

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  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 22 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.10 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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	54

8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	54
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	56
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	60
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	62
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	62
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	62
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	62
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12	投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	64
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	64
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	64
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	64
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4	基金投资策略的改变 .....	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8	其他重大事件 .....	69
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</b>
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	70
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
13.1	备查文件目录 .....	70
13.2	存放地点 .....	70
13.3	查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	银河定投宝腾讯济安指数
基金主代码	519677
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 14 日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	118,941,833.40 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数基金，力求对中证腾讯济安价值 100A 股指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离和跟踪误差的前提下追求跟踪误差的最小化。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%。
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，按照成份股在中证腾讯济安价值 100A 股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。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将在拟替代成份股内选取替代成份股进行替代投资，并对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。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%。本基金投资策略还包括债券投资策略、股指期货投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证腾讯济安价值 100A 股指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，预期风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	秦长建	王小飞
	联系电话	021-38568989	021-60637103
	电子邮箱	qinchangjian@cgf.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	021-60637228
传真		021-38568769	021-60635778

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	宋卫刚	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cgf.cn">http://www.cgf.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-8,502,639.85	-13,341,612.39	61,516,298.98
本期利润	2,219,304.36	-45,229,061.95	71,664,969.42
加权平均基金份额本期利润	0.0201	-0.4206	0.7535
本期加权平均净值利润率	0.73%	-15.04%	29.32%
本期基金份额净值增长率	0.23%	-14.08%	33.38%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	154,960,048.39	159,887,947.88	134,377,608.76

期末可供分配基金份额利润	1.3028	1.3755	1.4966
期末基金资产净值	312,752,142.36	304,923,357.07	274,129,855.30
期末基金份额净值	2.629	2.623	3.053
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	162.90%	162.30%	205.30%

注：1、本期已实现收益是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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、所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。

### 3.2 基金净值表现

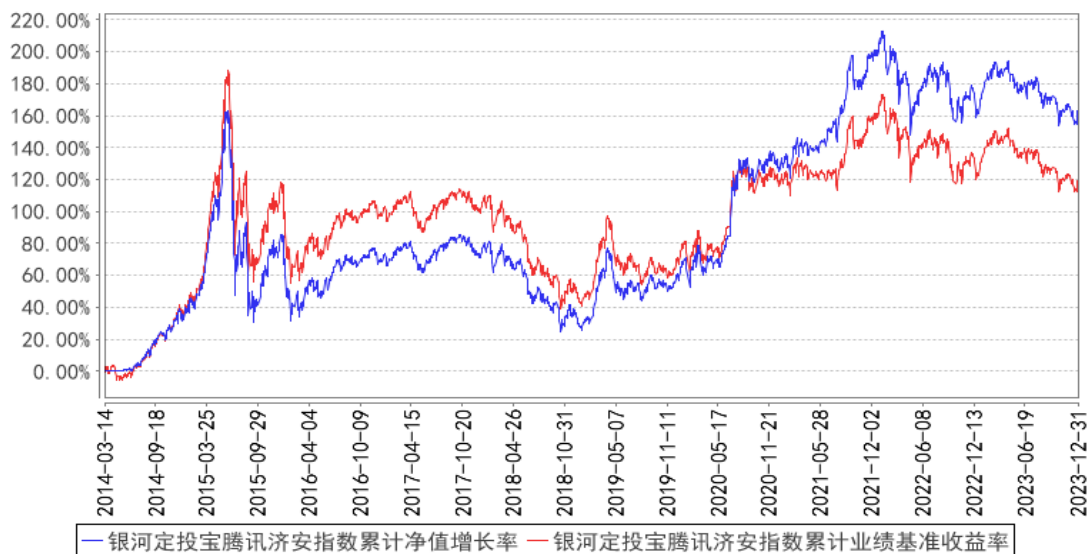
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.38%	0.76%	-3.61%	0.78%	0.23%	-0.02%
过去六个月	-6.11%	0.74%	-7.62%	0.76%	1.51%	-0.02%
过去一年	0.23%	0.75%	-1.65%	0.78%	1.88%	-0.03%
过去三年	14.85%	1.00%	0.29%	1.03%	14.56%	-0.03%
过去五年	106.52%	1.15%	53.95%	1.17%	52.57%	-0.02%
自基金合同生效起至今	162.90%	1.44%	119.52%	1.45%	43.38%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：中证腾讯济安价值 100A 股指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

### 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

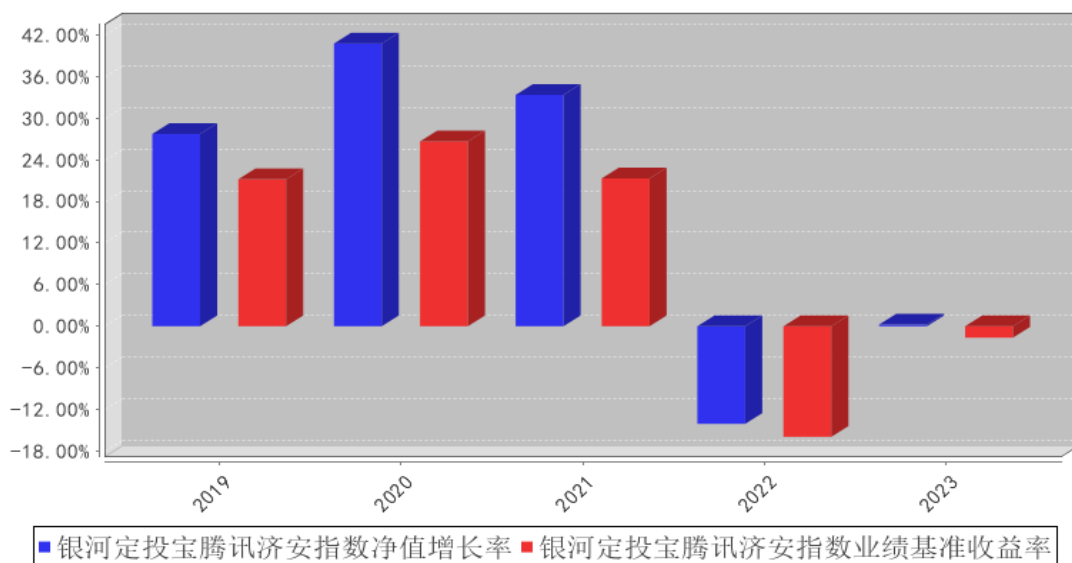
银河定投宝腾讯济安指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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：本基金股票投资比例为基金资产的 90-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本报告期末各项资产配置比例符合合同约定。

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

银河定投宝腾讯济安指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图





### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

截至报告期末，本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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、首都机场集团有限公司、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 股指数量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、银河医药健康混合型证券投资基金、银河颐年稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银河兴益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银河悦宁稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银河成长优选一年持有期混合型证券投资基金、银河核心优势混合型证券投资基金、银河中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、银河季季盈 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、银河价值成长混合型证券投资基金、银河景气行业混合型证券投资基金、银河成长远航混合型证券投资基金、银河中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银河星汇 30 天持有期债券型证券投资基金、银河景泰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		
黄栋	本基金的基金经理	2023 年 11 月 29 日	-	17 年	硕士研究生学历，CFA，17 年证券从业经历。曾先后就职于东方证券股份有限公司、工银瑞信基金管理有限公司、上投摩根基金管理有限公司、金鹰基金管理有限公司、人保资产管理有限公司，从事研究、投资相关工作。2021 年 10 月起加入银河基金管理有限公司，现任量化与 FOF 投资部副总监（主持工作）、基金经理。2022 年 1 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，2023 年 10 月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 11 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。
罗博	本基金的基金经理	2014 年 3 月 14 日	2023 年 11 月 29 日	18 年	中共党员，博士研究生学历，18 年证券从业经历。曾就职于华夏银行，中信万通证券有限公司，期间从事企业金融、投资银行业务及上市公司并购等工作。2009 年 12 月起担任银河沪深 300 价值指数证券投资基金的基金经理，2013 年 3 月至 2018 年 8 月担任银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金的基金经理。2014 年 3 月至 2023 年 11 月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（原为“银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金”）基金经理。2016 年 12 月至 2023 年 10 月任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月至 2018 年 12 月担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 2 月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021 年 2 月起担任银河量化稳进混合型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月起任银河沪深 300 指数增强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的基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 4 月任银河量化价值混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、上表中任职、离任日期为我公司作出决定之日。

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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

无

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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。

由于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，按照成份股在中证腾讯济安价值 100A 股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）。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

严格按照基金合同的规定，紧密跟踪业绩基准、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河定投宝腾讯济安指数基金份额净值为 2.629 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.23%，同期业绩比较基准收益率为-1.65%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过两年多的调整，市场估值水平重新回到低位，风险溢价、股债收益比等指标均处于较低区域，未来市场有望从弱势行情中逐步恢复。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 结合新颁布的法律法规及监管要求变化，定期开展合规培训，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照公司制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，确保独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

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

(4) 公司按照监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，针对投研交易、销售、运营、人员规范、反洗钱等重点业务领域开展例行或专项检查，坚持以法律法规、基金合同

及公司规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资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、基金运营部基金会计等相关人员组成的估值委员会，以上人员拥有丰富的风控、合规、证券研究、估值经验，根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但基金经理可以列席估值委员会会议提供估值建议，以便估值委员会决策。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》有关规定：“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 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。”

本基金截至 2023 年 12 月 31 日本基金可供分配利润为 154,960,048.39 元，本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进

行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2402462 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河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全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的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（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人银河基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

	<p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p>



	(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	叶凯韵	梁潇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层	
审计报告日期	2024 年 3 月 22 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	19,311,512.03	26,062,305.57
结算备付金		-	-
存出保证金		19,802.25	17,261.60
交易性金融资产	7.4.7.2	295,490,909.91	278,238,993.65
其中：股票投资		295,490,909.91	278,238,993.65
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		147,665.16	70,978.97
应收股利		-	-
应收申购款		1,347,644.88	2,351,923.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		316,317,534.23	306,741,463.11

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,883,671.54	1,141,857.38
应付管理人报酬		126,436.72	128,554.96
应付托管费		37,931.02	38,566.52
应付销售服务费		63,218.37	64,277.49
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	454,134.22	444,849.69
负债合计		3,565,391.87	1,818,106.04
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	118,941,833.40	116,236,948.55
未分配利润	7.4.7.12	193,810,308.96	188,686,408.52
净资产合计		312,752,142.36	304,923,357.07
负债和净资产总计		316,317,534.23	306,741,463.11

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.629 元，基金份额总额 118,941,833.40 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数量型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		5,170,982.08	-42,317,761.80
1. 利息收入		84,857.37	88,816.59
其中：存款利息收入	7.4.7.13	84,857.37	88,816.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,650,648.51	-10,568,979.23
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-13,412,536.17	-19,485,513.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	32,272.05	403,266.72
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	7,729,615.61	8,513,267.87
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	10,721,944.21	-31,887,449.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	14,829.01	49,850.40
<b>减：二、营业总支出</b>		2,951,677.72	2,911,300.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,522,496.02	1,500,547.92
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	456,748.82	450,164.31
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	761,248.01	750,273.92
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.05	2.04
8. 其他费用	7.4.7.23	211,184.82	210,311.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,219,304.36	-45,229,061.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,219,304.36	-45,229,061.95
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,219,304.36	-45,229,061.95

### 7.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	116,236,948.55	-	188,686,408.52	304,923,357.07
二、本期期初净资产	116,236,948.55	-	188,686,408.52	304,923,357.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,704,884.85	-	5,123,900.44	7,828,785.29
(一)、综合收益总额	-	-	2,219,304.36	2,219,304.36
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	2,704,884.85	-	2,904,596.08	5,609,480.93
其中：1. 基金申购款	87,607,445.82	-	153,897,541.48	241,504,987.30
2. 基金赎回款	-84,902,560.97	-	- 150,992,945.40	-235,895,506.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	118,941,833.40	-	193,810,308.96	312,752,142.36
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	89,786,964.48	-	184,342,890.82	274,129,855.30
二、本期期初净资产	89,786,964.48	-	184,342,890.82	274,129,855.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	26,449,984.07	-	4,343,517.70	30,793,501.77
(一)、综合收益总额	-	-	-45,229,061.95	-45,229,061.95
(二)、本期基金份额交易产生的	26,449,984.07	-	49,572,579.65	76,022,563.72

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	153,092,942.34	-	281,210,934.58	434,303,876.92
2. 基金赎 回款	- 126,642,958.27	-	- 231,638,354.93	-358,281,313.20
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	116,236,948.55	-	188,686,408.52	304,923,357.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>史平武</u>	<u>史平武</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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(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》、《银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式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[2013]1654 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 69,792,833.07 份,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为安永华明(2014)验字第 60821717\_B03 号的验资报告。基金合同于 2014 年 3 月 14 日正式生效。根据基金管理人发布的《关于修改银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金名称及基金合同的公告》,自 2016 年 5 月 30 日起,本基金由“银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金”更名为“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”。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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新适用的基金合同及《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、权证、股指期货、货币市场工具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）。股票投资包括中证腾讯济安价值 100A 股指数成份股、备选成份股等。本基金的投资组合为：本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%、且占非现金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。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：中证腾讯济安价值 100A 股指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其

变动计入当期损益的金融负债。

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 后续计量

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

– 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

##### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：



- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有

资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎

回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 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；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日当天的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4) 每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 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，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	19,311,512.03	26,062,305.57
等于：本金	19,309,409.59	26,059,367.93
加：应计利息	2,102.44	2,937.64
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	19,311,512.03	26,062,305.57

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	299,126,415.15	-	295,490,909.91	-3,635,505.24
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		299,126,415.15	-	295,490,909.91	-3,635,505.24
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		292,596,443.10	-	278,238,993.65	-14,357,449.45
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		292,596,443.10	-	278,238,993.65	-14,357,449.45

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末无期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末无黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内及上年度末均无需按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期内无债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期内无其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	-	-
应付交易费用	289,029.82	279,753.06
其中：交易所市场	289,029.82	279,753.06
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	150,000.00	150,000.00
应付指数使用费	15,104.40	15,096.63
合计	454,134.22	444,849.69



#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	116,236,948.55	116,236,948.55
本期申购	87,607,445.82	87,607,445.82
本期赎回（以“-”号填列）	-84,902,560.97	-84,902,560.97
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	118,941,833.40	118,941,833.40

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末及上年度末均无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 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	159,887,947.88	28,798,460.64	188,686,408.52
本期期初	159,887,947.88	28,798,460.64	188,686,408.52
本期利润	-8,502,639.85	10,721,944.21	2,219,304.36
本期基金份额交易产生的变动数	3,574,740.36	-670,144.28	2,904,596.08
其中：基金申购款	118,868,691.55	35,028,849.93	153,897,541.48
基金赎回款	-115,293,951.19	-35,698,994.21	-150,992,945.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	154,960,048.39	38,850,260.57	193,810,308.96

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	81,111.20	84,588.00
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	3,368.53	3,743.21
其他	377.64	485.38
合计	84,857.37	88,816.59

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-13,412,536.17	-19,485,513.82
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	-13,412,536.17	-19,485,513.82

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总 额	333,468,169.72	320,311,844.35
减：卖出股票成本 总额	345,940,651.94	338,723,703.27
减：交易费用	940,053.95	1,073,654.90
买卖股票差价收 入	-13,412,536.17	-19,485,513.82

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利 息收入	18.22	586.42
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债	32,253.83	402,680.30

券到期兑付) 差价收入		
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	32,272.05	403,266.72

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	225,781.54	1,841,839.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	193,500.00	1,438,500.00
减：应计利息总额	18.66	610.15
减：交易费用	9.05	49.25
买卖债券差价收入	32,253.83	402,680.30

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	7,729,615.61	8,513,267.87
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	7,729,615.61	8,513,267.87

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	10,721,944.21	-31,887,449.56
股票投资	10,721,944.21	-31,887,449.56
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	10,721,944.21	-31,887,449.56

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	14,518.14	48,432.63
基金转换费收入	310.87	1,417.77
合计	14,829.01	49,850.40

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	285.00	290.00
指数使用费	60,899.82	60,021.96
合计	211,184.82	210,311.96

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司（“银河基金”）	基金管理人、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
湖南电广传媒股份有限公司（“电广传媒”）	基金管理人的股东
首都机场集团公司（“首都机场”）	基金管理人的股东
上海城投(集团)有限公司（“上海城投”）	基金管理人的股东
中国银河金融控股有限责任公司（“银河金控”）	基金管理人的股东
中国石油天然气集团有限公司（“中国石油”）	基金管理人的股东
银河资本资产管理有限公司（“银河资本”）	基金管理人的子公司
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	基金代销机构、同受基金管理人控股股东控制
中国银河投资管理有限公司（“银河投资”）	同受基金管理人控股股东控制
中国银河资产管理有限责任公司（“银河资产”）	同受基金管理人控股股东控制

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	1,522,496.02	1,500,547.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	593,504.12	581,895.45
应支付基金管理人的净管理费	928,991.90	918,652.47

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	456,748.82	450,164.31

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.10.2.3 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	银河定投宝腾讯济安指数
银河基金	89,025.82
银河证券	11,768.85
合计	100,794.67

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	银河定投宝腾讯济安指数	
银河基金	94,650.71	
银河证券	11,498.36	
合计	106,149.07	

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比区间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人均无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。



#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	19,311,512.03	81,111.20	26,062,305.57	84,588.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比区间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定	12.05	21.94	189	2,277.45	4,146.66	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股锁定	53.63	84.62	60	3,217.80	5,077.20	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股锁定	41.18	51.74	99	4,076.82	5,122.26	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	新股锁定	31.68	36.39	173	5,480.64	6,295.47	-
301172	君	2023	6 个月	新股	31.33	38.14	365	11,435.45	13,921.10	-

	逸数 码	年 7 月 19 日		锁定						
301202	朗威 股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股 锁定	25.82	31.77	299	7,720.18	9,499.23	-
301210	金杨 股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 锁定	57.88	45.12	168	9,723.84	7,580.16	-
301251	威尔 高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股 锁定	28.88	34.64	273	7,884.24	9,456.72	-
301272	英华 特	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股 锁定	51.39	53.27	159	8,171.01	8,469.93	-
301291	明阳 电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 锁定	38.13	28.20	343	13,078.59	9,672.60	-
301292	海科 新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股 锁定	19.99	19.33	474	9,475.26	9,162.42	-
301329	信音 电子	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股 锁定	21.00	22.21	422	8,862.00	9,372.62	-
301362	民爆 光电	2023 年 7 月 27 日	6 个月	新股 锁定	51.05	38.50	262	13,375.10	10,087.00	-
301370	国科 恒泰	2023 年 7 月 3 日	6 个月	新股 锁定	13.39	16.00	822	11,006.58	13,152.00	-
301371	敷尔 佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股 锁定	55.68	37.55	136	7,572.48	5,106.80	-
301372	科	2023	6 个月	新股	45.00	43.48	231	10,395.00	10,043.88	-

	净源	年 8 月 3 日		锁定							
301393	昊帆生物	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股锁定	67.68	59.34	119	8,053.92	7,061.46	-	
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	26.68	18.67	368	9,818.24	6,870.56	-	
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新股锁定	33.25	70.25	164	5,453.00	11,521.00	-	
301418	协昌科技	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定	51.88	50.22	136	7,055.68	6,829.92	-	
301456	盘古智能	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股锁定	37.96	30.36	226	8,578.96	6,861.36	-	
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁定	31.90	44.48	202	6,443.80	8,984.96	-	
301468	博盈特焊	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁定	47.58	30.21	256	12,180.48	7,733.76	-	
301469	恒达新材	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定	36.58	33.10	251	9,181.58	8,308.10	-	
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定	39.78	69.04	217	8,632.26	14,981.68	-	
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	41.66	67.77	128	5,332.48	8,674.56	-	
301498	乖	2023	6 个月	新股	39.99	38.79	222	8,877.78	8,611.38	-	

	宝宠物	年 8 月 9 日		锁定						
301500	飞南资源	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁定	23.97	20.89	328	7,862.16	6,851.92	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.35	35.79	194	5,111.90	6,943.26	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股锁定	16.82	32.25	419	7,047.58	13,512.75	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股锁定	56.56	62.14	145	8,201.20	9,010.30	-
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	6 个月	新股锁定	12.00	35.00	396	4,752.00	13,860.00	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁定	28.00	22.67	342	9,576.00	7,753.14	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股锁定	31.16	28.26	186	5,795.76	5,256.36	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.87	20.06	604	4,149.48	12,116.24	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	26.87	51.90	185	4,970.95	9,601.50	-
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定	67.88	52.74	99	6,720.12	5,221.26	-
301525	儒	2023	6 个月	新股	99.57	81.46	82	8,164.74	6,679.72	-

	竞科技	年 8 月 23 日		锁定						
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁定	2.66	5.26	4,069	10,823.54	21,402.94	-
301528	多浦乐	2023 年 8 月 17 日	6 个月	新股锁定	71.80	68.86	122	8,759.60	8,400.92	-
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁定	36.60	37.88	168	6,148.80	6,363.84	-
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定	29.50	33.15	225	6,637.50	7,458.75	-
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁定	37.56	43.58	162	6,084.72	7,059.96	-
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股锁定	22.88	39.68	224	5,125.12	8,888.32	-
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁定	7.33	13.67	1,001	7,337.33	13,683.67	-
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股锁定	24.22	18.25	308	7,459.76	5,621.00	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁定	8.90	27.95	576	5,126.40	16,099.20	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股锁定	23.23	43.26	246	5,714.58	10,641.96	-
301578	辰	2023	6 个月	新股	48.94	74.43	118	5,774.92	8,782.74	-

	奕智能	年 12 月 21 日		锁定							
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股锁定	1.70	5.23	1,996	3,393.20	10,439.08	-	
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.80	34.50	150	2,520.00	5,175.00	-	
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股锁定	23.10	23.32	107	2,471.70	2,495.24	-	
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁定	21.29	22.26	129	2,746.41	2,871.54	-	
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.50	20.45	178	1,691.00	3,640.10	-	
603275	众辰科技	2023 年 8 月 16 日	6 个月	新股锁定	49.97	39.70	93	4,647.21	3,692.10	-	
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定	25.73	24.88	125	3,216.25	3,110.00	-	
603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股锁定	80.80	77.72	131	10,584.80	10,181.32	-	
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.10	40.47	88	1,680.80	3,561.36	-	
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁定	53.09	36.41	136	7,220.24	4,951.76	-	
688548	广	2023	6 个月	新股	9.87	12.74	1,138	11,232.06	14,498.12	-	

	钢 气 体	年 8 月 8 日		锁定							
688563	航 材 股 份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股 锁定	78.99	60.47	177	13,981.23	10,703.19	-	
688582	芯 动 联 科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 锁定	26.74	38.32	341	9,118.34	13,067.12	-	
688602	康 鹏 科 技	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股 锁定	8.66	11.05	764	6,616.24	8,442.20	-	
688603	天 承 科 技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股 锁定	55.00	74.10	140	7,700.00	10,374.00	-	
688610	埃 科 光 电	2023 年 7 月 10 日	6 个月	新股 锁定	73.33	50.97	182	13,346.06	9,276.54	-	
688612	威 迈 斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股 锁定	47.29	37.94	138	6,526.02	5,235.72	-	
688627	精 智 达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股 锁定	46.77	87.67	187	8,745.99	16,394.29	-	
688638	誉 辰 智 能	2023 年 7 月 4 日	6 个月	新股 锁定	83.90	59.65	124	10,403.60	7,396.60	-	
688646	逸 飞 激 光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股 锁定	46.80	36.06	193	9,032.40	6,959.58	-	
688648	中 邮 科 技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	新股 锁定	15.18	24.91	303	4,599.54	7,547.73	-	
688651	盛	2023	6 个月	新股	39.90	46.03	178	7,102.20	8,193.34	-	

	邦安全	年 7 月 19 日		锁定						
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股锁定	31.95	57.06	225	7,188.75	12,838.50	-
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新股锁定	103.40	79.31	65	6,721.00	5,155.15	-
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定	40.83	43.40	178	7,267.74	7,725.20	-
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁定	42.66	48.19	175	7,465.50	8,433.25	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁定	29.66	36.38	217	6,436.22	7,894.46	-

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务



手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

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

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

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。

##### **7.4.13.2.2 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。

##### **7.4.13.2.3 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。

##### **7.4.13.2.4 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。

##### **7.4.13.2.5 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。

##### **7.4.13.2.6 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。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金为指数基金，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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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							
货币资金	19,311,512.03	-	-	-	-	-	19,311,512.03
存出保证金	19,802.25	-	-	-	-	-	19,802.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-295,490,909.91	295,490,909.91
应收申购款	4,500.00	-	-	-	-	1,343,144.88	1,347,644.88
应收清算款	-	-	-	-	-	147,665.16	147,665.16
资产总计	19,335,814.28	-	-	-	-	-296,981,719.95	316,317,534.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,883,671.54	2,883,671.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	126,436.72	126,436.72
应付托管费	-	-	-	-	-	37,931.02	37,931.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	63,218.37	63,218.37
其他负债	-	-	-	-	-	454,134.22	454,134.22
负债总计	-	-	-	-	-	3,565,391.87	3,565,391.87
利率敏感度缺口	19,335,814.28	-	-	-	-	-293,416,328.08	312,752,142.36
上年度末 2022 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							
货币资金	26,062,305.57	-	-	-	-	-	26,062,305.57
存出保证金	17,261.60	-	-	-	-	-	17,261.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-278,238,993.65	278,238,993.65
应收申购款	2,000.00	-	-	-	-	2,349,923.32	2,351,923.32
应收清算款	-	-	-	-	-	70,978.97	70,978.97
资产总计	26,081,567.17	-	-	-	-	-280,659,895.94	306,741,463.11
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,141,857.38	1,141,857.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	128,554.96	128,554.96
应付托管费	-	-	-	-	-	38,566.52	38,566.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	64,277.49	64,277.49
其他负债	-	-	-	-	-	444,849.69	444,849.69
负债总计	-	-	-	-	-	1,818,106.04	1,818,106.04
利率敏感度缺口	26,081,567.17	-	-	-	-	-278,841,789.90	304,923,357.07

注：上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予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金为指数基金，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	295,490,909.91	94.48	278,238,993.65	91.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	295,490,909.91	94.48	278,238,993.65	91.25

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为中证腾讯济安价值 100A 股指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定中证腾讯济安价值 100A 股指数变化 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	中证腾讯济安价值 100A 股指数上升	14,578,953.03	13,196,255.90

	5%		
	中证腾讯济安价值 100A 股指数下降	-14,578,953.03	-13,196,255.90
	5%		

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	294,836,842.88	277,115,023.55
第二层次	654,067.03	1,123,970.10
第三层次	-	-
合计	295,490,909.91	278,238,993.65

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无使用第三层次公允价值计量的金融工具。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

###### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31

日：无)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	295,490,909.91	93.42
	其中：股票	295,490,909.91	93.42
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	19,311,512.03	6.11
8	其他各项资产	1,515,112.29	0.48
9	合计	316,317,534.23	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	23,310,640.00	7.45
C	制造业	205,470,659.89	65.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,185,932.00	1.98
E	建筑业	14,676,448.00	4.69
F	批发和零售业	2,778,837.00	0.89
G	交通运输、仓储	2,945,285.00	0.94

	和邮政业		
H	住宿和餐饮业	2,677,268.00	0.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,089,016.00	3.55
J	金融业	8,728,805.00	2.79
K	房地产业	2,920,944.00	0.93
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	3,008,720.00	0.96
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	11,005,553.00	3.52
S	综合	-	-
	合计	294,798,107.89	94.26

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	583,860.50	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,835.67	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,823.34	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,561.36	0.00
M	科学研究和技术	25,677.27	0.01

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	10,043.88	0.00
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	692,802.02	0.22

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	1,076,500	6,006,870.00	1.92
2	601668	中国建筑	1,219,300	5,864,833.00	1.88
3	300729	乐歌股份	207,000	3,707,370.00	1.19
4	002756	永兴材料	66,460	3,469,876.60	1.11
5	301061	匠心家居	67,900	3,378,025.00	1.08
6	603298	杭叉集团	135,100	3,361,288.00	1.07
7	603556	海兴电力	114,100	3,312,323.00	1.06
8	300118	东方日升	186,800	3,297,020.00	1.05
9	002466	天齐锂业	58,800	3,280,452.00	1.05
10	000528	柳工	470,300	3,169,822.00	1.01
11	601038	一拖股份	216,900	3,160,233.00	1.01
12	002273	水晶光电	232,400	3,146,696.00	1.01
13	601985	中国核电	418,000	3,135,000.00	1.00
14	600480	凌云股份	339,600	3,093,756.00	0.99
15	002078	太阳纸业	254,100	3,092,397.00	0.99
16	600438	通威股份	123,400	3,088,702.00	0.99
17	600425	青松建化	780,900	3,084,555.00	0.99
18	603079	圣达生物	211,348	3,079,340.36	0.98
19	600582	天地科技	565,100	3,074,144.00	0.98
20	603518	锦泓集团	305,300	3,059,106.00	0.98
21	002223	鱼跃医疗	88,300	3,053,414.00	0.98
22	600461	洪城环境	333,800	3,050,932.00	0.98
23	600873	梅花生物	318,900	3,045,495.00	0.97



24	002345	潮宏基	446,400	3,039,984.00	0.97
25	002738	中矿资源	81,440	3,038,526.40	0.97
26	002833	弘亚数控	170,874	3,031,304.76	0.97
27	600875	东方电气	207,100	3,027,802.00	0.97
28	605377	华旺科技	157,973	3,015,704.57	0.96
29	002533	金杯电工	373,100	3,014,648.00	0.96
30	688556	高测股份	77,300	3,013,927.00	0.96
31	600475	华光环能	289,300	3,008,720.00	0.96
32	000937	冀中能源	420,500	3,002,370.00	0.96
33	603367	辰欣药业	204,800	2,998,272.00	0.96
34	600612	老凤祥	43,400	2,994,600.00	0.96
35	603688	石英股份	34,400	2,988,672.00	0.96
36	002106	莱宝高科	280,600	2,985,584.00	0.95
37	002588	史丹利	467,800	2,984,564.00	0.95
38	600050	中国联通	679,900	2,977,962.00	0.95
39	600285	羚锐制药	173,400	2,966,874.00	0.95
40	601390	中国中铁	520,800	2,958,144.00	0.95
41	600089	特变电工	214,140	2,955,132.00	0.94
42	603339	四方科技	248,200	2,951,098.00	0.94
43	601877	正泰电器	137,000	2,946,870.00	0.94
44	601006	大秦铁路	408,500	2,945,285.00	0.94
45	600497	驰宏锌锗	581,600	2,937,080.00	0.94
46	000589	贵州轮胎	479,600	2,935,152.00	0.94
47	601088	中国神华	93,600	2,934,360.00	0.94
48	600519	贵州茅台	1,700	2,934,200.00	0.94
49	601211	国泰君安	196,800	2,928,384.00	0.94
50	601186	中国铁建	384,600	2,926,806.00	0.94
51	601669	中国电建	598,500	2,926,665.00	0.94
52	002773	康弘药业	158,600	2,924,584.00	0.94
53	000728	国元证券	427,900	2,922,557.00	0.93
54	600064	南京高科	483,600	2,920,944.00	0.93
55	600879	航天电子	378,700	2,919,777.00	0.93
56	003012	东鹏控股	353,200	2,913,900.00	0.93
57	002255	海陆重工	550,400	2,911,616.00	0.93
58	603156	养元饮品	136,900	2,910,494.00	0.93
59	603508	思维列控	185,200	2,907,640.00	0.93
60	601163	三角轮胎	201,500	2,903,615.00	0.93
61	600587	新华医疗	112,300	2,896,217.00	0.93
62	601811	新华文轩	211,900	2,894,554.00	0.93
63	603589	口子窖	63,800	2,890,140.00	0.92
64	300856	科思股份	46,250	2,878,137.50	0.92
65	601319	中国人保	594,600	2,877,864.00	0.92
66	300360	炬华科技	210,300	2,872,698.00	0.92

67	603619	中曼石油	155,000	2,870,600.00	0.92
68	002745	木林森	331,100	2,867,326.00	0.92
69	000858	五粮液	20,400	2,862,324.00	0.92
70	300003	乐普医疗	176,900	2,858,704.00	0.91
71	300349	金卡智能	230,100	2,857,842.00	0.91
72	600332	白云山	99,700	2,851,420.00	0.91
73	002737	葵花药业	109,700	2,850,006.00	0.91
74	600737	中粮糖业	345,600	2,847,744.00	0.91
75	002304	洋河股份	25,900	2,846,410.00	0.91
76	600741	华域汽车	174,400	2,839,232.00	0.91
77	603035	常熟汽饰	150,400	2,838,048.00	0.91
78	688580	伟思医疗	44,290	2,831,459.70	0.91
79	603187	海容冷链	186,700	2,830,372.00	0.90
80	600522	中天科技	225,900	2,821,491.00	0.90
81	000661	长春高新	19,300	2,813,940.00	0.90
82	002674	兴业科技	231,100	2,812,487.00	0.90
83	600583	海油工程	472,300	2,805,462.00	0.90
84	300109	新开源	154,500	2,787,180.00	0.89
85	600745	闻泰科技	65,700	2,779,767.00	0.89
86	600546	山煤国际	158,700	2,778,837.00	0.89
87	600256	广汇能源	385,700	2,753,898.00	0.88
88	002757	南兴股份	174,700	2,732,308.00	0.87
89	002821	凯莱英	23,400	2,716,740.00	0.87
90	600757	长江传媒	364,600	2,716,270.00	0.87
91	300020	银江技术	326,500	2,709,950.00	0.87
92	601801	皖新传媒	389,400	2,706,330.00	0.87
93	600060	海信视像	129,200	2,700,280.00	0.86
94	000719	中原传媒	276,300	2,688,399.00	0.86
95	301039	中集车辆	285,800	2,680,804.00	0.86
96	600258	首旅酒店	171,400	2,677,268.00	0.86
97	000625	长安汽车	154,300	2,596,869.00	0.83
98	002558	巨人网络	228,300	2,543,262.00	0.81

### 8.3.2 期末积极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(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	301526	国际复材	4,069	21,402.94	0.01
2	688627	精智达	187	16,394.29	0.01
3	301566	达利凯普	576	16,099.20	0.01
4	301488	豪恩汽电	217	14,981.68	0.00
5	688548	广钢气体	1,138	14,498.12	0.00
6	301172	君逸数码	365	13,921.10	0.00
7	301510	固高科技	396	13,860.00	0.00

8	301558	三态股份	1,001	13,683.67	0.00
9	301508	中机认检	419	13,512.75	0.00
10	301370	国科恒泰	822	13,152.00	0.00
11	688582	芯动联科	341	13,067.12	0.00
12	688652	京仪装备	225	12,838.50	0.00
13	301516	中远通	604	12,116.24	0.00
14	301413	安培龙	164	11,521.00	0.00
15	688563	航材股份	177	10,703.19	0.00
16	301568	思泰克	246	10,641.96	0.00
17	688620	安凯微	894	10,567.08	0.00
18	601096	宏盛华源	1,996	10,439.08	0.00
19	688603	天承科技	140	10,374.00	0.00
20	603296	华勤技术	131	10,181.32	0.00
21	301362	民爆光电	262	10,087.00	0.00
22	301372	科净源	231	10,043.88	0.00
23	301291	明阳电气	343	9,672.60	0.00
24	301517	陕西华达	185	9,601.50	0.00
25	301202	朗威股份	299	9,499.23	0.00
26	301251	威尔高	273	9,456.72	0.00
27	301329	信音电子	422	9,372.62	0.00
28	688610	埃科光电	182	9,276.54	0.00
29	301292	海科新源	474	9,162.42	0.00
30	301509	金凯生科	145	9,010.30	0.00
31	301459	丰茂股份	202	8,984.96	0.00
32	301555	惠柏新材	224	8,888.32	0.00
33	301578	辰奕智能	118	8,782.74	0.00
34	301489	思泉新材	128	8,674.56	0.00
35	301498	乖宝宠物	222	8,611.38	0.00
36	301397	溯联股份	188	8,493.84	0.00
37	301272	英华特	159	8,469.93	0.00
38	688602	康鹏科技	764	8,442.20	0.00
39	688702	盛科通信	175	8,433.25	0.00
40	301528	多浦乐	122	8,400.92	0.00
41	301469	恒达新材	251	8,308.10	0.00
42	688651	盛邦安全	178	8,193.34	0.00
43	688716	中研股份	217	7,894.46	0.00
44	301511	德福科技	342	7,753.14	0.00
45	301468	博盈特焊	256	7,733.76	0.00
46	688693	锆威特	178	7,725.20	0.00
47	301210	金杨股份	168	7,580.16	0.00
48	688648	中邮科技	303	7,547.73	0.00
49	301533	威马农机	225	7,458.75	0.00
50	688638	誉辰智能	124	7,396.60	0.00

51	688631	莱斯信息	202	7,120.50	0.00
52	301393	昊帆生物	119	7,061.46	0.00
53	301550	斯菱股份	162	7,059.96	0.00
54	688429	时创能源	332	7,035.08	0.00
55	688646	逸飞激光	193	6,959.58	0.00
56	301505	苏州规划	194	6,943.26	0.00
57	301395	仁信新材	368	6,870.56	0.00
58	301456	盘古智能	226	6,861.36	0.00
59	301500	飞南资源	328	6,851.92	0.00
60	301418	协昌科技	136	6,829.92	0.00
61	301525	儒竞科技	82	6,679.72	0.00
62	301529	福赛科技	168	6,363.84	0.00
63	001378	德冠新材	173	6,295.47	0.00
64	301559	中集环科	308	5,621.00	0.00
65	301170	锡南科技	181	5,507.83	0.00
66	301515	港通医疗	186	5,256.36	0.00
67	688612	威迈斯	138	5,235.72	0.00
68	301520	万邦医药	99	5,221.26	0.00
69	603004	鼎龙科技	150	5,175.00	0.00
70	688657	浩辰软件	65	5,155.15	0.00
71	001326	联域股份	99	5,122.26	0.00
72	301371	敷尔佳	136	5,106.80	0.00
73	001306	夏厦精密	60	5,077.20	0.00
74	688450	光格科技	136	4,951.76	0.00
75	001239	永达股份	189	4,146.66	0.00
76	603275	众辰科技	93	3,692.10	0.00
77	603273	天元智能	178	3,640.10	0.00
78	603373	安邦护卫	88	3,561.36	0.00
79	603276	恒兴新材	125	3,110.00	0.00
80	603231	索宝蛋白	129	2,871.54	0.00
81	603075	热威股份	107	2,495.24	0.00
82	301009	可靠股份	1	10.66	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002738	中矿资源	4,095,461.00	1.34
2	300118	东方日升	4,048,621.00	1.33
3	000719	中原传媒	3,982,761.00	1.31
4	002756	永兴材料	3,949,390.00	1.30
5	000528	柳工	3,652,273.70	1.20

6	301039	中集车辆	3,647,765.00	1.20
7	601877	正泰电器	3,560,500.00	1.17
8	300360	炬华科技	3,521,766.00	1.15
9	601668	中国建筑	3,451,492.00	1.13
10	300020	银江技术	3,423,142.31	1.12
11	603508	思维列控	3,413,974.00	1.12
12	600064	南京高科	3,360,060.00	1.10
13	300729	乐歌股份	3,357,796.80	1.10
14	600461	洪城环境	3,260,130.20	1.07
15	600285	羚锐制药	3,193,988.00	1.05
16	002737	葵花药业	3,188,799.00	1.05
17	002038	双鹭药业	3,177,339.00	1.04
18	600546	山煤国际	3,175,184.00	1.04
19	002757	南兴股份	3,167,511.00	1.04
20	000625	长安汽车	3,145,557.00	1.03

注：本项及下项 8.4.2，8.4.3 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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000932	华菱钢铁	6,510,332.00	2.14
2	601988	中国银行	6,332,473.00	2.08
3	601169	北京银行	5,850,342.00	1.92
4	601898	中煤能源	4,636,976.55	1.52
5	600780	通宝能源	4,575,222.00	1.50
6	000938	紫光股份	4,438,707.00	1.46
7	000028	国药一致	4,408,155.88	1.45
8	600373	中文传媒	4,343,580.00	1.42
9	600761	安徽合力	4,199,723.12	1.38
10	002441	众业达	4,002,707.09	1.31
11	600985	淮北矿业	3,988,735.00	1.31
12	600584	长电科技	3,593,448.00	1.18
13	600705	中航产融	3,582,121.00	1.17
14	600941	中国移动	3,543,177.00	1.16
15	600459	贵研铂业	3,519,086.53	1.15
16	601328	交通银行	3,497,174.00	1.15
17	002038	双鹭药业	3,482,933.00	1.14
18	600449	宁夏建材	3,468,619.00	1.14
19	000425	徐工机械	3,337,007.00	1.09
20	600309	万华化学	3,318,346.00	1.09

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	352,470,623.99
卖出股票收入（成交）总额	333,468,169.72

### 8.5 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。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期间本基金没有参与国债期货投资。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期间本基金没有参与国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,802.25
2	应收清算款	147,665.16

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,347,644.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,515,112.29

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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不存在流通受限情况。

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

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	301526	国际复材	21,402.94	0.01	新股锁定
2	688627	精智达	16,394.29	0.01	新股锁定
3	301566	达利凯普	16,099.20	0.01	新股锁定
4	301488	豪恩汽电	14,981.68	0.00	新股锁定
5	688548	广钢气体	14,498.12	0.00	新股锁定

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
23,994	4,957.15	115,336.03	0.10	118,826,497.37	99.90

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	53.69	0.0000

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

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

**9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况**

截止本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

**9.5 发起式基金发起资金持有份额情况**

《银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金》合同生效日为 2014 年 3 月 14 日。鉴于中证指数有限公司 2016 年 5 月 25 日发布《中证腾安价值 100 指数名称变更公告》，决定自 2016 年 5 月 30 日起将“中证腾安价值 100 指数”的名称变更为“中证腾讯济安价值 100A 股指数”，简称由“中证腾安”变更为“腾讯济安”。指数编制方法没有变化。《基金合同》中所有“中证腾安价值 100 指数”的文字表述统一修改为“中证腾讯济安价值 100A 指数”。根据合同规定：发起资金认购的基金份额，自基金合同生效之日起进行锁定，其持有期限不少于 3 年（基金合同生效不满 3 年提前终止的情况除外）。2017 年 12 月 20 日本基金管理人赎回基金份额 10,000,900.00 份，发起份额全部赎回。

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2014 年 3 月 14 日） 基金份额总额	69,792,833.07
本报告期期初基金份额总额	116,236,948.55
本报告期基金总申购份额	87,607,445.82
减：本报告期基金总赎回份额	84,902,560.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	118,941,833.40

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§ 11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：



1、2023 年 1 月 11 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》，金立国先生担任银河基金管理有限公司副总经理。

2、2023 年 6 月 8 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》，史平武先生担任银河基金管理有限公司总经理。

3、2023 年 11 月 29 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 指数型发起式证券投资基金变更基金经理的公告》，罗博不再担任本基金的基金经理，增聘黄栋担任本基金的基金经理。

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根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所，本基金本报告期内应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 30,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 3 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

根据托管行审计报告，托管行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，托管行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；托管行或者托管行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；托管行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华创证券	1	181,634,772.14	26.96	171,499.91	27.29	-
申万宏源证券	2	173,347,722.77	25.73	159,706.01	25.41	-
东北证券	3	147,430,919.43	21.88	137,251.50	21.84	-
中信建投证券	2	131,603,199.87	19.53	123,166.46	19.60	-
华西证券	1	13,632,397.98	2.02	12,559.26	2.00	-
兴业证券	2	13,062,635.43	1.94	12,163.04	1.94	-
国泰君安证券	2	8,803,592.08	1.31	8,110.58	1.29	-
广发证券	1	4,287,813.04	0.64	4,012.90	0.64	-
国投证券	2	-	-	-	-	更名
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
网信证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

华西证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	225,781.54	100.00	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
网信证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-

银河证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中投证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、公司网站	2023 年 1 月 11 日
2	银河基金管理有限公司 2022 年年度报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2023 年 3 月 29 日
3	银河基金管理有限公司 2023 年第一季度提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2023 年 4 月 21 日
4	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基金产品资料概要更新	《上海证券报》、公司网站	2023 年 4 月 27 日
5	银河基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、公司网站	2023 年 6 月 8 日
6	银河基金管理有限公司 2023 年第二季度提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2023 年 7 月 20 日
7	银河基金管理有限公司 2023 年第三季度提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2023 年 10 月 24 日
8	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基金经理变更公告	《上海证券报》、公司网站	2023 年 11 月 29 日
9	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基金	《上海证券报》、公司网站	2023 年 11 月 30 日

产品资料概要更新		
----------	--	--

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河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文件
- 2、《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基金合同》
- 3、《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财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

### 13.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021) 38568888 / 400-820-0860

公司网址：<http://www.cgf.cn>

银河基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日