

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）
2021 年年度报告

2021 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：2022 年 3 月 29 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 2022 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2021 年 8 月 23 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50

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	50
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	50
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	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
8.12 本报告期投资基金情况	51
8.13 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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的情况	54
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§10 开放式基金份额变动	56
§ 11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件	57
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.9 其他重大事件	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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）
基金简称	银河悦宁稳健养老目标一年持有混合发起（FOF）
场内简称	-
基金主代码	013135
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 23 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	10,000,009.93 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金运用资产配置技术和基金优选策略，以定量和定性相结合的方法，通过积极主动的投资管理追求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。
投资策略	<p>1. 大类资产配置策略：本基金是目标风险策略基金，通过资产配置模型，优化资产配置比例，将风险维持在相对恒定水平，并提高风险调整后收益。本基金采用战略资产配置与战术资产配置、定量研究和定性研究相结合的方法实现不同类别资产的配置，其中权益类资产的战略配置比例中枢是 25%，本基金将基于国内外宏观经济发展趋势、货币和财政政策导向、资本市场环境及各类证券资产一段时间内的表现等因素，综合评估权益类和非权益类资产的相对吸引力，并在战略配置中枢的基础上动态调整各类资产的配置比例，本基金投资于权益类资产的浮动比例范围为 15%-30%。</p> <p>2. 基金投资策略：基金管理人将采用定量研究与定性研究相结合的方法，对备选基金进行深入的评估分析，精选风格清晰、业绩稳定、投资能力出色的优秀基金作为子基金构建投资组合。</p> <p>3. 其他投资策略：包括股票（含港股通标的股票、存托凭证）投资策略、债券（含可转债）投资策略、资产支持证券投资策略、风险控制策略。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银

	行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金属于混合型基金中基金（FOF），是养老目标风险系列基金中基金（FOF）中风险收益特征相对稳健的基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票。除需要承担与内地证券投资基金类似市场波动风险外，本基金还面临港股通机制下的诸如环境、市场波动风险、投资标的、市场制度以及交易规则等差异因素带来的特有风险。</p>

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	李申
	联系电话	021-38568989	021-60637102
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-820-0860	021-60637111
传真		021-38568769	021-60635778
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		刘立达	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	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
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	银河基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层

§ 3 主要财务指标、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	2021 年 8 月 23 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-12,057.38
本期利润	82,107.34
加权平均基金份额本期利润	0.0082
本期加权平均净值利润率	0.82%
本期基金份额净值增长率	0.82%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	-12,057.36
期末可供分配基金份额利润	-0.0012
期末基金资产净值	10,082,117.33
期末基金份额净值	1.0082
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	0.82%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金合同于 2021 年 8 月 23 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

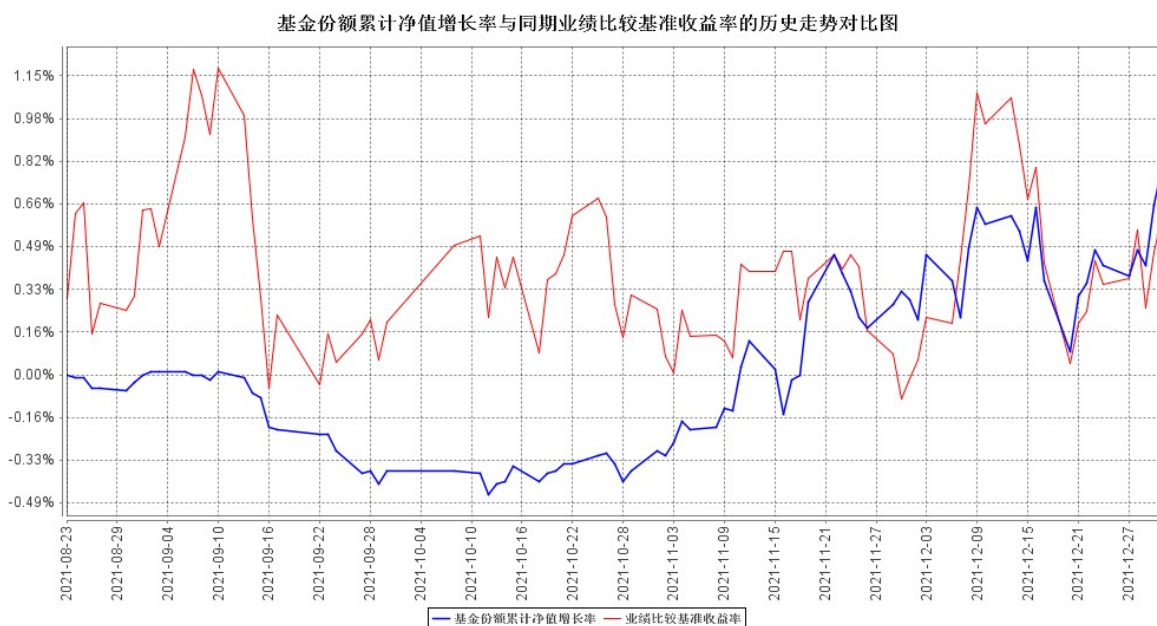
3.2 基金净值表现

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	1.19%	0.12%	0.43%	0.19%	0.76%	-0.07%
自基金合同生效起至今	0.82%	0.10%	0.63%	0.21%	0.19%	-0.11%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%

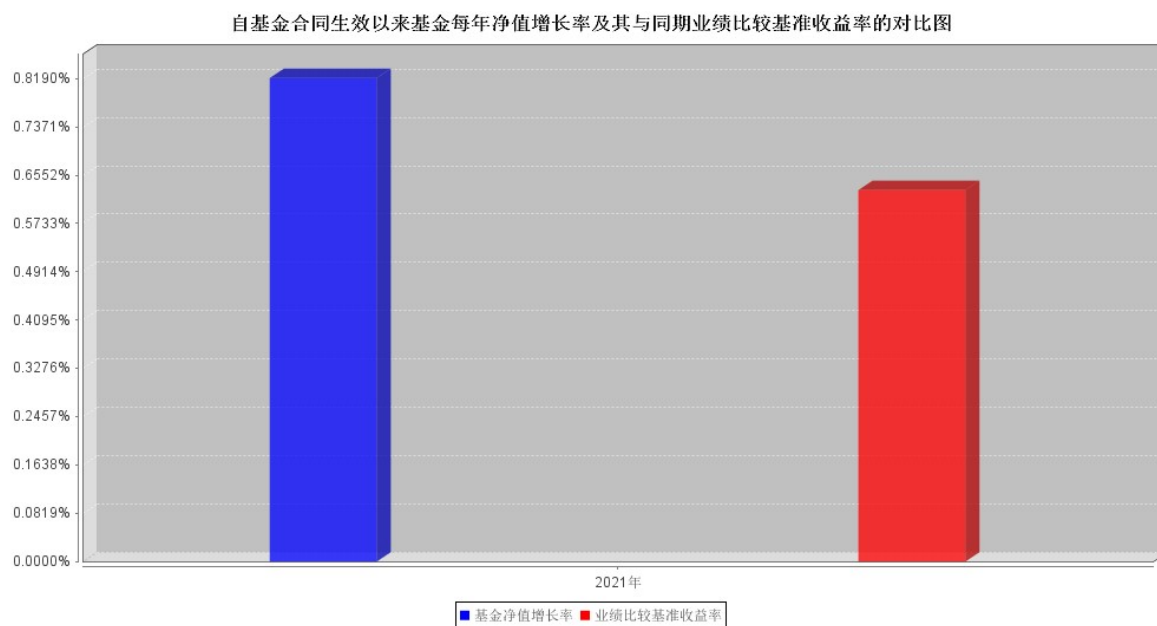
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于 2021 年 8 月 23 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，投资于本基金界定的龙头企业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。截至本期末，本基金建仓期未满。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金合同生效于 2021 年 8 月 23 日，本基金本报告期末实施利润分配。

§ 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、银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河泰利纯债债券型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发

起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金、银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银河和美生活主题混合型证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金、银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、银河乐活优萃混合型证券投资基金、银河丰泰 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河沪深 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、银河龙头精选股票型发起式证券投资基金、银河臻优稳健配置混合型证券投资基金、银河聚利 87 个月定期开放债券型证券投资基金、银河产业动力混合型证券投资基金、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）、银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金。

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		
蒋敏	基金经理	2021 年 8 月 23 日	-	9	硕士研究生学历，9 年金融行业从业经历。曾先后任职于汇丰人寿保险有限公司、中国太平洋人寿保险股份有限公司、交银康联人寿保险有限公司，从事业务分析师、账户经理、资产配置与委托管理经理等相关工作，2019 年 7 月加入银河基金管理有限公司，从事投资、研究相关工作，现任 FOF 基金经理。2021 年 7 月起担任银河颐年稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金

					金（FOF）的基金经理，2021 年 8 月起担任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）。
--	--	--	--	--	---

注：1、上表中任职日期为基金合同生效之日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.4 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《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。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。

4.3.3 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

2021 年 A 股无论是宽基指数、行业还是市场风格均呈现明显的“分化”特征。纵观全年，宽基指数方面中证 1000、中证 500 和创业板指涨幅居前，年度涨幅分别达到 20.52%、15.58%和 12.02%，而沪深 300 和上证 50 指数下跌，年度跌幅分别为-5.20%和-10.06%。回溯市场表现，一季度初始白酒板块表现突出，两市成交量温和放大，1 月下旬受到流动性紧缩和春节节假日效应的影响，股市短暂回撤之后又再度震荡上行，直至 2 月下旬核心资产开始调整，整个市场也随之快速下行，二季度以新能源为代表的景气成长赛道持续上涨，带动了创业板为代表的成长风格指数大幅领跑，三季度以煤炭、钢铁为代表的资源类周期股快速上行，成为全市场最热门的品种，9

月份开始直至整个四季度结构性行情愈演愈烈，板块轮动加速，新能源、周期、消费、军工等行业轮番调整，元宇宙等主题表现活跃，四季度赚钱效应较差。按照中信一级行业进行统计显示，全年表现最好的前三个行业分别是电力设备及新能源、基础化工和有色金属，年度涨幅分别为 50.41%、48.05%和 46.39%。相较于 2020 年，今年 A 股市场的风格极致化和市场机构化特征愈加明显，但机构间抱团现象有所缓解，风格方面中小市值股票相对行业龙头的表现更好。

在本基金的组合管理方面，本基金成立于 8 月底，四季度初仍处于建仓期中，同时四季度 A 股市场的特征是轮动速度和行业之间的表现分化较大，为了避免基金净值出现大幅波动，基金建仓过程中始终保持谨慎防御的态度，建仓过程比较平稳，权益类资产的配置比例逐步增加，权益类资产配置相比长期战略中枢配置比例维持略微低配的状态，并通过分散策略进行了相对较为均衡的行业配置，避免在单一风格上有过多的风险暴露。本基金管理人严格遵循产品的风险收益特征和稳健的投资风格，紧密跟踪组合的波动水平变化，比较好的控制了产品的回撤风险。在基金优选上，紧密跟踪基金表现，发挥专业化选择基金的优势，债券型基金的挑选注重基金公司平台实力和基金经理的管理能力，权益性基金方面通过匹配市场风格，并在风格中精选投资能力强、与投资目标相契合的标的产品来获取增强收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0082 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.82%，业绩比较基准收益率为 0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年以来，用中位数进行统计，权益类基金产品的收益率已经连续上涨三年，从预期收益角度、宏观经济形势以及所面临的外部市场环境综合判断，2022 年投资难度在提高，需要用更加谨慎的态度和更精细化的操作管理组合。综合来看，A 股市场的高波动性和分化特征会继续延续，权益类资产的布局一方面从行业景气度角度，业绩与估值相匹配的行业或者业绩增速可以消化估值的行业是重点配置方向；另一方面需要跟踪宏观、信用及流动性等各方面政策的变化及其落地效果，布局相应受益或者有催化的板块，2022 年全年获取回报的预期需要调降，注重在控制好风险和波动的前提下去追求更高收益。

债券市场方面，2022 年相对于货币政策，财政政策的影响可能会更显著一些，随着宽信用政策和稳增长措施的不断出台，经济出现失速下行的风险较低，债券类资产的投资收益高低将主要取决于信用风险的管控和久期调节能力。

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》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了由公司相关领导、监察部投资风控岗、研究部数量研究员、行业研究员、支持保障部基金会计等相关人员组成的估值委员会，以上人员拥有丰富的风控、合规、证券研究、估值经验，

根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但基金经理可以列席估值委员会会议提供估值建议，以便估值委员会决策。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月，可不进行收益分配。截至本报告期末，本基金可供分配利润为 -12,057.36 元。

本基金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

无。

§ 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，本基金未实施利润分配。

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 2202061 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) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的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) (以下简称“银河悦宁稳健养老 (FOF)”) 财务报表, 包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2021 年 8 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>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、在财务报表附注 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, 公允反映了银河悦宁稳健养老 (FOF) 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2021 年 8 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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, 我们独立于银河悦宁稳健养老 (FOF), 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。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银河悦宁稳健养老 (FOF) 管理人银河基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层对其他信息负责。其他信息包括银河悦宁稳健养老 (FOF) 2021 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。</p> <p>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> <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>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的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，基金管理人管理层负责评估银河悦宁稳健养老（FOF）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，除非银河悦宁稳健养老（FOF）计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银河悦宁稳健养老（FOF）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，就可能导致对银河悦宁稳健养老（FOF）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银河悦宁稳健养老（FOF）不能持续经营。</p> <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。</p> <p>我们与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。</p>
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	王国蓓 汪霞
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	2022 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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）

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	574,857.90
结算备付金		4,545.45
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	8,168,035.82
其中：股票投资		-
基金投资		8,168,035.82
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,400,737.97
应收利息	7.4.7.5	-363.76
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		10,147,813.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		4,442.98
应付托管费		1,253.07
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	60,000.00
负债合计		65,696.05
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	10,000,009.93
未分配利润	7.4.7.10	82,107.40
所有者权益合计		10,082,117.33
负债和所有者权益总计		10,147,813.38

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0082 元，基金份额总额 10,000,009.93 份。

2、本基金合同生效日为 2021 年 8 月 23 日。截至本报告期末，本基金合同生效日未满一年，本报告期的资产负债表无同期可比数据。

7.2 利润表

会计主体：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）

本报告期：2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2021 年 8 月 23 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		171,017.00
1. 利息收入		7,969.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,960.54
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		4,008.61
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		68,883.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	7.4.7.13	-31,660.66
债券投资收益	7.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	100,543.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	94,164.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	-
减：二、费用		88,909.66

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	19,551.95
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,293.34
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.20	2,661.37
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.21	61,403.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		82,107.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		82,107.34

注：本基金合同生效日为 2021 年 8 月 23 日。截至本报告期末，本基金合同生效日未满一年，本报告期的利润表无同期可比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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）

本报告期：2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,000,000.00	-	10,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,107.34	82,107.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	9.93	0.06	9.99
其中：1. 基金申购款	9.93	0.06	9.99
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,000,009.93	82,107.40	10,082,117.33

注：本基金合同生效日为 2021 年 8 月 23 日。截至本报告期末，本基金合同生效日未满一年，本报告期的所有者权益变动表无同期可比数据。

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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)(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)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[2021]2287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10,000,000.00份。基金合同于2021年8月23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》、截至报告期末最新公告的基金合同及《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)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,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(包括QDII基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF,下同)、香港互认基金及其他经中国证监会核准或注册的基金,以下简称“证券投资基金”)、国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票和存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、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的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金等品种的比例合计不超过基金资产的30%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%,投资于商品基金的比例不得超过基金资产的10%;每个交易日日终应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金战略配置中枢目标是将25%的基金资产投资于权益类资产(包括

股票、股票型基金、最近连续四个季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 60%或基金合同中明确约定股票投资占基金资产的比例不低于 60%的混合型基金)，上述权益类资产配置比例可上浮不超过 5%、下浮不超过 10%，即权益类资产占基金资产的比例为 15%-30%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

中债综合全价指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+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 2021 年 12 月 31 日的财务状况、自 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间经营成果和基金净值变动情况。

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 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 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

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。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。

本基金持有的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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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

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成本的差额确认。

基金投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。

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。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

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变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

本基金的交易费用于进行基金投资等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

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，本基金可进行收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

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，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，按如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金 (LOF) 及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

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

根据财政部、国家税务总局财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改

为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(e) 对于基金从事 A 股买卖，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。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(f) 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。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	574,857.90
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	574,857.90

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	8,073,871.10	8,168,035.82	94,164.72
其他	-	-	-
合计	8,073,871.10	8,168,035.82	94,164.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产 / 负债。

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

注：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	187.52
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-553.48
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	-363.76

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

注：本基金于本报告期末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
预提信息披露费	40,000.00
预提审计费用	20,000.00
合计	60,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	10,000,000.00	10,000,000.00
本期申购	9.93	9.93
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	10,000,009.93	10,000,009.93

注：1、本基金于2021年8月20日公开发售，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币10,000,000.00元，募集期间未孳生利息。以上实收基金（本息）合计为人民币10,000,000.00元，折合10,000,000.00份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、申购含转入份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-12,057.38	94,164.72	82,107.34
本期基金份额交易产生的变动数	0.02	0.04	0.06
其中：基金申购款	0.02	0.04	0.06
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,057.36	94,164.76	82,107.40

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
	活期存款利息收入
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	154.81

其他	-
合计	3,960.54

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	726,468.77
减：卖出/赎回基金成本总额	758,129.43
基金投资收益	-31,660.66

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益**7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 衍生工具收益**7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	100,543.79
合计	100,543.79

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	94,164.72
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——基金投资	94,164.72
——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	94,164.72

7.4.7.19 其他收入

注：本基金在本报告期内无其他收入。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月 31日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	2,661.37
其中：申购费	2,661.37
赎回费	-
合计	2,661.37

7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12 月31日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	6,628.39
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	12,988.93
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,058.58

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月 31日
审计费用	20,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
其他	400.00
银行费用	1,003.00
合计	61,403.00

7.4.7.22 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

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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、基金直销机构、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
中国银河金融控股有限责任公司（“银河金控”）	基金管理人的控股股东
中国石油天然气集团有限公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海城投(集团)有限公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司(“银河证券”)	同受基金管理人控股股东控制

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
银河证券	21,800,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内没有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 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,551.95
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）×0.6%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	5,293.34
----------------	----------

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值(扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分)的 0.15%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(扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分)×0.15%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不设销售服务费。

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

注：本基金在本报告期内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

注：本基金在本报告期内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

注：本基金在本报告期内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

份额单位：份

项目	本期
	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
基金合同生效日(2021年8月23日)持有的基金份额	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	99.9999%

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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

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 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	574,857.90	3,805.73

注：本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2021年12月31日的相关余额为人民币4,545.45元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

于本报告期末，本基金持有基金管理人银河基金所管理的基金合计1,329,774.67元，占本基金资产净值的比例为13.19%。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,836.07
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	493.50
-	-

注：上述费用为本基金交易及持有基金管理人所管理基金产生的费用，其中申购费、赎回费是实际产生的费用，销售服务费、管理费和托管费为估算费用。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2021 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

注：本基金未持有因认购新发或增发证券而受约束的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

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。

本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上预期风险和预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围内，使本基金的风险和收益之间取得最佳平衡，以实现“风险和收益匹配”的风险收益目标。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割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

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	574,857.90	-	-	-	-	-	574,857.90
结算备付金	4,545.45	-	-	-	-	-	4,545.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-8,168,035.82	8,168,035.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-1,400,737.97	1,400,737.97
应收利息	-	-	-	-	-	-363.76	-363.76
资产总计	579,403.35	-	-	-	-	-9,568,410.03	10,147,813.38
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,442.98	4,442.98
应付托管费	-	-	-	-	-	1,253.07	1,253.07
其他负债	-	-	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	65,696.05	65,696.05
利率敏感度缺口	579,403.35	-	-	-	-	-9,502,713.98	10,082,117.33

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期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。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于公开募集的基金，所面临的其他价格风险主要来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

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 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	8,168,035.82	81.02
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	8,168,035.82	81.02

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测市场价格风险的数据为业绩比较基准变动时，基金资产相应的理论变动值。 2、假定业绩比较基准变化 5%，其他市场变量均不发生变化。	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	53,971.52
	业绩比较基准下降 5%	-53,971.52

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1 以公允价值计量的资产和负债

(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。

(2) 持续的以公允价值计量的金融工具

(a) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 8,168,035.82 元，无属于第二层次和第三层次的余额。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(c) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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。

2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

3 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	8,168,035.82	80.49
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	579,403.35	5.71
8	其他各项资产	1,400,374.21	13.80
9	合计	10,147,813.38	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末持有股票投资。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

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

报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，本基金按照所设定的目标风险，确定权益类资产和非权益类资产的配置比例，控制本基金的波动性，从而实现本基金的风险设定目标。本基金主要投资于开放式基金，总体风险较低，符合本基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)	是否属于基金管 理人及管理人关 联方所管理的基 金
1	519783	交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金	契约型开放式	816,004.80	1,011,356.35	10.03	-
2	000033	易方达信用债C	契约型开放式	900,009.00	1,002,790.03	9.95	-
3	519669	银河领先债券	契约型开放式	714,662.25	811,141.65	8.05	是
4	000998	南方双元C	契约型开放式	466,760.34	604,454.64	6.00	-
5	004706	南方祥元C	契约型开放式	531,266.08	573,448.61	5.69	-
6	519616	银河君信灵活配置混合A	契约型开放式	417,780.75	518,633.02	5.14	是
7	001338	安信稳健增值混合C	契约型开放式	340,994.34	514,014.87	5.10	-
8	003266	招商招坤纯债C	契约型开放式	428,412.30	506,554.70	5.02	-
9	675113	西部利得汇享债券C	契约型开放式	349,497.60	406,850.16	4.04	-
10	004235	中欧智选C	契约型开放式	58,546.52	313,575.16	3.11	-
11	450011	国富精选	契约型开放式	86,053.05	312,114.41	3.10	-
12	519133	海富通改革驱动灵活配置混	契约型开放式	102,327.58	308,916.73	3.06	-

		合型证券投资基金					
13	002340	富国价值优势混合	契约型开放式	72,578.03	303,978.56	3.02	-
14	004200	博时富瑞纯债债券A	契约型开放式	282,425.28	296,998.42	2.95	-
15	519196	万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金	契约型开放式	78,938.59	211,965.90	2.10	-
16	002251	华夏军工安全混合	契约型开放式	98,473.71	207,582.58	2.06	-
17	006567	中泰星元灵活配置混合A	契约型开放式	68,649.90	158,780.35	1.57	-
18	005609	富国军工主题混合	契约型开放式	42,420.19	104,879.68	1.04	-

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

8.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.13.3 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	-
2	应收证券清算款	1,400,737.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-363.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,400,374.21
---	----	--------------

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 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
2	5,000,004.97	10,000,000.00	100.00%	9.93	0.00%

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	0.00	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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	100.00	10,000,000.00	100.00	自基金合同生效之日起持有期限不少于3年。
基金管理人高级管理人员	-	0.00	-	0.00	-
基金经理等人员	-	0.00	-	0.00	-
基金管理人股东	-	0.00	-	0.00	-
其他	-	0.00	-	0.00	-
合计	10,000,000.00	100.00	10,000,000.00	100.00	自基金合同生效之日起持有期限不

					少于 3 年。
--	--	--	--	--	---------

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2021 年 8 月 23 日 ）基金份额总额	10,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9.93
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	10,000,009.93

§ 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：

2021 年 3 月 13 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，钱睿南先生个人原因辞职，自 2021 年 3 月 12 日起不再担任银河基金管理有限公司副总经理职务。

2021 年 7 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》，自 2021 年 7 月 6 日起陈勇先生离任基金管理人副总经理、首席信息官职务。

2021 年 9 月 16 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高见先生个人原因辞职，自 2021 年 9 月 15 日起不再担任银河基金管理有限公司总经理职务。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 本报告持有的基金发生的重大影响事件

自 2021 年 8 月 20 日起，南方祥元债券 A：004705；南方祥元债券 C：004706 下调管理费率 and 托管费率；

富国价值优势混合型证券投资基金自 2021 年 7 月 20 日起，至 2021 年 8 月 19 日 17:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2021 年 8 月 20 日审议通过了《关于富国价值优势混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》；

中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金自 2021 年 07 月 19 日起增设 C 类基金份额（基金代码：012940）；

华夏军工安全灵活配置混合型证券投资基金自 2021 年 12 月 6 日起增加 C 类基金份额（基金代码：013566）；

本基金所投资的其他子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金审计工作。

本基金本期报告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 20,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 1 年的审计服务。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
银河证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
网信证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

11.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
银河证券	-	-	21,800,000.00	100.00%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
网信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.9 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）基金份额发售公告	《证券时报》、公司网站	2021年8月17日
2	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）托管协议	《证券时报》、公司网站	2021年8月17日
3	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）基金合同	《证券时报》、公司网站	2021年8月17日
4	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）基金产品资料概要	《证券时报》、公司网站	2021年8月17日

5	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）招募说明书	《证券时报》、公司网站	2021 年 8 月 17 日
6	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）基金合同生效公告	《证券时报》、公司网站	2021 年 8 月 24 日
7	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）基金产品资料概要更新	《证券时报》、公司网站	2021 年 8 月 26 日
8	银河基金管理有限公司 2021 年中期报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 8 月 27 日
9	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通定投业务并参加申购、定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、公司网站	2021 年 8 月 27 日
10	银河基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《证券日报》、公司网站	2021 年 9 月 15 日
11	银河基金管理有限公司 2021 年第三季度提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 10 月 26 日
12	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）开放日常申购、定期定额投资业务公告	《证券时报》、公司网站	2021 年 11 月 30 日
13	银河基金管理有限公司关于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）新增部分代销机构及费率优惠活动	《证券时报》、公司网站	2021 年 12 月 20 日

	的公告		
--	-----	--	--

§ 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

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	2021.08.23-2021.12.31	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	100.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p>							

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）的文件
- 2、《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）基金合同》
- 3、《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）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）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)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 楼

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.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司

2022 年 3 月 29 日