

# 银河臻选多策略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。本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

<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	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河臻选多策略混合型证券投资基金	
基金简称	银河臻选多策略混合	
场内简称	-	
基金主代码	006945	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 9 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	1,392,824.68 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	-	
下属分级基金的基金简称:	银河臻选多策略混合 A	银河臻选多策略混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	006945	008387
报告期末下属分级基金的份额总额	715,543.75 份	677,280.93 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产持续稳定增值。	
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将主要遵循“自下而上”的分析框架，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资。</p> <p>3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、金融衍生品投资策略：包括（1）股指期货投资策略和（2）国债期货投资策略；6、存托凭证投资策略。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+上证国债指数收益率×75%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
	银河臻选多策略混合 A	银河臻选多策略混合 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	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	<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、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	银河基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

### § 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	银河臻选多策略混合 A	银河臻选多策略混合 C
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)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	-1,667.49	-2,711.52
本期利润	-1,402.49	-2,846.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0012	-0.0017
本期加权平均净值利润率	-0.12%	-0.17%
本期基金份额净值增长率	-0.11%	-0.18%
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	-8,693.81	-9,406.91
期末可供分配基金份额利润	-0.0121	-0.0139
期末基金资产净值	712,329.34	673,045.57
期末基金份额净值	0.9955	0.9937
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	-0.45%	-0.63%

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

银河臻选多策略混合 A

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	0.46%	0.09%	-0.40%	0.21%	0.86%	-0.12%
过去三个月	0.01%	0.09%	1.56%	0.24%	-1.55%	-0.15%
过去六个月	-0.11%	0.07%	1.51%	0.33%	-1.62%	-0.26%
过去一年	0.23%	0.10%	8.19%	0.33%	-7.96%	-0.23%



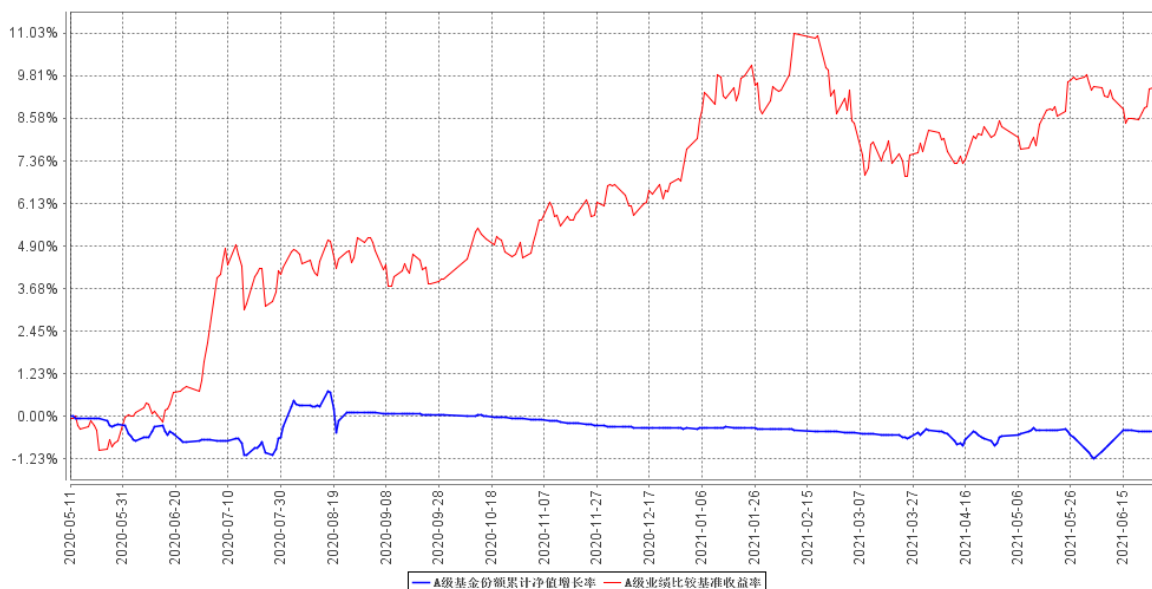
自基金合同生效起至今	-0.45%	0.10%	9.32%	0.32%	-9.77%	-0.22%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	--------

银河臻选多策略混合 C

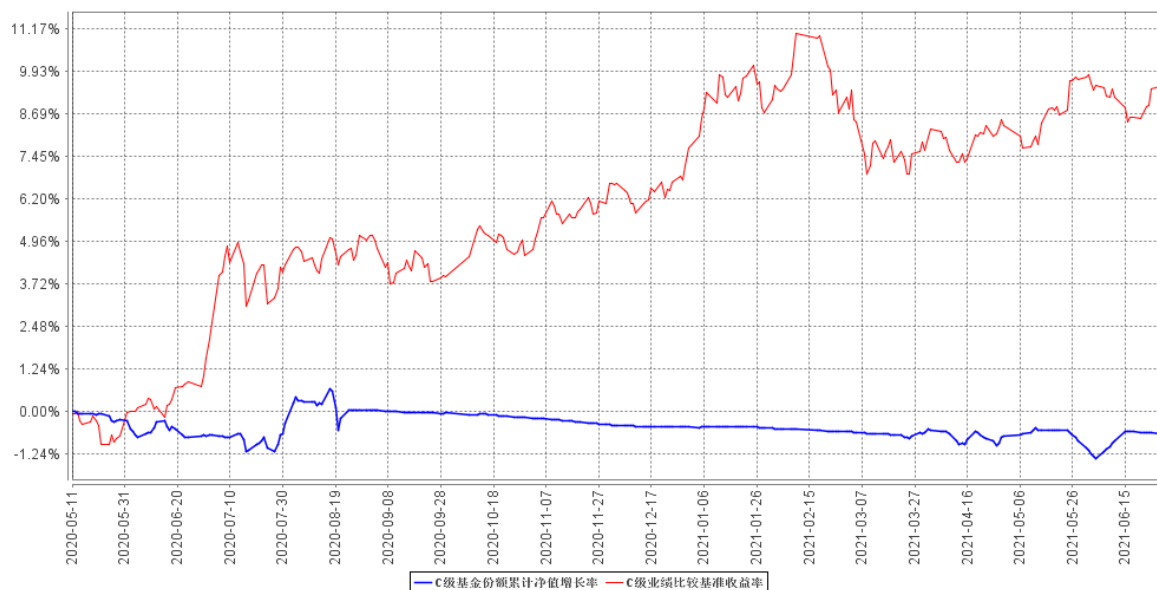
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.44%	0.09%	-0.40%	0.21%	0.84%	-0.12%
过去三个月	-0.03%	0.09%	1.56%	0.24%	-1.59%	-0.15%
过去六个月	-0.18%	0.07%	1.51%	0.33%	-1.69%	-0.26%
过去一年	0.06%	0.10%	8.19%	0.33%	-8.13%	-0.23%
自基金合同生效起至今	-0.63%	0.10%	9.32%	0.32%	-9.95%	-0.22%

### 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



C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：1、基金管理人应当自基金合同生效之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约定。本基金股票资产投资占基金资产的比例为 0-45%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。截至建仓期结束，本基金各项资产配置符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、本基金合同生效日为 2020 年 5 月 9 日。

### 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		
张沛	基金经理	2020 年 5 月 9 日	-	15	硕士研究生学历，15 年金融行业从业经历。曾任职于花旗银行、东亚银行、大华银行、招商银行、上海赞庚投资公司等金融机构。2017 年 11 月加入我公司。2018 年 2 月起担任银河钱包货币市场基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河银富货币市场基金的基金经理，2019 年 5 月起担任银河丰泰 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2019 年 10 月起担任银河天盈中短债债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月起担任银河嘉裕纯债债券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，2020 年 12 月起担任银河聚利 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
郑巍山	基金经 理	2020 年 5 月 9 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、上表中任职日期为基金合同生效之日。

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》、《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。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

上半年，国内经济呈平稳增长态势，出口较为强劲，投资仍有韧性，消费温和回升。国内货币政策保持稳健中性，资金面较为宽松。上半年债券市场呈区间震荡格局。一季度债市收益率整体上行，1 月份资金面大幅收紧各期限收益率上行，短端上行幅度高于中长端；2 月份资金面有所缓解，但受到通胀预期及美债调整等影响，中长端继续上行，曲线陡峭化；3 月份资金面持续宽松带动收益率下行。二季度债市收益率震荡下行，4-5 月份资金面继续保持宽松，带动长端收益率下行，6 月资金面有所收敛，窄幅震荡。上半年 1Y 国开下行 5BP，3Y 国开上行 5bp，5Y 国开收平，10Y 国开下行 4bp，曲线整体平坦化。信用债方面，一季度市场防守情绪较浓，短端收益率下行而 3、5 年收益率小幅上行。二季度在资金较宽松及欠配缺资产的推动下，市场资金追逐中低等级品种，AA+及 AA 品种下行幅度多于 AAA，短端上行，中长端下行，信用债曲线走平。上半年整体来看，AAA 等级一年期下行 14BP，3 年期下行 7BP，5 年期下行 5BP，AA+等级一年期下行 34BP，3 年期下行 40BP，5 年期下行 42BP。

本基金适度参与债券投资，保持净值稳定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河臻选多策略混合 A 基金份额净值为 0.9955 元,本报告期基金份额净值增长率为-0.11%;截至本报告期末银河臻选多策略混合 C 基金份额净值为 0.9937 元,本报告期基金份额净值增长率为-0.18%;同期业绩比较基准收益率为 1.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济增长预计稳中偏弱。在控制宏观杠杆率和防范地方债务风险的背景下,基建和地产投资将走弱;出口订单下滑预示着出口动能可能衰减;消费呈缓慢恢复态势。7 月份的降准有助于防范经济的周期性风险,我们判断下半年货币政策将以稳为主,会根据经济形势进行相机抉择。随着地方政府债供给放量,社融增速回落速度将有望缓和。综合来看,债市大概率以震荡为主,关注资金面波动、地方债供给、信用风险事件和疫情等可能带来的影响。

本基金将继续秉持审慎的投资操作策略,着重采取票息策略,并适当加大杠杆操作力度,为持有人获取较为稳定的收益。

#### 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,本基金可进行收益分配,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,本基金 A 类份额无可供分配收益,C 类份额无可供分配收益。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**

本报告期内，本基金已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万的情形。我司已于 2020 年 11 月向中国证券监督管理委员会提交了《银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略混合型证券投资基金解决方案的报告》。



## § 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：银河臻选多策略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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	155,174.43	4,860,806.96
结算备付金		13,350.03	-
存出保证金		138.08	10,904.34
交易性金融资产	6.4.7.2	735,097.00	539,828.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		735,097.00	539,828.50
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	500,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	20,301.46	6,842.92
应收股利		-	-
应收申购款		209.99	4,168.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,424,270.99	5,422,551.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付赎回款		22,115.20	411,073.23
应付管理人报酬		1,473.11	2,950.20
应付托管费		245.53	491.68
应付销售服务费		185.85	258.95
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	0.06

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	14,876.39	110,129.95
负债合计		38,896.08	524,904.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,392,824.68	4,917,113.53
未分配利润	6.4.7.10	-7,449.77	-19,466.38
所有者权益合计		1,385,374.91	4,897,647.15
负债和所有者权益总计		1,424,270.99	5,422,551.22

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，银河臻选多策略混合 A 基金份额净值 0.9955 元，基金份额总额 715,543.75 份；银河臻选多策略混合 C 基金份额净值 0.9937 元，基金份额总额 677,280.93 份。银河臻选多策略混合份额总额合计为 1,392,824.68 份。

2、本基金基金合同于 2020 年 5 月 9 日生效。

## 6.2 利润表

会计主体：银河臻选多策略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 5 月 9 日(基金合 同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		22,440.90	-1,199,883.53
1.利息收入		15,264.28	702,731.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,393.81	25,049.71
债券利息收入		8,572.29	541,285.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,298.18	136,396.56
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,912.47	-1,623,602.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,912.47	-1,623,602.05
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	129.61	-284,861.81

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	4,134.54	5,848.50
<b>减：二、费用</b>		26,690.30	248,885.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,292.95	159,149.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,382.13	26,524.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	797.76	25,848.02
4. 交易费用	6.4.7.19	44.11	1,396.26
5. 利息支出		25.70	5,426.24
其中：卖出回购金融资产支出		25.70	5,426.24
6. 税金及附加		1.26	653.21
7. 其他费用	6.4.7.20	16,146.39	29,886.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,249.40	-1,448,768.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,249.40	-1,448,768.75

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河臻选多策略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）	4,917,113.53	-19,466.38	4,897,647.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,249.40	-4,249.40
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）	-3,524,288.85	16,266.01	-3,508,022.84
其中：1. 基金申购款	3,013,908.80	-15,919.70	2,997,989.10
2. 基金赎回款	-6,538,197.65	32,185.71	-6,506,011.94

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）	1,392,824.68	-7,449.77	1,385,374.91
项目	上年度可比期间 2020年5月9日(基金合同生效日)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）	216,793,316.62	-	216,793,316.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,448,768.75	-1,448,768.75
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）	-76,346,104.76	477,849.26	-75,868,255.50
其中：1.基金申购款	3,034,245.74	-17,974.78	3,016,270.96
2.基金赎回款	-79,380,350.50	495,824.04	-78,884,526.46
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）	140,447,211.86	-970,919.49	139,476,292.37

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：

<u>高见</u>	<u>秦长建</u>	<u>刘晓彬</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银河臻选多策略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》、《银河臻选多策略混合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[2019] 2217 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 216, 793, 316. 62 份, 经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证, 并出具了编号为德师报(验)字(20)第 00017 号的验资报告。基金合同于 2020 年 5 月 9 日正式生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司, 基金托管人为招商银行股份有限公司。

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“银河臻选多策略混合 A”)和 C 类基金份额(以下简称“银河臻选多策略混合 C”)两类份额。其中, 银河臻选多策略混合 A 是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额; 银河臻选多策略混合 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, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

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《银河臻选多策略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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券、可交换债券)、债券回购、同业存单、银行存款、资产支持证券、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为: 本基金股票资产投资占基金资产的比例为 0-45%, 每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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; 股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。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。本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 $\times$ 25%+上证国债指数收益率 $\times$ 75%。

#### 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 2021 上半年度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要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要说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要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	155,174.43
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：	155,174.43

### 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	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	735,149.31	735,097.00
	银行间市场	-	-
	合计	735,149.31	735,097.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	735,149.31	735,097.00	-52.31



**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：本基金本报告期末无衍生金融工具。

**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**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	500,000.00	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末无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	100.68
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	6.10
应收债券利息	19,926.72
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	267.96
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	20,301.46

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	14,876.39
合计	14,876.39

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银河臻选多策略混合 A		
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	2,304,821.41	2,304,821.41
本期申购	323,533.47	323,533.47
本期赎回(以“-”号填列)	-1,912,811.13	-1,912,811.13
- 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	715,543.75	715,543.75

金额单位：人民币元

银河臻选多策略混合 C		
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	2,612,292.12	2,612,292.12
本期申购	2,690,375.33	2,690,375.33
本期赎回(以“-”号填列)	-4,625,386.52	-4,625,386.52
- 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	677,280.93	677,280.93

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

银河臻选多策略混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-25,190.67	17,394.36	-7,796.31
本期利润	-1,667.49	265.00	-1,402.49
本期基金份额交易产生的变动数	18,164.35	-12,179.96	5,984.39
其中：基金申购款	-3,803.67	2,416.63	-1,387.04
基金赎回款	21,968.02	-14,596.59	7,371.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,693.81	5,479.40	-3,214.41

单位：人民币元

银河臻选多策略混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-31,331.08	19,661.01	-11,670.07
本期利润	-2,711.52	-135.39	-2,846.91
本期基金份额交易产生的变动数	24,635.69	-14,354.07	10,281.62
其中：基金申购款	-35,869.70	21,337.04	-14,532.66
基金赎回款	60,505.39	-35,691.11	24,814.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,406.91	5,171.55	-4,235.36

#### 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	3,330.20
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	43.78
其他	19.83
合计	3,393.81

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

注：本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：本基金本报告期无股票投资收益。

**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	2,912.47
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	2,912.47

**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	2,044,162.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,010,248.90
减：应收利息总额	31,000.90
买卖债券差价收入	2,912.47

**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**

注：本基金本报告期内无股利收益。

**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	129.61
—— 股票投资	-
—— 债券投资	129.61
—— 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	129.61

#### 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	4,132.31
基金转换费收入 006945	0.22
基金转换费收入 008387	2.01
合计	4,134.54

#### 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	44.11
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	44.11

#### 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	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,270.00

合计	16,146.39
----	-----------

#### 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（“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

#### 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

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股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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5月9日(基金合同生效日)至 2020年6月30日	
	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 成交总额的比例
银河证券	4,195,823.06	100.00%	168,167,190.06	100.00%

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年5月9日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
银河证券	5,400,000.00	100.00%	558,000,000.00	100.00%

**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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**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5月9日(基金合同生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,292.95	159,149.83
其中：支付销售机构的客户维护费	2,581.92	9,074.77

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×0.60%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×0.60%÷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5月9日(基金合同生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,382.13	26,524.93



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×0.10%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×0.10%÷当年天数。

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河臻选多策略混合 A	银河臻选多策略混合 C	合计
招商银行	-	105.77	105.77
银河证券	-	283.99	283.99
银河基金	-	5.83	5.83
合计	-	395.59	395.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年5月9日(基金合同生效日)至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河臻选多策略混合 A	银河臻选多策略混合 C	合计
招商银行	-	268.62	268.62
银河基金	-	23,062.61	23,062.61
银河证券	-	43.83	43.83
合计	-	23,375.06	23,375.06

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按基金前一日基金资产净值×0.10%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：银河臻选多策略混合 C 的日销售服务费=前一日银河臻选多策略混合 C 基金资产净值×0.10%÷当年天数。

#### 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：本基金报告期及上一报告期末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

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5月9日(基金合同生效日)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	155,174.43	3,330.20	3,881,147.08	21,483.91

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有临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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	100,410.00	19,892.00
合计	100,410.00	19,892.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

#### 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	-	40,812.00
AAA 以下	-	-
未评级	634,687.00	479,124.50
合计	634,687.00	519,936.50

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

#### 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	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
----------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日							
资产							
银行存款	155,174.43	-	-	-	-	-	155,174.43
结算备付金	13,350.03	-	-	-	-	-	13,350.03
存出保证金	138.08	-	-	-	-	-	138.08
交易性金融资产	505,251.00	-	140,782.00	-	89,064.00	-	735,097.00
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	-	-	-	500,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	20,301.46	20,301.46
应收申购款	-	-	-	-	-	209.99	209.99
资产总计	1,173,913.54	-	140,782.00	-	89,064.00	20,511.45	1,424,270.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	22,115.20	22,115.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,473.11	1,473.11
应付托管费	-	-	-	-	-	245.53	245.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	185.85	185.85
其他负债	-	-	-	-	-	14,876.39	14,876.39
负债总计	-	-	-	-	-	38,896.08	38,896.08
利率敏感度缺口	1,173,913.54	-	140,782.00	-	89,064.00	-18,384.63	1,385,374.91
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	4,860,806.96	-	-	-	-	-	4,860,806.96
存出保证金	10,904.34	-	-	-	-	-	10,904.34
交易性金融资产	50,708.00	9,996.00	468,859.50	10,265.00	-	-	539,828.50
应收利息	-	-	-	-	-	6,842.92	6,842.92
应收申购款	-	-	-	-	-	4,168.50	4,168.50
资产总计	4,922,419.30	9,996.00	468,859.50	10,265.00	-	11,011.42	5,422,551.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	411,073.23	411,073.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,950.20	2,950.20
应付托管费	-	-	-	-	-	491.68	491.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-	258.95	258.95
应交税费	-	-	-	-	-	0.06	0.06
其他负债	-	-	-	-	-	110,129.95	110,129.95
负债总计	-	-	-	-	-	524,904.07	524,904.07
利率敏感度缺口	4,922,419.30	9,996.00	468,859.50	10,265.00	-	-513,892.65	4,897,647.15

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

**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	2,814.03	1,108.52
市场利率上升 25 个基点	-2,814.03	-1,108.52	

**6.4.13.4.2 外汇风险**

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**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**

注：本基金本报告期末（及上年度末）无交易性权益类投资。

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

注：本基金本报告期末及上年度末无交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

**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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	735,097.00	51.61
	其中：债券	735,097.00	51.61
	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	500,000.00	35.11
	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	168,524.46	11.83
8	其他各项资产	20,649.53	1.45
9	合计	1,424,270.99	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票投资。



## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	105,411.00	7.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	629,686.00	45.45
	其中：政策性金融债	629,686.00	45.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	735,097.00	53.06

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	108802	进出 1902	5,000	500,150.00	36.10
2	019645	20 国债 15	1,000	100,310.00	7.24
3	018009	国开 1803	800	89,064.00	6.43
4	018006	国开 1702	400	40,472.00	2.92
5	019543	16 国债 15	50	5,001.00	0.36

## 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：本基金本报告期末持有股指期货合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末持有股指期货合约。

### 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

报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

#### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责，处罚的情形。

#### 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没有超出基金合同规定的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	138.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,301.46
5	应收申购款	209.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,649.53

#### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
银河臻选多策略混合 A	281	2,546.42	0.00	0.00%	715,543.75	100.00%
银河臻选多策略混合 C	517	1,310.02	0.00	0.00%	677,280.93	100.00%
合计	798	1,745.39	0.00	0.00%	1,392,824.68	100.00%

### 8.2 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	银河臻选多策略混合 A	9,920.83	1.3865%
	银河臻选多策略混合 C	0.00	0.0000%
	合计	9,920.83	0.7123%

### 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	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	银河臻选多策略混合 A	0
	银河臻选多策略混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	银河臻选多策略混合	0

开放式基金	A	
	银河臻选多策略混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河臻选多策略 混合 A	银河臻选多策略 混合 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 9 日）基金份额总额	4,774,319.78	212,018,996.84
本报告期期初基金份额总额	2,304,821.41	2,612,292.12
本报告期基金总申购份额	323,533.47	2,690,375.33
减：本报告期基金总赎回份额	1,912,811.13	4,625,386.52
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	715,543.75	677,280.93

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

银河臻选多策略混合型证券投资基金的基金管理人银河基金管理有限公司经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，分别于 2021 年 5 月 10 日、5 月 11 日和 5 月 12 日发布《关于以通讯方式召开银河臻选多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《关于以通讯方式召开银河臻选多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》、《关于以通讯方式召开银河臻选多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》，审议关于本基金持续运作的事项。本次基金份额持有人大会于 2021 年 6 月 10 日表决通过了《关于银河臻选多策略混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》，并发布《银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，于 2021 年 6 月 11 日起生效。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元 数量	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	备注
银河证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券	1	-	-	-	-	-
野村东方证 券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	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
银河证券	4,195,823.06	100.00%	5,400,000.00	100.00%	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
野村东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

### 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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河臻选多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《中国证券报》、 公司网站	2021 年 5 月 10 日
9	银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河臻选多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《中国证券报》、 公司网站	2021 年 5 月 11 日
10	银河基金管理有限公司关于以通讯方式召开银河臻选多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《中国证券报》、 公司网站	2021 年 5 月 12 日
11	银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《中国证券报》、 公司网站	2021 年 6 月 11 日

---

	告		
--	---	--	--

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20210518-20210617	0.00	1,005,429.32	1,005,429.32	0.00	0.00%
	2	20210518-20210617	0.00	1,508,143.98	1,508,143.98	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p>							

### 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臻选多策略混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河臻选多策略混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河臻选多策略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、银河臻选多策略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