

# 银河沪深 300 价值指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 26 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 24 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 2022 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 .....	6
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 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	53

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河沪深 300 价值指数证券投资基金	
基金简称	银河沪深 300 价值指数	
基金主代码	519671	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 12 月 28 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	1,700,632,864.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	银河沪深 300 价值指数 A	银河沪深 300 价值指数 C
下属分级基金的交易代码	519671	013074
报告期末下属分级基金的份额总额	1,662,950,398.82 份	37,682,465.20 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段，追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数跟踪方法，按照成份股在沪深 300 价值指数中的基准权重构建股票投资组合，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金将利用数量化模型，对跟踪误差及其相关指标进行动态管理，根据结果对基金投资组合进行相应调整；并将定期或不定期对数量化模型进行优化改善，力求减少跟踪误差，期望改进指数跟踪效果。</p> <p>基金建仓期内，原则上采用快速建仓的策略，但在具体运作中，根据市场情况，适度择时。</p> <p>基金的日常运作过程中，一定时间内的跟踪误差或其相关指标超过相应的控制目标值，或出现其他实际情况导致本基金不能投资或无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据需要采用抽样复制或替代复制的策略，对投资组合管理进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>在实际的投资过程中由于种种原因可能带来跟踪误差，指数型基金股票投资策略的核心内容就是对跟踪误差的管理，包括对跟踪误差及其来源的识别、度量、应对和处理。</p>
业绩比较基准	沪深 300 价值指数收益率*95% + 银行活期存款收益率（税后）*5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中高风险高收益的

	品种，其预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。
--	------------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	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		宋卫刚	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.galaxyasset.com">http://www.galaxyasset.com</a>
基金中期报告备置地点	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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	银河沪深 300 价值指数 A	银河沪深 300 价值指数 C
本期已实现收益	-16,720,622.80	-600,612.63
本期利润	-171,678,712.85	-1,203,549.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0874	-0.0299
本期加权平均净值利润率	-5.64%	-3.01%
本期基金份额净值	-4.50%	-4.61%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	632,507,033.77	511,015.84
期末可供分配基金份额利润	0.3804	0.0136
期末基金资产净值	2,573,678,047.55	38,193,481.04
期末基金份额净值	1.548	1.014
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	79.11%	1.40%

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、本基金合同于 2009 年 12 月 28 日生效。

5、本基金于 2021 年 7 月 26 日新增 C 类，并于 2021 年 7 月 30 日起 C 类开始持有份额。

## 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

银河沪深 300 价值指数 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	5.02%	0.99%	3.18%	1.01%	1.84%	-0.02%
过去三个月	0.06%	1.17%	-1.61%	1.16%	1.67%	0.01%

过去六个月	-4.50%	1.32%	-6.15%	1.32%	1.65%	0.00%
过去一年	-6.24%	1.17%	-10.12%	1.18%	3.88%	-0.01%
过去三年	7.70%	1.11%	-7.49%	1.13%	15.19%	-0.02%
自基金合同生效 起至今	79.11%	1.33%	28.58%	1.34%	50.53%	-0.01%

## 银河沪深 300 价值指数 C

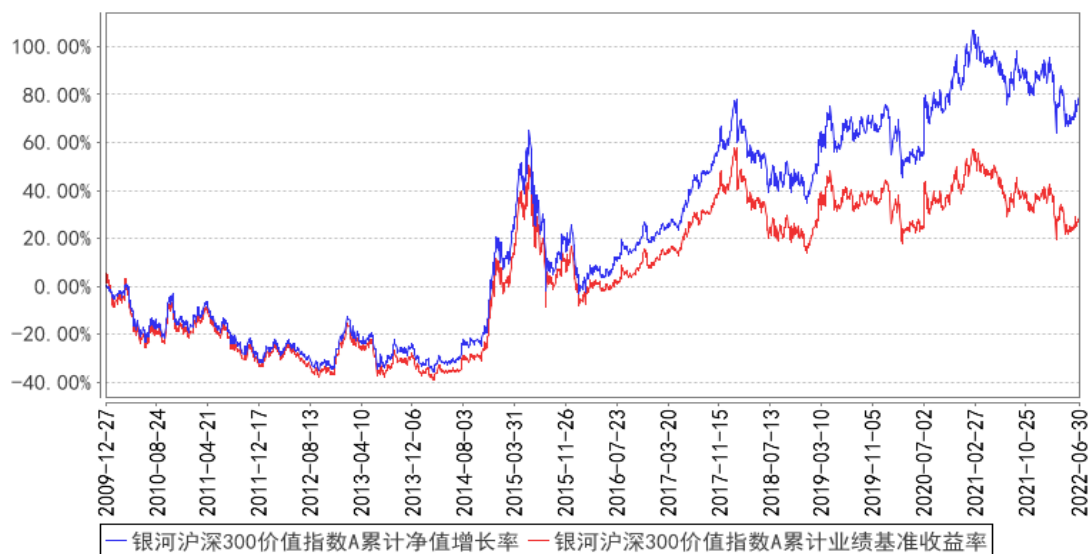
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	4.97%	1.00%	3.18%	1.01%	1.79%	-0.01%
过去三个月	0.00%	1.16%	-1.61%	1.16%	1.61%	0.00%
过去六个月	-4.61%	1.31%	-6.15%	1.32%	1.54%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	1.40%	1.16%	-0.68%	1.17%	2.08%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 价值指数收益率\*95% + 银行活期存款收益率（税后）\*5%。

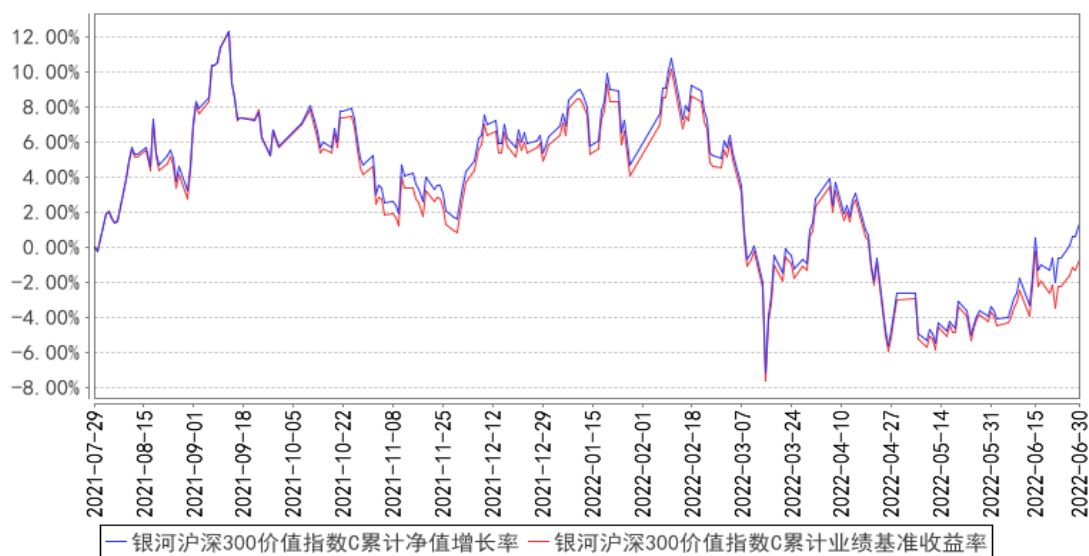


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

银河沪深300价值指数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



银河沪深300价值指数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



注：1. 本基金合同于 2009 年 12 月 28 日生效。

2. 本本基金于 2021 年 7 月 26 日新增 C 类，并于 2021 年 7 月 30 日起 C 类开始持有份额。

3. 按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定：本基金跟踪标的指数的股票投资组合资产（包括标的指数成份股和备选成份股）不低于基金资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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发起式基金中基金（FOF）、银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银河成长优选一年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		
罗博	本基金的基金经理	2009 年 12 月 28 日	-	17 年	中共党员，博士研究生学历，17 年证券从业经历。曾就职于华夏银行，中信万通证券有限公司，期间从事企业金融、投资银行业务及上市公司并购等工作。2006 年 2 月加入银河基金管理有限公司，历任产品设计经理、衍生品数量化投资研究员、行业研究员等职务，现担任基金经理。2009 年 12 月起担任银河沪深 300 价值指数证券投资基金的基金经理，2014 年 3 月担任银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 2 月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 2 月起担任银河量化稳进混合型证券投资基金的

					基金经理，2021 年 6 月起担任银河量化优选混合型证券投资基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上表中任职日期为该基金合同生效之日。

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

本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易，各投资组合经理均严格按照制度规定，事前确定好申购价格和数量，按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

由于本基金采用被动式指数投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数跟踪方法，按照成份股在沪深 300 价值指数中的基准权重构建股票投资组合，并原则上根据标的指数成份股的变化或其权重的变动而进行相应调整，本报告期未发现重大异常情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况（完全复制的指数基金除外）。

#### 4.3.2 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

本基金依据基金合同的规定，以控制跟踪误差最小化为管理目标，以完全复制为基本策略配置股票。未进行股指期货的投资。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河沪深 300 价值指数 A 的基金份额净值为 1.548 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.50%，同期业绩比较基准收益率为-6.15%；截至本报告期末银河沪深 300 价值指数 C 的基金份额净值为 1.014 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.61%，同期业绩比较基准收益率为-6.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济处在后增长周期，美国面临财政刺激退坡，货币政策收紧局面，今年对中国出口的拉动环比逐季走弱的确定性较强。并且，美联储加息步伐或持续到年末，全年海外流动性都是偏紧的状态。目前叠加俄-乌危机所造成的供给侧通胀仍在持续，对全球风险资产价格有较大的压制。

疫情对经济影响的最糟糕时期已过去，供应链有望部分恢复。货币政策持续宽松，信贷总量改善明确，结构优化仍有较大压力。考虑到贷款需求低迷，总量工具传导作用有限，宏观环境仍会宽松，期待更多结构性政策。美联储加息未必会对中国货币政策产生很大掣肘。

3 季度仍需要关注结构性机会。围绕经济复苏链条是近期市场催化的主要线索。风格上中小成长或更占优。从长周期的维度看，新经济替代老经济，科技周期延续的趋势没有改变，因此景气度行业仍有望成为市场主线。

密切关注美国货币政策的走向，以及可能的冲击。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中

国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金经理人与本基金托管人一同完成，本基金经理人完成账务处理、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。

本基金经理人制定了健全、有效的估值政策和程序，为确保估值的合规、公允，本基金经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。

本基金经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

本基金《基金合同》于 2009 年 12 月 28 日生效，根据《基金合同》有关约定，“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，全年分配比例不得低于可供分配收益的 50%。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。”截止至 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 级份额可供分配利润为 632,507,033.77 元，本基金 C 级份额可供分配利润为 511,015.84 元。本报告期末进行利润分配。

#### 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

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银河沪深 300 价值指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	195,220,476.96	251,779,785.61
结算备付金		1,240,503.29	1,757,965.46
存出保证金		87,923.68	251,125.07
交易性金融资产	6.4.7.2	2,418,711,657.24	3,049,752,252.30
其中：股票投资		2,418,711,657.24	3,032,006,252.30
基金投资		-	-
债券投资		-	17,746,000.00
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,094,401.74	740,326.40
应收股利		-	-
应收申购款		4,203,831.30	2,192,914.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	30,077.86
资产总计		2,621,558,794.21	3,306,504,447.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	-
应付赎回款		6,839,531.70	6,167,295.50
应付管理人报酬		1,085,284.89	1,401,162.21
应付托管费		325,585.47	420,348.67
应付销售服务费		3,728.95	29.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,433,134.61	887,351.62
负债合计		9,687,265.62	8,876,187.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,700,632,864.02	2,034,009,252.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	911,238,664.57	1,263,619,007.69
净资产合计		2,611,871,528.59	3,297,628,259.93
负债和净资产总计		2,621,558,794.21	3,306,504,447.17

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，银河沪深 300 价值指数 A 基金份额净值 1.548 元，基金份额总额 1,662,950,398.82 份；银河沪深 300 价值指数 C 基金份额净值 1.014 元，基金份额总额 37,682,465.20 份。银河沪深 300 价值指数份额总额合计为 1,700,632,864.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银河沪深 300 价值指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-162,483,457.92	56,282,459.67
1. 利息收入		421,950.35	291,308.44
其中：存款利息收入	6.4.7.13	421,950.35	290,294.02
债券利息收入		-	1,014.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,473,698.71	81,684,094.56



其中：股票投资收益	6.4.7.14	-52,712,944.25	59,106,424.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,410,921.08	405,713.68
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	40,828,324.46	22,171,956.24
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
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	-155,561,027.16	-26,322,286.72
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	1,129,317.60	629,343.39
<b>减：二、营业总支出</b>		10,398,804.67	7,812,472.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,680,612.61	4,849,941.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,304,183.83	1,454,982.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	19,892.71	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.56	1.81
8. 其他费用	6.4.7.23	394,114.96	1,507,547.68
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-172,882,262.59	48,469,986.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以 “-”号填列）</b>		-172,882,262.59	48,469,986.73
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-172,882,262.59	48,469,986.73

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银河沪深 300 价值指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	2,034,009,252.24	-	1,263,619,007.69	3,297,628,259.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产（基金净值）	2,034,009,252.24	-	1,263,619,007.69	3,297,628,259.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-333,376,388.22	-	-352,380,343.12	-685,756,731.34
（一）、综合收益总额	-	-	-172,882,262.59	-172,882,262.59
（二）、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）	-333,376,388.22	-	-179,498,080.53	-512,874,468.75
其中：1. 基金申购款	426,629,946.10	-	179,540,939.45	606,170,885.55
2. 基金赎回款	-760,006,334.32	-	-359,039,019.98	-1,119,045,354.30
（三）、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）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,700,632,864.02	-	911,238,664.57	2,611,871,528.59
项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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（基金净值）	1,241,188,007.44	-	764,489,472.89	2,005,677,480.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产（基金净值）	1,241,188,007.44	-	764,489,472.89	2,005,677,480.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	141,384,049.56	-	136,160,379.73	277,544,429.29
（一）、综合收益总额	-	-	48,469,986.73	48,469,986.73
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	141,384,049.56	-	87,690,393.00	229,074,442.56

号填列)				
其中：1. 基金申购款	452,570,589.86	-	303,848,543.93	756,419,133.79
2. 基金赎回款	-311,186,540.30	-	-216,158,150.93	-527,344,691.23
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,382,572,057.00	-	900,649,852.62	2,283,221,909.62

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：

于东升

于东升

刘晓彬

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银河沪深 300 价值指数证券投资基金(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》、《银河沪深 300 价值指数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[2009]1025 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 871,170,063.66 份,经中瑞岳华会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为中瑞岳华验字(2009)第 284 号的验资报告。基金合同于 2009 年 12 月 28 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《银河沪深 300 价值指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、央行票据、现金等，以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资包括沪深 300 价值指数成份股和备选成份股、新股（首次发行或增发）等。本基金的投资组合为：本基金跟踪标的指数的股票投资组合资产（包括标的指数成份股和备选成份股）不低于基金资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种（包括股指期货、股指期权等金融衍生产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并依法进行投资管理。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 价值指数收益率  $\times$  95% + 银行活期存款收益率（税后） $\times$  5%

#### 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。

#### 6.4.3 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 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要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况、2022 年上半年度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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”）和 2022 年中国证监会发布的修订的《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》)。

#### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的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》,本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产;及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下,金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则,嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来,而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险,因此在新金融工具准则下,本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金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。本基金未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。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下:

##### (i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息、应收申购款,对应的账面价值分别为人民币 251,779,785.61 元、1,757,965.46 元、251,125.07 元、740,326.40 元、30,077.86 元、2,192,914.47 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结

算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 251,808,495.15 元、1,758,789.37 元、251,249.37 元、740,326.40 元、2,192,945.63 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 3,049,752,252.30 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 3,049,752,641.25 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 6,167,295.50 元、1,401,162.21 元、420,348.67 元、29.24 元、528,706.48 元和 358,645.14 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 6,167,295.50 元、1,401,162.21 元、420,348.67 元、29.24 元和 887,351.62 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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。

(e) 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。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	195,220,476.96
等于：本金	195,201,020.05
加：应计利息	19,456.91
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	195,220,476.96

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,586,078,251.19	-	2,418,711,657.24	- 167,366,593.95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,586,078,251.19	-	2,418,711,657.24	- 167,366,593.95

#### 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

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17,750.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	737,905.69
其中：交易所市场	737,905.69
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	206,780.45
应付指数使用费	470,697.82

合计	1,433,134.61
----	--------------

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银河沪深 300 价值指数 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,033,522,783.39	2,033,522,783.39
本期申购	339,250,477.12	339,250,477.12
本期赎回（以“-”号填列）	-709,822,861.69	-709,822,861.69
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	1,662,950,398.82	1,662,950,398.82

银河沪深 300 价值指数 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	486,468.85	486,468.85
本期申购	87,379,468.98	87,379,468.98
本期赎回（以“-”号填列）	-50,183,472.63	-50,183,472.63
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	37,682,465.20	37,682,465.20

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

银河沪深 300 价值指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	794,766,850.30	468,821,616.68	1,263,588,466.98
本期利润	-16,720,622.80	-154,958,090.05	-171,678,712.85
本期基金份额交易产生的变动数	-145,539,193.73	-35,642,911.67	-181,182,105.40
其中：基金申购款	133,166,804.41	44,228,712.82	177,395,517.23
基金赎回款	-278,705,998.14	-79,871,624.49	-358,577,622.63
本期已分配利润	-	-	-

本期末	632,507,033.77	278,220,614.96	910,727,648.73
-----	----------------	----------------	----------------

## 银河沪深 300 价值指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	11,767.86	18,772.85	30,540.71
本期利润	-600,612.63	-602,937.11	-1,203,549.74
本期基金份额交易产生的变动数	1,207,853.50	476,171.37	1,684,024.87
其中：基金申购款	2,218,372.58	-72,950.36	2,145,422.22
基金赎回款	-1,010,519.08	549,121.73	-461,397.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	619,008.73	-107,992.89	511,015.84

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	405,061.44
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	13,909.04
其他	2,979.87
合计	421,950.35

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-52,712,944.25
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	-52,712,944.25

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	754,313,905.22
减：卖出股票成本总额	805,116,463.55
减：交易费用	1,910,385.92

买卖股票差价收入	-52,712,944.25
----------	----------------

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,602.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,408,318.44
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	3,410,921.08

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,710,756.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,299,400.00
减：应计利息总额	2,996.19
减：交易费用	42.20
买卖债券差价收入	3,408,318.44

##### 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——买卖贵金属差价收入。

**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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	40,828,324.46
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	40,828,324.46

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-155,561,027.16
股票投资	-155,561,027.16
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-155,561,027.16

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,126,335.09
基金转换费收入	2,982.51
合计	1,129,317.60

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	110.00
指数使用费	307,224.51
合计	394,114.96

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
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

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,680,612.61	4,849,941.11
其中：支付销售机构的客户维护 费	3,071,129.01	1,963,020.59

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力，支付日期顺延。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,304,183.83	1,454,982.34

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力，支付日期顺延。

## 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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河沪深 300 价值指数	银河沪深 300 价值指数	合计
	A	C	
银河基金	-	7,087.18	7,087.18
合计	-	7,087.18	7,087.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河沪深 300 价值指数	银河沪深 300 价值指数	合计
	A	C	
合计	-	-	-

注：1、本基金自 2021 年 7 月 26 日增设 C 类，故不涉及上年可比区间；

2、基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.1%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
建设银行	195,220,476.96	405,061.44	191,371,937.79	210,688.95

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

#### 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期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股锁定	55.57	30.01	635	35,286.95	19,056.35	-
301097	天益医疗	2022 年 3 月 25 日	6 个月	新股锁定	52.37	48.40	249	13,040.13	12,051.60	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股锁定	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定	42.50	32.03	390	16,575.00	12,491.70	-
301103	何氏眼科	2022 年 6 月 1 日	1-6 个月(含)	新股锁定-送股	-	32.03	117	-	3,747.51	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定	34.81	16.22	1,225	42,642.25	19,869.50	-
301109	军信股份	2022 年 6 月 17 日	1-6 个月(含)	新股锁定-送股	-	16.22	613	-	9,942.86	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股锁定	11.40	20.44	577	6,577.80	11,793.88	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁定	46.80	54.33	262	12,261.60	14,234.46	-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股锁定	50.31	70.30	301	15,143.31	21,160.30	-

301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股锁定	37.23	25.37	656	24,422.88	16,642.72	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股锁定	31.98	26.29	338	10,809.24	8,886.02	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股锁定	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股锁定	38.39	23.97	516	19,809.24	12,368.52	-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股锁定	163.56	84.91	269	43,997.64	22,840.79	-
301150	中一科技	2022年6月10日	1-6个月(含)	新股锁定-送股	-	84.91	135	-	11,462.85	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股锁定	30.82	21.50	703	21,666.46	15,114.50	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.34	379	5,927.56	7,708.86	-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股锁定	45.13	55.82	334	15,073.42	18,643.88	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.50	271	17,365.68	10,162.50	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.48	353	25,659.57	25,232.44	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股锁定	109.30	45.67	630	68,859.00	28,772.10	-
301206	三元生物	2022年6月	1-6个月	新股锁定-送	-	45.67	315	-	14,386.05	-

		17 日	(含)	股							
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-	
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	17.27	14.82	4,284	73,984.68	63,488.88	-	
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股锁定	72.88	31.38	1,384	100,865.92	43,429.92	-	
301236	软通动力	2022 年 6 月 9 日	1-6 个月 (含)	新股锁定-送股	-	31.38	692	-	21,714.96	-	
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股锁定	56.69	41.87	261	14,796.09	10,928.07	-	
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-	
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-	
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	39.07	29.97	472	18,441.04	14,145.84	-	
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-	
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股锁定	18.39	25.84	483	8,882.37	12,480.72	-	
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-	
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.50	34.92	641	18,268.50	22,383.72	-	
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股锁定	16.91	21.57	784	13,257.44	16,910.88	-	
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	19.09	21.88	452	8,628.68	9,889.76	-	
600938	中国	2022	6 个月	新股锁	10.80	16.16	84,004	907,243.20	1,357,504.64	-	

	海油	年 4 月 14 日		定							
688115	思林杰	2022 年 3 月 7 日	6 个月	新股锁 定	65.65	38.46	2,153	141,344.45	82,804.38		-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股流 通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57		-
688259	创耀科技	2022 年 1 月 5 日	6 个月	新股锁 定	66.60	79.14	1,595	106,227.00	126,228.30		-
688282	理工导航	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定	65.21	45.35	3,185	207,693.85	144,439.75		-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁 定	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71		-
688327	云从科技	2022 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁 定	15.37	22.15	88,678	1,362,980.86	1,964,217.70		-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内 (含)	新股流 通受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23		-

#### 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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	17,746,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	17,746,000.00

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。



#### 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。

本基金为指数基金，采用在法律法规允许范围内最大复制指数的策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	195,220,476.96	-	-	-	-	-	195,220,476.96
结算备付金	1,240,503.29	-	-	-	-	-	1,240,503.29
存出保证金	87,923.68	-	-	-	-	-	87,923.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,418,711,657.24	2,418,711,657.24
应收申购款	6,112.47	-	-	-	-	4,197,718.83	4,203,831.30
应收清算款	-	-	-	-	-	2,094,401.74	2,094,401.74
资产总计	196,555,016.40	-	-	-	-	2,425,003,777.81	2,621,558,794.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,839,531.70	6,839,531.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,085,284.89	1,085,284.89
应付托管费	-	-	-	-	-	325,585.47	325,585.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,728.95	3,728.95
其他负债	-	-	-	-	-	1,433,134.61	1,433,134.61
负债总计	-	-	-	-	-	9,687,265.62	9,687,265.62
利率敏感度缺口	196,555,016.40	-	-	-	-	2,415,316,512.19	2,611,871,528.59
上年度末 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	251,779,785	-	-	-	-	-	251,779,785

	.61						5.61
结算备付金	1,757,965.46	-	-	-	-	-	1,757,965.46
存出保证金	251,125.07	-	-	-	-	-	251,125.07
交易性金融资产	-	-	17,746,000.00	-	-	3,032,006,252.30	3,049,752,252.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	740,326.40	740,326.40
应收利息	-	-	-	-	-	30,077.86	30,077.86
应收申购款	-	-	-	-	-	2,192,914.47	2,192,914.47
资产总计	253,788,876.14	-	17,746,000.00	-	-	3,034,969,571.03	3,306,504,447.17
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,167,295.50	6,167,295.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,401,162.21	1,401,162.21
应付托管费	-	-	-	-	-	420,348.67	420,348.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	29.24	29.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	528,706.48	528,706.48
其他负债	-	-	-	-	-	358,645.14	358,645.14
负债总计	-	-	-	-	-	8,876,187.24	8,876,187.24
利率敏感度缺口	253,788,876.14	-	17,746,000.00	-	-	3,026,093,383.79	3,297,628,259.93

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，并按照合同约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。	
相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	

	动	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	-	255,443.15
	市场利率上升 25 个基点	-	-255,443.15

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股、备选成份股，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

##### 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	2,418,711,657.24	92.60	3,032,006,252.30	91.95
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	2,418,711,657.24	92.60	3,032,006,252.30	91.95

##### 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。
	对资产负债表日基金资产净值的

	相关风险变量的变动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	93,265,305.29	96,907,123.65
	沪深 300 指数下降 5%	-93,265,305.29	-96,907,123.65

#### 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层决定：

第一层次： 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次： 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： 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	2,413,319,111.03	3,025,643,059.53
第二层次	5,392,546.21	24,109,192.77
第三层次	-	-
合计	2,418,711,657.24	3,049,752,252.30

###### 6.4.14.2.2 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。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2022 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(2021 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**

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。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,418,711,657.24	92.26
	其中：股票	2,418,711,657.24	92.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	196,460,980.25	7.49
8	其他各项资产	6,386,156.72	0.24
9	合计	2,621,558,794.21	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	118,526,339.78	4.54
C	制造业	482,335,989.13	18.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	75,783,743.16	2.90
E	建筑业	124,979,179.78	4.79

F	批发和零售业	6,052,928.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	53,692,631.27	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,146,128.00	1.27
J	金融业	1,350,296,669.62	51.70
K	房地产业	159,225,121.88	6.10
L	租赁和商务服务业	9,232,214.00	0.35
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,413,270,944.62	92.40

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,357,504.64	0.05
C	制造业	1,357,607.16	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,419,952.52	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务	19,959.78	0.00

	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	54,661.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,625.76	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,440,712.62	0.21

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	4,603,875	214,954,923.75	8.23
2	600036	招商银行	4,853,193	204,804,744.60	7.84
3	601166	兴业银行	6,588,367	131,108,503.30	5.02
4	600030	中信证券	3,562,790	77,170,031.40	2.95
5	000651	格力电器	1,862,172	62,792,439.84	2.40
6	601398	工商银行	13,104,604	62,508,961.08	2.39
7	000001	平安银行	4,162,259	62,350,639.82	2.39
8	000002	万科 A	2,737,043	56,109,381.50	2.15
9	600048	保利发展	3,027,208	52,855,051.68	2.02
10	601328	交通银行	10,316,455	51,375,945.90	1.97
11	601088	中国神华	1,324,229	44,096,825.70	1.69
12	601668	中国建筑	7,694,702	40,935,814.64	1.57
13	000725	京东方 A	10,212,700	40,238,038.00	1.54
14	600690	海尔智家	1,415,051	38,857,300.46	1.49
15	600585	海螺水泥	1,055,627	37,242,520.56	1.43
16	601288	农业银行	11,932,498	36,036,143.96	1.38
17	600000	浦发银行	4,377,546	35,064,143.46	1.34
18	600837	海通证券	3,444,100	33,786,621.00	1.29
19	600919	江苏银行	4,690,790	33,398,424.80	1.28
20	601601	中国太保	1,409,302	33,160,876.06	1.27
21	601919	中远海控	2,330,590	32,395,201.00	1.24



22	601225	陕西煤业	1,507,450	31,927,791.00	1.22
23	600016	民生银行	8,558,988	31,839,435.36	1.22
24	600104	上汽集团	1,594,483	28,397,742.23	1.09
25	601688	华泰证券	1,887,674	26,804,970.80	1.03
26	601169	北京银行	5,860,038	26,604,572.52	1.02
27	601229	上海银行	3,782,651	24,776,364.05	0.95
28	600028	中国石化	5,883,701	24,005,500.08	0.92
29	600050	中国联通	6,810,800	23,565,368.00	0.90
30	601988	中国银行	7,225,519	23,555,191.94	0.90
31	000100	TCL 科技	4,911,100	23,524,169.00	0.90
32	601211	国泰君安	1,546,028	23,499,625.60	0.90
33	000703	恒逸石化	2,118,600	22,266,486.00	0.85
34	601766	中国中车	4,255,820	22,130,264.00	0.85
35	601390	中国中铁	3,500,500	21,493,070.00	0.82
36	601658	邮储银行	3,974,900	21,424,711.00	0.82
37	601628	中国人寿	652,552	20,281,316.16	0.78
38	000338	潍柴动力	1,598,220	19,929,803.40	0.76
39	601009	南京银行	1,905,238	19,852,579.96	0.76
40	600795	国电电力	5,014,526	19,606,796.66	0.75
41	601669	中国电建	2,430,944	19,131,529.28	0.73
42	601818	光大银行	6,344,279	19,096,279.79	0.73
43	000776	广发证券	1,010,400	18,894,480.00	0.72
44	600926	杭州银行	1,260,127	18,876,702.46	0.72
45	600019	宝钢股份	3,090,188	18,602,931.76	0.71
46	600999	招商证券	1,246,300	17,959,183.00	0.69
47	000895	双汇发展	582,348	17,062,796.40	0.65
48	001979	招商蛇口	1,234,600	16,580,678.00	0.63
49	601985	中国核电	2,311,400	15,856,204.00	0.61
50	600346	恒力石化	693,200	15,416,768.00	0.59
51	600741	华域汽车	660,498	15,191,454.00	0.58
52	601838	成都银行	866,428	14,365,376.24	0.55
53	601006	大秦铁路	2,166,478	14,277,090.02	0.55
54	601377	兴业证券	1,929,200	13,600,860.00	0.52
55	002202	金风科技	909,590	13,461,932.00	0.52
56	601138	工业富联	1,336,600	13,152,144.00	0.50
57	600886	国投电力	1,228,665	12,900,982.50	0.49
58	600089	特变电工	467,300	12,799,347.00	0.49
59	601186	中国铁建	1,598,400	12,627,360.00	0.48
60	600383	金地集团	928,321	12,476,634.24	0.48
61	601600	中国铝业	2,594,500	12,323,875.00	0.47
62	600015	华夏银行	2,350,041	12,243,713.61	0.47
63	003816	中国广核	4,221,900	11,821,320.00	0.45

64	601800	中国交建	1,251,085	11,610,068.80	0.44
65	000157	中联重科	1,786,800	11,006,688.00	0.42
66	600011	华能国际	1,542,900	10,862,016.00	0.42
67	002601	龙佰集团	537,600	10,778,880.00	0.41
68	000069	华侨城 A	1,646,723	10,687,232.27	0.41
69	601155	新城控股	413,533	10,516,144.19	0.40
70	601336	新华保险	322,600	10,384,494.00	0.40
71	601916	浙商银行	3,044,100	10,106,412.00	0.39
72	600352	浙江龙盛	987,436	10,052,098.48	0.38
73	000425	徐工机械	1,805,800	9,733,262.00	0.37
74	002027	分众传媒	1,371,800	9,232,214.00	0.35
75	601618	中国中冶	2,403,561	8,412,463.50	0.32
76	000708	中信特钢	401,700	8,094,255.00	0.31
77	600332	白云山	238,600	7,537,374.00	0.29
78	600489	中金黄金	977,300	7,222,247.00	0.28
79	600018	上港集团	1,204,175	7,020,340.25	0.27
80	601898	中煤能源	620,200	6,437,676.00	0.25
81	600606	绿地控股	1,563,836	6,192,790.56	0.24
82	601216	君正集团	1,262,800	6,162,464.00	0.24
83	600655	豫园股份	641,200	6,052,928.00	0.23
84	601728	中国电信	1,597,000	5,956,810.00	0.23
85	601998	中信银行	1,163,996	5,528,981.00	0.21
86	600061	国投资本	859,600	5,467,056.00	0.21
87	601319	中国人保	980,400	4,960,824.00	0.19
88	600188	兖矿能源	122,500	4,836,300.00	0.19
89	600025	华能水电	677,600	4,736,424.00	0.18
90	601117	中国化学	486,300	4,576,083.00	0.18
91	002736	国信证券	381,900	3,654,783.00	0.14
92	600941	中国移动	59,900	3,623,950.00	0.14
93	000800	一汽解放	313,700	2,929,958.00	0.11
94	002064	华峰化学	196,200	1,655,928.00	0.06
95	000877	天山股份	80,900	995,070.00	0.04
96	601825	沪农商行	127,400	798,798.00	0.03

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688327	云从科技	88,678	1,964,217.70	0.08
2	600938	中国海油	84,004	1,357,504.64	0.05
3	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
4	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.01
5	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01

6	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
7	688282	理工导航	3,185	144,439.75	0.01
8	688259	创耀科技	1,595	126,228.30	0.00
9	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
10	688115	思林杰	2,153	82,804.38	0.00
11	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
12	301217	铜冠铜箔	4,284	63,488.88	0.00
13	301206	三元生物	945	43,158.15	0.00
14	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
15	301150	中一科技	404	34,303.64	0.00
16	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
17	301109	军信股份	1,838	29,812.36	0.00
18	301201	诚达药业	353	25,232.44	0.00
19	301268	铭利达	641	22,383.72	0.00
20	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
21	301122	采纳股份	301	21,160.30	0.00
22	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
23	300834	星辉环材	635	19,056.35	0.00
24	301162	国能日新	334	18,643.88	0.00
25	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
26	301286	侨源股份	784	16,910.88	0.00
27	301123	奕东电子	656	16,642.72	0.00
28	301103	何氏眼科	507	16,239.21	0.00
29	301151	冠龙节能	703	15,114.50	0.00
30	301117	佳缘科技	262	14,234.46	0.00
31	301248	杰创智能	472	14,145.84	0.00
32	301259	艾布鲁	483	12,480.72	0.00
33	301148	嘉戎技术	516	12,368.52	0.00
34	301097	天益医疗	249	12,051.60	0.00
35	301116	益客食品	577	11,793.88	0.00
36	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
37	301237	和顺科技	261	10,928.07	0.00
38	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
39	301196	唯科科技	271	10,162.50	0.00
40	301288	清研环境	452	9,889.76	0.00
41	301135	瑞德智能	338	8,886.02	0.00
42	301158	德石股份	379	7,708.86	0.00
43	301009	可靠股份	1	12.48	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	21,181,755.42	0.64
2	601318	中国平安	20,227,499.00	0.61
3	600030	中信证券	15,662,208.50	0.47
4	600089	特变电工	12,657,970.00	0.38
5	601166	兴业银行	11,989,354.00	0.36
6	002027	分众传媒	8,478,576.00	0.26
7	601398	工商银行	6,600,765.00	0.20
8	000651	格力电器	6,339,777.00	0.19
9	000001	平安银行	5,736,063.27	0.17
10	600795	国电电力	5,663,554.00	0.17
11	600958	东方证券	5,489,251.56	0.17
12	600886	国投电力	5,452,069.00	0.17
13	601328	交通银行	5,419,691.93	0.16
14	000725	京东方 A	5,401,577.00	0.16
15	600188	兖矿能源	5,127,034.00	0.16
16	601117	中国化学	4,838,772.00	0.15
17	600048	保利发展	4,759,042.74	0.14
18	000002	万科 A	4,549,740.00	0.14
19	601668	中国建筑	4,460,685.00	0.14
20	600028	中国石化	4,452,030.00	0.14

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	600900	长江电力	100,695,989.10	3.05
2	601318	中国平安	43,253,725.34	1.31
3	600036	招商银行	41,698,337.00	1.26
4	300498	温氏股份	37,386,089.69	1.13
5	601166	兴业银行	27,085,221.00	0.82
6	600958	东方证券	20,855,984.32	0.63
7	600030	中信证券	15,763,915.21	0.48
8	601877	正泰电器	15,663,979.00	0.48
9	601788	光大证券	14,472,296.00	0.44
10	601398	工商银行	13,094,059.00	0.40
11	000651	格力电器	12,726,428.40	0.39
12	000001	平安银行	12,448,424.00	0.38
13	601328	交通银行	10,891,072.00	0.33
14	000002	万科 A	10,020,440.00	0.30

15	600048	保利发展	9,865,641.00	0.30
16	601088	中国神华	9,108,634.36	0.28
17	601607	上海医药	8,976,592.98	0.27
18	601668	中国建筑	8,910,719.00	0.27
19	000725	京东方 A	8,768,906.00	0.27
20	601919	中远海控	7,909,782.00	0.24

#### 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	347,382,895.65
卖出股票收入（成交）总额	754,313,905.22

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 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	87,923.68
2	应收清算款	2,094,401.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,203,831.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,386,156.72

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688327	云从科技	1,964,217.70	0.08	新股锁定
2	600938	中国海油	1,357,504.64	0.05	新股锁定
3	688400	凌云光	287,524.23	0.01	新股流通受限
4	688322	奥比中光	264,313.71	0.01	新股流通受限
5	301139	元道通信	217,337.46	0.01	新股流通受限

### 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 (%)
银河沪深 300 价值 指数 A	217,376	7,650.11	26,912,158.23	1.62	1,636,038,240.59	98.38
银河沪深 300 价值 指数 C	447	84,300.82	29,849,347.76	79.21	7,833,117.44	20.79
合计	217,823	7,807.41	56,761,505.99	3.34	1,643,871,358.03	96.66

### 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	银河沪深 300 价值指数 A	39,257.68	0.0024
	银河沪深 300 价值指数 C	0.00	0.0000
	合计	39,257.68	0.0023

### 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、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	银河沪深 300 价值指数 A	0~10
	银河沪深 300 价值指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	银河沪深 300 价值指数 A	0
	银河沪深 300 价值指数 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河沪深 300 价值指数 A	银河沪深 300 价值指数 C
基金合同生效日 (2009 年 12 月 28 日) 基金份额总额	871,170,063.66	-
本报告期期初基金 份额总额	2,033,522,783.39	486,468.85

本报告期基金总申购份额	339,250,477.12	87,379,468.98
减：本报告期基金总赎回份额	709,822,861.69	50,183,472.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,662,950,398.82	37,682,465.20

注：本基金于 2021 年 7 月 26 日新增 C 类，并于 2021 年 7 月 30 日起 C 类开始持有份额。

## § 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：

2022 年 1 月 21 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》，管良权先生担任银河基金管理有限公司首席信息官。

2022 年 3 月 15 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》，于东升先生担任银河基金管理有限公司总经理。

2022 年 3 月 15 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》，于东升先生代任基金管理公司董事长，刘立达先生不再担任银河基金管理有限公司董事长职务。

2022 年 5 月 12 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》，宋卫刚先生担任银河基金管理有限公司董事长。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内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

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华西证券	1	524,674,529.50	49.34	483,287.06	49.21	-
海通证券	1	158,830,807.68	14.94	147,919.01	15.06	-
中信建投证券	2	158,000,341.80	14.86	145,488.24	14.81	-
兴业证券	2	109,742,970.60	10.32	102,204.01	10.41	-
中金公司	1	36,660,884.22	3.45	33,775.35	3.44	-
申万宏源证券	2	32,267,254.06	3.03	29,404.94	2.99	-
东方证券	2	27,013,891.64	2.54	25,157.94	2.56	退租 1
安信证券	3	7,892,917.77	0.74	7,271.66	0.74	-
信达证券	1	5,914,005.77	0.56	5,389.46	0.55	-
中泰证券	1	2,478,633.51	0.23	2,258.73	0.23	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
网信证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：选择证券公司专用席位的标准：

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的

		比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
华西证券	23,235,993.80	98.00	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	474,763.03	2.00	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
网信证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《证券日报》、公司网站	2022 年 01 月 21 日
2	银河沪深 300 价值指数证券投资基金基金产品资料概要更新	《上海证券报》、公司网站	2022 年 02 月 10 日
3	银河沪深 300 价值指数证券投资基金招募说明书更新	《上海证券报》、公司网站	2022 年 02 月 10 日
4	银河沪深 300 价值指数证券投资基金基金产品资料概要更新	《上海证券报》、公司网站	2022 年 02 月 10 日
5	银河基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《证券日报》、公司网站	2022 年 03 月 15 日
6	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	2022 年 03 月 15 日
7	银河基金管理有限公司 2021 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	2022 年 03 月 29 日
8	银河基金管理有限公司关于旗下银河沪深 300 价值指数证券投资基金 C 类份额新增宁波银行股份有限公司为代销机构并开通定投的公告	《上海证券报》、公司网站	2022 年 03 月 31 日
9	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构、开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、公司网站	2022 年 04 月 07 日
10	银河基金管理有限公司关于银河沪深 300 价值指数证券投资基金（C 类份额）新增上海长量基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务的公告	《上海证券报》、公司网站	2022 年 04 月 08 日
11	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构、开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、公司网站	2022 年 04 月 08 日
12	银河基金管理有限公司 2022 年第一季度报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2022 年 04 月 21 日
13	银河基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯资产管理有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《上海证券报》、公司网站	2022 年 04 月 21 日
14	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	2022 年 05 月 12 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河沪深 300 价值指数证券投资基金的文件
- 2、《银河沪深 300 价值指数证券投资基金基金合同》
- 3、《银河沪深 300 价值指数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、银河沪深 300 价值指数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

上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼

### 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38568888 /400-820-0860

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司

2022 年 8 月 26 日