

银河龙头精选股票型发起式证券投资基金
清算报告

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023年9月8日

§ 1 重要提示

银河龙头精选股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河龙头精选股票型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2019]2610号文注册公开募集。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380,213,886.69份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(20)第00229号的验资报告。基金合同于2020年8月6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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《银河基金管理有限公司关于旗下部分基金增加C类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》,本基金自2022年11月7日起增加收取销售服务费的C类基金份额,并对本基金的基金合同作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的C类基金份额后,原有的基金份额将全部自动转换为本基金A类基金份额。在投资者申购时收取申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类基金份额;在投资者申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额;C类基金份额仅在场外申购、赎回。本基金A类和C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中约定:

“《基金合同》生效满3年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,《基金合同》应当终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

根据《银河基金管理有限公司关于银河龙头精选股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,截至2023年8月6日日终,本基金的基金资产规模低于2亿元,已触发基金合同终止事由,本基金根据《基金合同》约定进入清算程序并终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金最后运作日为2023年8月6日,自

2023年8月7日起进入清算期。

由基金管理人银河基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2023年8月7日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金名称	银河龙头精选股票型发起式证券投资基金
基金简称	银河龙头股票
基金主代码	008709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年8月6日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末（2023年8月6日）基金份额总额	120,303,414.65份
基金合同存续期	不定期
投资目标	本基金投资于内地和香港市场，通过深入的基本面研究，精选各行业及细分行业中的龙头企业进行投资，在严格控制风险的前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金在综合分析多方面因素的基础上，将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间进行配置，同时采取积极主动的股票投资和债券投资策略，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金以价值投资理念为导向，选择优势行业中的龙头企业作为主要投资目标。</p> <p>（1）龙头企业的界定</p> <p>本基金主要投资于各行业及细分行业的龙头企业，本基金所定义的“龙头企业”主要是指在所处行业中规模领先、市场份额大、盈利能力强、成长性高的上市公司。</p> <p>（2）港股通标的股票投资策略</p> <p>（3）个股精选策略</p> <p>3、股指期货投资策略；4、债券投资策略；5、可转换债券、可交换债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、存托凭证投资策略</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率(使用估值

	汇率折算)*30%+中债综合全价指数收益率*15%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金如投资于法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场,除需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	银河龙头股票 A	银河龙头股票 C
下属分级基金的交易代码	008709	016982
报告期末(2023年8月6日)下属分级基金的份额总额	119,718,645.45 份	584,769.20 份

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2019] 2610号《关于准予银河龙头精选股票型发起式证券投资基金注册的批复》的注册,由基金管理人银河基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2020年8月6日生效,首次设立募集规模为380,213,886.69份基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《银河龙头精选股票型发起式证券投资基金基金合同》等有关规定,截至2023年8月6日日终,本基金的基金资产规模低于2亿元,已触发基金合同终止事由,本基金根据《基金合同》约定进入清算程序并终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金最后运作日为2023年8月6日,自2023年8月7日起进入清算期。本基金的清算期间为2023年8月7日(清算开始日)起至2023年8月11日(清算结束日)止期间。自本基金基金合同生效日至最后运作日期间,本基金按基金合同约定正常运作。

本基金的清算报表仅为供本基金基金管理人用以本基金清算相关监管报送或公告之目的而编制,清算报表以非持续经营为基础编制。因此,清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债,期末资产项目以预计可收回金额列报,负债项目按照需要偿付的金额列报。清算报表仅列示了2023年8月6日(最后运作日)的清算资产负债表和2023年8月7日(清算开始日)至2023年8月11日(清算结束日)止清算期间的清算损益表及重要报表项目说明,除上述内容外,本基金遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《银河基金管理有限公司关于银河龙头精选股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》及基金合同的有关规定。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：银河龙头精选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年8月6日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2023年8月6日
资产：	
银行存款	9,974,715.21
结算备付金	156,282.39
存出保证金	26,893.64
交易性金融资产	60,980,145.06
其中：股票投资	60,980,145.06
买入返售金融资产	-
应收清算款	1,511,613.46
应收申购款	17,871.26
其他资产	0.56
资产总计	72,667,521.58
负债和所有者权益	最后运作日 2023年8月6日
负债：	
应付清算款	1.49
应付赎回款	4,887,533.24
应付管理人报酬	17,629.56
应付托管费	2,938.26
应付销售服务费	21.67
应交税费	0.41
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	100,522.28
负债合计	5,008,646.91
所有者权益：	
实收基金	120,303,414.65
未分配利润	-52,644,539.98
所有者权益合计	67,658,874.67
负债和所有者权益总计	72,667,521.58

注：1、本基金最后运作日2023年8月6日，银河龙头股票A基金份额净值0.5624元，基金份额总额119,718,645.45份；银河龙头股票C基金份额净值0.5611元，基金份额总额584,769.20份。银河龙头股票份额总额合计为120,303,414.65份。

2、财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师张楠、汪霞签字出具了毕马威华振审字第 2309271 号无保留意见带强调事项段和其他事项段的审计报告。

§ 5 基金财产分配

自 2023 年 8 月 7 日至 2023 年 8 月 11 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2 资产处置情况

5.2.1 本基金最后运作日银行存款余额为人民币 9,974,715.21 元，其中活期存款人民币 9,972,695.77 元，应计活期存款利息为人民币 2,019.44 元，该款项未结息部分将由基金管理人以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.2.2 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 156,282.39 元。其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的结算备付金为人民币 155,945.99 元，将于 2023 年 9 月 8 日调整。应计结算备付金利息为人民币 336.40 元，该款项未结息部分将由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.2.3 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 26,893.64 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的存出保证金为人民币 26,836.82 元，将于 2023 年 9 月 4 日全额调回托管户。应计存出保证金利息为人民币 56.82 元，该款项未结息部分将由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.2.4 本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币 60,980,145.06 元，已于 2023 年 8 月 7 日全部处置变现。

5.2.5 本基金最后运作日应收清算款余额为人民币 1,511,613.46 元。该款项已于 2023 年 8 月 7 日划入托管账户。

5.2.6 本基金最后运作日应收申购款余额为人民币 17,871.26 元。该款项已于 2023 年 8 月 7 日划入托管户。

5.2.7 本基金最后运作日其他资产为应收申购款利息人民币 0.56 元，该款项已于 2023 年 8 月 11 日划入托管账户。

5.3 负债清偿情况

5.3.1 本基金最后运作日应付清算款余额为人民币 1.49 元，该款项已于 2023 年 8 月 7 日支付完毕。

5.3.2 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 4,887,533.24 元，该款项分别于 2023 年 8 月 7 日、2023 年 8 月 8 日支付完毕。

5.3.3 本基金最后运作日应付管理人报酬余额为人民币 17,629.56 元，该款项已于 2023 年 8 月 11 日支付完毕。

5.3.4 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 2,938.26 元，该款项已于 2023 年 8 月 11 日支付完毕。

5.3.5 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 21.67 元，该款项已于 2023 年 8 月 11 日支付完毕。

5.3.6 本基金最后运作日应付税费余额为人民币 0.41 元，该款项已于 2023 年 8 月 11 日支付完毕。

5.3.7 本基金最后运作日其他负债余额为人民币 100,522.28 元，其中应付赎回费为人民币 468.20 元，该款项于 2023 年 8 月 8 日支付完毕；应付交易费用为人民币 37,342.02 元，该款项于 2023 年 8 月 11 日支付完毕；预提 2023 年度审计费为人民币 14,930.82 元，作为清算审计费，该款项将于清算结束后支付；预提 2023 年度信息披露费为人民币 47,781.24 元，该款项将于清算结束后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

项目	自 2023 年 8 月 7 日至 2023 年 8 月 11 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	1,411.63
2、投资收益（注 2）	1,719,847.67
3、公允价值变动损益（注 3）	-2,061,291.38
4、其他收入（注 4）	2,240.78
清算收入小计	-337,791.30
二、清算费用	

1、其他费用（注5）	20,007.37
清算费用小计	20,007.37
三、清算净收益	-357,798.67

注1：利息收入为计提的自2023年8月7日至2023年8月11日止清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入和存出保证金利息收入。该款项将于下一个结息日划入托管账户；

注2：投资收益为2023年8月7日资产变现产生的收益；

注3：公允价值变动损益为2023年8月7日资产变现产生的公允价值变动损益；

注4：其他收入为赎回产生归基金资产的赎回补偿收入人民币2,240.78元；

注5：其他费用为深港通股票持仓产生的证券组合费人民币7.37元、清算律师费人民币20,000.00元。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2023年8月6日基金净资产	67,658,874.67
加：清算期间净收益	-357,798.67
加：基金净申购转入金额（于2023年8月7日确认的投资者申购申请）	7,156.59
减：基金净赎回转出金额（于2023年8月7日确认的投资者赎回申请）	6,148,637.79
二、2023年8月11日基金资产净值	61,159,594.80

根据本基金的基金合同以及《银河基金管理有限公司关于银河龙头精选股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2023年8月11日止的剩余财产为人民币61,159,594.80元。其中银河龙头股票A剩余财产为人民币60,944,536.87元，银河龙头股票C剩余财产为人民币215,057.93元。

截至2023年8月11日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额（不含利息）共人民币61,098,247.56元。

清算起始日（2023年8月7日）至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息、结算备付金利息、存出保证金利息归基金份额持有人所有。该款项未结息部分由基金管理人垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、银河龙头精选股票型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、《银河龙头精选股票型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站：

<http://www.cgf.cn>

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所免费查阅。

银河龙头精选股票型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2023年8月11日(清算报告出具日期)