

# 银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 21 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>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 主要财务指标和基金净值表现</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 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
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 .....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
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 .....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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内容的真实、准确和完整发表意见 .....	18
<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 净资产变动表 .....	20
6.4 报表附注 .....	22
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
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 .....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
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 .....	49
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 .....	49

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 .....	49
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 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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情况 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金		
基金简称	银河鑫利混合		
基金主代码	519652		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 4 月 22 日		
基金管理人	银河基金管理有限公司		
基金托管人	北京银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	166,007,116.99 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I
下属分级基金的交易代码	519652	519653	519646
报告期末下属分级基金的份额总额	164,875,593.36 份	1,131,523.63 份	0.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、固定收益类资产投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、权证投资策略；7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中国人民银行公布的 3 年期定期存款利率(税后)+1%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	贺凌
	联系电话	021-38568989	010-66223348
	电子邮箱	qinchangjian@cgf.cn	heling@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95526
传真		021-38568769	010-89661115
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甲 17 号首层
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区富	北京市西城区金融大街丙 17 号

	城路 99 号 21-22 层	
邮政编码	200120	100033
法定代表人	宋卫刚	霍学文

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cgf.cn">http://www.cgf.cn</a>
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)		
	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I
本期已实现收益	-441,789.73	-7,835.22	-
本期利润	-1,631,533.52	-15,856.39	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0099	-0.0135	-
本期加权平均净值利润率	-0.72%	-1.01%	-
本期基金份额净值增长率	-0.65%	-0.97%	0.00%
3.1.2 期末数据和	报告期末(2024 年 6 月 30 日)		

指标			
期末可供分配利润	44,928,497.44	266,036.30	-
期末可供分配基金份额利润	0.2725	0.2351	-
期末基金资产净值	226,131,624.29	1,508,986.27	0.00
期末基金份额净值	1.372	1.334	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	51.11%	43.49%	0.00%

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。

4、本基金自 2015 年 11 月 18 日起，增加银河鑫利混合 I 类基金份额类别。增加基金份额类别后，本基金将分设 A 类、C 类及 I 类三类基金份额，详情请参阅相关公告。

5、本基金 2016 年 02 月 04 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回，份额为 0；2016 年 09 月 14 日，银河鑫利混合 I 类基金新增基金份额。2018 年 7 月 20 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回，份额为 0。2019 年 03 月 14 日，银河鑫利混合 I 类基金新增基金份额。2022 年 12 月 9 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回，份额为 0。

## 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

银河鑫利混合 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	-0.36%	0.14%	0.31%	0.01%	-0.67%	0.13%
过去三个月	-0.15%	0.23%	0.93%	0.01%	-1.08%	0.22%

过去六个月	-0.65%	0.30%	1.87%	0.01%	-2.52%	0.29%
过去一年	-3.85%	0.28%	3.76%	0.01%	-7.61%	0.27%
过去三年	-9.13%	0.28%	11.26%	0.01%	- 20.39%	0.27%
自基金合同生效 起至今	51.11%	0.33%	34.75%	0.01%	16.36%	0.32%

## 银河鑫利混合 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	-0.45%	0.15%	0.31%	0.01%	-0.76%	0.14%
过去三个月	-0.30%	0.24%	0.93%	0.01%	-1.23%	0.23%
过去六个月	-0.97%	0.29%	1.87%	0.01%	-2.84%	0.28%
过去一年	-4.37%	0.28%	3.76%	0.01%	-8.13%	0.27%
过去三年	-10.90%	0.27%	11.26%	0.01%	- 22.16%	0.26%
自基金合同生效 起至今	43.49%	0.33%	34.75%	0.01%	8.74%	0.32%

## 银河鑫利混合 I

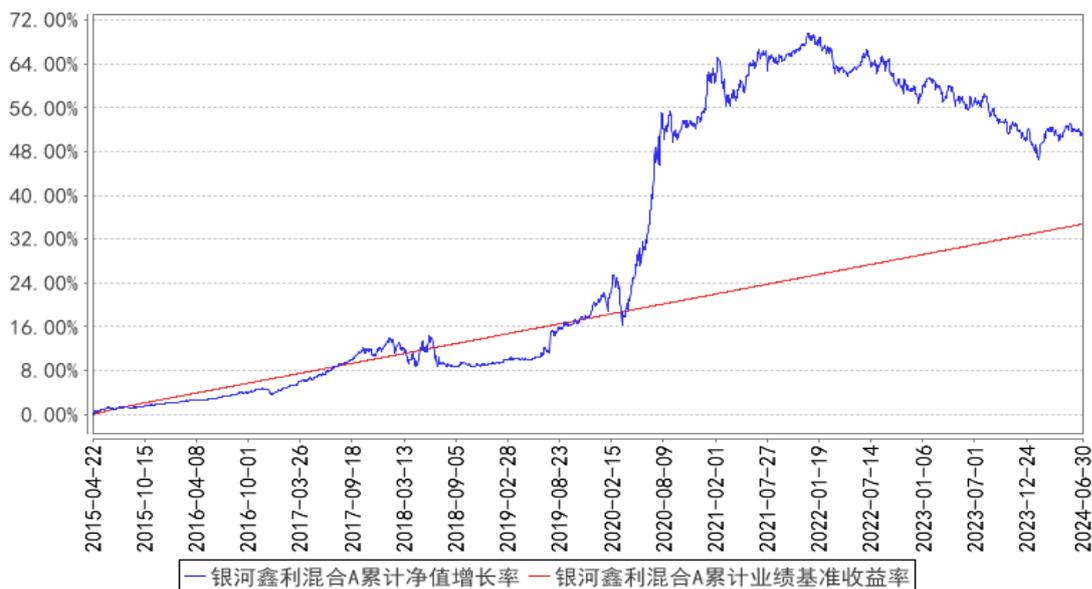
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
成立起至 2016-2- 3	0.40%	0.04%	0.80%	0.01%	-0.40%	0.03%
2016-9-14 至 2018-7-19	5.20%	0.27%	6.92%	0.01%	-1.72%	0.26%
2019-3-14 至 2022-12-8	44.45%	0.44%	14.02%	0.01%	30.43%	0.43%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的 3 年期定期存款利率(税后)+1%。

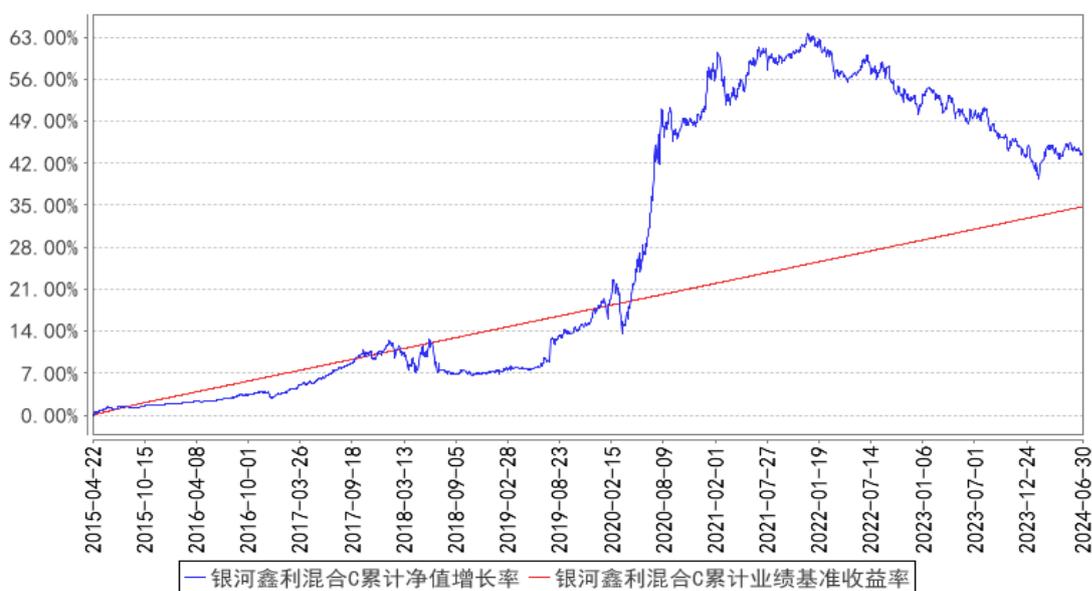
2、2022 年 12 月 9 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回，份额为 0。

### 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

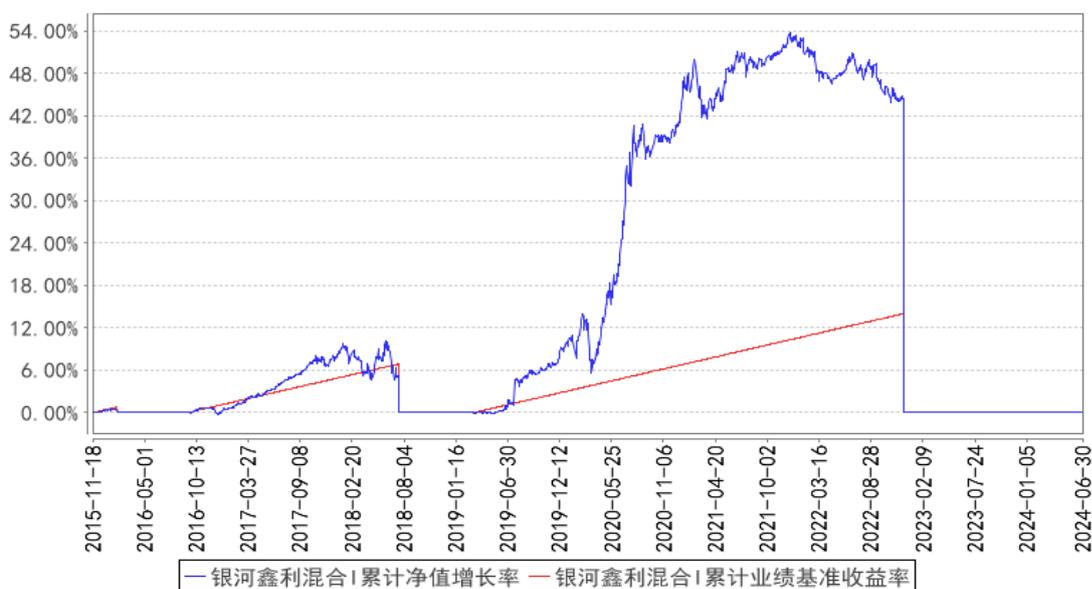
银河鑫利混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



银河鑫利混合C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



银河鑫利混合 I 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：本基金合同生效日为 2015 年 4 月 22 日，根据《银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。本基金自 2015 年 11 月 18 日起，增加银河鑫利混合 I 类基金份额类别。增加基金份额类别后，本基金将分设 A 类、C 类及 I 类三类基金份额。截至本报告期末，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。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

银河基金公司的经营范围包括发起设立、管理基金等，注册资本 2 亿元人民币，注册地中国上海。银河基金公司的股东分别为：中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团有限公司、首都机场集团有限公司、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、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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发起式基金中基金（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、银河高端装备混合型发起式证券投资基金、银河国企主题混合型发起式证券投资基金、银河新材料股票型发起式证券投资基金、银河中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河招益 6 个月持有期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		
卢轶乔	本基金的基金经理	2017 年 4 月 29 日	-	16 年	博士研究生学历，16 年证券从业经历。曾就职于建设银行。2008 年 7 月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理等职，现担任股票投资部基金经理。2012 年 12 月起担任银河消费驱动股票型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月至 2016 年 12 月担任银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月起任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至 2023 年 4 月担任银河睿利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 7 月起担任银河君盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 10 月至 2021 年 10 月担任银河旺利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 10 月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 4 月起担任银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起担任银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 12 月任银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
刘铭	本基金的基金经理	2017 年 4 月 29 日	-	13 年	硕士研究生学历，13 年金融行业从业经历。曾任职于上海汽车集团财务有限责任公司固定收益部、上海银行股份有限公司资产管理部，从事固定收益交易、研究与投资相关工作。2016 年 7 月加入我公司，现任固定收益部总监助理、基金经理。2016 年 12 月至 2019 年 2 月担任银河银富货币市场基金基金经理，2017 年 4 月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资

					<p>资基金基金经理，2017 年 4 月起担任银河君耀灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至 2018 年 12 月担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至 2024 年 6 月担任银河君盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至 2023 年 9 月担任银河君信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月起担任银河君润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月起担任银河君荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月至 2019 年 2 月担任银河钱包货币市场基金基金经理，2017 年 12 月起担任银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 3 月起担任银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金，2018 年 3 月至 2023 年 8 月担任银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 6 月至 2023 年 7 月担任银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 9 月起担任银河沃丰纯债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至 2020 年 2 月担任银河家盈纯债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至 2020 年 4 月担任银河嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月至 2020 年 5 月担任银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金基金经理，2019 年 6 月至 2021 年 7 月担任银河睿安纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 9 月至 2023 年 9 月担任银河久泰纯债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 12 月起担任银河睿鑫纯债债券型证券投资基金基金经理，2020 年 1 月至 2020 年 9 月担任银河久悦纯债债券型证券投资基金基金经理，2024 年 5 月起担任银河泰利纯债债券型证券投资基金的基金经理。</p>
鲍武斌	本基金的基金经理	2022 年 3 月 18 日	-	11 年	<p>中共党员，硕士研究生学历，11 年证券从业经历。曾就职于诺安基金管理有限公司，担任研究员。2015 年 4 月加入银河</p>

					基金管理有限公司研究部，现任股票投资部基金经理。2022 年 3 月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 3 月担任银河行业优选混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 3 月起担任银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河新动能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的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上表中任职日期为公司作出决定之日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

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

本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚实信用、勤奋律己、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金份额持有人的利益，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

2024 年上半年我国 GDP 同比增长 5.0%，经济回升维持了稳步向好的态势。尽管外部环境复杂性多变，包括不确定性上升和全球贸易保护主义抬头，但中国上半年的出口增速仍然实现了累计同比 6.1%、贸易差额累计同比 8.55%的正增长，显示了中国在全球供应链中的韧性。不过，在经济结构调整和产业升级中，以传统债务投资为驱动的代表性板块基建与房地产，同比增速出现了降速或拖累。社会消费品零售总额增幅也不断收窄，反应了一定程度上内需疲弱的问题。

上半年债券市场整体面临较为宽松的资金环境。央行在 1 月份对中小型金融机构定向降准 50BP 并下调 LPR 利率 25BP，为市场提供了较为呵护的流动性条件。同时，由于信贷平滑和提质增效，上半年信贷投放总规模较去年同期有所减少。另外，对于“手工补息”的加强监管，去年市场的“流动性分层”问题也快速消失，非银资金总体充裕的状态下，市场流行性一直维持较为平衡宽松的状态。

债市方面，一季度，在降准降息预期下做多情绪较浓。2 月 5 年 LPR 下调 25 bp，创 LPR 报价机制改革以来单次最大降幅，长端收益率中枢下移。3 月初债市经历短暂调整，很快又回到下行通道。二季度，央行频繁提示关注长债风险。4 月下旬债市再度调整，回调幅度较大，10Y 和 30Y 最高上行至 2.3530%和 2.6126%。5 月随着超长期国债发行节奏落地，“517”地产政策后，债市在震荡中逐步走强。6 月在跨季资金呵护下，长债和超长债再次下行至央行前期提醒的关键点位，10Y 创新低达到 2.2058%，30Y 下行至 2.4282%。

权益市场方面，上半年权益市场整体下跌，万得全 A 下跌 8.01%。风格上，大盘表现优于中小盘，沪深 300 上涨 0.89%，中证 500 下跌 8.96%，中证 1000 下跌 16.84%；价值表现强于成长，大盘价值指数上涨 13.67%，大盘成长指数下跌 6.68%。行业上，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化涨幅靠前，计算机、商贸零售、社会服务、传媒、医药生物跌幅较大。

转债方面，上半年中证转债指数下跌 0.07%，转债估值上升，全市场转股溢价率中位数由去年

底的 33.5% 上升到半年末的 52.7%。从行业看，金融、公用事业行业有所上涨，材料、医疗信息和信息技术行业跌幅较大。

报告期内，基金债券配置以中高评级的信用债和利率债为主，参与了中长端利率债的波段性交易。权益方面，股票仓位保持稳定，增配价值股，优化部分制造业持仓个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河鑫利混合 A 的基金份额净值为 1.372 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.65%，同期业绩比较基准收益率为 1.87%；截至本报告期末银河鑫利混合 C 的基金份额净值为 1.334 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.97%，同期业绩比较基准收益率为 1.87%；截至本报告期末银河鑫利混合 I 的基金份额为 0。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年，随着年初出台的一系列大规模设备更新、消费品以旧换新、超长期特别国债等政策的不断推进落地，预计在总量上对经济能形成一定程度的支撑。全球库存周期回升态势延续，预计下半年外贸增速仍有持续性逻辑。“517”新政后房地产市场活跃度有所提升，期待下半年随着政策的逐步优化，房地产市场可以企稳。尽管内部经济表现良好，但外部环境依然复杂严峻，预计下半年全球降息周期可以顺畅启动，减轻国内汇率压力，为货币政策操作打开空间。

资金面上，预计债券市场流动性平衡宽松的局面还将持续。一方面，金融“挤水分”的情况预计还会持续，在市场低风险偏好的预期下，非银负债端预计保持稳定。另一方面，国内基本面还处于弱复苏的通道之中，维持较低的利率水平以及稳定平衡的资金面有利于经济运行。往后看，降准降息仍有空间，不过需要关注中美利差等指标，预计在汇率能维持动态平衡的条件下，可以看到。

债市方面，下半年市场焦点可能在于宏观经济的基本面表现和央行的货币政策宽松预期。在新旧动能切换的背景下，地产行业仍在筑底，短期内经济有效需求不足或使得基本面压力仍存，预计债市资产荒格局将延续。美联储三季度降息概率上升，国内货币政策放松空间增大。但 8 月之后利率债供给或有放量，稳增长政策加码可能性也在上升，债市出现阶段性调整的风险加大。随着央行对于长端利率的关注度不断增强，债券买卖机制建立逐步完善，对债市长端利率也存在扰动。预计下半年长端利率整体将呈现震荡态势。

权益方面，下半年市场信心有望会稳步提升，积极寻找市场机会。我们会重点关注国家战略导向的行业和全球新兴科技趋势演绎，持续跟踪高端制造、人工智能和信息技术等景气度较好板块的产业趋势变化，同时也会自上而下关注国内宏观经济驱动的投资机会。

#### 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、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。

#### 4.7 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，本基金收益每年最多分配 12 次，每次收益分配比例不低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”。

本基金截至 2024 年 06 月 30 日，银河鑫利混合 A 可供分配利润为 44,928,497.44 元，银河鑫利混合 C 可供分配利润为 266,036.30 元，银河鑫利混合 I 可供分配利润为 0.00 元，本报告期未进行利润分配。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的

投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本基金托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容，复核内容真实、准确和完整。

## § 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：银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	2,924,613.72	2,521,616.91
结算备付金		4,657,516.45	1,896,364.15
存出保证金		23,200.12	36,612.26
交易性金融资产	6.4.7.2	220,290,493.39	216,345,612.53
其中：股票投资		70,111,878.17	69,636,043.44
基金投资		-	-
债券投资		150,178,615.22	146,709,569.09
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	7,999,344.65
应收清算款		-	1,272,907.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	0.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		227,895,823.68	230,072,458.55
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024 年 6 月 30 日</b>	<b>2023 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		-	-

应付清算款		-	89,245.92
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		112,461.21	116,115.92
应付托管费		37,487.09	38,705.32
应付销售服务费		745.90	819.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,300.11	2,758.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	101,218.81	198,711.51
负债合计		255,213.12	446,356.50
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	166,007,116.99	166,254,460.30
未分配利润	6.4.7.12	61,633,493.57	63,371,641.75
净资产合计		227,640,610.56	229,626,102.05
负债和净资产总计		227,895,823.68	230,072,458.55

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，银河鑫利混合 A 基金份额净值 1.372 元，基金份额总额 164,875,593.36 份；银河鑫利混合 C 基金份额净值 1.334 元，基金份额总额 1,131,523.63 份；银河鑫利混合 I 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 0 份。银河鑫利混合份额总额合计为 166,007,116.99 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-428,551.46	-60,059.94
1. 利息收入		32,037.44	23,835.23
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,266.06	20,088.39
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		3,771.38	3,746.84
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		737,124.71	-3,540,200.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,828,960.69	-6,605,013.36
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	2,112,881.77	2,534,224.22
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	453,203.63	530,588.61
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填 列)	6.4.7.20	-1,197,764.96	3,456,008.85
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	6.4.7.21	51.35	296.51
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,218,838.45</b>	<b>1,460,775.67</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	679,145.06	929,981.29
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	226,381.79	387,492.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,669.26	5,219.25
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		210,763.65	40,205.68
其中：卖出回购金融资 产支出		210,763.65	40,205.68
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,940.83	3,845.64
8. 其他费用	6.4.7.23	95,937.86	94,031.63
<b>三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)</b>		<b>-1,647,389.91</b>	<b>-1,520,835.61</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以 “-”号填列)</b>		<b>-1,647,389.91</b>	<b>-1,520,835.61</b>
<b>五、其他综合收益的税 后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-1,647,389.91</b>	<b>-1,520,835.61</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	166,254,460.30	-	63,371,641.75	229,626,102.05

资产				
二、本期期初净资产	166,254,460.30	-	63,371,641.75	229,626,102.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-247,343.31	-	-1,738,148.18	-1,985,491.49
(一)、综合收益总额	-	-	-1,647,389.91	-1,647,389.91
(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)	-247,343.31	-	-90,758.27	-338,101.58
其中：1. 基金申购款	10,458.32	-	3,776.92	14,235.24
2. 基金赎回款	-257,801.63	-	-94,535.19	-352,336.82
(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	166,007,116.99	-	61,633,493.57	227,640,610.56
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	262,756,055.27	-	115,116,409.89	377,872,465.16
二、本期期初净资产	262,756,055.27	-	115,116,409.89	377,872,465.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-82,562,620.25	-	-38,298,832.66	-120,861,452.91
(一)、综合收益总额	-	-	-1,520,835.61	-1,520,835.61
(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)	-82,562,620.25	-	-36,777,997.05	-119,340,617.30
其中：1. 基金申购款	209,672.05	-	94,043.68	303,715.73

2. 基金赎回款	-82,772,292.30	-	-36,872,040.73	-119,644,333.03
(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	180,193,435.02	-	76,817,577.23	257,011,012.25

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>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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银河鑫利灵活配置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》、《银河鑫利灵活配置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[2015]431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734,168,529.00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(2015)验字第60821717\_B04号的验资报告。基金合同于2015年4月22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,基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金份额分为A类基金份额(以下简称“银河鑫利混合A”)、C类基金份额(以下简称“银河鑫利混合C”)和I类基金份额(以下简称“银河鑫利混合I”)三类份额。其中,银河鑫利混合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;银河鑫利混合C是指在投资人认购/申购时不收取认购/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;银河鑫利混合I指通过基金管理人指定的特定销售渠道销售,且首笔申购资金不低于1,000.00万元的份额,投资人在申购I类基金份额时不收取申购费,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。

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《银河鑫利灵活配置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和存托凭证（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）。本基金的投资组合为：本基金股票投资比例为基金资产的 0%-95%；债券资产投资占基金资产的比例不低于 5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，股指期货、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。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的 3 年期定期存款利率（税后）+1%。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况、2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本基金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。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,924,613.72
等于：本金	2,923,933.52
加：应计利息	680.20
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	2,924,613.72

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	76,498,128.22	-	70,111,878.17	-6,386,250.05	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	106,947,138.99	1,774,133.79	109,051,467.73	330,194.95
	银行间市	40,498,086.44	449,147.49	41,127,147.49	179,913.56

	场				
	合计	147,445,225.43	2,223,281.28	150,178,615.22	510,108.51
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		223,943,353.65	2,223,281.28	220,290,493.39	-5,876,141.54

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

##### 6.4.7.3.2 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。

##### 6.4.7.3.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内无需按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 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。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 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。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
应付交易费用	17,627.93
其中：交易所市场	10,595.42
银行间市场	7,032.51
应付利息	-
预提费用	83,590.88
合计	101,218.81

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

#### 银河鑫利混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	165,051,917.44	165,051,917.44
本期申购	10,338.81	10,338.81
本期赎回（以“-”号填列）	-186,662.89	-186,662.89
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	164,875,593.36	164,875,593.36

#### 银河鑫利混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,202,542.86	1,202,542.86
本期申购	119.51	119.51

本期赎回(以“-”号填列)	-71,138.74	-71,138.74
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	1,131,523.63	1,131,523.63

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

银河鑫利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,418,412.90	17,535,662.80	62,954,075.70
本期期初	45,418,412.90	17,535,662.80	62,954,075.70
本期利润	-441,789.73	-1,189,743.79	-1,631,533.52
本期基金份额交易产生的变动数	-48,125.73	-18,385.52	-66,511.25
其中：基金申购款	2,844.59	891.84	3,736.43
基金赎回款	-50,970.32	-19,277.36	-70,247.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,928,497.44	16,327,533.49	61,256,030.93

银河鑫利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	290,675.42	126,890.63	417,566.05
本期期初	290,675.42	126,890.63	417,566.05
本期利润	-7,835.22	-8,021.17	-15,856.39
本期基金份额交易产生的变动数	-16,803.90	-7,443.12	-24,247.02
其中：基金申购款	28.55	11.94	40.49
基金赎回款	-16,832.45	-7,455.06	-24,287.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	266,036.30	111,426.34	377,462.64

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,256.09
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	12,760.07

其他	249.90
合计	28,266.06

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,828,960.69
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	-1,828,960.69

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	17,475,906.49
减：卖出股票成本总额	19,257,827.43
减：交易费用	47,039.75
买卖股票差价收入	-1,828,960.69

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,008,402.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	104,479.42
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	2,112,881.77

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	484,409,172.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	480,254,756.02
减：应计利息总额	4,039,902.66
减：交易费用	10,034.22
买卖债券差价收入	104,479.42

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	453,203.63
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	453,203.63

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,197,764.96
股票投资	-1,092,377.82
债券投资	-105,387.14
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	-1,197,764.96

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	51.33
基金转换费收入	0.02
合计	51.35

## 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,746.98
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	95,937.86

## 6.4.7.24 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 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
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	基金托管人、基金代销机构
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

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

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。

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	30,202,200.00	71.35	29,953,800.00	97.52

#### 6.4.10.1.3 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。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	679,145.06	929,981.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,275.53	53,642.97
应支付基金管理人的净管理费	664,869.53	876,338.32

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	226,381.79	387,492.18

注：自2023年1月1日至2023年8月27日，支付基金托管人北京银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

根据《银河基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同、托管协议的公告》，

自 2023 年 8 月 28 日起,支付基金托管人北京银行的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.20\%$ 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 $\times 0.20\%$ /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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I	合计
北京银行	-	1,542.85	-	1,542.85
银河基金	-	837.92	-	837.92
银河证券	-	166.26	-	166.26
合计	-	2,547.03	-	2,547.03
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I	合计
北京银行	-	1,631.00	-	1,631.00
银河基金	-	964.22	-	964.22
银河证券	-	175.37	-	175.37
合计	-	2,770.59	-	2,770.59

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 $\times 0.60\%$ 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:银河鑫利混合 C 的日销售服务费=前一日银河鑫利混合 C 基金资产净值 $\times 0.60\%$  $\div$ 当年天数。I 类基金份额的销售服务费按基金前一日基金资产净值 $\times 0.05\%$ 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:银河鑫利混合 I 的日销售服务费=前一日银河鑫利混合 I 基金资产净值 $\times 0.05\%$  $\div$ 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

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。

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

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

本基金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。

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

本基金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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

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。

##### 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

份额单位：份

银河鑫利混合 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
银河金控	158,439,366.24	96.10	158,439,366.24	95.99

注：1、本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金系在正常业务范围内按一般商业条款进行，投资本基金的费率是公允的。

2、报告期末持有的基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

##### 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 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行	2,924,613.72	15,256.09	2,595,747.26	16,204.19

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

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

##### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

报告期内，本基金涉及的关联交易买卖金额为 1,294,923 元，涉及的关联证券为古井贡酒，该证券为托管行的关联方。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导

致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	113,037,535.28	61,687,040.11
AAA 以下	2,128,102.86	37,806.97
未评级	35,012,977.08	84,984,722.01
合计	150,178,615.22	146,709,569.09

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

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内

部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 4 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币	2,924,613.72	-	-	-	-	-	-2,924,613.72

资金							
结算备付金	4,657,516.45	-	-	-	-	-	-4,657,516.45
存出保证金	23,200.12	-	-	-	-	-	23,200.12
交易性金融资产	17,011,674.30	40,937,194.52	20,295,030.14	61,388,751.78	10,545,964.48	70,111,878.17	220,290,493.39
资产总计	24,617,004.59	40,937,194.52	20,295,030.14	61,388,751.78	10,545,964.48	70,111,878.17	227,895,823.68
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	112,461.21	112,461.21
应付托管费	-	-	-	-	-	37,487.09	37,487.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	745.90	745.90
应	-	-	-	-	-	3,300.11	3,300.11

交税费							
其他负债	-	-	-	-	-	101,218.81	101,218.81
负债总计	-	-	-	-	-	255,213.12	255,213.12
利率敏感度缺口	24,617,004.59	40,937,194.52	20,295,030.14	61,388,751.78	10,545,964.48	69,856,665.05	227,640,610.56
上年度末 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	2,521,616.91	-	-	-	-	-	-2,521,616.91
结算备付金	1,896,364.15	-	-	-	-	-	-1,896,364.15
存出保证金	36,612.26	-	-	-	-	-	36,612.26

交易性金融资产	687,032.29	-	64,684,985.63	61,092,108.55	20,245,442.62	69,636,043.44	216,345,612.53
买入返售金融资产	7,999,344.65	-	-	-	-	-	-7,999,344.65
应收申购款	-	-	-	-	-	0.60	0.60
应收清算款	-	-	-	-	-	1,272,907.45	1,272,907.45
资产总计	13,140,970.26	-	64,684,985.63	61,092,108.55	20,245,442.62	70,908,951.49	230,072,458.55
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	116,115.92	116,115.92
应付托管费	-	-	-	-	-	38,705.32	38,705.32
应付	-	-	-	-	-	89,245.92	89,245.92

清算款							
应付销售服务费						819.41	819.41
应交税费						2,758.42	2,758.42
其他负债						198,711.51	198,711.51
负债总计						446,356.50	446,356.50
利率敏感度缺口	13,140,970.26		64,684,985.63	61,092,108.55	20,245,442.62	70,462,594.99	229,626,102.05

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。

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月）

			31 日 )
市场利率下降 25 个基点		587,343.09	640,703.66
市场利率上升 25 个基点		-587,343.09	-640,703.66

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 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。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本基金所有的资产及负债均以人民币计价，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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	70,111,878.17	30.80	69,636,043.44	30.33
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	70,111,878.17	30.80	69,636,043.44	30.33

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、测算时期为 3 个月，对于交易少于 3 个月的资产，默认其波动与指数同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,472,080.69	3,347,592.06
沪深 300 指数下降 5%	-3,472,080.69	-3,347,592.06	

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	72,904,941.51	70,323,075.73
第二层次	147,385,551.88	146,022,536.80
第三层次	-	-
合计	220,290,493.39	216,345,612.53

#### 6.4.14.2.2 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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2023 年 12 月 31 日：无)。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 06 月 30 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。

## § 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	70,111,878.17	30.76
	其中：股票	70,111,878.17	30.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	150,178,615.22	65.90
	其中：债券	150,178,615.22	65.90
	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	7,582,130.17	3.33
8	其他各项资产	23,200.12	0.01
9	合计	227,895,823.68	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,608,956.00	1.15

C	制造业	36,831,618.54	16.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,516,672.00	1.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,905,846.00	0.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,734,583.13	2.08
J	金融业	17,965,523.50	7.89
K	房地产业	1,372,119.00	0.60
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,176,560.00	0.52
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	70,111,878.17	30.80

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	870,000	4,959,000.00	2.18
2	600519	贵州茅台	3,300	4,842,387.00	2.13
3	600900	长江电力	121,600	3,516,672.00	1.54
4	601939	建设银行	438,200	3,242,680.00	1.42
5	600036	招商银行	88,700	3,032,653.00	1.33
6	000858	五粮液	20,700	2,650,428.00	1.16
7	601088	中国神华	58,800	2,608,956.00	1.15
8	600150	中国船舶	61,900	2,519,949.00	1.11
9	002475	立讯精密	63,500	2,496,185.00	1.10
10	600941	中国移动	22,400	2,408,000.00	1.06
11	601128	常熟银行	254,870	1,929,365.90	0.85
12	002352	顺丰控股	53,400	1,905,846.00	0.84
13	600030	中信证券	86,700	1,580,541.00	0.69
14	000568	泸州老窖	10,800	1,549,692.00	0.68
15	601318	中国平安	37,400	1,546,864.00	0.68

16	601138	工业富联	55,400	1,517,960.00	0.67
17	600426	华鲁恒升	55,300	1,473,192.00	0.65
18	001979	招商蛇口	156,100	1,372,119.00	0.60
19	300750	宁德时代	7,300	1,314,219.00	0.58
20	000100	TCL 科技	287,900	1,243,728.00	0.55
21	300308	中际旭创	8,960	1,235,404.80	0.54
22	000860	顺鑫农业	71,800	1,201,932.00	0.53
23	300751	迈为股份	9,900	1,182,852.00	0.52
24	000526	学大教育	19,100	1,176,560.00	0.52
25	688212	澳华内镜	28,352	1,134,363.52	0.50
26	603890	春秋电子	125,100	1,133,406.00	0.50
27	688256	寒武纪	5,609	1,114,340.03	0.49
28	688036	传音控股	14,500	1,109,830.00	0.49
29	688012	中微公司	7,457	1,053,375.82	0.46
30	300059	东方财富	98,660	1,041,849.60	0.46
31	601633	长城汽车	37,100	938,630.00	0.41
32	600872	中炬高新	40,500	918,945.00	0.40
33	688981	中芯国际	19,768	911,304.80	0.40
34	301393	昊帆生物	18,500	785,695.00	0.35
35	300274	阳光电源	12,600	781,578.00	0.34
36	603986	兆易创新	8,000	764,960.00	0.34
37	600536	中国软件	25,330	757,873.60	0.33
38	002531	天顺风能	80,000	715,200.00	0.31
39	688408	中信博	7,573	697,321.84	0.31
40	300033	同花顺	6,100	632,570.00	0.28
41	000066	中国长城	68,000	595,000.00	0.26
42	601689	拓普集团	9,700	520,017.00	0.23
43	605376	博迁新材	21,400	482,998.00	0.21
44	688702	盛科通信	11,219	454,369.50	0.20
45	002068	黑猫股份	60,100	426,710.00	0.19
46	688448	磁谷科技	18,377	346,957.76	0.15
47	002920	德赛西威	3,300	287,397.00	0.13

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	2,827,157.00	1.23
2	601088	中国神华	2,210,586.00	0.96
3	600941	中国移动	2,204,788.00	0.96
4	600519	贵州茅台	2,054,472.00	0.89
5	001979	招商蛇口	1,562,188.00	0.68
6	688036	传音控股	1,523,068.93	0.66

7	000100	TCL 科技	1,346,740.00	0.59
8	601138	工业富联	1,336,735.00	0.58
9	603806	福斯特	1,335,954.80	0.58
10	688256	寒武纪	1,116,191.00	0.49
11	600348	华阳股份	1,106,154.00	0.48
12	688408	中信博	668,471.15	0.29
13	000596	古井贡酒	659,202.00	0.29
14	600536	中国软件	439,393.10	0.19
15	002920	德赛西威	434,939.00	0.19

注：本项及下项 7.4.2, 7.4.3 的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688271	联影医疗	2,114,376.31	0.92
2	603688	石英股份	1,216,637.00	0.53
3	600348	华阳股份	1,169,570.00	0.51
4	003021	兆威机电	1,062,312.00	0.46
5	603806	福斯特	975,504.80	0.42
6	600486	扬农化工	925,075.00	0.40
7	600519	贵州茅台	850,000.00	0.37
8	688678	福立旺	792,058.37	0.34
9	600436	片仔癀	682,881.20	0.30
10	300679	电连技术	679,628.00	0.30
11	600183	生益科技	675,640.00	0.29
12	603259	药明康德	653,240.00	0.28
13	601398	工商银行	649,440.00	0.28
14	300033	同花顺	646,443.00	0.28
15	000596	古井贡酒	635,721.00	0.28
16	601939	建设银行	605,667.00	0.26
17	603501	韦尔股份	577,730.00	0.25
18	000100	TCL 科技	492,991.00	0.21
19	300572	安车检测	474,437.00	0.21
20	300308	中际旭创	437,331.00	0.19

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	20,826,039.98
卖出股票收入（成交）总额	17,475,906.49

#### 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	14,218,610.96	6.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	82,046,991.88	36.04
	其中：政策性金融债	20,794,366.12	9.13
4	企业债券	51,119,949.04	22.46
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,793,063.34	1.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	150,178,615.22	65.97

### 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	115843	23 中财 G3	200,000	20,624,814.25	9.06
2	188483	21 诚通 13	200,000	20,491,561.64	9.00
3	188520	21 建材 03	200,000	20,445,632.88	8.98
4	212480005	24 光大银行 债 01	200,000	20,332,781.37	8.93
5	185286	22 招证 G1	200,000	20,295,030.14	8.92

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不参与股指期货的投资。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金不参与国债期货的投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 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	23,200.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,200.12

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113661	福 22 转债	2,088,818.39	0.92
2	110059	浦发转债	664,960.48	0.29
3	128136	立讯转债	39,284.47	0.02

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
银河鑫利混合 A	263	626,903.40	158,441,504.69	96.10	6,434,088.67	3.90
银河鑫利混合 C	553	2,046.15	0.00	0.00	1,131,523.63	100.00
银河鑫利混合 I	0	-	0.00	-	0.00	-
合计	816	203,440.09	158,441,504.69	95.44	7,565,612.30	4.56

## 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	银河鑫利混合 A	0.00	0.0000
	银河鑫利混合 C	0.00	0.0000
	银河鑫利混合 I	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

## 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	银河鑫利混合 A	0
	银河鑫利混合 C	0
	银河鑫利混合 I	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银河鑫利混合 A	0
	银河鑫利混合 C	0
	银河鑫利混合 I	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河鑫利混合 A	银河鑫利混合 C	银河鑫利混合 I
基金合同生效日 (2015 年 4 月 22 日) 基金份额总额	594,375,763.26	139,792,765.74	-
本报告期期初	165,051,917.44	1,202,542.86	-

基金份额总额			
本报告期基金总申购份额	10,338.81	119.51	-
减：本报告期基金总赎回份额	186,662.89	71,138.74	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	164,875,593.36	1,131,523.63	-

注：1、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。

2、2022 年 12 月 9 日，银河鑫利混合 I 类基金份额全部赎回，份额为 0。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

2024 年 1 月 9 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》，吴磊先生担任基金管理公司副总经理。

二、报告期内基金托管人发生以下重大人事变动：

报告期内，史学通先生 2024 年 4 月 25 日起不再担任本基金托管人的专门基金托管部门负责人，暂由闫朝女士代为履职，2024 年 6 月 28 日，资产托管部总经理贺凌女士高管任职资格已完成证监会备案。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 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。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	1	29,559,731.47	77.18	27,664.60	77.18	-
东北证券	1	8,742,215.00	22.82	8,181.75	22.82	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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。

### 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 (%)
招商证券	12,128,367.54	28.65	1,954,500,000.00	99.19	-	-
东北证券	-	-	16,000,000.00	0.81	-	-
银河证券	30,202,200.00	71.35	-	-	-	-

### 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基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、公司网站	2024 年 1 月 9 日
2	银河基金管理有限公司 2023 年第四季度提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2024 年 1 月 20 日
3	银河基金管理有限公司 2023 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	2024 年 3 月 28 日
4	银河基金管理有限公司 2024 年 1 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	2024 年 4 月 20 日
5	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国银河证券股份有限公司等为代销机构并开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、公司网站	2024 年 4 月 22 日
6	银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	《证券日报》、公司网站	2024 年 6 月 5 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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	1	20240101- 20240630	158,439,3 66.24	0.00	0.00	158,439,366.2 4	95.44
产品特有风险							
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。							

## 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鑫利灵活配置混合型证券投资基金的文件
- 2、《银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《银河鑫利灵活配置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、银河鑫利灵活配置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）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

### 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.cgf.cn>

银河基金管理有限公司

2024 年 8 月 27 日