

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）
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 年 08 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 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 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 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 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 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 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 37 |
| 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 | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 37 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 37 |
| 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 | 37 |
| 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 | 38 |
| 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 | 38 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 38 |
| 7.12 本报告期投资基金情况 | 38 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 42 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 43 |
| 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 | 43 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 43 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 43 |
| § 10 重大事件揭示 | 44 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 44 |
| 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 | 44 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 44 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 44 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 44 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 44 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 44 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 45 |
| 10.9 其他重大事件 | 48 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| 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 | 48 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| § 12 备查文件目录 | 49 |
| 12.1 备查文件目录 | 49 |
| 12.2 存放地点 | 49 |
| 12.3 查阅方式 | 49 |

§ 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） |
| 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 | 10,004,396.70 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

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管理需求。 |
| 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 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 021-38568989 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | qinchangjian@galaxyasset.com | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-820-0860 | 021-60637228 |
| 传真 | | 021-38568769 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.cgf.cn |
| 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 | 银河基金管理有限公司 | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023年1月1日-2023年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -139,260.43 |
| 本期利润 | 71,229.52 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0071 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.73% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.73% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | -308,323.73 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0308 |
| 期末基金资产净值 | 9,759,018.63 |
| 期末基金份额净值 | 0.9755 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -2.45% |

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

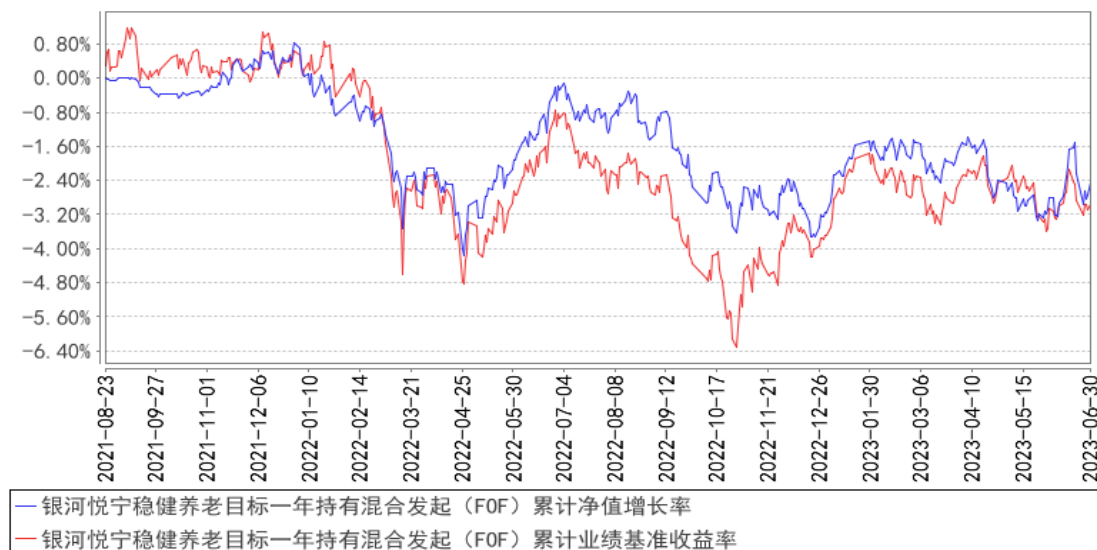
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.76% | 0.33% | 0.66% | 0.23% | 0.10% | 0.10% |
| 过去三个月 | -0.73% | 0.25% | -0.47% | 0.21% | -0.26% | 0.04% |
| 过去六个月 | 0.73% | 0.22% | 0.75% | 0.21% | -0.02% | 0.01% |
| 过去一年 | -2.26% | 0.22% | -2.14% | 0.26% | -0.12% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.45% | 0.22% | -2.97% | 0.28% | 0.52% | -0.06% |

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

银河悦宁稳健养老目标一年持有混合发起（FOF）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：按基金合同规定，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。截至本期末，本基金建仓期已满，各项资产配置比例符合合同约定。

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、首都机场集团有限公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

本报告期内公司管理的基金有：银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联系列证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金（LOF）、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河泰利纯债债券型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河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）、银河成长优选一年持有期混合型证券投资基金、银河核心优势混合型证券投资基金、银河中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、银河季季盈 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、银河价值成长混合型证券投资基金、银河景气行业混合型证券投资基金。

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 | 本基金的基金经理 | 2021 年 8 月 23 日 | - | 11 年 | 中共党员，硕士研究生学历，11 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（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

本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金合同》和其他有关法律、法规的规定，本着“诚实信用、勤勉律己、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、勤勉律己、创新图强”的理念，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定，进一步加强风险管理和完善内部控制体系，为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

针对反向交易部分，公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。本报告期内，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况（完全复制的指数基金除外）。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年 A 股表现跌宕起伏、整体呈现频繁轮动的特征，但市场在不同阶段又演绎着不同的交易逻辑。一季度市场行情主要围绕“预期”与“现实”展开，年初市场在疫后经济逐步修复的良好预期中迎来春季躁动行情，伴随着“中强美弱”格局下北向资金的持续回流，复苏逻辑及外资偏好推动了消费、新能源、计算机及多数顺周期行业一起上涨。春节后随着较强经济数据的披露，内资陆续入场成为市场该阶段主要的增量资金，但此时外资随着美国经济硬着陆风险的降低流入趋势开始减缓，市场迈入了存量博弈阶段。随后三月份市场经济复苏预期转弱叠加 TMT 产业新技术的问世，一季度末和二季度初，重磅政策和产业动向催生出“数字经济”和“中特估”两大市场主线。二季度前期 TMT 板块快速上行同时交易拥挤度也不断攀升，高位震荡一段时间后迅速回调，期间“中特估”接棒成为市场主力并带领大盘指数反弹，但由于 4、5 月份经济数据持续不及预期，大盘一路缩量下跌并来到阶段性低点位置。二季度后半段 TMT 先是在海外龙头股景气验证的催化下反弹，接着随着交易拥挤度再次攀升至高位后又快速回调并在 TMT 板块内部开始震荡并走出分化行情。

债市一季度整体波动较小，在经济复苏逐步恢复预期的压制下，10 年期国债到期收益率先上后下，整个区间内利率小幅上行；二季度在较强的政策定力和不及预期的经济复苏背景下债券利率短时间内快速下行，10 年期国债到期收益率从 2.86% 一路降至 2.62% 附近低点位置，之后维持窄幅波动，二季度债券市场表现超预期、成为市场中为数不多的 alpha 来源之一。

在本基金的组合管理方面，一季度随着市场情绪回暖，逐步提升了主动权益类资产的占比，整体保持均衡偏成长风格，并辅以行业主题基金的配置以实现小幅的行业偏离。二季度纯权益类资产总体占比先降后升，结构方面增配了 TMT 内部低位并且前期涨幅不大的子行业以及不同风险等级的含权类债基，降低了新能源等成长行业基金的占比，少量增配了偏防御属性的红利板块；债权类基金方面随着债券利率的不断下行，降低了纯债类基金的配置比例，将仓位部分转移至含权债基。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河悦宁稳健养老目标一年持有混合发起（FOF）基金份额净值为 0.9755 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.73%；同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年市场的交易主线和主导逻辑围绕“数字经济”和“中特估”展开，虽然短期内由于情

绪面和资金面的扰动行情有所反复，但产业新技术诞生和自上而下政府政策支持鼓励方向下所催生的行情持续性仍然值得期待和肯定。在主线思维的基础上，上半年市场分歧主要集中在经济实际复苏力度与预期之间的偏差，同时市场中周期板块、多数商品价格以及债券收益率也率先于经济基本面给出了指示。但资本市场特别是权益市场逐渐对持续低迷的经济数据反应程度降低，转而对稳增长政策和其他利好变化更加敏感，特别是低位时期对利好反应的弹性会更强，因而当前位置，适当拉长时间维度，股票资产的性价比和赔率非常具有吸引力和配置价值。

权益方面，展望下半年，相对来说股票资产当前的估值较低，经过最近一轮调整之后，上证指数又回到 3200 点低点位置震荡，意味着 A 股从估值角度重回高配置价值阶段，在存量资金行情下，仍将维持结构性行情为主，TMT 板块的主线位置不改，但经过一轮估值快速修复后，新一轮行情会更加重视各环节产业链上“中美映射”情况和板块内部投资性价比的比较和高低切换。

债券方面，经过二季度的利率下行，10 年期国债到期收益率已经非常接近 2022 年第三季度的阶段性低点，离 2020 年疫情爆发以来的最低点 2.48%也仅有十几个 BP 的空间，债市已领先于经济基本面有所反应，三季度海外美联储政策的变化和接下来的经济走势在利率走势上造成的扰动都将有限。债券基金主要提供配置和票息价值为主。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了由公司相关领导、监察部投资风控岗、研究部数量研究员、行业研究员、基金运营部基金会计等相关人员组成的估值委员会，以上人员拥有丰富的风控、合规、证券研究、估值经验，根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但基金经理可以列席估值委员会会议提供估值建议，以便估值委员会决策。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定，“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”。

本基金本报告期末未进行利润分配。本基金截至 2023 年 06 月 30 日，无可供分配利润。

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

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 864,050.42 | 1,137,007.28 |
| 结算备付金 | | 1,597.79 | 2,554.02 |
| 存出保证金 | | 115.52 | 77.14 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 8,908,689.76 | 8,610,466.89 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | 8,908,689.76 | 8,610,466.89 |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 衍生金融资产 | 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 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 0.18 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 9,774,453.49 | 9,750,105.51 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 4,363.44 | 4,253.32 |
| 应付托管费 | | 1,154.43 | 1,239.56 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 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 | 9,916.99 | 20,000.00 |
| 负债合计 | | 15,434.86 | 25,492.88 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 10,004,396.70 | 10,042,328.40 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -245,378.07 | -317,715.77 |
| 净资产合计 | | 9,759,018.63 | 9,724,612.63 |
| 负债和净资产总计 | | 9,774,453.49 | 9,750,105.51 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9755 元，基金份额总额 10,004,396.70 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 114,806.08 | -57,761.74 |
| 1. 利息收入 | | 2,406.38 | 3,420.14 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 2,406.38 | 2,095.15 |
| 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 | | - | 1,324.99 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -98,090.25 | -27,029.16 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | -112,922.61 | -52,278.98 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.17 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 14,832.36 | 25,249.82 |
| 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） | 6.4.7.21 | 210,489.95 | -34,152.72 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.22 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 43,576.56 | 42,579.61 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 26,250.85 | 25,317.72 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 7,235.35 | 7,194.90 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 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 | 6.4.7.24 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 58.37 | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.25 | 10,031.99 | 10,066.99 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 71,229.52 | -100,341.35 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 71,229.52 | -100,341.35 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 71,229.52 | -100,341.35 |

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|-------------|--------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 10,042,328.40 | - | -317,715.77 | 9,724,612.63 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 10,042,328.40 | - | -317,715.77 | 9,724,612.63 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -37,931.70 | - | 72,337.70 | 34,406.00 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 71,229.52 | 71,229.52 |
| （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） | -37,931.70 | - | 1,108.18 | -36,823.52 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,337.89 | - | -21.95 | 1,315.94 |
| 2. 基金赎回款 | -39,269.59 | - | 1,130.13 | -38,139.46 |
| （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） | 10,004,396.70 | - | -245,378.07 | 9,759,018.63 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 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） | 10,000,009.93 | - | 82,107.40 | 10,082,117.33 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 10,000,009.93 | - | 82,107.40 | 10,082,117.33 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 42,178.74 | - | -101,297.85 | -59,119.11 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -100,341.35 | -100,341.35 |
| （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） | 42,178.74 | - | -956.50 | 41,222.24 |
| 其中：1. 基金申购款 | 42,178.74 | - | -956.50 | 41,222.24 |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| （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） | 10,042,188.67 | - | -19,190.45 | 10,022,998.22 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>史平武</u> | <u>史平武</u> | <u>刘晓彬</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银河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。

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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2023 年 06 月 30 日的财务状况、自 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、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 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 864,050.42 |
| 等于：本金 | 863,972.12 |
| 加：应计利息 | 78.30 |
| 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 | 864,050.42 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------|------------------------|------|--------------|-----------|
| | 成本 | 应计利息 | 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 | 8,845,019.36 | - | 8,908,689.76 | 63,670.40 |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 8,845,019.36 | - | 8,908,689.76 | 63,670.40 |

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 2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 9,916.99 |
| 合计 | 9,916.99 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|---------------|---------------------------------|---------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 10,042,328.40 | 10,042,328.40 |
| 本期申购 | 1,337.89 | 1,337.89 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -39,269.59 | -39,269.59 |
| 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 | 10,004,396.70 | 10,004,396.70 |

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

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| 上年度末 | -170,241.09 | -147,474.68 | -317,715.77 |
| 本期利润 | -139,260.43 | 210,489.95 | 71,229.52 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,177.79 | -69.61 | 1,108.18 |
| 其中：基金申购款 | -25.97 | 4.02 | -21.95 |
| 基金赎回款 | 1,203.76 | -73.63 | 1,130.13 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -308,323.73 | 62,945.66 | -245,378.07 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 2,400.35 |
| 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 | 5.15 |
| 其他 | 0.88 |
| 合计 | 2,406.38 |

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

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——买卖股票差价收入。

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 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 卖出/赎回基金成交总额 | 3,300,960.55 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 3,411,490.82 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 486.44 |
| 减：交易费用 | 1,905.90 |
| 基金投资收益 | -112,922.61 |

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.16.3 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。

6.4.7.16.4 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。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.18.3 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。

6.4.7.18.4 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。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 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。

6.4.7.19.2 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。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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 | 14,832.36 |
| 合计 | 14,832.36 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 210,489.95 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | 210,489.95 |
| 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 | 210,489.95 |

6.4.7.22 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------|---|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 10,004.41 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 27,098.65 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 5,809.67 |

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。

6.4.7.24 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 9,916.99 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 115.00 |
| 合计 | 10,031.99 |

6.4.7.26 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、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 |
| 中国银河证券股份有限公司（“银河证券”） | 同受基金管理人控股股东控制 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) |
| 银河证券 | - | - | 1,100,000.00 | 100.00 |

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期基金 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 | 980,619.20 | 100.00 | - | - |

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 26,250.85 | 25,317.72 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 46.87 | 13.88 |

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,235.35 | 7,194.90 |

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；若为负数，则为 0）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；若为负数，则为 0）×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不设销售服务费。

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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 | 10,000,000.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 99.9561% | 99.5800% |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

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

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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|---------------------------------|----------|---------------------------------|----------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 | 864,050.42 | 2,400.35 | 845,306.43 | 2,079.05 |

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

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 904,126.08 元，占本基金资产净值的比例为 9.26%。

上年度末，本基金持有基金管理人银河基金所管理的基金合计 1,393,265.86 元，占本基金资产净值的比例为 14.33%。

6.4.10.8.2 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

| 项目 | 本期费用 | 上年度可比期间 |
|----------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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） | 3,249.96 | 4,090.22 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 955.66 | 1,086.49 |

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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，

通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 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 | 864,050.42 | - | - | - | - | - | 864,050.42 |
| 结算备付金 | 1,597.79 | - | - | - | - | - | 1,597.79 |
| 存出保证金 | 115.52 | - | - | - | - | - | 115.52 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -8,908,689.76 | 8,908,689.76 |
| 资产总计 | 865,763.73 | - | - | - | - | -8,908,689.76 | 9,774,453.49 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 4,363.44 | 4,363.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,154.43 | 1,154.43 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 9,916.99 | 9,916.99 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 15,434.86 | 15,434.86 |
| 利率敏感度缺口 | 865,763.73 | - | - | - | - | -8,893,254.90 | 9,759,018.63 |
| 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 1,137,007.28 | - | - | - | - | - | 1,137,007.28 |
| 结算备付金 | 2,554.02 | - | - | - | - | - | 2,554.02 |
| 存出保证金 | 77.14 | - | - | - | - | - | 77.14 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -8,610,466.89 | 8,610,466.89 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 0.18 | 0.18 |
| 资产总计 | 1,139,638.44 | - | - | - | - | -8,610,467.07 | 9,750,105.51 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 4,253.32 | 4,253.32 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,239.56 | 1,239.56 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 20,000.00 | 20,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 25,492.88 | 25,492.88 |
| 利率敏感度缺口 | 1,139,638.44 | - | - | - | - | -8,584,974.19 | 9,724,612.63 |

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

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

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 2023年6月30日 | | 上年度末 2022年12月31日 | |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | 8,908,689.76 | 91.29 | 8,610,466.89 | 88.54 |
| 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 | 8,908,689.76 | 91.29 | 8,610,466.89 | 88.54 |

6.4.13.4.3.2 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。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升 5% | 199,340.22 | 172,980.72 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -199,340.22 | -172,980.72 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 8,908,689.76 | 8,610,466.89 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 8,908,689.76 | 8,610,466.89 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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(2022 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、买入返售金融资产款、卖出回购金融资产和其他金融负债，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

于 2023 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|--------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 8,908,689.76 | 91.14 |
| 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 | 865,648.21 | 8.86 |
| 8 | 其他各项资产 | 115.52 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 9,774,453.49 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

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

本基金本报告期无卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无买入、卖出股票。

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

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 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。

7.12.2 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 | 519669 | 银河领先债券A | 契约型开放式 | 714,662.25 | 841,872.13 | 8.63 | 是 |
| 2 | 006361 | 财通资管鸿益中短债券C | 契约型开放式 | 564,881.51 | 597,644.64 | 6.12 | 否 |
| 3 | 012778 | 中欧养老产业混合C | 契约型开放式 | 185,569.47 | 591,057.32 | 6.06 | 否 |
| 4 | 001258 | 兴业收益增强 | 契约型开 | 407,401.03 | 549,583.99 | 5.63 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---------------------------|----------------|------------|------------|------|---|
| | | 债券 C | 放式 | | | | |
| 5 | 003266 | 招商招 坤纯债 债券 C | 契约 型开 放式 | 428,412.30 | 531,359.78 | 5.44 | 否 |
| 6 | 519783 | 交银施 罗德裕 隆纯债 债券 C | 契约 型开 放式 | 388,223.44 | 498,828.30 | 5.11 | 否 |
| 7 | 008792 | 招商安 华债券 C | 契约 型开 放式 | 440,031.89 | 498,160.10 | 5.10 | 否 |
| 8 | 002637 | 广发集 裕债券 C | 契约 型开 放式 | 396,728.75 | 488,769.82 | 5.01 | 否 |
| 9 | 000033 | 易方达 信用债 债券 C | 契约 型开 放式 | 431,300.38 | 483,315.21 | 4.95 | 否 |
| 10 | 675113 | 西部利 得汇享 债券 C | 契约 型开 放式 | 349,497.60 | 423,206.64 | 4.34 | 否 |
| 11 | 002362 | 富兰克 林国海 恒瑞债 券 C | 契约 型开 放式 | 256,253.17 | 359,266.94 | 3.68 | 否 |
| 12 | 010119 | 天弘多 元收益 债券 C | 契约 型开 放式 | 276,566.55 | 311,552.22 | 3.19 | 否 |
| 13 | 004200 | 博时富 瑞纯债 债券 A | 契约 型开 放式 | 293,562.59 | 308,886.56 | 3.17 | 否 |
| 14 | 014243 | 富国新 材料新 能源混 合 C | 契约 型开 放式 | 173,313.88 | 276,383.64 | 2.83 | 否 |
| 15 | 000109 | 富国稳 健增强 | 契约 型开 | 206,575.02 | 248,922.90 | 2.55 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|------------------|--------------|------------|------------|------|---|
| | | 债券 C | 放式 | | | | |
| 16 | 519133 | 海富通改革驱动灵活配置混合 | 契约型开放式 | 102,327.58 | 223,493.67 | 2.29 | 否 |
| 17 | 006567 | 中泰星元价值优选灵活配置混合 A | 契约型开放式 | 87,019.14 | 207,209.98 | 2.12 | 否 |
| 18 | 000727 | 融通健康产业灵活配置混合 A/B | 契约型开放式 | 63,723.30 | 194,419.79 | 1.99 | 否 |
| 19 | 001338 | 安信稳健增值灵活配置混合 C | 契约型开放式 | 120,994.34 | 187,129.85 | 1.92 | 否 |
| 20 | 512720 | 国泰中证计算机主题 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 140,900.00 | 184,860.80 | 1.89 | 否 |
| 21 | 006408 | 汇添富消费升级混合 A | 契约型开放式 | 92,112.74 | 170,675.70 | 1.75 | 否 |
| 22 | 004706 | 南方祥元债券 C | 契约型开放式 | 131,645.05 | 144,309.30 | 1.48 | 否 |
| 23 | 006080 | 海富通电子信息传媒产业股 | 契约型开放式 | 40,123.19 | 115,811.58 | 1.19 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|------------------------|--------------|------------|-----------|------|---|
| | | 票 C | | | | | |
| 24 | 516640 | 富国中证芯片产业 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 144,000.00 | 95,904.00 | 0.98 | 否 |
| 25 | 515880 | 国泰中证全指通信设备 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 68,000.00 | 89,080.00 | 0.91 | 否 |
| 26 | 000893 | 工银瑞信创新动力股票 | 契约型开放式 | 78,676.69 | 84,105.38 | 0.86 | 否 |
| 27 | 151001 | 银河稳健混合 | 契约型开放式 | 29,329.10 | 62,253.95 | 0.64 | 是 |
| 28 | 005609 | 富国军工主题混合 A | 契约型开放式 | 27,101.97 | 44,146.40 | 0.45 | 否 |
| 29 | 515450 | 南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF | 交易型开放式 (ETF) | 19,000.00 | 25,821.00 | 0.26 | 否 |
| 30 | 588380 | 富国中证科创创业 50ETF | 交易型开放式 (ETF) | 41,700.00 | 24,227.70 | 0.25 | 否 |
| 31 | 516950 | 银华中证基建 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 21,300.00 | 23,472.60 | 0.24 | 否 |
| 32 | 009439 | 西部利得中证国有企业 | 上市契约型开 | 12,906.38 | 22,957.87 | 0.24 | 否 |

| | | | | | | | |
|--|--|---------------------------|-------------|--|--|--|--|
| | | 业红利 指数增 强 (LOF)C | 放式 (LOF) | | | | |
|--|--|---------------------------|-------------|--|--|--|--|

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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 | 115.52 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 115.52 |

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.13.6 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。

§ 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

| 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 (%) |
|----|--------------|---------------|---------------|----------|---------------|
| 10 | 1,000,439.67 | 10,000,000.00 | 99.96 | 4,396.70 | 0.04 |

8.2 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 | 2,853.12 | 0.0285 |

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 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发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 |

8.4 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 | 99.96 | 10,000,000.00 | 99.96 | 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 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 99.96 | 10,000,000.00 | 99.96 | 自基金合同生效之日起持有期限不少于3年。 |

§ 9 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 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 10,042,328.40 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,337.89 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 39,269.59 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |

| | |
|-------------|---------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 10,004,396.70 |
|-------------|---------------|

§ 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：

- 1、2023 年 1 月 11 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，金立国先生担任银河基金管理有限公司副总经理。
- 2、2023 年 6 月 8 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，史平武先生担任银河基金管理有限公司总经理。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

“博时富瑞纯债债券 A（004200.OF）自 2023 年 2 月 20 日起降低博时富瑞纯债债券型证券投资基金的托管费费率，将托管费费率由 0.10%调整为 0.08%；

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。”

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施- | 内容 |
|---------------|----|
| 受到稽查或处罚等措施的主体 | 无 |
| 受到稽查或处罚等措施的时间 | - |
| 采取稽查或处罚等措施的机构 | 无 |
| 受到的具体措施类型 | 无 |

| | |
|-----------------------|---|
| 受到稽查或处罚等措施的原因 | 无 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 无 |
| 其他 | 无 |

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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 (%) | |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 网信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 3 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 浙商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 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。

10.8.2 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 (%) |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 网信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|---|---|------------|--------|
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | 980,619.20 | 100.00 |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.9 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 | 银河基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 《中国证券报》、公司网站 | 2023 年 1 月 11 日 |
| 2 | 银河基金管理有限公司 2022 年年度报告提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站 | 2023 年 3 月 29 日 |
| 3 | 银河基金管理有限公司 2023 年第一季度提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 4 | 银河基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 《中国证券报》、公司网站 | 2023 年 6 月 8 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|------|------|------|------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |

| | | | | | | | |
|--|---|-----------------------|-------------------|---|---|---------------|-------|
| 机构 | 1 | 20230101-202 30630 | 10,000,00 0.00 | - | - | 10,000,000.00 | 99.96 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河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

12.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 楼

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38568888 /400-820-0860

公司网址：<http://www.cgf.cn>

银河基金管理有限公司

2023 年 8 月 26 日