

银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	5
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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
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	13
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
§ 5 托管人报告	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	银河沪深 300 指数增强	
基金主代码	007275	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 8 月 29 日	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	125,279,521.81 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 指数增强 A	银河沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	007275	007276
报告期末下属分级基金的份额总额	56,623,304.23 份	68,656,217.58 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过量化方法进行积极主动的指数组合管理与风险控制，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，实现超越标的指数的业绩表现，获取基金资产的长期增值。
投资策略	1、股票投资策略：（1）指数增强量化投资策略：本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数中权重的偏离，以控制跟踪误差，进而达成对标的指数的跟踪目标；本基金的增强量化策略主要采用多因子选股及事件驱动策略相结合的模式进行投资组合配置，并结合风险模型进行基金整体风险进行调控；（2）股票组合调整及风险控制；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生品投资策略：（1）股指期货投资策略；（2）权证投资策略；5、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建
	联系电话	021-38568989
		郭明
		010-66105799

电子邮箱	qinchangjian@cgf.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-820-0860	95588
传真	021-38568769	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	宋卫刚	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 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(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	银河沪深 300 指数增强 A	银河沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	-808,752.05	-1,044,465.98
本期利润	1,755,787.21	2,364,172.15
加权平均基金份额 本期利润	0.0321	0.0335
本期加权平均净 值利润率	2.71%	2.89%
本期基金份额净 值增长率	2.82%	2.55%
3.1.2 期末数 和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	2,161,216.79	731,435.01

期末可供分配基金份额利润	0.0382	0.0107
期末基金资产净值	67,591,482.46	79,973,808.39
期末基金份额净值	1.1937	1.1648
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	24.95%	21.92%

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

银河沪深 300 指数增强 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	-2.07%	0.44%	-3.14%	0.46%	1.07%	-0.02%
过去三个月	-0.23%	0.67%	-2.03%	0.72%	1.80%	-0.05%
过去六个月	2.82%	0.82%	0.88%	0.85%	1.94%	-0.03%
过去一年	-5.70%	0.78%	-9.38%	0.83%	3.68%	-0.05%
过去三年	-23.40%	0.95%	-32.19%	0.99%	8.79%	-0.04%
自基金合同生效起至今	24.95%	1.06%	-8.12%	1.09%	33.07%	-0.03%

银河沪深 300 指数增强 C

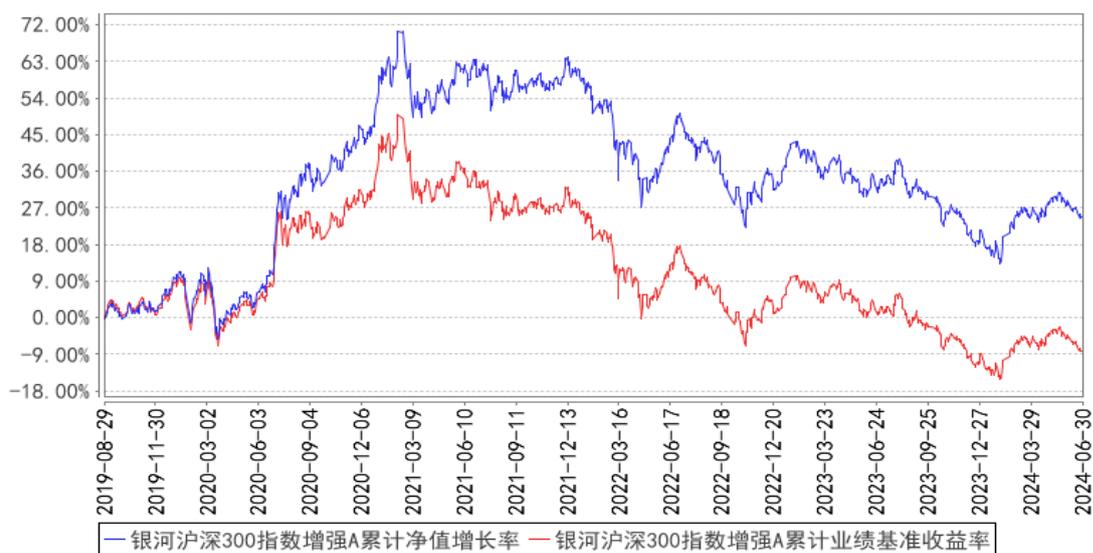
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.12%	0.44%	-3.14%	0.46%	1.02%	-0.02%
过去三个月	-0.35%	0.67%	-2.03%	0.72%	1.68%	-0.05%
过去六个月	2.55%	0.82%	0.88%	0.85%	1.67%	-0.03%

过去一年	-6.18%	0.78%	-9.38%	0.83%	3.20%	-0.05%
过去三年	-24.55%	0.95%	-32.19%	0.99%	7.64%	-0.04%
自基金合同生效起 至今	21.92%	1.06%	-8.12%	1.09%	30.04%	-0.03%

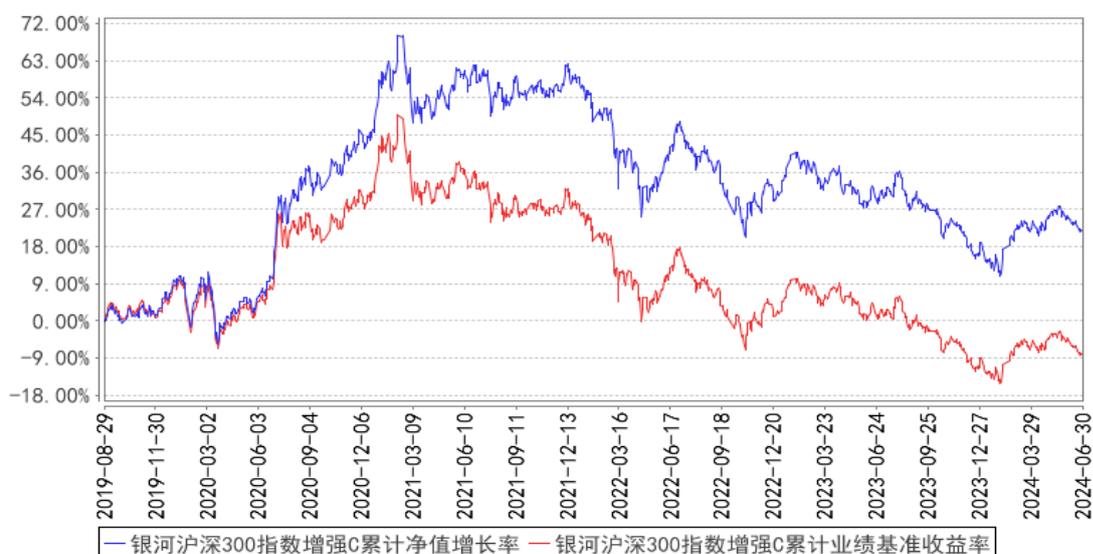
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。

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

银河沪深300指数增强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指数增强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：按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定：本基金股票投资的比例不小于基金资产净值的 80%；现金的比例不小于

基金资产净值的 5%。截至本报告期末，本基金各项资产配置符合合同约定。

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、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主

题灵活配置混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金 (LOF)、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金、银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银河和美生活主题混合型证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金、银河中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、银河乐活优萃混合型证券投资基金、银河丰泰 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、银河久泰纯债债券型证券投资基金、银河天盈中短债债券型证券投资基金、银河新动能混合型证券投资基金、银河聚星两年定期开放债券型证券投资基金、银河睿鑫纯债债券型证券投资基金、银河臻优稳健配置混合型证券投资基金、银河聚利 87 个月定期开放债券型证券投资基金、银河产业动力混合型证券投资基金、银河医药健康混合型证券投资基金、银河颐年稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银河兴益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银河悦宁稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银河成长优选一年持有期混合型证券投资基金、银河核心优势混合型证券投资基金、银河中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、银河季季盈 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、银河价值成长混合型证券投资基金、银河景气行业混合型证券投资基金、银河成长远航混合型证券投资基金、银河中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银河星汇 30 天持有期债券型证券投资基金、银河景泰纯债债券型证券投资基金、银河高端装备混合型发起式证券投资基金、银河国企主题混合型发起式证券投资基金、银河新材料股票型发起式证券投资基金、银河中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河招益 6 个月持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗博	本基金的基金经理	2021 年 6 月 7 日	-	19 年	中共党员，博士研究生学历，19 年证券从业经历。曾就职于华夏银行股份有限公司、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，现任量化与 FOF 投资部总监助理、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，2013 年 3 月至 2018 年 8 月担任银河沪深 300 成长

					增强指数分级证券投资基金的基金经理，2014 年 3 月至 2023 年 11 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（原为“银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金”）基金经理，2016 年 12 月至 2023 年 10 月任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 9 月至 2018 年 12 月担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 2 月至 2024 年 5 月担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 2 月起担任银河量化稳进混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任银河沪深 300 指数增强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的基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 4 月任银河量化价值混合型证券投资基金的基金经理。
黄栋	本基金的基金经理	2022 年 1 月 19 日	-	18 年	硕士研究生学历，CFA，18 年证券从业经历。曾先后就职于东方证券股份有限公司、工银瑞信基金管理有限公司、上投摩根基金管理有限公司、金鹰基金管理有限公司、人保资产管理有限公司，从事研究、投资相关工作。2021 年 10 月加入银河基金管理有限公司，现任量化与 FOF 投资部副总监（主持工作）、基金经理。2022 年 1 月起担任银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理，2023 年 10 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，2023 年 11 月起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，2024 年 5 月起担任银河中证机器人指数发起式证券投资基金的基金经理。

注：1、上表中任职日期为公司作出决定之日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、勤勉尽责、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合

法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金份额持有人的利益，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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。

由于本基金为指数增强基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略。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

本基金的选股，主要对指数成分股采用传统的多因子分析技术，在稳定跟踪指数的基础上，希望获得适度的超额收益；对于指数增强部分，灵活运用事件驱动策略，以及机器学习方法，构

建投资组合，希望获得较好的超额收益。

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 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1937 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.82%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%；截至本报告期末银河沪深 300 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1648 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.55%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国市场在博弈美联储何时降息，展望后续，美国经济或将面临加息的累积效用和经济增长能力的再平衡，加息是否适度、是否引发了衰退，需要在经济运行中验证。2024 年三季度，是否会引发降息，都需要密切关注。

国内经济还处于信心恢复的过程中，但在此过程中，部分有内生增长能力、具有经营性现金流创造能力的公司或将脱颖而出，特别是在国际竞争中有比较优势，能够走出去的公司，同时特别关注有安全边际的低估值、高股息的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》有关约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金截至 2024 年 06 月 30 日，银河沪深 300 指数增强 A 可供分配利润为 2,161,216.79 元，银河沪深 300 指数增强 C 可供分配利润为 731,435.01 元，本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——银河基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银河基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	12,784,408.58	11,282,285.60
结算备付金		7,958.81	7,897.06
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	135,470,123.78	132,946,869.50
其中：股票投资		135,470,123.78	132,946,869.50
基金投资		-	-
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		538,985.28	1,082,500.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		148,801,476.45	145,319,552.98
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		970,289.83	272,251.32
应付管理人报酬		122,786.64	114,621.67
应付托管费		24,557.33	22,924.33
应付销售服务费		33,954.45	30,235.09
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	84,597.35	311,276.59
负债合计		1,236,185.60	751,309.00
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	125,279,521.81	126,030,730.24
未分配利润	6.4.7.12	22,285,769.04	18,537,513.74
净资产合计		147,565,290.85	144,568,243.98
负债和净资产总计		148,801,476.45	145,319,552.98

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，银河沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.1937 元，基金份额总额 56,623,304.23 份；银河沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 1.1648 元，基金份额总额 68,656,217.58 份。银河沪深 300 指数增强份额总额合计为 125,279,521.81 份。

6.2 利润表

会计主体：银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,295,443.74	1,471,749.34
1. 利息收入		16,926.16	22,634.99
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,926.16	22,634.99
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-722,485.75	-9,205,044.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,348,453.53	-10,362,856.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	3,764.51
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	1,625,967.78	1,154,046.53
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	5,973,177.39	10,649,200.69
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	27,825.94	4,958.64
减：二、营业总支出		1,175,484.38	888,086.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	729,465.90	564,804.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	145,893.19	112,960.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	203,300.11	114,255.14
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	96,825.18	96,065.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,119,959.36	583,662.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,119,959.36	583,662.92

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,119,959.36	583,662.92

6.3 净资产变动表

会计主体：银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	126,030,730.24	-	18,537,513.74	144,568,243.98
二、本期期初净资产	126,030,730.24	-	18,537,513.74	144,568,243.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-751,208.43	-	3,748,255.30	2,997,046.87
(一)、综合收益总额	-	-	4,119,959.36	4,119,959.36
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-751,208.43	-	-371,704.06	-1,122,912.49
其中：1. 基金申购款	87,540,103.33	-	14,756,425.52	102,296,528.85
2. 基金赎回款	-88,291,311.76	-	-15,128,129.58	-103,419,441.34
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	125,279,521.81	-	22,285,769.04	147,565,290.85
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	123,876,300.79	-	31,806,473.78	155,682,774.57
二、本期期初净资产	123,876,300.79	-	31,806,473.78	155,682,774.57

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-49,363,162.08	-	-12,745,931.84	-62,109,093.92
(一)、综合收益总额	-	-	583,662.92	583,662.92
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-49,363,162.08	-	-13,329,594.76	-62,692,756.84
其中：1. 基金申购款	18,754,374.11	-	6,012,173.69	24,766,547.80
2. 基金赎回款	-68,117,536.19	-	-19,341,768.45	-87,459,304.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	74,513,138.71	-	19,060,541.94	93,573,680.65

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：

史平武

史平武

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 指数增强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》、银河沪深 300 指数增强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]621 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 82,698,300.04 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(19)第 00005 号的验资报告。基金合同于 2019 年 8 月 29 日生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金份额分为 A 类基金份额(以下简称“银河沪深 300 指数增强 A”)和 C 类基金份额(以下简称“银河沪深 300 指数增强 C”)两类份额。其中,银河沪深 300 指数增强 A 是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;银河沪深 300 指数增强 C 是指在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

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 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股和存托凭证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券等)、货币市场工具(含银行存款、同业存单等)、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 95%+同期银行活存款利率(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。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况、2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,510,147.34
等于：本金	7,509,540.32
加：应计利息	607.02
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	5,274,261.24
等于：本金	5,274,002.15
加：应计利息	259.09
减：坏账准备	-
合计	12,784,408.58

注：其他存款是指存放在证券经纪商国投证券经纪专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	140,003,330.89	-	135,470,123.78	-4,533,207.11
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	140,003,330.89	-	135,470,123.78	-4,533,207.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末无期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末无黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内无需按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期内无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期内无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6.47
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	74,590.88
应付指数使用费	10,000.00
合计	84,597.35

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银河沪深 300 指数增强 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,405,608.51	56,405,608.51
本期申购	28,035,780.38	28,035,780.38
本期赎回（以“-”号填列）	-27,818,084.66	-27,818,084.66
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	56,623,304.23	56,623,304.23

银河沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,625,121.73	69,625,121.73
本期申购	59,504,322.95	59,504,322.95
本期赎回（以“-”号填列）	-60,473,227.10	-60,473,227.10
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	68,656,217.58	68,656,217.58

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 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,918,971.45	6,162,732.82	9,081,704.27
本期期初	2,918,971.45	6,162,732.82	9,081,704.27
本期利润	-808,752.05	2,564,539.26	1,755,787.21
本期基金份额交易产生的变动数	50,997.39	79,689.36	130,686.75
其中：基金申购款	959,239.79	4,335,870.52	5,295,110.31
基金赎回款	-908,242.40	-4,256,181.16	-5,164,423.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,161,216.79	8,806,961.44	10,968,178.23

银河沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,871,855.94	7,583,953.53	9,455,809.47
本期期初	1,871,855.94	7,583,953.53	9,455,809.47
本期利润	-1,044,465.98	3,408,638.13	2,364,172.15
本期基金份额交易产生的变动数	-95,954.95	-406,435.86	-502,390.81
其中：基金申购款	225,765.65	9,235,549.56	9,461,315.21
基金赎回款	-321,720.60	-9,641,985.42	-9,963,706.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	731,435.01	10,586,155.80	11,317,590.81

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	11,681.82	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	5,082.52	
结算备付金利息收入	61.75	
其他	100.07	
合计	16,926.16	

注：其他存款利息收入是指存放在国投证券的证券交易结算资金的利息收入。

其他为申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,348,453.53	
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	-2,348,453.53	

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	110,988,542.51	
减：卖出股票成本总额	113,169,116.46	
减：交易费用	167,879.58	
买卖股票差价收入	-2,348,453.53	

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	1,625,967.78
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	1,625,967.78

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,973,177.39
股票投资	5,973,177.39
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	5,973,177.39

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	27,824.85
基金转换费收入	1.09
合计	27,825.94

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,234.30
指数使用费	20,000.00
合计	96,825.18

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司（“银河基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
银河证券	-	-	111,649,476.23	40.07

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
银河证券	102,862.91	39.81	63,261.98	39.19

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金或买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	729,465.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	258,416.97	100,886.51
应支付基金管理人的净管理费	471,048.93	463,918.37

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×1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	145,893.19

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河沪深 300 指数增强 A	银河沪深 300 指数增强 C	合计
银河基金	-	33,873.62	33,873.62
银河证券	-	985.32	985.32
合计	-	34,858.94	34,858.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河沪深 300 指数增强 A	银河沪深 300 指数增强 C	合计
银河基金	-	74,096.16	74,096.16
银河证券	-	3,562.16	3,562.16
合计	-	77,658.32	77,658.32

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按基金前一日 C 类基金资产净值×0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：银河沪深 300 指数增强 C 的日销售服务费=前一日银河沪深 300 指数增强 C 基金资产净值×0.50%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比区间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	银河沪深 300 指数增强 A	银河沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日(2019 年 8 月 29 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,100.02	5,001,100.02
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	5,000,100.02	5,001,100.02
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	银河沪深 300 指数增强 A	银河沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日(2019 年 8 月 29 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,100.02	5,001,100.02
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,100.02	5,001,100.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.4057%	16.3037%

注：1、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。

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

6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	7,510,147.34	11,681.82	6,646,989.98	20,990.08

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比区间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股锁定	16.20	15.95	191	3,094.20	3,046.45	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.48	53	1,127.84	1,562.44	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1-6个月（含）	新股流通受限	18.65	18.65	708	13,204.20	13,204.20	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.34	50	1,451.00	1,267.00	-
603325	博	2024	6个月	新股	72.46	68.02	22	1,594.12	1,496.44	-

	隆技术	年1月3日		锁定						
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	54	1,035.72	1,223.64	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1-6个月(含)	新股流通受限	20.56	20.56	737	15,152.72	15,152.72	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定	38.18	38.88	39	1,489.02	1,516.32	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定	23.35	26.59	49	1,144.15	1,302.91	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定	9.60	18.96	344	3,302.40	6,522.24	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定	22.66	15.87	217	4,917.22	3,443.79	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定	19.86	49.38	151	2,998.86	7,456.38	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	209.54	53	4,608.88	11,105.62	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.54	112	2,512.16	3,532.48	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定	15.69	18.77	269	4,220.61	5,049.13	-

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。本基金为指数增强基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略。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 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	12,784,408.58	-	-	-	-	-	12,784,408.58
结算备付金	7,958.81	-	-	-	-	-	7,958.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	135,470,123.78	135,470,123.78
应收申购款	-	-	-	-	-	538,985.28	538,985.28
资产总计	12,792,367.39	-	-	-	-	136,009,109.06	148,801,476.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	970,289.83	970,289.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	122,786.64	122,786.64
应付托管费	-	-	-	-	-	24,557.33	24,557.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	33,954.45	33,954.45
其他负债	-	-	-	-	-	84,597.35	84,597.35
负债总计	-	-	-	-	-	1,236,185.60	1,236,185.60
利率敏感度缺口	12,792,367.39	-	-	-	-	134,772,923.46	147,565,290.85
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	11,282,285.60	-	-	-	-	-	11,282,285.60
结算备付金	7,897.06	-	-	-	-	-	7,897.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	132,946,869.50	132,946,869.50
应收申购款	-	-	-	-	-	1,082,500.82	1,082,500.82
资产总计	11,290,182.66	-	-	-	-	134,029,370.32	145,319,552.98
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	272,251.32	272,251.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	114,621.67	114,621.67

应付托管费	-	-	-	-	22,924.33	22,924.33
应付销售服务费	-	-	-	-	30,235.09	30,235.09
其他负债	-	-	-	-	311,276.59	311,276.59
负债总计	-	-	-	-	751,309.00	751,309.00
利率敏感度缺口	11,290,182.66	-	-	-	-133,278,061.32	144,568,243.98

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本基金所有的资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金为指数增强基金，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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例(%)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
交易性金融资产—股票投资	135,470,123.78	91.80	132,946,869.50	91.96
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	135,470,123.78	91.80	132,946,869.50	91.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、测算时期为 3 个月，对于交易少于 3 个月的资产，默认其波动与指数同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	6,414,107.49	6,289,562.51
	沪深 300 指数下降 5%	-6,414,107.49	-6,289,562.51

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	135,393,242.02	132,925,903.68
第二层次	76,881.76	20,965.82
第三层次	-	-

合计	135,470,123.78	132,946,869.50
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、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 2024 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	135,470,123.78	91.04
	其中：股票	135,470,123.78	91.04
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	12,792,367.39	8.60
8	其他各项资产	538,985.28	0.36
9	合计	148,801,476.45	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	1,763,728.80	1.20
B	采矿业	7,101,111.52	4.81
C	制造业	62,301,970.03	42.22

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,518,061.00	3.74
E	建筑业	2,237,429.00	1.52
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,349,927.50	2.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,412,560.55	3.67
J	金融业	29,995,773.47	20.33
K	房地产业	972,267.00	0.66
L	租赁和商务服务业	1,060,281.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	746,961.40	0.51
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	380,013.36	0.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	121,840,084.63	82.57

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	299,980.00	0.20
C	制造业	7,544,088.63	5.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	286,342.00	0.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,281,580.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,620,192.38	1.10
J	金融业	627,743.00	0.43
K	房地产业	984,692.00	0.67
L	租赁和商务服务业	56,243.99	0.04

M	科学研究和技术服务业	301,251.70	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	337,765.45	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	290,160.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,630,039.15	9.24

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	600519	贵州茅台	4,900	7,190,211.00	4.87
2	601318	中国平安	95,760	3,960,633.60	2.68
3	300750	宁德时代	21,880	3,939,056.40	2.67
4	600036	招商银行	99,700	3,408,743.00	2.31
5	000333	美的集团	46,100	2,973,450.00	2.02
6	600900	长江电力	96,400	2,787,888.00	1.89
7	601899	紫金矿业	132,500	2,328,025.00	1.58
8	601166	兴业银行	117,300	2,066,826.00	1.40
9	601328	交通银行	272,800	2,037,816.00	1.38
10	000858	五粮液	15,500	1,984,620.00	1.34
11	000651	格力电器	42,800	1,678,616.00	1.14
12	002475	立讯精密	42,700	1,678,537.00	1.14
13	002594	比亚迪	6,700	1,676,675.00	1.14
14	600887	伊利股份	61,154	1,580,219.36	1.07
15	600309	万华化学	17,800	1,439,308.00	0.98
16	600030	中信证券	78,085	1,423,489.55	0.96
17	000725	京东方 A	343,500	1,404,915.00	0.95
18	601088	中国神华	31,096	1,379,729.52	0.93
19	300760	迈瑞医疗	4,700	1,367,277.00	0.93
20	600276	恒瑞医药	35,164	1,352,407.44	0.92
21	601288	农业银行	286,500	1,249,140.00	0.85
22	601816	京沪高铁	226,100	1,214,157.00	0.82
23	600000	浦发银行	146,300	1,204,049.00	0.82

24	002415	海康威视	35,600	1,100,396.00	0.75
25	300059	东方财富	101,763	1,074,617.28	0.73
26	600050	中国联通	218,800	1,028,360.00	0.70
27	600690	海尔智家	36,100	1,024,518.00	0.69
28	688981	中芯国际	22,113	1,019,409.30	0.69
29	601668	中国建筑	190,700	1,012,617.00	0.69
30	600919	江苏银行	133,300	990,419.00	0.67
31	601138	工业富联	34,200	937,080.00	0.64
32	300308	中际旭创	6,780	934,826.40	0.63
33	002714	牧原股份	21,178	923,360.80	0.63
34	601985	中国核电	84,500	900,770.00	0.61
35	600941	中国移动	8,200	881,500.00	0.60
36	300124	汇川技术	17,070	875,691.00	0.59
37	601919	中远海控	56,450	874,410.50	0.59
38	600406	国电南瑞	34,800	868,608.00	0.59
39	600028	中国石化	135,300	855,096.00	0.58
40	600031	三一重工	51,300	846,450.00	0.57
41	300498	温氏股份	42,400	840,368.00	0.57
42	000338	潍柴动力	50,400	818,496.00	0.55
43	601766	中国中车	107,900	810,329.00	0.55
44	600809	山西汾酒	3,840	809,779.20	0.55
45	000063	中兴通讯	28,800	805,536.00	0.55
46	600585	海螺水泥	33,900	799,701.00	0.54
47	601169	北京银行	135,500	791,320.00	0.54
48	000568	泸州老窖	5,500	789,195.00	0.53
49	601225	陕西煤业	30,300	780,831.00	0.53
50	300274	阳光电源	12,580	780,337.40	0.53
51	000001	平安银行	76,300	774,445.00	0.52
52	601988	中国银行	165,200	763,224.00	0.52
53	000792	盐湖股份	43,000	750,350.00	0.51
54	603259	药明康德	19,060	746,961.40	0.51
55	603501	韦尔股份	7,500	745,275.00	0.51
56	601728	中国电信	120,500	741,075.00	0.50
57	601601	中国太保	26,500	738,290.00	0.50
58	600016	民生银行	194,700	737,913.00	0.50
59	000100	TCL 科技	170,500	736,560.00	0.50
60	002371	北方华创	2,300	735,747.00	0.50
61	600837	海通证券	85,314	730,287.84	0.49
62	600893	航发动力	19,500	712,725.00	0.48
63	600660	福耀玻璃	14,600	699,340.00	0.47
64	600150	中国船舶	17,000	692,070.00	0.47
65	002352	顺丰控股	19,100	681,679.00	0.46
66	601012	隆基绿能	47,276	662,809.52	0.45

67	002142	宁波银行	29,830	658,049.80	0.45
68	600089	特变电工	44,970	623,733.90	0.42
69	002230	科大讯飞	14,400	618,480.00	0.42
70	601901	方正证券	79,600	615,308.00	0.42
71	600048	保利发展	67,400	590,424.00	0.40
72	600905	三峡能源	135,300	589,908.00	0.40
73	601006	大秦铁路	81,100	580,676.00	0.39
74	600104	上汽集团	41,800	579,348.00	0.39
75	601688	华泰证券	46,300	573,657.00	0.39
76	601229	上海银行	78,300	568,458.00	0.39
77	002027	分众传媒	93,500	566,610.00	0.38
78	600436	片仔癀	2,700	559,359.00	0.38
79	600019	宝钢股份	82,900	551,285.00	0.37
80	600938	中国海油	16,700	551,100.00	0.37
81	601211	国泰君安	40,588	549,967.40	0.37
82	601818	光大银行	170,000	538,900.00	0.37
83	688041	海光信息	7,535	529,861.20	0.36
84	601390	中国中铁	79,800	520,296.00	0.35
85	603986	兆易创新	5,300	506,786.00	0.34
86	000625	长安汽车	37,600	504,968.00	0.34
87	600886	国投电力	27,200	496,128.00	0.34
88	601888	中国中免	7,900	493,671.00	0.33
89	601600	中国铝业	63,000	480,690.00	0.33
90	601009	南京银行	45,800	475,862.00	0.32
91	600438	通威股份	24,500	468,195.00	0.32
92	600999	招商证券	33,200	461,812.00	0.31
93	603019	中科曙光	11,100	460,650.00	0.31
94	601658	邮储银行	89,900	455,793.00	0.31
95	603993	洛阳钼业	53,600	455,600.00	0.31
96	000938	紫光股份	20,100	449,235.00	0.30
97	002179	中航光电	11,734	446,478.70	0.30
98	603288	海天味业	12,900	444,663.00	0.30
99	601989	中国重工	89,100	439,263.00	0.30
100	688012	中微公司	3,108	439,036.08	0.30
101	600795	国电电力	70,300	421,097.00	0.29
102	000425	徐工机械	58,000	414,700.00	0.28
103	000538	云南白药	8,080	413,292.00	0.28
104	300014	亿纬锂能	10,200	407,184.00	0.28
105	601628	中国人寿	13,100	406,755.00	0.28
106	688111	金山办公	1,770	402,675.00	0.27
107	601669	中国电建	71,300	398,567.00	0.27
108	600547	山东黄金	14,500	397,010.00	0.27
109	688008	澜起科技	6,875	392,975.00	0.27

110	601939	建设银行	52,800	390,720.00	0.26
111	600926	杭州银行	29,900	390,195.00	0.26
112	002304	洋河股份	4,800	387,552.00	0.26
113	000002	万科 A	55,100	381,843.00	0.26
114	300015	爱尔眼科	36,823	380,013.36	0.26
115	600584	长电科技	11,900	377,349.00	0.26
116	600111	北方稀土	21,600	371,520.00	0.25
117	600760	中航沈飞	9,000	360,900.00	0.24
118	600958	东方证券	47,100	357,960.00	0.24
119	600489	中金黄金	23,900	353,720.00	0.24
120	600426	华鲁恒升	13,200	351,648.00	0.24
121	002241	歌尔股份	18,000	351,180.00	0.24
122	601916	浙商银行	125,400	346,104.00	0.23
123	688187	时代电气	6,975	344,425.50	0.23
124	002252	上海莱士	44,000	344,080.00	0.23
125	600015	华夏银行	52,900	338,560.00	0.23
126	001965	招商公路	28,500	338,010.00	0.23
127	002050	三花智控	17,600	335,808.00	0.23
128	600009	上海机场	10,300	332,175.00	0.23
129	000776	广发证券	27,100	329,807.00	0.22
130	600115	中国东航	82,000	328,820.00	0.22
131	688126	沪硅产业	23,537	325,045.97	0.22
132	600011	华能国际	33,500	322,270.00	0.22
133	688396	华润微	8,579	321,197.76	0.22
134	000977	浪潮信息	8,600	312,782.00	0.21
135	601186	中国铁建	35,700	305,949.00	0.21
136	002311	海大集团	6,500	305,825.00	0.21
137	000157	中联重科	39,300	301,824.00	0.20
138	000166	申万宏源	69,600	299,976.00	0.20
139	300408	三环集团	10,100	294,819.00	0.20
140	301269	华大九天	3,800	292,790.00	0.20
141	688256	寒武纪	1,465	291,051.55	0.20
142	300454	深信服	5,700	288,021.00	0.20
143	300999	金龙鱼	10,500	287,175.00	0.19
144	601066	中信建投	14,900	286,676.00	0.19
145	002049	紫光国微	5,300	278,780.00	0.19
146	688036	传音控股	3,377	258,475.58	0.18
147	300122	智飞生物	9,200	257,876.00	0.17
148	000596	古井贡酒	1,200	253,284.00	0.17
149	002129	TCL 中环	26,725	231,171.25	0.16
150	688363	华熙生物	1,151	65,112.07	0.04
151	600346	恒力石化	4,600	64,170.00	0.04
152	000786	北新建材	1,900	56,354.00	0.04

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	000036	华联控股	125,000	405,000.00	0.27
2	002273	水晶光电	22,100	375,258.00	0.25
3	600688	上海石化	132,400	345,564.00	0.23
4	001872	招商港口	17,500	336,875.00	0.23
5	002627	三峡旅游	69,300	334,719.00	0.23
6	600269	赣粤高速	64,500	333,465.00	0.23
7	000738	航发控制	16,500	331,155.00	0.22
8	000967	盈峰环境	78,000	329,940.00	0.22
9	300113	顺网科技	31,500	322,560.00	0.22
10	600038	中直股份	7,800	320,658.00	0.22
11	002797	第一创业	62,900	320,161.00	0.22
12	002294	信立泰	11,900	316,897.00	0.21
13	688015	交控科技	17,375	312,228.75	0.21
14	601107	四川成渝	59,200	310,800.00	0.21
15	000681	视觉中国	27,000	310,500.00	0.21
16	601579	会稽山	30,300	310,272.00	0.21
17	600602	云赛智联	28,000	309,120.00	0.21
18	601375	中原证券	90,200	307,582.00	0.21
19	688739	成大生物	12,665	306,999.60	0.21
20	688289	圣湘生物	17,443	306,647.94	0.21
21	603881	数据港	23,910	303,896.10	0.21
22	688222	成都先导	26,542	301,251.70	0.20
23	600641	万业企业	25,600	300,800.00	0.20
24	000099	中信海直	18,500	300,440.00	0.20
25	600508	上海能源	21,200	299,980.00	0.20
26	600206	有研新材	33,600	299,040.00	0.20
27	600581	八一钢铁	111,900	296,535.00	0.20
28	688065	凯赛生物	6,445	292,538.55	0.20
29	600556	天下秀	80,200	291,928.00	0.20
30	002219	新里程	156,000	290,160.00	0.20
31	000869	张裕 A	13,500	288,225.00	0.20
32	301206	三元生物	11,700	287,586.00	0.19
33	600452	涪陵电力	22,600	286,342.00	0.19
34	600997	开滦股份	41,500	284,690.00	0.19
35	605006	山东玻纤	63,400	279,594.00	0.19
36	600007	中国国贸	12,700	278,892.00	0.19
37	688598	金博股份	9,839	278,443.70	0.19
38	000553	安道麦 A	56,900	258,326.00	0.18
39	688169	石头科技	620	243,412.00	0.16
40	688617	惠泰医疗	522	238,084.20	0.16

41	301589	诺瓦星云	1,060	206,170.00	0.14
42	688032	禾迈股份	1,578	181,122.84	0.12
43	002937	兴瑞科技	3,000	69,930.00	0.05
44	600487	亨通光电	4,300	67,811.00	0.05
45	300577	开润股份	3,200	66,656.00	0.05
46	600299	安迪苏	6,700	64,990.00	0.04
47	300054	鼎龙股份	2,800	63,504.00	0.04
48	300415	伊之密	3,000	62,340.00	0.04
49	603298	杭叉集团	3,160	62,062.40	0.04
50	300218	安利股份	4,100	61,828.00	0.04
51	603239	浙江仙通	4,500	61,695.00	0.04
52	300286	安科瑞	2,800	60,592.00	0.04
53	300491	通合科技	4,200	60,312.00	0.04
54	688777	中控技术	1,594	60,093.80	0.04
55	300662	科锐国际	3,400	54,842.00	0.04
56	300866	安克创新	700	49,847.00	0.03
57	300842	帝科股份	1,200	46,560.00	0.03
58	603350	安乃达	737	15,152.72	0.01
59	603285	键邦股份	708	13,204.20	0.01
60	688692	达梦数据	53	11,105.62	0.01
61	688691	灿芯股份	151	7,456.38	0.01
62	688530	欧莱新材	344	6,522.24	0.00
63	688709	成都华微	269	5,049.13	0.00
64	688352	颀中科技	327	3,731.07	0.00
65	688695	中创股份	112	3,532.48	0.00
66	688584	上海合晶	217	3,443.79	0.00
67	601033	永兴股份	191	3,046.45	0.00
68	603082	北自科技	53	1,562.44	0.00
69	603375	盛景微	39	1,516.32	0.00
70	603325	博隆技术	22	1,496.44	0.00
71	603373	安邦护卫	51	1,401.99	0.00
72	603381	永臻股份	49	1,302.91	0.00
73	603312	西典新能	50	1,267.00	0.00
74	603344	星德胜	54	1,223.64	0.00
75	603004	鼎龙科技	65	1,101.75	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	600519	贵州茅台	1,633,915.00	1.13
2	600900	长江电力	1,371,515.00	0.95
3	300750	宁德时代	1,332,347.00	0.92

4	601318	中国平安	1,247,551.00	0.86
5	600036	招商银行	1,125,619.00	0.78
6	601328	交通银行	970,486.00	0.67
7	601899	紫金矿业	848,785.00	0.59
8	601166	兴业银行	794,961.00	0.55
9	000333	美的集团	790,517.00	0.55
10	300760	迈瑞医疗	771,588.00	0.53
11	002594	比亚迪	771,542.00	0.53
12	000002	万科 A	757,668.00	0.52
13	600115	中国东航	734,968.00	0.51
14	600926	杭州银行	715,295.00	0.49
15	601916	浙商银行	699,218.00	0.48
16	601288	农业银行	693,636.00	0.48
17	600157	永泰能源	693,007.00	0.48
18	000898	鞍钢股份	692,056.00	0.48
19	601901	方正证券	691,408.00	0.48
20	000785	居然之家	691,296.00	0.48

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	600016	民生银行	1,318,946.00	0.91
2	601318	中国平安	922,618.00	0.64
3	000883	湖北能源	813,919.00	0.56
4	603826	坤彩科技	807,729.00	0.56
5	600028	中国石化	785,101.00	0.54
6	000333	美的集团	776,825.00	0.54
7	300750	宁德时代	763,459.00	0.53
8	600104	上汽集团	754,607.00	0.52
9	600036	招商银行	742,121.00	0.51
10	002807	江阴银行	731,742.00	0.51
11	601077	渝农商行	731,479.00	0.51
12	688222	成都先导	722,292.97	0.50
13	601009	南京银行	686,954.00	0.48
14	600153	建发股份	683,532.00	0.47
15	600157	永泰能源	676,287.00	0.47
16	000898	鞍钢股份	674,367.00	0.47
17	000338	潍柴动力	672,684.00	0.47
18	000785	居然之家	668,398.00	0.46
19	000651	格力电器	665,240.00	0.46

20	600236	桂冠电力	663,223.00	0.46
----	--------	------	------------	------

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	109,719,193.35
卖出股票收入（成交）总额	110,988,542.51

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

本基金没有进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	538,985.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	538,985.28

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

本基金本报告期末指数投资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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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 (%)
银河沪深 300 指数 增强 A	5,645	10,030.70	5,640,985.89	9.96	50,982,318.34	90.04
银河沪深 300 指数 增强 C	20,177	3,402.70	1,089,285.01	1.59	67,566,932.57	98.41
合计	25,822	4,851.66	6,730,270.90	5.37	118,549,250.91	94.63

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 指数增强 A	120,971.92	0.2136
	银河沪深 300 指数增强 C	0.00	0.0000
	合计	120,971.92	0.0966

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 指数增强 A	10~50
	银河沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	银河沪深 300 指数增强 A	10~50
	银河沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起式份额已全部赎回。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河沪深 300 指数增强 A	银河沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2019 年 8 月 29 日) 基金份额总额	64,497,040.02	18,201,260.02
本报告期期初基金份额总额	56,405,608.51	69,625,121.73
本报告期基金总申购份额	28,035,780.38	59,504,322.95
减：本报告期基金总赎回份额	27,818,084.66	60,473,227.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	56,623,304.23	68,656,217.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动： 2024 年 1 月 9 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴磊先生担任基金管理公司副总经理。

二、报告期内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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国投证券	3	220,346,898.55	100.00	98,252.98	100.00	-

注：1、选择证券公司专用席位的标准：

(1) 实力雄厚；

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

2、选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国投证券	-	-	-	-	-	-

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	《中国证券报》、公司网站	2024 年 1 月 9 日
2	银河基金管理有限公司 2023 年第四季度提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2024 年 1 月 20 日
3	银河基金管理有限公司 2023 年年度报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2024 年 3 月 28 日
4	银河基金管理有限公司 2024 年 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2024 年 4 月 20 日
5	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国银河证券股份有限公司等为代销机构并开通定投、转换业务	《上海证券报》、公司网站	2024 年 4 月 22 日

	及参加费率优惠活动的公告		
6	银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	《中国证券报》、公司网站	2024 年 6 月 14 日
7	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商银行股份有限公司申购、定投费率优惠活动的公告	《上海证券报》、公司网站	2024 年 6 月 20 日
8	银河基金管理有限公司关于旗下银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金增加民生银行股份有限公司为代销机构并开通定投、转换业务及参加费率优惠的公告	《中国证券报》、公司网站	2024 年 6 月 21 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 (%)
个人	1	20240429-20240630	0.00	25,857,620.36	0.00	25,857,620.36	20.64

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沪深 300 指数增强发起式证券投资基金的文件
- 2、《银河沪深 300 指数增强发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《银河沪深 300 指数增强发起式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 指数增强发起式证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021) 38568888 / 400-820-0860

公司网址：<http://www.cgf.cn>

银河基金管理有限公司

2024 年 8 月 27 日