

# 银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金 （LOF）证券投资基金 2020 年中期报告

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：北京银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。

基金托管人北京银行股份有限公司（以下简称：北京银行）根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</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
<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.....	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
7.7 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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）	
基金简称	银河中证沪港深高股息指数（LOF）	
场内简称	银河高股	
基金主代码	501307	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2018 年 4 月 10 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	
报告期末基金份额总额	58,074,758.42 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018 年 4 月 25 日	
下属分级基金的基金简称:	银河高股息 LOF	银河高 C
下属分级基金场内简称:	银河高股	-
下属分级基金的交易代码:	501307	501308
报告期末下属分级基金的份额总额	55,448,101.77 份	2,626,656.65 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证沪港深高股息指数。在正常市场情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	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，按照成份股在中证沪港深高股息指数中的基准权重构建股票投资组合。并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金将采用数量化模型，对跟踪误差及其相关指标进行动态管理，根据结果对基金投资组合进行相应调整；并将定期或不定期对数量化模型进行优化改善，力求减少跟踪误差，期望改进指数跟踪效果。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 在建仓期，或遇有特殊情况，或在一定时间内的跟踪误差或其相关指标超过相应的控制目标值，或出现其他实际情况导致本基金不能投资或无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据情况，对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证沪港深高股息指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金投资于法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，除需要

	承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。	
	银河高股息 LOF	银河高 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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	刘晔
	联系电话	021-38568989	010-66223586
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	liuyel@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95526
传真		021-38568769	010-66226045
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甲 17 号首层
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码		200122	100033
法定代表人		刘立达	张东宁

### 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.galaxyasset.com">http://www.galaxyasset.com</a>
基金中期报告备置地点	1、中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层 2、北京市西城区金融大街丙 17 号

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	银河高股息 LOF	银河高 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,366,848.66	61,077.68
本期利润	-6,952,097.89	-233,785.77
加权平均基金份额本期利润	-0.1167	-0.0953
本期加权平均净值利润率	-12.62%	-10.40%
本期基金份额净值增长率	-11.10%	-11.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-5,159,020.07	-256,921.31
期末可供分配基金份额利润	-0.0930	-0.0978
期末基金资产净值	50,289,081.70	2,369,735.34
期末基金份额净值	0.9070	0.9022
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-9.30%	-9.78%

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

银河高股息 LOF

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
过去一个月	4.30%	1.01%	2.32%	1.02%	1.98%	-0.01%
过去三个月	3.95%	1.05%	0.99%	1.01%	2.96%	0.04%
过去六个月	-11.10%	1.57%	-14.00%	1.52%	2.90%	0.05%
过去一年	-7.73%	1.25%	-11.57%	1.20%	3.84%	0.05%
自基金合同生效起至今	-9.30%	1.10%	-17.10%	1.11%	7.80%	-0.01%



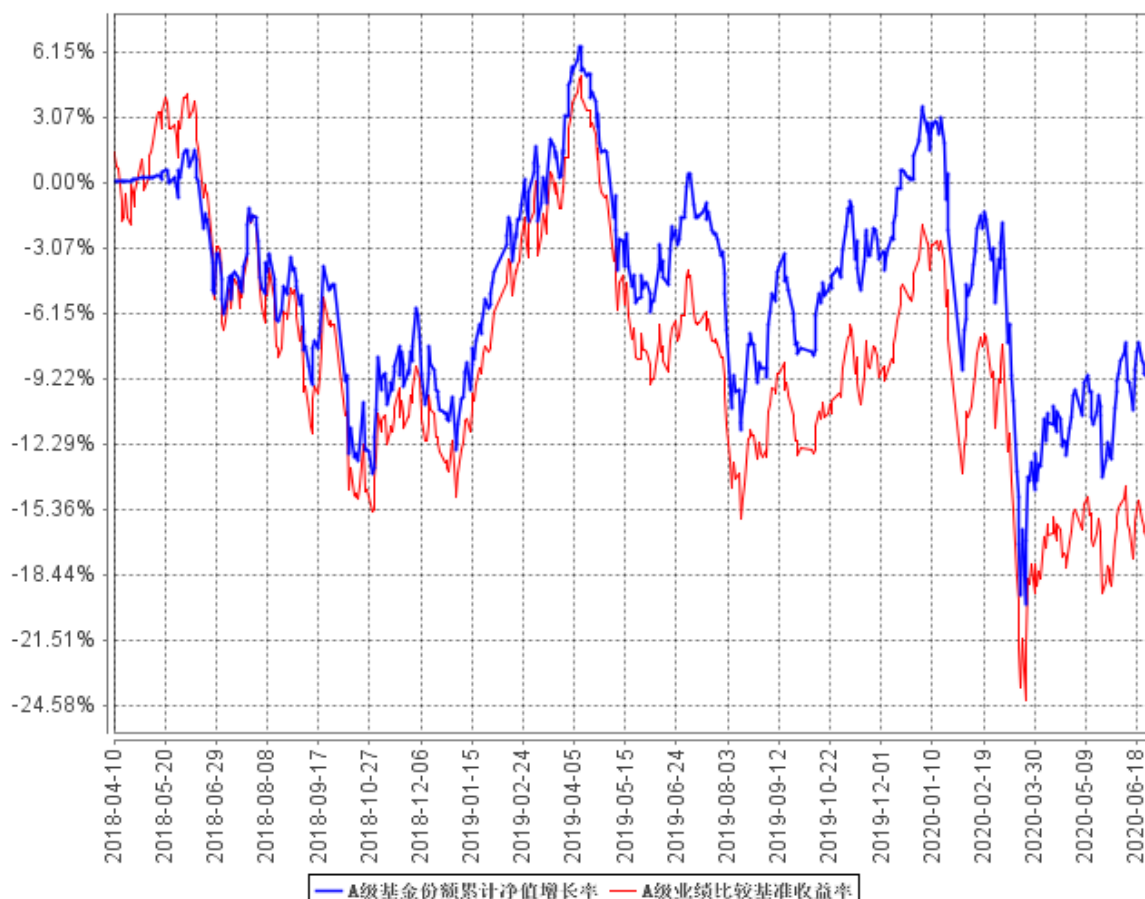
银河高 C

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
过去一个月	4.28%	1.01%	2.32%	1.02%	1.96%	-0.01%
过去三个月	3.88%	1.05%	0.99%	1.01%	2.89%	0.04%
过去六个月	-11.21%	1.57%	-14.00%	1.52%	2.79%	0.05%
过去一年	-7.97%	1.25%	-11.57%	1.20%	3.60%	0.05%
自基金合同生效起至今	-9.78%	1.10%	-17.10%	1.11%	7.32%	-0.01%

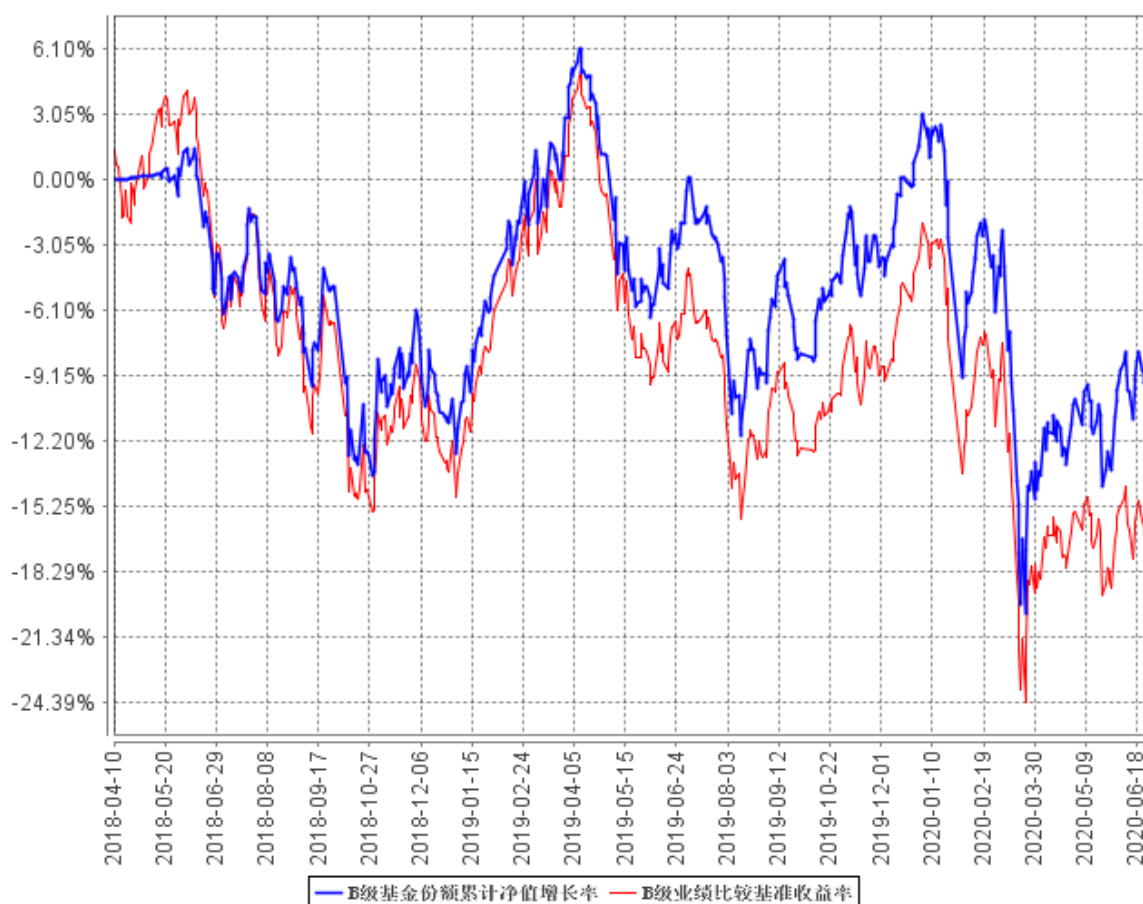
注：本基金的业绩比较基准为：中证沪港深高股息指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%，每日进行再平衡过程。

### 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



B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：根据本基金合同规定，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 90%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于中证沪港深高股息指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。截至本报告期末基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

### 3.3 其他指标

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。

本报告期内公司管理的基金有：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、银河新动能混合型证券投资基金、银河聚星两年定期开放债券型证券投资基金、银河睿鑫纯债债券型证券投资基金、银河久悦纯债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
陈伯祯	基金 经理	2018 年 6 月 26 日	-	15	硕士研究生学历，15 年证券从业经历。曾任职于宏利证券投资信托股份有限公司（台湾）、泰达宏利基金管理有限公司、富兰克林华美证券投资信托股份有限公司（台湾），从事投资、研究相关工作。2018 年 4 月起加入银河基金。2018 年 6 月起担任银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）的基金经理，2019 年 10 月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 2 月起担任银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
楼华锋	基金 经理	2018 年 4 月 10 日	-	10	中共党员，硕士研究生学历，10 年证券从业经历，先后就职于东方证券股份有限公司研究所分析师、光大证券股份有限公司信用业务高级经理、方正证券股份有限公司研究所分析师。2015 年 8 月加入银河基金管理有限公司，现任数量与指数工作室负责人、基金经理。2016 年 1 月起担任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的基金经理，2017 年 4 月起担任银河量化优选混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 10 月起担任银河量化价值混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 12 月担任银河量化稳进混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 3 月起担任银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）的基金经理，2019 年 8 月起担任银河沪深 300 指数

					增强型发起式证券投资基金的基金经理，2019 年 10 月起担任银河和美生活主题混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上表中楼华锋的任职日期为基金合同生效之日，陈伯祯的任职日期为公司作出决定之日。

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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。

本基金原则上采取指数完全复制法，进行被动指数化投资。按照成份股在中证沪港深高股息指数中的基准权重构建股票投资组合，并原则上根据标的指数成份股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，未发现本基金与其他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

2020 上半年市场指数分化较大，以创业板为代表的成长股大幅上涨，而价值类指数沪深 300 指数走势落后较大，市场动量效应明显。本轮动量因子的强势主要有以下两个原因：投资者结构：机构占比显著增加，而且还处于快速边际增加状态；基本面因素：成长、医药、消费强势有一定基本面解释因素，特别是疫情后投资者对于价值板块更加悲观。沪港深高股息指数主要配置高股息的价值股，且港股配置比例较高，受价值股和港股表现影响，整体业绩相对落后。

日常操作严格按照指数样本股的权重复制指数，以跟踪误差最小化为控制目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河高股息 LOF 基金份额净值为 0.9070 元，本报告期基金份额净值增长率为 -11.10%；截至本报告期末银河高 C 基金份额净值为 0.9022 元，本报告期基金份额净值增长率为 -11.21%；同期业绩比较基准收益率为 -14.00%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年随着疫情的逐步控制宏观经济指标会不断走高，历史上看价值股要有所表现一方面靠货币政策大幅放松，另一方面依靠基本面驱动。随着宏观经济的不断改善，预期下半年市场风格将趋于更加均衡，成长和价值各有机会，历史上看年底价值股有超额收益的可能性比较高。

近期市场短期快速上涨，活跃度大幅提升，短期面临一定回调压力。随着增量资金的进入，市场中长期趋势会变得更加明朗，对于下半年走势持谨慎乐观的态度。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金

托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金《基金合同》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 10%，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，银河高股息 LOF 可供分配利润为-5,159,020.07 元，银河高 C 可供分配利润为-256,921.31 元。本基金本报告期末未实施利润分配。

#### **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

在本报告期内，本基金托管人在托管银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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。

本基金本报告期未进行利润分配。

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

托管人复核了中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,612,736.36	5,276,922.90
结算备付金		-	6,605.83
存出保证金		6,787.11	-
交易性金融资产	6.4.7.2	48,995,413.12	67,810,234.04
其中：股票投资		48,995,413.12	67,810,234.04
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,385,848.62
应收利息	6.4.7.5	748.08	1,184.52
应收股利		695,830.68	69,654.02
应收申购款		72,309.56	10,142.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1.70	1.70
资产总计		53,383,826.61	75,560,594.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6.90	-
应付赎回款		588,729.88	2,173,838.02
应付管理人报酬		22,043.90	32,029.80
应付托管费		7,935.78	11,530.74
应付销售服务费		487.34	739.75
应付交易费用	6.4.7.7	1,105.67	41,109.31
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,700.10	160,000.00
负债合计		725,009.57	2,419,247.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	58,074,758.42	71,705,334.60
未分配利润	6.4.7.10	-5,415,941.38	1,436,012.20
所有者权益合计		52,658,817.04	73,141,346.80
负债和所有者权益总计		53,383,826.61	75,560,594.42

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 58,074,758.42 份，其中银河高股息 LOF 基金份额净值 0.9070 元，份额总额 55,448,101.77 份；银河高 C 基金份额净值 0.9022 元，份额总额 2,626,656.65 份；

## 6.2 利润表

会计主体：银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-6,810,734.48	10,730,509.42
1.利息收入		16,976.50	24,759.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,976.50	24,759.33
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,780,668.42	3,065,747.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	338,196.74	1,032,227.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,442,471.68	2,033,519.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,613,810.00	7,638,814.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,430.60	1,188.02
<b>减：二、费用</b>		375,149.18	537,257.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	143,011.67	233,286.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	51,484.17	83,983.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,789.07	3,855.64
4. 交易费用	6.4.7.19	22,250.92	50,129.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	155,613.35	166,003.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,185,883.66	10,193,251.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,185,883.66	10,193,251.73

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	71,705,334.60	1,436,012.20	73,141,346.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,185,883.66	-7,185,883.66
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）	-13,630,576.18	333,930.08	-13,296,646.10
其中：1.基金申购款	7,592,403.30	-689,033.12	6,903,370.18
2.基金赎回款	-21,222,979.48	1,022,963.20	-20,200,016.28
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)	58,074,758.42	-5,415,941.38	52,658,817.04
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	316,379,381.04	-11,137,876.37	305,241,504.67
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	10,193,251.73	10,193,251.73
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)	-26,998,571.68	-484,590.54	-27,483,162.22
其中：1.基金申购款	4,735,768.08	-81,957.47	4,653,810.61
2.基金赎回款	-31,734,339.76	-402,633.07	-32,136,972.83
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)	289,380,809.36	-1,429,215.18	287,951,594.18

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：

\_\_\_\_\_ 高见 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 高见 \_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 陈勇 \_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)(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》、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]80号文批准公开募集。本基金为契约型、上市开放式基金(LOF),存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为205,840,341.68

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(2018)验字第60821717\_B07号的验资报告。基金合同于2018年4月10日生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

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“银河高股息LOF”)和C类基金份额(以下简称“银河高C”)两类份额。其中，银河高股息LOF是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；银河高C是指在投资人认购/申购基金时不收取认购/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《银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于中证沪港深高股息指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(包括同业存单)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合为：本基金90%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于中证沪港深高股息指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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。如法律法规或中国证监会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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证沪港深高股息指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

#### 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说明的会计估计变更。

##### 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》、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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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;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。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	3,612,736.36
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：	3,612,736.36

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,310,231.64	48,995,413.12	-9,314,818.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		58,310,231.64	48,995,413.12	-9,314,818.52

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产期末余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	744.97
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.11
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.00
合计	748.08

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----



	2020 年 6 月 30 日
其他应收款	1.70
待摊费用	-
合计	1.70

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,105.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,105.67

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,700.10
合计	104,700.10

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银河高股息 LOF		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,399,355.44	69,399,355.44
本期申购	5,216,243.69	5,216,243.69
本期赎回(以“-”号填列)	-19,167,497.36	-19,167,497.36
- 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	55,448,101.77	55,448,101.77

金额单位：人民币元

银河高 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,305,979.16	2,305,979.16
本期申购	2,376,159.61	2,376,159.61
本期赎回(以“-”号填列)	-2,055,482.12	-2,055,482.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,626,656.65	2,626,656.65

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

银河高股息 LOF			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-155,419.27	1,554,414.22	1,398,994.95
本期利润	1,366,848.66	-8,318,946.55	-6,952,097.89
本期基金份额交易产生的变动数	4,429.67	389,653.20	394,082.87
其中：基金申购款	-6,032.34	-459,178.48	-465,210.82
基金赎回款	10,462.01	848,831.68	859,293.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,215,859.06	-6,374,879.13	-5,159,020.07

单位：人民币元

银河高 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,949.57	50,966.82	37,017.25
本期利润	61,077.68	-294,863.45	-233,785.77
本期基金份额交易产生的变动数	-2,865.89	-57,286.90	-60,152.79
其中：基金申购款	-6,385.58	-217,436.72	-223,822.30
基金赎回款	3,519.69	160,149.82	163,669.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,262.22	-301,183.53	-256,921.31

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,581.31
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	329.13
其他	66.06
合计	16,976.50

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,539,207.66
减：卖出股票成本总额	10,201,010.92
买卖股票差价收入	338,196.74

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金未进行贵金属投资。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

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

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,442,471.68
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	1,442,471.68

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,647,801.99
——股票投资	-1,647,801.99
——债券投资	-
——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	-6,966,008.01
减：应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	-8,613,810.00

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	5,133.86
基金转换费收入 501307	296.74
合计	5,430.60

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	22,250.92
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	22,250.92

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-

指数使用费	100,000.00
银行费用	913.25
合计	155,613.35

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
北京银行股份有限公司	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

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	-	-	2,641,063.34	11.38%

### 6.4.10.1.2 债券交易

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。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

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。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	2,459.72	12.65%	-	-

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上海证券交易所买（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。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	143,011.67
其中：支付销售机构的客户维护费	59,460.87	96,363.38

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：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,484.17	83,983.01

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.18% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 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		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河高股息 LOF	银河高 C	合计
北京银行	-	1,566.73	1,566.73
银河基金	-	138.32	138.32
银河证券	-	10.36	10.36
合计	-	1,715.41	1,715.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河高股息 LOF	银河高 C	合计
北京银行	-	2,097.65	2,097.65



银河基金	-	209.56	209.56
银河证券	-	56.15	56.15
合计	-	2,363.36	2,363.36

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

在通常情况下，C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.25% 年费率计提。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类基金份额销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送 C 类基金份额销售服务费划付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给登记机构，再由登记机构代付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日顺延至下一个工作日。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

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。

##### 6.4.10.4.2 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

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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	银河高股息 LOF	银河高 C

基金合同生效日（2018 年 4 月 10 日）持有的基金份额	5,000,450.00	-
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.6104%	-

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	银河高股息 LOF	银河高 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 10 日）持有的基金份额	5,000,450.00	-
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,450.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.9857%	-

#### 6.4.10.5.2 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

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。

#### 6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行	3,612,736.36	16,581.31	6,247,270.81	23,424.56

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 6.4.10.8 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### **6.4.13.2 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。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

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。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

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。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

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。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

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。

#### **6.4.13.3 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。

### 6.4.13.3.1 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 6.4.12 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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

本基金为指数基金，采用在法律法规允许范围内最大复制指数的策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 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	3,612,736.36	-	-	-	-	-	3,612,736.36

存出保证金	6,787.11						6,787.11
交易性金融资产						-48,995,413.12	48,995,413.12
应收利息						748.08	748.08
应收股利						695,830.68	695,830.68
应收申购款	497.02					71,812.54	72,309.56
其他资产						1.70	1.70
资产总计	3,620,020.49					-49,763,806.12	53,383,826.61
负债							
应付证券清算款						6.90	6.90
应付赎回款						588,729.88	588,729.88
应付管理人报酬						22,043.90	22,043.90
应付托管费						7,935.78	7,935.78
应付销售服务费						487.34	487.34
应付交易费用						1,105.67	1,105.67
其他负债						104,700.10	104,700.10
负债总计						725,009.57	725,009.57
利率敏感度缺口	3,620,020.49					-49,038,796.55	52,658,817.04
上年度末 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	5,276,922.90						5,276,922.90
结算备付金	6,605.83						6,605.83
交易性金融资产						-67,810,234.04	67,810,234.04
应收证券清算款						2,385,848.62	2,385,848.62
应收利息						1,184.52	1,184.52
应收股利						69,654.02	69,654.02
应收申购款	497.02					9,645.77	10,142.79
其他资产						1.70	1.70
资产总计	5,284,025.75					-70,276,568.67	75,560,594.42
负债							
应付赎回款						2,173,838.02	2,173,838.02
应付管理人报酬						32,029.80	32,029.80
应付托管费						11,530.74	11,530.74
应付销售服务费						739.75	739.75
应付交易费用						41,109.31	41,109.31
其他负债						160,000.00	160,000.00
负债总计						2,419,247.62	2,419,247.62
利率敏感度缺口	5,284,025.75					-67,857,321.05	73,141,346.80

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
清算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	31,363,333.87	-	31,363,333.87
买入返售证券	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	695,830.68	-	695,830.68
资产合计	-	32,059,164.55	-	32,059,164.55
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	6.90	-	6.90
应付赎回款	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	6.90	-	6.90
资产负债表外汇风险敞口净额	-	32,059,157.65	-	32,059,157.65
	上年度末 2019年12月31日			
项目	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

银行存款	-	-	-	-
清算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	46,759,867.64	-	46,759,867.64
买入返售证券	-	-	-	-
应收证券清算款	-	2,385,848.62	-	2,385,848.62
应收申购款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	69,654.02	-	69,654.02
资产合计	-	49,215,370.28	-	49,215,370.28
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	49,215,370.28	-	49,215,370.28

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假	-		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	1,602,957.88	2,460,768.51
	所有外币相对人民币贬值5%	-1,602,957.88	-2,460,768.51

#### 6.4.13.4.3 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。本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股、备选成份股，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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元



项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	48,995,413.12	93.04	67,810,234.04	92.71
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	48,995,413.12	93.04	67,810,234.04	92.71

#### 6.4.13.4.3.2 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中证腾沪港深高息指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定中证腾沪港深高息指数变化 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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	中证腾沪港深高息指数上升 5%	2,603,455.23	2,842,458.08
中证腾沪港深高息指数下降 5%	-2,603,455.23	-2,842,458.08	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	48,995,413.12	91.78
	其中：股票	48,995,413.12	91.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,612,736.36	6.77
8	其他各项资产	775,677.13	1.45
9	合计	53,383,826.61	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 31,363,333.87 元，占期末净值比例 59.56%。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,219,996.00	2.32
C	制造业	10,397,604.55	19.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	617,486.40	1.17
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	558,360.00	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,947,892.00	3.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,890,740.30	5.49

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,632,079.25	33.48

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	2,156,717.70	4.10
B 消费者非必需品	2,453,780.70	4.66
C 消费者常用品	-	-
D 能源	1,543,544.01	2.93
E 金融	6,376,715.45	12.11
F 医疗保健	-	-
G 工业	3,067,508.37	5.83
H 信息技术	2,165,970.48	4.11
I 电信服务	1,206,719.16	2.29
J 公用事业	1,512,631.52	2.87
K 房地产	10,879,746.48	20.66
合计	31,363,333.87	59.56

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

## 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

### 7.3.1 期末指数投资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	000895	双汇发展	20,000	921,800.00	1.75
2	01813	合景泰富	68,597	815,823.35	1.55
3	00968	信义光能	120,600	808,580.74	1.54
4	601088	中国神华	55,600	798,416.00	1.52
5	000036	华联控股	180,000	792,000.00	1.50
6	03380	龙光地产	62,871	787,924.32	1.50
7	03383	雅居乐集团	91,548	762,647.28	1.45
8	002601	龙鳞佰利	41,100	760,350.00	1.44
9	601636	旗滨集团	120,000	710,400.00	1.35
10	01233	时代中国控股	53,757	703,166.33	1.34

11	00884	旭辉控股集团	125,577	692,830.61	1.32
12	02777	富力地产	82,990	683,773.60	1.30
13	01288	农业银行	238,431	679,512.33	1.29
14	00813	世茂房地产	22,141	663,362.78	1.26
15	03328	交通银行	146,744	640,719.99	1.22
16	00008	电讯盈科	157,417	635,556.15	1.21
17	03988	中国银行	241,276	632,522.60	1.20
18	600900	长江电力	32,600	617,444.00	1.17
19	02128	中国联塑	67,000	616,900.84	1.17
20	01628	禹洲地产	200,768	614,354.90	1.17
21	00817	中国金茂	122,663	610,646.83	1.16
22	00939	建设银行	104,169	596,603.86	1.13
23	00868	信义玻璃	68,391	593,475.21	1.13
24	01313	华润水泥控股	68,000	589,461.10	1.12
25	000157	中联重科	91,500	588,345.00	1.12
26	00083	信和置业	66,000	587,798.64	1.12
27	02380	中国电力	448,561	581,821.65	1.10
28	00604	深圳控股	258,909	579,419.70	1.10
29	01310	香港宽频	46,000	569,767.33	1.08
30	01359	中国信达	403,000	559,536.81	1.06
31	600738	兰州民百	108,000	558,360.00	1.06
32	02007	碧桂园	63,942	556,036.36	1.06
33	600383	金地集团	40,529	555,247.30	1.05
34	000550	江铃汽车	43,900	543,043.00	1.03
35	00683	嘉里建设	29,624	541,194.93	1.03
36	01398	工商银行	124,420	534,155.96	1.01
37	06818	中国光大银行	200,894	533,998.43	1.01
38	00836	华润电力	63,618	529,393.27	1.01
39	01238	宝龙地产	133,000	527,255.84	1.00
40	000338	潍柴动力	38,200	524,104.00	1.00
41	01888	建滔积层板	73,595	523,679.76	0.99
42	01382	互太纺织	152,000	519,272.37	0.99
43	603328	依顿电子	49,400	515,242.00	0.98
44	601006	大秦铁路	73,100	514,624.00	0.98
45	00576	浙江沪杭甬	101,759	509,370.06	0.97
46	00123	越秀地产	396,351	499,619.14	0.95
47	000848	承德露露	70,840	495,880.00	0.94
48	002110	三钢闽光	74,400	495,504.00	0.94
49	002367	康力电梯	54,700	477,531.00	0.91

50	600741	华域汽车	22,600	469,854.00	0.89
51	02689	玖龙纸业	73,000	467,434.65	0.89
52	000656	金科股份	57,200	466,752.00	0.89
53	01308	海丰国际	61,000	460,803.08	0.88
54	02333	长城汽车	104,000	459,789.16	0.87
55	01171	兖州煤业股份	86,000	454,838.31	0.86
56	03883	中国奥园	53,000	453,623.44	0.86
57	000581	威孚高科	21,700	448,756.00	0.85
58	00386	中国石油化工股份	150,792	444,898.41	0.84
59	03618	重庆农村商业银行	158,000	440,186.74	0.84
60	600873	梅花生物	96,500	438,110.00	0.83
61	600104	上汽集团	25,600	434,944.00	0.83
62	002233	塔牌集团	36,100	434,283.00	0.82
63	00165	中国光大控股	42,000	430,449.47	0.82
64	00303	VTECHHOLDINGS	10,049	427,289.83	0.81
65	01052	越秀交通基建	86,000	424,987.09	0.81
66	600395	盘江股份	78,800	421,580.00	0.80
67	000718	苏宁环球	133,100	411,279.00	0.78
68	00883	中国海洋石油	51,767	407,605.74	0.77
69	00148	建滔化工	22,136	406,420.15	0.77
70	01928	金沙中国有限公司	14,535	403,616.25	0.77
71	00272	瑞安房地产	339,000	402,553.01	0.76
72	00006	电能实业	10,426	401,416.60	0.76
73	02314	理文造纸	104,825	398,325.61	0.76
74	00005	汇丰控股	11,938	394,748.21	0.75
75	601003	柳钢股份	88,900	393,827.00	0.75
76	03377	远洋集团	231,210	392,825.42	0.75
77	000429	粤高速 A	54,500	380,955.00	0.72
78	02799	中国华融	533,000	379,753.55	0.72
79	600398	海澜之家	65,000	378,300.00	0.72
80	00144	招商局港	43,983	368,010.62	0.70
81	600377	宁沪高速	37,300	365,913.00	0.69
82	600019	宝钢股份	80,100	365,256.00	0.69
83	00581	中国东方集团	186,000	358,488.66	0.68
84	600897	厦门空港	19,800	354,618.00	0.67
85	600177	雅戈尔	59,300	353,428.00	0.67
86	000488	晨鸣纸业	70,800	349,752.00	0.66
87	00659	新创建集团	57,000	348,322.08	0.66
88	01333	中国忠旺	257,200	343,007.68	0.65

89	02588	中银航空租赁	7,500	339,114.60	0.64
90	600376	首开股份	57,200	335,192.00	0.64
91	600548	深高速	36,300	331,782.00	0.63
92	002016	世荣兆业	50,500	330,270.00	0.63
93	600507	方大特钢	57,365	297,724.35	0.57
94	00665	海通国际	165,000	278,827.56	0.53
95	00998	中信银行	88,403	272,937.83	0.52
96	00551	裕元集团	25,293	272,160.85	0.52
97	00338	上海石油化工股份	139,024	236,201.55	0.45
98	01212	利福国际	35,312	205,466.86	0.39
99	02202	万科企业	90	2,014.14	0.00
100	00806	惠理集团	405	1,453.88	0.00
101	00563	上实城市开发	1,755	1,426.75	0.00
102	00799	IGG	241	1,395.68	0.00
103	00440	大新金融	66	1,308.23	0.00
104	600066	宇通客车	96	1,171.20	0.00
105	00173	嘉华国际	286	872.55	0.00
106	09928	时代邻里	60	576.56	0.00
107	600236	桂冠电力	10	42.40	0.00

## 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

本项及下项 7.4.2、7.4.3 的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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，不考虑相关交易费用。

本基金本报告期未买入股票。

### 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

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	01813	合景泰富	925,944.65	1.27
2	000895	双汇发展	630,166.00	0.86
3	00008	电讯盈科	501,283.40	0.69
4	01928	金沙中国有限公司	444,049.59	0.61
5	02380	中国电力	419,335.73	0.57
6	00817	中国金茂	403,464.47	0.55
7	00123	越秀地产	400,129.51	0.55

8	00005	汇丰控股	386,134.93	0.53
9	01398	工商银行	358,272.85	0.49
10	00868	信义玻璃	353,883.82	0.48
11	00939	建设银行	345,303.56	0.47
12	02777	富力地产	330,108.34	0.45
13	00883	中国海洋石油	323,781.46	0.44
14	600738	兰州民百	317,845.00	0.43
15	01628	禹洲地产	313,118.20	0.43
16	00303	VTECHHOLDINGS	293,994.57	0.40
17	00836	华润电力	277,786.60	0.38
18	00604	深圳控股	269,324.22	0.37
19	03380	龙光地产	228,294.97	0.31
20	601636	旗滨集团	220,020.00	0.30

#### 7.4.3 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	-
卖出股票收入（成交）总额	10,539,207.66

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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

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

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

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股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	6,787.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	695,830.68
4	应收利息	748.08
5	应收申购款	72,309.56
6	其他应收款	1.70
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	775,677.13



#### **7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

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**

##### **7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况

##### **7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

#### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
银河高股息 LOF	1,710	32,425.79	5,000,450.00	9.02%	50,447,651.77	90.98%
银河高 C	368	7,137.65	1,575.00	0.06%	2,625,081.65	99.94%
合计	2,078	27,947.43	5,002,025.00	8.61%	53,072,733.42	91.39%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

银河高股息 LOF

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王运涛	7,986,011.94	14.40%
2	刘通渤	5,002,375.00	9.02%
3	银河基金管理有限公司	5,000,450.00	9.02%
4	吴用	2,997,926.98	5.41%
5	李胜利	1,194,461.85	2.15%
6	屠小英	995,114.88	1.79%
7	屠彬	995,114.88	1.79%
8	温晓明	697,399.41	1.26%
9	万黎妮	507,508.59	0.92%
10	丁军	497,692.44	0.90%

### 8.3 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）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	银河高股息 LOF	497,534.94	0.8973%
	银河高 C	14,287.02	0.5439%
	合计	511,821.96	0.8813%

**8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银河高股息 LOF	0
	银河高 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银河高股息 LOF	10~50
	银河高 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河高股息 LOF	银河高 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 10 日）基金份额总额	164,948,483.01	40,891,858.67
本报告期期初基金份额总额	69,399,355.44	2,305,979.16
本报告期基金总申购份额	5,216,243.69	2,376,159.61
减：本报告期基金总赎回份额	19,167,497.36	2,055,482.12
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	55,448,101.77	2,626,656.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2020年4月23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》，高见先生自2020年4月22日起担任银河基金管理有限公司总经理，董事长刘立达先生不再代为履行总经理职务。

2、2020年6月20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》，王庆仁先生自2020年6月19日起担任银河基金管理有限公司副总经理职务。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

本报告期内，上海证监局因现场检查对公司和相关人员出具了监管措施。我司已按法律法规和监管要求及时进行整改。

本报告期内无基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			例			
东北证券	1	9,509,053.66	90.23%	7,718.53	89.16%	-
招商证券	1	1,030,154.00	9.77%	938.74	10.84%	-

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
- (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
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、公司网站	2020年1月17日

2	银河基金管理有限公司第四季度报告提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2020 年 1 月 17 日
3	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、公司网站	2020 年 3 月 30 日
4	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、公司网站	2020 年 4 月 7 日
5	银河基金管理有限公司 2020 年第一季度报告提示性公告	《上海证券报》、公司网站	2020 年 4 月 20 日
6	银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》公司网站	2020 年 4 月 23 日
7	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、公司网站	2020 年 4 月 23 日
8	银河基金管理有限公司 2019 年年度报告提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2020 年 4 月 29 日
9	银河基金管理有限公司关于基金经理休假由他人代为履职的公告	《证券日报》、公司网站	2020 年 4 月 30 日
10	银河基金管理有限公司银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	《证券时报》、公司网站	2020 年 5 月 23 日
11	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新摘要）	《证券时报》、公司网站	2020 年 5 月 23 日
12	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、公司网站	2020 年 6 月 18 日

13	银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》、公司网站	2020 年 6 月 20 日
14	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、公司网站	2020 年 6 月 29 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

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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）基金的文件
- 2、《银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）基金基金合同》
- 3、《银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）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、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）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

### 12.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 楼

### 12.3 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 8 月 28 日