

银河创新成长混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 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。中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
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.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
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.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62

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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河创新成长混合型证券投资基金
基金简称	银河创新混合
场内简称	-
基金主代码	519674
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 29 日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,980,021,922.95 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	本基金投资于具有良好成长性的创新类上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的股票选择相结合。在资产配置策略上，本基金根据对经济面、政策面、市场面等多因素分析，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。在股票选择上，本基金主要投资于具有创新能力和持续增长潜力的上市公司股票，力争为基金份额持有人带来长期、稳定的资本增值。具体包括：1. 资产配置策略；2. 股票投资策略：(1) 企业初选；(2) 企业创新能力评价；(3) 成长型股票筛选；(4) 企业基本面及价值评估；3. 债券投资策略：(1) 债券投资；(2) 可转换债券投资；(3) 资产支持证券投资；4. 权证投资策略；5. 存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的品种。

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	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	秦长建	张燕
	联系电话	021-38568989	0755-83199084
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-820-0860	95555
传真		021-38568769	0755-83195201
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200122	518040
法定代表人		刘立达	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金中期报告备置地点	1、上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼 2、深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	2,021,354,806.18
本期利润	4,012,201,565.77
加权平均基金份额本期利润	1.5154
本期加权平均净值利润率	25.23%
本期基金份额净值增长率	26.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	5,377,395,675.20
期末可供分配基金份额利润	2.7158
期末基金资产净值	14,717,599,520.67
期末基金份额净值	7.4330
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	643.30%

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

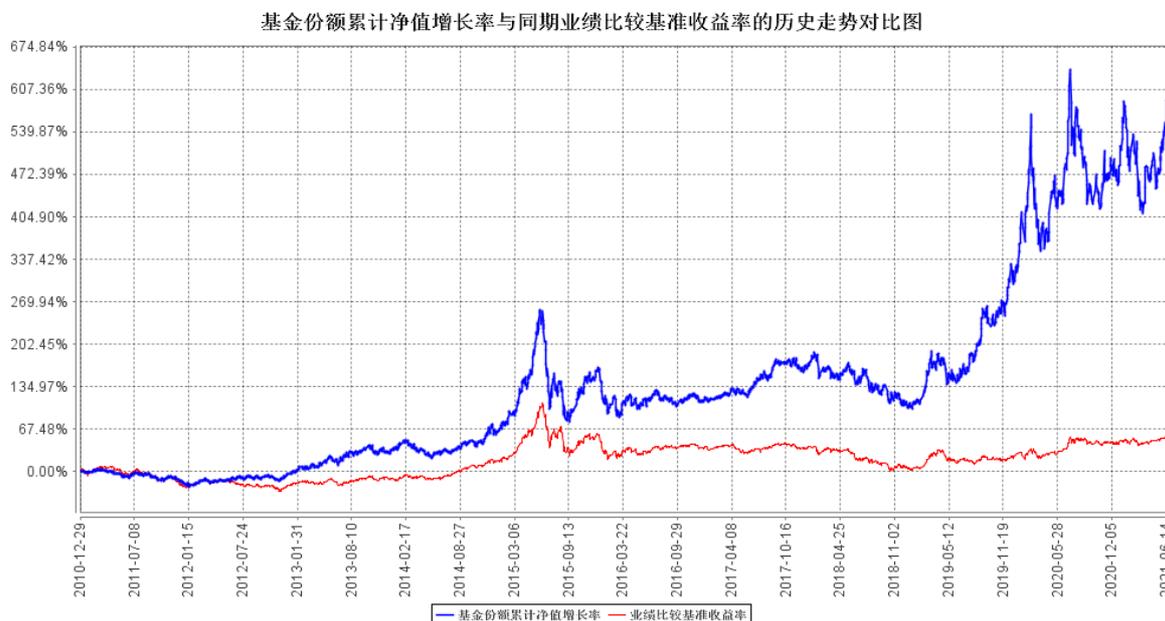
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	19.24%	2.55%	0.92%	0.55%	18.32%	2.00%
过去三个月	40.75%	2.20%	6.83%	0.51%	33.92%	1.69%
过去六个月	26.87%	2.34%	5.70%	0.74%	21.17%	1.60%
过去一年	24.62%	2.35%	12.92%	0.94%	11.70%	1.41%
过去三年	196.17%	2.27%	27.79%	1.11%	168.38%	1.16%
自基金合同生效起至今	643.30%	1.79%	54.83%	1.23%	588.47%	0.56%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%，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



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：本基金投资的股票资产占基金资产的 60%—95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%—40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有创新能力和成长潜力的上市公司。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司成立于 2002 年 6 月 14 日，是经中国证券监督管理委员会按照市场化机制批准成立的第一家基金管理公司（俗称：“好人举手第一家”），是中央汇金公司旗下专业资产管理机构。

银河基金公司的经营范围包括发起设立、管理基金等，注册资本 2 亿元人民币，注册地中国上海。银河基金公司的股东分别为：中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团有限公司、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

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、银河臻选多策略混合型证券投资基金、银河龙头精选股票型发起式证券投资基金、银河臻优稳健配置混合型证券投资基金、银河聚利 87 个月定期开放债券型证券投资基金、银河产业动力混合型证券投资基金。

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		
郑巍山	基金经理	2019 年 5 月 11 日	-	13	硕士研究生，13 年证券从业经历。曾先后就职于国元证券研究中心、景顺长城基金管理有限公司、兴业基金管理有限公司，从事投资、研究等工作。2018 年 10 月加入我公司股票投资部。2019 年 5 月起担任银河创新成长混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 2 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，2020 年 5 月起担任银河臻选多策略混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、上表中的任职、离任日期均为我公司做出决定之日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

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

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

配置依然是具有创新属性的科技领域，主要投资方向为半导体、云计算、5G 及应用、消费电子等。

一季度持仓依然以科技行业中景气度最高的半导体产业链为主，并适当优化了持仓结构，增加了高景气度和增长相对较高的资产配置。

二季度持仓依然以科技行业中景气度最高的半导体产业链为主，并适当优化了持仓结构，增加了增长确定性较高的资产配置。

上半年科技股的基本面是比较好的，目前来看三季度科技股特别是硬科技的基本面也是比较好的。但由于二季度手机库存上升及销售不理想的影响，对某些细分子行业产生了一定的压力。对于科技股未来的投资，我们依然乐观。半导体行业，国产替代率不断提升，下游需求强劲，从晶圆代工厂和封测厂商订单排产来看今年基本上是满产。

对于科技中景气度最高的半导体板块来讲，高景气度有望持续。对于第三季度的操作策略依然是寻找景气度最好的子行业和最核心的科技资产，加强对业绩增长确定性的高景气度资产配置。

目前来看科技板块特别是硬科技的基本面是比较好的。但对于科技股未来的投资，我们依然乐观。另外，随着半导体国产化进程的推进，国产化率逐步提升，这基本上是个不可逆的过程。对于半导体产业链，我们相对看好的是 IDM、设备材料、晶圆代工以及龙头设计公司，并且我们认为这是一个中长期的投资机会。

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 7.4330 元；本报告期基金份额净值增长率为 26.87%，业绩比较基准收益率为 5.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内宏观背景：国内经济从高点回落，政府抓紧窗口期，一方面调结构，控制地产和基建投资，另外一方面出口继续受益于全球复苏。

海外宏观背景：目前各国疫苗接种率破快速上升，主要国家新增人数都大幅下滑，经济复苏的方向是比较明确的。经济复苏程度和疫苗接种率有显著相关性；但另一方面，接种率超过 50% 以后，边际提升难度大幅提升，使得欧洲边际改善力度超越了美国，新兴市场可能超越发达市场；美联储继续强调会继续维持资产购买计划和目前低利率环境，结合欧元升值，美元指数大幅下滑，但随着年底 TAPER 预期提升，市场开始担心海外流动性可能会边际收紧。

从长周期的维度看，新经济替代老经济，科技周期延续的趋势没有改变，因此高景气度行业有望成为市场亮点。

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：本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

截止本报告期末，可分配收益为：5,377,395,675.20，本基金本报告期内未实施利润分配。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：银河创新成长混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	953,976,578.91	1,047,494,047.51
结算备付金		15,479,654.56	32,027,870.49
存出保证金		4,588,698.81	6,374,867.71
交易性金融资产	6.4.7.2	13,930,657,376.99	17,580,875,868.47
其中：股票投资		13,930,657,376.99	17,560,079,868.47
基金投资		-	-
债券投资		-	20,796,000.00
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		164,937,255.77	166,376,344.03
应收利息	6.4.7.5	141,232.99	158,845.28
应收股利		-	-
应收申购款		113,712,046.18	66,913,155.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		15,183,492,844.21	18,900,220,998.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	-
应付赎回款		427,202,787.51	364,138,405.40
应付管理人报酬		19,098,100.86	23,650,691.15
应付托管费		3,183,016.80	3,941,781.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,783,917.31	20,558,049.04
应交税费		-	21.32

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,625,501.06	1,555,910.55
负债合计		465,893,323.54	413,844,859.33
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,980,021,922.95	3,155,359,435.37
未分配利润	6.4.7.10	12,737,577,597.72	15,331,016,704.27
所有者权益合计		14,717,599,520.67	18,486,376,139.64
负债和所有者权益总计		15,183,492,844.21	18,900,220,998.97

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 7.4330 元，基金份额总额 1,980,021,922.95 份。

6.2 利润表

会计主体：银河创新成长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,199,430,369.93	2,457,853,300.99
1.利息收入		2,107,950.46	2,074,563.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,105,737.94	2,074,563.88
债券利息收入		2,212.52	-
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）		2,174,546,349.83	370,316,289.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,138,114,281.28	352,553,694.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	15,075,519.84	-
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	21,356,548.71	17,762,594.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,990,846,759.59	2,057,050,855.55
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	31,929,310.05	28,411,592.04
减：二、费用		187,228,804.16	105,718,600.14

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	118,694,065.20	57,277,793.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,782,344.15	9,546,298.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	48,598,349.61	38,758,115.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		7.99	-
7. 其他费用	6.4.7.20	154,037.21	136,391.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,012,201,565.77	2,352,134,700.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,012,201,565.77	2,352,134,700.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河创新成长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	3,155,359,435.37	15,331,016,704.27	18,486,376,139.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,012,201,565.77	4,012,201,565.77
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）	-1,175,337,512.42	-6,605,640,672.32	-7,780,978,184.74
其中：1. 基金申购款	2,305,531,347.03	11,780,698,162.56	14,086,229,509.59
2. 基金赎回款	-3,480,868,859.45	-18,386,338,834.88	-21,867,207,694.33
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）	1,980,021,922.95	12,737,577,597.72	14,717,599,520.67

项目	上年度可比期间 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)	492,980,532.46	1,493,128,152.82	1,986,108,685.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,352,134,700.85	2,352,134,700.85
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)	1,593,018,795.42	6,510,537,804.10	8,103,556,599.52
其中：1.基金申购款	4,558,866,191.35	19,252,071,007.82	23,810,937,199.17
2.基金赎回款	-2,965,847,395.93	-12,741,533,203.72	-15,707,380,599.65
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)	2,085,999,327.88	10,355,800,657.77	12,441,799,985.65

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	秦长建	刘晓彬
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银河创新成长混合型证券投资基金(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》、《银河创新成长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[2010]1635 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 1,252,121,826.55 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(2010)验字第 60821717_B02 号的验资报告。基金合同于 2010 年 12 月 29 日正式生效。根据基金管理人于 2015 年 7 月 17 日发布的《关于旗下部分基金更名并修改基金合同、托管协议等相关条款的公告》,自该日起,本基金由“银河创新成长股票型证券投资

资基金”更名为“银河创新成长混合型证券投资基金”。本次基金更名不改变基金投资范围。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新适用的基金合同及《银河创新成长混合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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等，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。本基金的投资组合为：股票资产占基金资产的 60%-95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有创新能力和成长潜力的上市公司。以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并依法进行投资管理。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需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[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,由上市公司代扣代缴个人所得税;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。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	953,976,578.91
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：	953,976,578.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,187,209,507.10	13,930,657,376.99	3,743,447,869.89
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	10,187,209,507.10	13,930,657,376.99	3,743,447,869.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金期末未持有衍生金融资产/负债。

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

注：本基金本报告期末未持有各项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

注：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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	129,841.31
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	6,965.80
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	2,360.88
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2,065.00
合计	141,232.99

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	14,783,917.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,783,917.31

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,517,322.11
应付证券出借违约金	-
预提费用	108,178.95
合计	1,625,501.06

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	3,155,359,435.37	3,155,359,435.37
本期申购	2,305,531,347.03	2,305,531,347.03
本期赎回(以“-”号填列)	-3,480,868,859.45	-3,480,868,859.45
- 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	1,980,021,922.95	1,980,021,922.95

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	5,813,256,320.47	9,517,760,383.80	15,331,016,704.27
本期利润	2,021,354,806.18	1,990,846,759.59	4,012,201,565.77
本期基金份额交易产生的变动数	-2,457,215,451.45	-4,148,425,220.87	-6,605,640,672.32
其中：基金申购款	4,608,895,130.15	7,171,803,032.41	11,780,698,162.56
基金赎回款	-7,066,110,581.60	-11,320,228,253.28	-18,386,338,834.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,377,395,675.20	7,360,181,922.52	12,737,577,597.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	1,912,465.28
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	146,693.43
其他	46,579.23
合计	2,105,737.94

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
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	18,774,238,685.45
减：卖出股票成本总额	16,636,124,404.17
买卖股票差价收入	2,138,114,281.28

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

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30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	15,075,519.84
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	15,075,519.84

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	35,874,163.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,796,000.00
减：应收利息总额	2,643.66
买卖债券差价收入	15,075,519.84

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：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

注：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

注：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**

注：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

注：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

注：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

注：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**

注：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
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	21,356,548.71
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	21,356,548.71

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	1,990,846,759.59

——股票投资	1,990,846,759.59
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,990,846,759.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	31,755,751.50
基金转换费收入	173,558.55
合计	31,929,310.05

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	48,598,349.61
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	48,598,349.61

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	600.00
银行间账户维护费	18,000.00
银行费用	36,258.26
合计	154,037.21

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

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的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（“银河基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	同受基金管理人控股股东控制、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

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	174,232,656.10	0.59%	13,687,488,762.72	48.64%
------	----------------	-------	-------------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

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 2021年1月1日至2021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	162,261.89	0.60%	162,261.89	1.10%
关联方名称	上年度可比期间 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	12,620,104.43	48.91%	5,222,035.12	31.65%

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	118,694,065.20
其中：支付销售机构的客户维护费	49,146,922.43	24,220,139.19

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,782,344.15	9,546,298.96

注：支付基金托管人招商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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

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

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。

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

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。

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

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。

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自有资金投资本基金的情况

注：本基金本期与上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

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

注：本基金本期末与上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
招商银行	953,976,578.91	1,912,465.28	864,997,974.29	1,847,578.81

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期与上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封	2021年	2021	新股	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-

	科技	6月28日	年7月6日	流通受限						
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.16	359	3,862.84	7,955.44	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.08	217	2,905.63	6,527.36	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.53	183	2,538.21	5,403.99	-
300931	通用	2021年	2021	新股	4.31	13.10	672	2,896.32	8,803.20	-

	电梯	1月13日	年7月21日	锁定						
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.66	244	2,989.00	13,093.04	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.35	307	3,917.32	13,308.45	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	21.31	49.91	399	8,502.69	19,914.09	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.49	443	2,352.33	12,621.07	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.87	474	2,161.44	8,944.38	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.00	255	2,496.45	5,865.00	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13.00	27.39	216	2,808.00	5,916.24	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	新股锁定-送股	-	27.39	108	-	2,958.12	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.12	219	1,841.79	8,567.28	-
300952	恒辉	2021年	2021	新股	11.72	27.07	340	3,984.80	9,203.80	-

	安防	3月3日	年9月13日	锁定						
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.89	240	6,904.80	23,973.60	-
688633	星球石墨	2021年3月17日	2021年9月24日	新股锁定	33.62	53.12	1,558	52,379.96	82,760.96	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.05	232	3,834.96	10,683.60	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	252.43	853	40,372.49	215,322.79	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	22.13	576	1,958.40	12,746.88	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	27.74	283	3,432.79	7,850.42	-
300967	晓鸣	2021年	2021	新股	4.54	15.34	507	2,301.78	7,777.38	-

	股份	4月2日	年10月13日	锁定						
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	145.09	360	10,180.80	52,232.40	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	14.98	1,162	7,982.94	17,406.76	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	16.20	430	3,091.70	6,966.00	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	105.33	925	30,728.50	97,430.25	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	16.77	593	4,993.06	9,944.61	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	106.28	601	29,202.59	63,874.28	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	50.96	317	5,018.11	16,154.32	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	27.29	295	7,345.50	8,050.55	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	37.24	264	3,904.56	9,831.36	-
300987	川网	2021年	2021	新股	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-

	传媒	4月28日	年11月11日	锁定						
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	34.14	254	3,317.24	8,671.56	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	23.23	410	4,961.00	9,524.30	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	49.61	329	3,023.51	16,321.69	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	28.81	191	2,811.52	5,502.71	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	17.26	928	4,584.32	16,017.28	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	28.50	201	1,210.02	5,728.50	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	20.81	50.60	241	5,015.21	12,194.60	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股锁定	18.94	124.87	1,941	36,762.54	242,372.67	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股锁定	2.65	5.90	907,763	2,405,571.95	5,355,801.70	-
301007	德迈	2021年	2021	新股	5.29	19.12	303	1,602.87	5,793.36	-

	仕	6月4日	年12月16日	锁定						
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	31.22	801	10,044.54	25,007.22	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	44.02	175	2,485.00	7,703.50	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	22.62	218	1,706.94	4,931.16	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	32.12	170	1,368.50	5,460.40	-
301013	C利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	35.33	471	4,107.12	16,640.43	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	54.81	462	3,529.68	25,322.22	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	41.07	275	3,781.25	11,294.25	-

注：1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。
2. 本基金持有的限售新股冠中生态于 2021 年 6 月 4 日实施 2020 年度权益分派方案，向全体股东每股派送 0.5 股，因送股所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日期	停牌原	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	-----	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

	称		因							
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	25,200,000	550,461,234.01	1,420,020,000.00	-

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 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 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。

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

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

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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	20,796,000.00
未评级	-	-
合计	-	20,796,000.00

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

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。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	953,976,578.91	-	-	-	-	-	953,976,578.91
结算备付金	15,479,654.56	-	-	-	-	-	15,479,654.56
存出保证金	4,588,698.81	-	-	-	-	-	4,588,698.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-13,930,657,376.99	-13,930,657,376.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	164,937,255.77	164,937,255.77
应收利息	-	-	-	-	-	141,232.99	141,232.99
应收申购款	497.02	-	-	-	-	113,711,549.16	113,712,046.18
资产总计	974,045,429.30	-	-	-	-	-14,209,447,414.91	15,183,492,844.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	427,202,787.51	427,202,787.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	19,098,100.86	19,098,100.86
应付托管费	-	-	-	-	-	3,183,016.80	3,183,016.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,783,917.31	14,783,917.31
其他负债	-	-	-	-	-	1,625,501.06	1,625,501.06
负债总计	-	-	-	-	-	465,893,323.54	465,893,323.54
利率敏感度缺口	974,045,429.30	-	-	-	-	-13,743,554,091.37	14,717,599,520.67
上年度末 2020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	1,047,494,047.51	-	-	-	-	-	1,047,494,047.51
结算备付金	32,027,870.49	-	-	-	-	-	32,027,870.49
存出保证金	6,374,867.71	-	-	-	-	-	6,374,867.71
交易性金融资产	-	-	-20,796,000.00	-	-	-17,560,079,868.47	-17,580,875,868.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	166,376,344.03	166,376,344.03
应收利息	-	-	-	-	-	158,845.28	158,845.28
应收申购款	-	-	-	-	-	66,913,155.48	66,913,155.48
资产总计	1,085,896,785.71	-	-20,796,000.00	-	-	-17,793,528,213.26	18,900,220,998.97
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	364,138,405.40	364,138,405.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	23,650,691.15	23,650,691.15
应付托管费	-	-	-	-	3,941,781.87	3,941,781.87
应付交易费用	-	-	-	-	20,558,049.04	20,558,049.04
应交税费	-	-	-	-	21.32	21.32
其他负债	-	-	-	-	1,555,910.55	1,555,910.55
负债总计	-	-	-	-	413,844,859.33	413,844,859.33
利率敏感度缺口	1,085,896,785.71	-20,796,000.00	-	-	-17,379,683,353.93	18,486,376,139.64

6.4.13.4.1.2 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	-	300,258.69
	市场利率上升 25 个基点	-	-300,258.69

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	13,930,657,376.99	94.65	17,560,079,868.47	94.99
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	13,930,657,376.99	94.65	17,560,079,868.47	94.99

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 500 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定中证 500 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	中证 500 指数上升 5%	1,046,332,447.44	1,226,276,374.32
	中证 500 指数下降 5%	-1,046,332,447.44	-1,226,276,374.32

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	13,930,657,376.99	91.75
	其中：股票	13,930,657,376.99	91.75
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	969,456,233.47	6.38
8	其他各项资产	283,379,233.75	1.87
9	合计	15,183,492,844.21	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	210,871.80	0.00
B	采矿业	87,263.74	0.00
C	制造业	12,495,459,627.51	84.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,472,974.50	0.04
E	建筑业	208,995.61	0.00
F	批发和零售业	689,118.84	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	39,570.63	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,426,336,380.40	9.69
J	金融业	306,777.40	0.00
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,133,352.91	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	578,426.64	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	42,194.72	0.00
S	综合	-	-
	合计	13,930,657,376.99	94.65

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300782	卓胜微	2,760,000	1,483,500,000.00	10.08
2	688981	中芯国际	23,800,000	1,471,316,000.00	10.00
3	603986	兆易创新	7,800,000	1,465,620,000.00	9.96
4	002371	北方华创	5,200,000	1,442,376,000.00	9.80
5	688536	思瑞浦	2,580,000	1,421,580,000.00	9.66
6	600460	士兰微	25,200,000	1,420,020,000.00	9.65
7	600584	长电科技	37,000,000	1,394,160,000.00	9.47
8	688396	华润微	12,800,000	1,165,056,000.00	7.92
9	688126	沪硅产业	29,000,000	846,220,000.00	5.75
10	300346	南大光电	18,600,000	719,448,000.00	4.89
11	300655	晶瑞股份	12,999,523	474,352,594.27	3.22
12	688012	中微公司	2,000,000	331,840,000.00	2.25
13	603005	晶方科技	2,300,000	136,229,000.00	0.93
14	600171	上海贝岭	3,865,500	117,627,165.00	0.80
15	600905	三峡能源	907,763	5,355,801.70	0.04
16	688608	恒玄科技	4,179	1,324,366.89	0.01
17	688819	天能股份	28,382	1,262,715.18	0.01
18	688256	寒武纪	8,962	1,238,548.40	0.01
19	688063	派能科技	5,499	1,082,203.20	0.01
20	300979	华利集团	9,246	1,045,192.15	0.01
21	688696	极米科技	1,252	1,041,664.00	0.01
22	300999	金龙鱼	12,114	1,029,205.44	0.01
23	688521	芯原股份	13,200	1,029,204.00	0.01
24	688083	中望软件	1,837	1,014,575.10	0.01
25	688425	铁建重工	135,282	827,925.84	0.01

26	688680	海优新材	2,795	718,315.00	0.00
27	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.00
28	300981	中红医疗	6,003	673,544.00	0.00
29	300896	爱美客	852	672,125.76	0.00
30	688617	惠泰医疗	1,673	637,396.27	0.00
31	300973	立高食品	3,593	553,347.40	0.00
32	688777	中控技术	5,794	545,505.10	0.00
33	688526	科前生物	14,620	529,536.40	0.00
34	688788	科思科技	3,629	527,584.02	0.00
35	688660	电气风电	51,238	450,894.40	0.00
36	688626	翔宇医疗	3,652	441,307.68	0.00
37	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.00
38	688383	新益昌	2,701	380,868.01	0.00
39	688317	之江生物	5,740	372,813.00	0.00
40	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.00
41	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
42	688595	芯海科技	3,190	280,624.30	0.00
43	301009	可靠股份	8,007	267,705.30	0.00
44	688183	生益电子	18,394	267,264.82	0.00
45	688630	芯碁微装	3,397	261,840.76	0.00
46	300953	震裕科技	2,394	258,651.90	0.00
47	301015	百洋医药	4,614	258,498.54	0.00
48	688269	凯立新材	1,941	242,372.67	0.00
49	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.00
50	688665	四方光电	1,687	229,685.05	0.00
51	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.00
52	300957	贝泰妮	853	215,322.79	0.00
53	688079	美迪凯	10,622	208,509.86	0.00
54	300941	创识科技	3,989	204,440.09	0.00
55	688677	海泰新光	1,768	193,596.00	0.00
56	300968	格林精密	11,620	182,643.16	0.00
57	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.00
58	300614	百川畅银	3,283	179,736.97	0.00
59	688609	九联科技	10,372	179,228.16	0.00
60	300982	苏文电能	3,170	175,779.67	0.00
61	301013	C利和兴	4,704	172,838.13	0.00
62	300997	欢乐家	9,279	172,682.04	0.00
63	688059	华锐精密	1,023	171,761.70	0.00
64	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.00

65	301002	崧盛股份	2,001	162,760.32	0.00
66	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.00
67	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
68	300925	法本信息	5,998	157,687.42	0.00
69	688687	凯因科技	5,354	155,266.00	0.00
70	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.00
71	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.00
72	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.00
73	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.00
74	300962	中金辐照	5,757	137,090.88	0.00
75	688661	和林微纳	1,452	136,705.80	0.00
76	300940	南极光	3,068	136,449.05	0.00
77	300996	普联软件	2,410	134,504.51	0.00
78	300937	药易购	2,434	133,586.84	0.00
79	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.00
80	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.00
81	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.00
82	688667	菱电电控	1,191	131,021.91	0.00
83	300942	易瑞生物	4,428	131,015.42	0.00
84	688313	仕佳光子	7,151	129,647.63	0.00
85	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.00
86	688689	银河微电	3,258	121,165.02	0.00
87	301016	雷尔伟	2,747	117,936.33	0.00
88	300933	中辰股份	11,117	117,462.18	0.00
89	300955	嘉亨家化	2,314	115,866.24	0.00
90	300987	川网传媒	3,004	115,771.64	0.00
91	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.00
92	688528	秦川物联	8,337	112,132.65	0.00
93	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.00
94	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.00
95	300978	东箭科技	5,930	107,558.34	0.00
96	300986	志特新材	2,632	105,190.72	0.00
97	688316	青云科技	1,428	102,102.00	0.00
98	688656	浩欧博	1,371	101,961.27	0.00
99	300993	玉马遮阳	4,097	101,514.95	0.00
100	688109	品茗股份	1,301	101,009.64	0.00
101	688329	艾隆科技	1,846	100,902.36	0.00
102	300956	英力股份	3,707	100,044.12	0.00
103	300882	万胜智能	5,712	99,674.40	0.00

104	300865	大宏立	3,311	99,594.88	0.00
105	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.00
106	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
107	688636	智明达	918	97,583.40	0.00
108	300961	深水海纳	3,936	95,687.10	0.00
109	300952	恒辉安防	3,398	95,317.08	0.00
110	688662	富信科技	2,556	93,856.32	0.00
111	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.00
112	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.00
113	300945	曼卡龙	4,731	92,934.99	0.00
114	300948	冠中生态	3,230	92,886.82	0.00
115	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.00
116	300991	创益通	2,535	91,152.52	0.00
117	300975	商络电子	4,917	90,128.19	0.00
118	300931	通用电梯	6,713	89,873.42	0.00
119	300950	德固特	2,186	89,332.30	0.00
120	688669	聚石化学	2,681	87,909.99	0.00
121	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.00
122	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.00
123	688070	纵横股份	2,407	87,085.26	0.00
124	300963	中洲特材	2,830	86,807.42	0.00
125	300958	建工修复	2,993	86,747.74	0.00
126	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.00
127	300985	致远新能	2,945	84,609.05	0.00
128	300967	晓鸣股份	5,061	83,601.48	0.00
129	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
130	688633	星球石墨	1,558	82,760.96	0.00
131	301011	华立科技	1,750	81,256.00	0.00
132	601963	重庆银行	7,472	81,220.64	0.00
133	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.00
134	300926	博俊科技	3,584	80,840.44	0.00
135	605117	德业股份	627	80,005.20	0.00
136	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.00
137	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.00
138	300861	美畅股份	895	75,457.45	0.00
139	300972	万辰生物	4,300	73,065.60	0.00
140	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.00
141	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.00
142	688191	智洋创新	3,203	69,184.80	0.00

143	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.00
144	300927	江天化学	2,163	65,627.38	0.00
145	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
146	688260	昀冢科技	2,990	64,105.60	0.00
147	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.00
148	688676	金盘科技	3,750	62,812.50	0.00
149	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
150	301007	德迈仕	3,022	61,723.19	0.00
151	300998	宁波方正	2,003	61,518.42	0.00
152	300869	康泰医学	862	61,046.84	0.00
153	688328	深科达	1,499	60,514.63	0.00
154	300943	春晖智控	2,542	59,952.55	0.00
155	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
156	688195	腾景科技	2,693	58,626.61	0.00
157	300995	奇德新材	1,909	58,417.11	0.00
158	301012	扬电科技	1,691	58,330.36	0.00
159	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.00
160	300960	通业科技	2,332	57,006.84	0.00
161	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.00
162	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
163	688616	西力科技	3,918	55,870.68	0.00
164	300929	华骐环保	1,827	54,888.39	0.00
165	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
166	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
167	301010	晶雪节能	2,172	51,573.14	0.00
168	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.00
169	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
170	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
171	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
172	688659	元琛科技	3,671	48,530.62	0.00
173	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.00
174	605337	李子园	788	46,886.00	0.00
175	300867	圣元环保	1,498	45,404.38	0.00
176	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
177	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00
178	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
179	300860	锋尚文化	724	42,194.72	0.00
180	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
181	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00

182	688092	爱科科技	1,137	39,283.35	0.00
183	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
184	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
185	300871	回盛生物	927	36,153.00	0.00
186	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
187	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
188	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
189	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.00
190	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
191	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00
192	300872	天阳科技	871	31,617.30	0.00
193	300870	欧陆通	478	29,884.56	0.00
194	003031	中瓷电子	542	29,647.40	0.00
195	605077	华康股份	618	28,193.16	0.00
196	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
197	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
198	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
199	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
200	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
201	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.00
202	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
203	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
204	605378	野马电池	473	21,729.62	0.00
205	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
206	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
207	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
208	300873	海晨股份	484	20,720.04	0.00
209	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
210	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
211	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
212	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
213	300878	维康药业	401	18,714.67	0.00
214	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
215	300868	杰美特	593	18,151.73	0.00
216	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.00
217	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
218	300864	南大环境	316	17,383.16	0.00
219	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
220	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00

221	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
222	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
223	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
224	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
225	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
226	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
227	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
228	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
229	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
230	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
231	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
232	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
233	300902	国安达	551	12,981.56	0.00
234	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
235	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
236	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
237	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
238	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
239	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
240	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
241	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
242	605289	罗曼股份	380	10,959.20	0.00
243	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
244	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
245	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
246	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
247	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
248	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
249	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
250	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
251	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
252	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
253	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
254	000888	峨眉山 A	888	5,692.08	0.00
255	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
256	003028	振邦智能	32	1,651.20	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

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	300782	卓胜微	1,245,440,897.49	6.74
2	002415	海康威视	1,133,477,842.32	6.13
3	688396	华润微	936,162,429.68	5.06
4	688126	沪硅产业	904,510,340.85	4.89
5	002371	北方华创	806,943,362.08	4.37
6	300346	南大光电	702,336,306.80	3.80
7	000725	京东方 A	588,566,172.73	3.18
8	002129	中环股份	492,763,484.29	2.67
9	300661	圣邦股份	457,662,377.64	2.48
10	300750	宁德时代	440,180,302.64	2.38
11	603290	斯达半导	419,469,968.41	2.27
12	600460	士兰微	397,491,785.34	2.15
13	688012	中微公司	375,798,249.72	2.03
14	300655	晶瑞股份	375,350,807.49	2.03
15	000066	中国长城	370,338,102.52	2.00
16	002156	通富微电	342,979,341.78	1.86
17	603005	晶方科技	315,846,060.56	1.71
18	300390	天华超净	206,175,142.76	1.12
19	600171	上海贝岭	98,777,032.46	0.53
20	002409	雅克科技	91,827,327.20	0.50

注：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。

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	000725	京东方 A	2,523,776,895.69	13.65
2	603501	韦尔股份	2,074,831,855.30	11.22
3	600703	三安光电	1,524,039,978.20	8.24
4	600460	士兰微	1,369,244,408.70	7.41

5	002415	海康威视	1,097,634,303.33	5.94
6	603005	晶方科技	886,303,429.78	4.79
7	688019	安集科技	720,465,025.85	3.90
8	688012	中微公司	679,097,815.17	3.67
9	603290	斯达半导	661,669,857.38	3.58
10	002371	北方华创	643,402,513.10	3.48
11	688008	澜起科技	629,859,789.95	3.41
12	300223	北京君正	534,860,758.35	2.89
13	002129	中环股份	521,397,900.50	2.82
14	300750	宁德时代	473,398,700.67	2.56
15	300782	卓胜微	469,226,365.26	2.54
16	603986	兆易创新	459,618,921.91	2.49
17	300661	圣邦股份	410,939,648.39	2.22
18	000066	中国长城	358,503,535.50	1.94
19	688396	华润微	346,168,957.57	1.87
20	002156	通富微电	330,361,641.50	1.79

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	11,015,855,153.10
卖出股票收入（成交）总额	18,774,238,685.45

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的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

注：本基金契约规定，无法投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金契约规定，无法投资股指期货。

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

注：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	4,588,698.81
2	应收证券清算款	164,937,255.77
3	应收股利	-
4	应收利息	141,232.99
5	应收申购款	113,712,046.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	283,379,233.75

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	1,420,020,000.00	9.65	重大事项停牌

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

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
1,276,239	1,551.45	25,138,699.54	1.27%	1,954,883,223.41	98.73%

8.2 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	142,643.40	0.0072%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2010 年 12 月 29 日 ）基金份额总额	1, 252, 121, 826. 55
本报告期期初基金份额总额	3, 155, 359, 435. 37
本报告期基金总申购份额	2, 305, 531, 347. 03
减：本报告期基金总赎回份额	3, 480, 868, 859. 45
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	1, 980, 021, 922. 95

§ 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、2021年3月13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》，钱睿南先生个人原因辞职，自2021年3月12日起不再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

报告期内本基金投资范围增加存托凭证投资品种，投资策略相应改变。

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

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	4,000,540,456.69	13.44%	3,645,686.48	13.43%	-
天风证券	2	3,857,935,213.97	12.96%	3,515,774.43	12.95%	-
招商证券	1	3,570,938,975.97	11.99%	3,254,206.28	11.99%	-
华创证券	1	3,491,774,976.35	11.73%	3,182,057.23	11.72%	-

中金公司	2	3,400,226,076.94	11.42%	3,098,643.05	11.41%	-
长江证券	1	3,257,627,691.03	10.94%	2,968,647.80	10.94%	-
华西证券	1	1,936,654,258.54	6.50%	1,764,871.29	6.50%	-
广发证券	2	1,807,890,420.24	6.07%	1,647,531.65	6.07%	-
中信证券	1	1,717,539,854.89	5.77%	1,565,196.39	5.77%	-
开源证券	1	1,149,069,327.61	3.86%	1,047,142.82	3.86%	-
中泰证券	1	585,366,348.97	1.97%	533,445.13	1.97%	-
西部证券	1	474,190,017.45	1.59%	441,612.03	1.63%	-
东兴证券	1	214,972,908.25	0.72%	195,900.78	0.72%	-
银河证券	2	174,232,656.10	0.59%	162,261.89	0.60%	-
华泰证券	1	136,433,302.59	0.46%	124,332.07	0.46%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	-	-	-	-	-
野村东方证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期本基金新增野村东方证券 1 个交易单元。

2、选择证券公司专用席位的标准：

(1) 实力雄厚；

(2) 信誉良好，经营行为规范；

(3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；

(5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；

(6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

(1) 资格考察；

(2) 初步确定；

(3) 签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	35,874,163.50	100.00%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
野村东方证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

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	银河基金管理有限公司 2020 年第四季度报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2021 年 1 月 21 日
2	银河创新成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）	《中国证券报》、公司网站	2021 年 2 月 9 日

3	银河创新成长混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、公司网站	2021 年 2 月 9 日
4	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》、公司网站	2021 年 3 月 13 日
5	银河基金管理有限公司关于旗下银河创新成长混合型证券投资基金在东方财富证券股份有限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》、公司网站	2021 年 3 月 15 日
6	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 3 月 23 日
7	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 3 月 23 日
8	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在安信证券股份有限公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、公司网站	2021 年 3 月 23 日
9	银河基金管理有限公司 2020 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	2021 年 3 月 30 日
10	银河基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在华夏银行股份有限公司申购及定投费率优惠的公告	《证券时报》、公司网站	2021 年 4 月 1 日
11	银河基金管理有限公司 2021 年第一季度报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 4 月 21 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

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。

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创新成长混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河创新成长混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河创新成长混合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、银河创新成长混合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

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

2021 年 8 月 27 日