购款	-	-	-	-	-	79,782.25	79,782.25
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	72,738,053.28	-	-	-	-	-428,687,418.10	501,425,471.38
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,659,442.94	7,659,442.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,095,726.05	1,095,726.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	624,080.97	624,080.97
应付托管费	-	-	-	-	-	104,013.47	104,013.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	352,737.52	352,737.52
其他负债	-	-	-	-	-	160,116.94	160,116.94
负债总计	-	-	-	-	-	9,996,117.89	9,996,117.89
利率敏感度缺口	72,738,053.28	-	-	-	-	-418,691,300.21	491,429,353.49
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	27,008,511.20	-	-	-	-	-	27,008,511.20
结算备付金	1,104,149.86	-	-	-	-	-	1,104,149.86
存出保证金	113,817.82	-	-	-	-	-	113,817.82
交易性金融资产	-	-25,110,000.00	-	-	-	-318,668,513.31	343,778,513.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-	25,065,948.77	25,065,948.77
应收利息	-	-	-	-	-	700,195.96	700,195.96
应收申购款	-	-	-	-	-	21,868.53	21,868.53
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	28,226,478.88	-25,110,000.00	-	-	-	-344,456,526.57	397,793,005.45
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,845,676.93	3,845,676.93
应付赎回款	-	-	-	-	-	47,556.91	47,556.91

应付管理人报酬	-	-	-	-	513,146.92	513,146.92
应付托管费	-	-	-	-	85,524.50	85,524.50
应付交易费用	-	-	-	-	275,289.23	275,289.23
其他负债	-	-	-	-	250,014.93	250,014.93
负债总计	-	-	-	-	5,017,209.42	5,017,209.42
利率敏感度缺口	28,226,478.88	-25,110,000.00	-	-	-339,439,317.15	392,775,796.03

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	2,306.38	16,679.32
市场利率上升 25 个基点	-2,306.38	-16,679.32	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	424,563,530.93	86.39	318,668,513.31	81.13
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	424,563,530.93	86.39	318,668,513.31	81.13

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、测算时期为 3 个月，对于交易少于 3 个月的资产，默认其波动与指数同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	21,563,784.93	16,096,376.59
	沪深 300 指数下降 5%	-21,563,784.93	-16,096,376.59

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 422,372,271.39 元，属于第二层次的余额为人民币 20,296,902.05 元，属于第三层次的余额为人民币 1,906,357.49 元（于 2018 年 12 月 31 日：第一层次为人民币 316,468,104.07 元，第

二层次为人民币 25,160,145.80 元，第三层次为人民币 2,150,263.44 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：上年度末余额为人民币 2,150,263.44 元，本期转入第三层次金额为人民币 0.00 元，转出第三层次金额为人民币 2,150,263.44 元，当期计入损益的利得或损失总额为人民币 1,177,978.08 元，本期购买金额为人民币 1,550,645.85 元，出售金额为人民币 0.00 元，本期末余额为人民币 1,906,357.49 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动金额为人民币 355,711.64 元。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	424,563,530.93	84.67
	其中：股票	424,563,530.93	84.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,012,000.00	3.99
	其中：债券	20,012,000.00	3.99
	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	52,636,088.94	10.50
8	其他各项资产	4,213,851.51	0.84
9	合计	501,425,471.38	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,524,500.00	0.51
C	制造业	223,104,483.91	45.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,671,588.15	13.57
J	金融业	41,385,000.00	8.42
K	房地产业	5,148,800.00	1.05
L	租赁和商务服务业	24,795,786.73	5.05
M	科学研究和技术服务业	4,584,594.10	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	46,589,200.00	9.48
R	文化、体育和娱乐业	9,753,000.00	1.98
S	综合	-	-
	合计	424,563,530.93	86.39

### 8.2.2 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。

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600763	通策医疗	290,000	29,733,700.00	6.05
2	300662	科锐国际	779,987	24,795,786.73	5.05
3	601318	中国平安	250,000	21,365,000.00	4.35
4	300253	卫宁健康	1,350,000	20,223,000.00	4.12
5	600519	贵州茅台	16,000	18,928,000.00	3.85
6	300015	爱尔眼科	380,000	15,032,800.00	3.06
7	002791	坚朗五金	449,851	13,715,956.99	2.79
8	002410	广联达	280,000	9,514,400.00	1.94
9	002475	立讯精密	260,000	9,490,000.00	1.93
10	002311	海大集团	250,000	9,000,000.00	1.83
11	002624	完美世界	200,000	8,828,000.00	1.80
12	000001	平安银行	500,000	8,225,000.00	1.67
13	000858	五粮液	60,000	7,980,600.00	1.62
14	002555	三七互娱	279,955	7,539,188.15	1.53
15	002241	歌尔股份	360,000	7,171,200.00	1.46
16	002396	星网锐捷	200,000	7,112,000.00	1.45
17	300315	掌趣科技	1,100,000	6,787,000.00	1.38
18	603369	今世缘	200,000	6,544,000.00	1.33
19	300788	中信出版	120,000	6,120,000.00	1.25
20	002557	洽洽食品	180,000	6,114,600.00	1.24
21	600176	中国巨石	549,987	5,994,858.30	1.22
22	300136	信维通信	130,000	5,899,400.00	1.20
23	600036	招商银行	150,000	5,637,000.00	1.15
24	002007	华兰生物	160,000	5,624,000.00	1.14
25	600436	片仔癀	50,000	5,493,500.00	1.12

26	600690	海尔智家	280,000	5,460,000.00	1.11
27	000661	长春高新	12,000	5,364,000.00	1.09
28	000538	云南白药	59,959	5,362,133.37	1.09
29	300115	长盈精密	300,000	5,337,000.00	1.09
30	600276	恒瑞医药	60,000	5,251,200.00	1.07
31	000651	格力电器	80,000	5,246,400.00	1.07
32	000568	泸州老窖	60,000	5,200,800.00	1.06
33	000002	万科 A	160,000	5,148,800.00	1.05
34	600085	同仁堂	179,924	5,070,258.32	1.03
35	300451	创业慧康	280,000	5,023,200.00	1.02
36	002456	欧菲光	320,000	4,992,000.00	1.02
37	600521	华海药业	282,000	4,867,320.00	0.99
38	603345	安井食品	80,000	4,752,800.00	0.97
39	600837	海通证券	300,000	4,638,000.00	0.94
40	600703	三安光电	250,000	4,590,000.00	0.93
41	002821	凯莱英	35,000	4,532,500.00	0.92
42	000919	金陵药业	600,000	4,380,000.00	0.89
43	603737	三棵树	50,000	4,032,500.00	0.82
44	002777	久远银海	100,000	3,640,000.00	0.74
45	002343	慈文传媒	300,000	3,633,000.00	0.74
46	000725	京东方 A	800,000	3,632,000.00	0.74
47	002959	小熊电器	50,000	3,470,000.00	0.71
48	688388	嘉元科技	60,000	3,400,200.00	0.69
49	603005	晶方科技	80,000	3,150,400.00	0.64
50	002912	中新赛克	25,000	3,150,000.00	0.64
51	603983	丸美股份	45,000	2,701,350.00	0.55
52	002032	苏泊尔	35,000	2,687,300.00	0.55
53	600380	健康元	249,948	2,586,961.80	0.53
54	300759	康龙化成	50,000	2,577,000.00	0.52
55	601899	紫金矿业	550,000	2,524,500.00	0.51
56	300753	爱朋医疗	60,000	2,445,600.00	0.50
57	600872	中炬高新	60,000	2,361,000.00	0.48
58	002216	三全食品	160,000	2,288,000.00	0.47
59	688111	金山办公	12,000	1,966,800.00	0.40
60	603658	安图生物	20,000	1,927,600.00	0.39
61	603259	药明康德	20,000	1,842,400.00	0.37
62	601231	环旭电子	80,000	1,538,400.00	0.31
63	601066	中信建投	50,000	1,520,000.00	0.31
64	002044	美年健康	80,000	1,191,200.00	0.24

65	603378	亚士创能	50,000	1,116,000.00	0.23
66	603288	海天味业	10,000	1,075,100.00	0.22
67	688036	传音控股	23,066	999,449.78	0.20
68	688198	佰仁医疗	20,000	843,000.00	0.17
69	688363	华熙生物	9,800	817,320.00	0.17
70	002690	美亚光电	20,000	782,000.00	0.16
71	688008	澜起科技	10,000	716,100.00	0.15
72	300347	泰格医药	10,000	631,500.00	0.13
73	688333	铂力特	7,359	395,178.30	0.08
74	688101	三达膜	13,483	255,233.19	0.05
75	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.04
76	688128	中国电研	9,027	165,194.10	0.03
77	688310	迈得医疗	3,276	91,302.12	0.02
78	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
79	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
80	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
81	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300662	科锐国际	19,266,625.62	4.91
2	603883	老百姓	17,115,142.40	4.36
3	300590	移为通信	12,738,865.00	3.24
4	300253	卫宁健康	12,736,502.00	3.24
5	002007	华兰生物	12,618,601.38	3.21
6	000001	平安银行	12,378,714.00	3.15
7	601628	中国人寿	11,791,872.84	3.00
8	601336	新华保险	11,706,730.14	2.98
9	600837	海通证券	9,811,493.00	2.50
10	002777	久远银海	9,452,910.33	2.41
11	600958	东方证券	9,083,176.00	2.31
12	002791	坚朗五金	9,060,245.45	2.31
13	601318	中国平安	9,012,618.72	2.29
14	300753	爱朋医疗	8,946,345.32	2.28

15	601601	中国太保	8,786,269.00	2.24
16	603583	捷昌驱动	8,374,955.74	2.13
17	600535	天士力	8,310,553.95	2.12
18	002938	鹏鼎控股	8,060,177.00	2.05
19	603983	丸美股份	7,806,806.74	1.99
20	300639	凯普生物	7,778,519.40	1.98

注：本项及以下 8.4.2、8.4.3 的买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不包括相关交易费用。

#### 8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600763	通策医疗	35,859,518.30	9.13
2	300463	迈克生物	27,465,359.03	6.99
3	300015	爱尔眼科	25,460,406.87	6.48
4	601398	工商银行	21,231,000.00	5.41
5	603883	老百姓	19,130,145.74	4.87
6	601288	农业银行	18,249,000.00	4.65
7	603288	海天味业	15,717,523.72	4.00
8	600036	招商银行	15,047,886.21	3.83
9	300365	恒华科技	14,417,134.50	3.67
10	300590	移为通信	14,357,794.00	3.66
11	300628	亿联网络	13,310,289.00	3.39
12	601628	中国人寿	13,287,702.72	3.38
13	601336	新华保险	13,111,262.99	3.34
14	002821	凯莱英	11,252,990.14	2.86
15	601601	中国太保	10,898,829.00	2.77
16	600845	宝信软件	10,737,080.30	2.73
17	600872	中炬高新	10,110,687.09	2.57
18	603658	安图生物	9,263,151.50	2.36
19	300595	欧普康视	8,887,987.32	2.26
20	600958	东方证券	8,702,385.80	2.22
21	002938	鹏鼎控股	8,413,420.00	2.14
22	000043	中航善达	8,354,875.56	2.13
23	300639	凯普生物	8,261,872.20	2.10
24	002777	久远银海	8,044,860.80	2.05
25	601166	兴业银行	8,011,281.00	2.04

26	002607	中公教育	7,884,300.00	2.01
----	--------	------	--------------	------

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	805,847,676.76
卖出股票收入（成交）总额	921,547,226.77

注：本项及 8.4.1、8.4.2 的买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不包括相关交易费用。

### 8.5 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	20,012,000.00	4.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,012,000.00	4.07

### 8.6 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	019611	19 国债 01	200,000	20,012,000.00	4.07

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期末未进行股指期货投资。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期末未进行股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	89,964.34
2	应收证券清算款	3,590,378.44
3	应收股利	-
4	应收利息	453,726.48
5	应收申购款	79,782.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,213,851.51

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### **8.12.5 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未存在流通受限股票。

### **8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
14,256	18,445.25	100.00	0.00%	262,955,423.74	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	106,974.06	0.0407%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2014年11月18日）基金份额总额	2,138,183,959.49
本报告期期初基金份额总额	334,388,621.74
本报告期基金总申购份额	16,777,800.35
减:本报告期基金总赎回份额	88,210,898.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	262,955,523.74

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

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

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	

东兴证券	1	270,357,288.69	15.81%	246,376.09	15.69%	-
银河证券	3	245,449,353.37	14.36%	225,976.54	14.39%	-
中信建投	2	137,037,739.40	8.01%	124,882.45	7.95%	-
东吴证券	1	118,657,781.62	6.94%	110,504.89	7.04%	-
海通证券	1	117,648,877.88	6.88%	109,567.23	6.98%	-
中金公司	1	111,058,392.50	6.50%	101,207.41	6.45%	-
国盛证券	1	108,821,557.10	6.36%	99,168.91	6.32%	-
中信证券	3	104,632,150.95	6.12%	97,443.38	6.21%	-
中泰证券	1	84,769,841.41	4.96%	77,250.77	4.92%	-
广发证券	1	82,568,878.03	4.83%	75,244.80	4.79%	-
华创证券	1	76,798,703.14	4.49%	71,521.82	4.56%	-
天风证券	2	64,559,939.94	3.78%	58,833.02	3.75%	-
民生证券	1	49,056,183.28	2.87%	44,704.97	2.85%	-
东北证券	3	47,942,371.23	2.80%	44,648.82	2.84%	-
长江证券	1	41,886,251.51	2.45%	38,171.13	2.43%	-
国泰君安	2	38,458,398.39	2.25%	35,047.35	2.23%	-
东方证券	2	10,072,110.00	0.59%	9,380.04	0.60%	新增 1
中银国际	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	新增 1
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	新增 1
新时代证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金本期新增东方证券 1 个交易单元、长城证券 1 个交易单元、华西证券 1 个交易单元；  
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。

### 11.7.2 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

东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	302,000,000.00	18.11%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东吴证券	223,601.40	0.63%	260,000,000.00	15.59%	-	-
海通证券	5,009,500.00	14.02%	241,000,000.00	14.45%	-	-
中金公司	19,981,822.80	55.92%	720,000,000.00	43.17%	-	-
国盛证券	501,644.78	1.40%	-	-	-	-
中信证券	10,013,500.00	28.03%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	90,000,000.00	5.40%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	55,000,000.00	3.30%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河康乐股票型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2019 年 1 月 22 日
2	银河康乐股票型证券投资基金 2018 年年度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2019 年 3 月 29 日
3	关于旗下部分基金继续参加交通 银行手机银行基金申购及定期定 额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2019 年 3 月 30 日
4	银河康乐股票型证券投资基金 2019 年 1 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2019 年 4 月 18 日
5	银河基金管理有限公司关于旗下 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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、	2019 年 5 月 21 日

	优惠活动的公告	公司网站	
6	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》、公司网站	2019年5月30日
7	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019年6月4日
8	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019年6月21日
9	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》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2019年6月26日
10	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》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2019年6月26日
11	银河康乐股票型证券投资基金招募说明书（更新摘要）	《证券时报》、公司网站	2019年6月29日
12	银河康乐股票型证券投资基金2019年2季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019年7月18日
13	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019年8月7日
14	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰证券股份有限公司	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2019年8月8日

	司更改定投业务起点金额的公告	报》、《证券日报》、 公司网站	
15	银河康乐股票型证券投资基金 2019 年半年度报告	《中国证券报》、《证 券时报》、《上海证券 报》、《证券日报》、 公司网站	2019 年 8 月 26 日
16	银河基金管理有限公司关于旗下 部分基金新增江苏汇林保大基金 销售有限公司为代销机构及费率 优惠的公告	《中国证券报》、《证 券时报》、《上海证券 报》、《证券日报》、 公司网站	2019 年 10 月 11 日
17	银河基金管理有限公司关于调整 奕丰基金销售有限公司定投业务 起始金额的公告	《中国证券报》、《证 券时报》、《上海证券 报》、《证券日报》、 公司网站	2019 年 10 月 23 日
18	银河康乐股票型证券投资基金 2019 年 3 季度报告	《中国证券报》、《证 券时报》、《上海证券 报》、《证券日报》、 公司网站	2019 年 10 月 24 日
19	银河基金管理有限公司关于根据 《公开募集证券投资基金信息披 露管理办法》修改旗下公募基金 基金合同的公告	《中国证券报》、《证 券时报》、《上海证券 报》、《证券日报》、 公司网站	2019 年 11 月 27 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河康乐股票型证券投资基金的文件
- 2、《银河康乐股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河康乐股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
- 5、银河康乐股票型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 楼

### 13.3 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 4 月 29 日