

银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资
基金
2025 年中期报告

2025 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 03 月 20 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	7
§ 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58

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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末上市基金前十名持有人	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4 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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	银河中证 A500ETF
基金主代码	563660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 20 日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	243,085,160.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略,原则上采取以完全复制为目标的指数跟踪方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票投资组合。并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等)导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将在拟替代成份股内选取替代成份股进行替代投资,并对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。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 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金投资策略还包括债券投资策略、股指期货投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	秦长建	任航
	联系电话	021-38568989	010-66060069

	电子邮箱	qinchangjian@cgf.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-820-0860	95599
传真		021-38568769	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		胡泊	谷澍

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 3 月 20 日(基金合同生效日) - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-12,347,104.89
本期利润	-10,954,620.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0272
本期加权平均净值利润率	-2.78%
本期基金份额净值增长率	1.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-4,903,433.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0202
期末基金资产净值	245,892,288.19
期末基金份额净值	1.0115
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.15%

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。

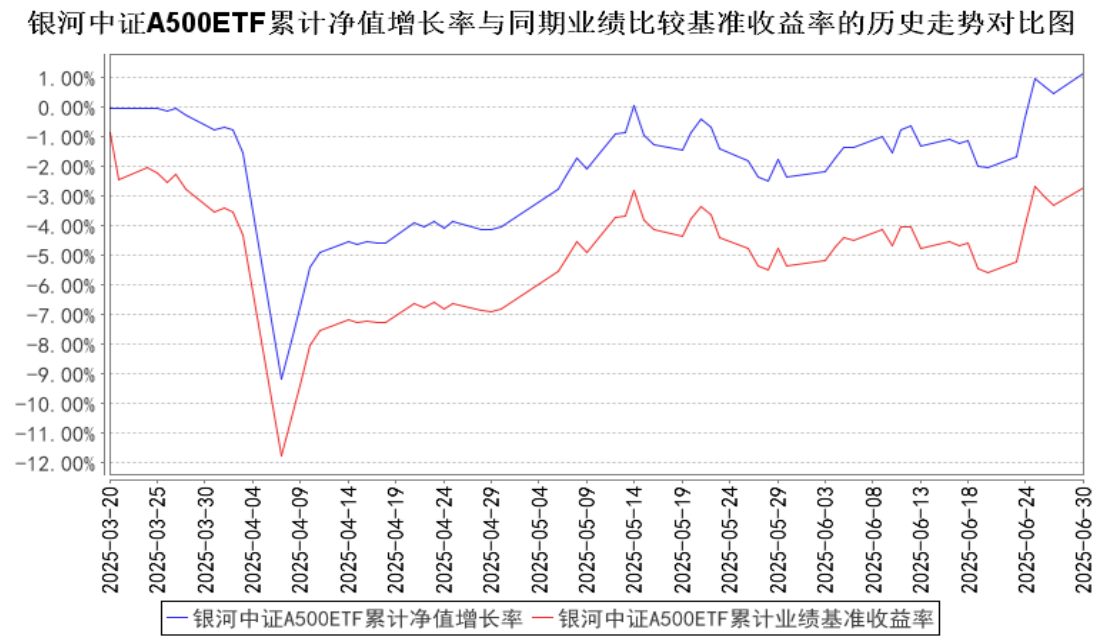
3.2 基金净值表现

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	3.57%	0.58%	2.82%	0.60%	0.75%	-0.02%
过去三个月	1.92%	1.18%	0.84%	1.20%	1.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.15%	1.11%	-2.70%	1.15%	3.85%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率。

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



注：1、本基金合同于 2025 年 3 月 20 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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、银河量化稳进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、银河中证机器人指数发起式证券投资基金、银河中证红利低波动 100 指数证券投资基金、银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金、银河 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金、银河中证通信设备主题指数发起式证券投资基金、银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金、银河科技成长混合型发起式证券投资基金、银河中证 A500 指数增强型证券投资基金、银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、银河致远养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 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		
黄栋	本基金的基金经理	2025 年 3 月 20 日	—	19 年	硕士研究生学历，CFA，19 年证券行业从业经历。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，现担任量化与 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基金经理，2023 年 10 月至 2025 年 6 月担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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基金经理，2024 年 7 月起担任银河中证红利低波动 100 指数证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2024 年 10 月起担任银河中证通信设备主题指数发起式证券投资基金、银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 1 月起担任银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025 年 3 月起担任银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 6 月起担任银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
王曦	本基金的基金助理	2025 年 3 月 24 日	—	9 年	中共党员，硕士研究生学历，9 年证券行业从业经历。2015 年 8 月加入银河基金管理有限公司，曾任量化与 FOF 投资部研究员，现担任量化与 FOF 投资部指数基金经理助理。2024 年 7 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、银河中证机器人指数发起式证券投资基金、银河中证红利低波动 100 指数证券投资基金的基金经理助理；2024 年 11 月起担任银河中证通信设备主题指数发起式证券投资基金、银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理；2025 年 1 月起担任银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理助理；2025 年 3 月起担任银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理；2025 年 6 月起担任银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。

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。

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

由于本基金采用被动式指数投资策略，原则上采取以完全复制为目标的指数跟踪方法，按照成份股在中证 A500 指数中的基准权重构建股票投资组合，并原则上根据标的指数成份股的变化或其权重的变动而进行相应调整，本报告期未发现重大异常情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况（完全复制的指数基金除外）。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

严格按照基金合同的规定，紧密跟踪业绩基准、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河中证 A500ETF 基金份额净值为 1.0115 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.15%，同期业绩比较基准收益率为-2.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济数据亮眼，下半年或许有些压力。预计下半年宽货币，宽信用的基调不变，流动性相对比较充裕，但是总量企稳的背后，结构上仍然存在较大压力，地产症结未除，居民端加杠杆意愿不强。资产荒的现象较为普遍。总量上，财政政策是主要关注点，同时财政导向已经从投资端向消费端倾斜，是比较重要的转向。当前市场已经走出低迷，风险偏好逐级抬升，但是伴随全球贸易争端升级以及地缘政治不确定性增加，市场也可能面临再平衡的风险。

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、监察部合规岗、监察部投资风控岗、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》有关规定，“1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金的收益分配方式为现金分红；
- 3、基金管理人每季度最后一个交易日（即收益评价日）对基金相对标的指数的超额收益率以及基

金的可供分配利润进行一次评估，收益评价日核定的基金净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配；

当基金收益分配根据基金相对标的指数的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构、证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整”。

本基金截至 2025 年 06 月 30 日本基金可供分配利润为-4,903,433.44 元，本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—银河基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，银河基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，银河基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务

指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	9,792,614.45
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	238,652,978.35
其中：股票投资		238,652,978.35
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	-
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		395,515.68
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		248,841,108.48
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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		2,849,588.96
应付赎回款		-
应付管理人报酬		33,115.26
应付托管费		11,038.43
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	55,077.64
负债合计		2,948,820.29
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	243,085,160.00
未分配利润	6.4.7.12	2,807,128.19
净资产合计		245,892,288.19
负债和净资产总计		248,841,108.48

注：1、报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0115 元，基金份额总额 243,085,160.00 份。

2、本基金基金合同于 2025 年 03 月 20 日生效。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 03 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-10,686,699.83
1. 利息收入		69,358.61
其中：存款利息收入	6.4.7.13	57,290.38
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		12,068.23
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,352,626.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-15,322,568.96
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	2,969,942.71
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	1,392,484.58
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	204,083.23
减：二、营业总支出		267,920.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	162,991.92
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	54,330.63
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	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		1.27
8. 其他费用	6.4.7.23	50,596.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,954,620.31
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,954,620.31
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-10,954,620.31

注：本基金基金合同于 2025 年 03 月 20 日生效。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 03 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日，无上年度可比区间。

6.3 净资产变动表

会计主体：银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 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	-	-	-	-
二、本期期初净	735,085,160.00	-	-	735,085,160.00

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 492,000,000.00	-	2,807,128.19	-489,192,871.81
(一)、综合收益总额	-	-	-10,954,620.31	-10,954,620.31
(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)	- 492,000,000.00	-	13,761,748.50	-478,238,251.50
其中：1. 基金申购款	75,000,000.00	-	-280,853.79	74,719,146.21
2. 基金赎回款	- 567,000,000.00	-	14,042,602.29	-552,957,397.71
(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	243,085,160.00	-	2,807,128.19	245,892,288.19

注：本基金基金合同于 2025 年 03 月 20 日生效。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 03 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日，无上年度可比区间。

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>管良权</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

银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以下简称“基金合同”及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会以下简称“中国证监会”以证监许可[2024]1760 号批准公开募集。本基金为交易型开放式

基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 735,085,160.00 份，经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为毕马威华振验字第 2500259 号验资报告，基金合同于 2025 年 3 月 20 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新适用的基金合同及《银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且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、国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率。

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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况、自 2025 年 03 月 20 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2025 年 03 月 20 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定期末偿付本金金额相关的信用风险、

以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

— 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

— 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

— 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

— 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

— 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

— 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形

成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	2,523,376.99
等于：本金	2,523,059.00
加：应计利息	317.99
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	7,269,237.46
等于：本金	7,269,110.14
加：应计利息	127.32
减：坏账准备	-
合计	9,792,614.45

注：其他存款是指存放在本基金证券经纪商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 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	237,260,493.77	-	238,652,978.35	1,392,484.58

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		237,260,493.77	-	238,652,978.35	1,392,484.58

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 2025 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	48,992.98
其他	6,084.66
合计	55,077.64

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	735,085,160.00	735,085,160.00
本期申购	75,000,000.00	75,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-567,000,000.00	-567,000,000.00
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	243,085,160.00	243,085,160.00

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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-12,347,104.89	1,392,484.58	-10,954,620.31
本期基金份额交易产生的变动数	7,443,671.45	6,318,077.05	13,761,748.50
其中：基金申购款	-1,676,576.44	1,395,722.65	-280,853.79
基金赎回款	9,120,247.89	4,922,354.40	14,042,602.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,903,433.44	7,710,561.63	2,807,128.19

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,463.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	16,809.61
结算备付金利息收入	-
其他	31,016.89
合计	57,290.38

注：其他存款利息收入为存放在本基金证券经纪商的证券交易结算资金利息收入。

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 2025年3月20日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,506,384.09
股票投资收益——赎回差价收入	-2,816,184.87
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	-15,322,568.96

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 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	265,866,656.96
减：卖出股票成本总额	277,982,530.78
减：交易费用	390,510.27
买卖股票差价收入	-12,506,384.09

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月20日（基金合同生效日）至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	552,957,397.71
减：现金支付赎回款总额	242,347,913.71
减：赎回股票成本总额	313,425,668.87
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,816,184.87

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票投资——申购差价收入。

6.4.7.14.5 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
	2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,969,942.71
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	2,969,942.71

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,392,484.58
股票投资	1,392,484.58
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	1,392,484.58

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	204,083.23
合计	204,083.23

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 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	11,305.28
信息披露费	32,299.77
证券出借违约金	-
银行费用	1,203.68
其他	400.00
IOPV 计算服务费	5,387.93
合计	50,596.66

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

本基金于资产负债表日后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如

下：

根据本基金管理人于 2025 年 07 月 05 日发布的分红公告，本基金向 2025 年 07 月 08 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.0300 元。

截至财务报表批准日，除上述利润分配事项外，本基金无其他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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
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
中国石油天然气集团有限公司（“中国石油”）	基金管理人的股东

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
银河证券	1,051,289,339.05	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内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 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	

	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
银河证券	250,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期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 2025年3月20日（基金合同生效日）至2025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	190,426.41	100.00	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、2024 年 7 月 1 日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。自 2024 年 7 月 1 日起，券商为本基金提供的服务按证监会相关规定执行。

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 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	162,991.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	30,092.30
应支付基金管理人的净管理费	132,899.62

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×0.15%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×0.15%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	54,330.63

注：支付基金托管人农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%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×0.05%÷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

本基金本报告期末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

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,523,376.99	9,463.88
银河证券	7,269,237.46	16,809.61

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金证券户的存款由中国银河证券股份有限公司保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期末持有中国石油（代码 601857）104,900.00 股，期末公允价值为人民币 896,895.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.36%。

本基金本报告期末持有农业银行（代码 601288）298,200.00 股，期末公允价值为人民币 1,753,416.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.71%。

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（2025 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
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股锁定	12.08	21.50	178	2,150.24	3,827.00	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	152.21	51	4,569.60	7,762.71	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	17.05	35.86	196	3,341.80	7,028.56	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.50	35.16	177	4,690.50	6,223.32	-
603049	中	2025	6 个月	新股	46.50	42.99	138	6,417.00	5,932.62	-

	策 橡 胶	年 5 月 27 日		锁定						
603382	海 阳 科 技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股 锁定	11.50	28.45	105	1,207.50	2,987.25	-
603400	华 之 杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股 锁定	19.88	49.62	57	1,133.16	2,828.34	-
688755	汉 邦 科 技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股 锁定	22.77	44.55	203	4,622.31	9,043.65	-
688775	影 石 创 新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股 锁定	47.27	156.28	243	11,486.61	37,976.04	-

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

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券资产支持证券投资。

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 2025 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	9,792,614.45	-	-	-	-	-	9,792,614.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	238,652,978.35	238,652,978.35
应收清算款	-	-	-	-	-	395,515.68	395,515.68

资产总计	9,792,614.45	-	-	-	-	239,048,494.03	248,841,108.48
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,115.26	33,115.26
应付托管费	-	-	-	-	-	11,038.43	11,038.43
应付清算款	-	-	-	-	-	2,849,588.96	2,849,588.96
其他负债	-	-	-	-	-	55,077.64	55,077.64
负债总计	-	-	-	-	-	2,948,820.29	2,948,820.29
利率敏感度缺口	9,792,614.45	-	-	-	-	-236,099,673.74	245,892,288.19

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。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 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	238,652,978.35	97.06
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	238,652,978.35	97.06

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中证 A500 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。 2、假定中证 A500 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（2025 年 6 月 30 日）
	中证 A500 指数上升 5%	12,005,294.56
	中证 A500 指数下降 5%	-12,005,294.56

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	238,553,983.32
第二层次	98,995.03

第三层次	-
合计	238,652,978.35

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 2025 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 (2024 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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 2025 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	238,652,978.35	95.91
	其中：股票	238,652,978.35	95.91
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	9,792,614.45	3.94
8	其他各项资产	395,515.68	0.16
9	合计	248,841,108.48	100.00

注：上述股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	1,275,849.00	0.52
B	采矿业	12,042,523.48	4.90
C	制造业	138,751,168.65	56.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,339,728.00	2.98
E	建筑业	4,556,035.00	1.85
F	批发和零售业	1,669,484.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	8,156,342.00	3.32
H	住宿和餐饮业	153,762.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,894,410.19	6.46
J	金融业	38,346,711.00	15.59
K	房地产业	2,622,626.00	1.07
L	租赁和商务服务业	2,704,662.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	2,756,833.00	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	496,839.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	147,492.00	0.06
Q	卫生和社会工作	974,468.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	665,365.00	0.27
S	综合	—	—
	合计	238,554,298.32	97.02

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	—	—
C	制造业	98,995.03	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	98,995.03	0.04

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	6,400	9,020,928.00	3.67
2	300750	宁德时代	27,900	7,036,938.00	2.86
3	601318	中国平安	113,300	6,285,884.00	2.56
4	600036	招商银行	128,500	5,904,575.00	2.40
5	601166	兴业银行	175,100	4,086,834.00	1.66
6	600900	长江电力	127,600	3,845,864.00	1.56
7	000333	美的集团	51,600	3,725,520.00	1.52
8	601899	紫金矿业	169,900	3,313,050.00	1.35
9	002594	比亚迪	9,600	3,186,336.00	1.30
10	300059	东方财富	132,200	3,057,786.00	1.24

11	601398	工商银行	370,800	2,814,372.00	1.14
12	600030	中信证券	101,200	2,795,144.00	1.14
13	000858	五 粮 液	20,300	2,413,670.00	0.98
14	600276	恒瑞医药	46,400	2,408,160.00	0.98
15	000651	格力电器	46,100	2,070,812.00	0.84
16	601328	交通银行	243,300	1,946,400.00	0.79
17	600919	江苏银行	157,700	1,882,938.00	0.77
18	603259	药明康德	26,900	1,870,895.00	0.76
19	600887	伊利股份	66,200	1,845,656.00	0.75
20	688981	中芯国际	20,408	1,799,373.36	0.73
21	002475	立讯精密	51,500	1,786,535.00	0.73
22	601816	京沪高铁	307,500	1,768,125.00	0.72
23	601288	农业银行	298,200	1,753,416.00	0.71
24	600000	浦发银行	118,800	1,648,944.00	0.67
25	002371	北方华创	3,600	1,591,956.00	0.65
26	000725	京东方 A	380,000	1,516,200.00	0.62
27	688256	寒武纪	2,425	1,458,637.50	0.59
28	601088	中国神华	35,300	1,431,062.00	0.58
29	300308	中际旭创	9,800	1,429,428.00	0.58
30	300760	迈瑞医疗	6,000	1,348,500.00	0.55
31	300502	新易盛	10,540	1,338,790.80	0.54
32	601601	中国太保	34,900	1,309,099.00	0.53
33	300124	汇川技术	19,700	1,272,029.00	0.52
34	688041	海光信息	8,950	1,264,545.50	0.51
35	601668	中国建筑	214,500	1,237,665.00	0.50
36	601728	中国电信	158,500	1,228,375.00	0.50
37	002352	顺丰控股	24,900	1,214,124.00	0.49
38	603501	豪威集团	9,200	1,174,380.00	0.48
39	601127	赛力斯	8,600	1,155,152.00	0.47
40	000001	平安银行	94,800	1,144,236.00	0.47
41	002230	科大讯飞	23,850	1,141,938.00	0.46
42	002714	牧原股份	26,900	1,130,069.00	0.46
43	600309	万华化学	20,500	1,112,330.00	0.45
44	000063	中兴通讯	33,800	1,098,162.00	0.45
45	603019	中科曙光	15,400	1,084,160.00	0.44
46	600031	三一重工	60,200	1,080,590.00	0.44
47	600941	中国移动	9,400	1,057,970.00	0.43
48	600660	福耀玻璃	18,036	1,028,232.36	0.42
49	002415	海康威视	36,700	1,017,691.00	0.41
50	600406	国电南瑞	45,100	1,010,691.00	0.41
51	300274	阳光电源	14,300	969,111.00	0.39
52	601919	中远海控	64,400	968,576.00	0.39
53	600690	海尔智家	38,800	961,464.00	0.39

54	601012	隆基绿能	63,700	956,774.00	0.39
55	688008	澜起科技	11,616	952,512.00	0.39
56	601766	中国中车	127,900	900,416.00	0.37
57	601857	中国石油	104,900	896,895.00	0.36
58	600050	中国联通	166,700	890,178.00	0.36
59	688012	中微公司	4,876	888,894.80	0.36
60	600028	中国石化	156,300	881,532.00	0.36
61	000338	潍柴动力	56,600	870,508.00	0.35
62	603986	兆易创新	6,700	847,751.00	0.34
63	000568	泸州老窖	7,300	827,820.00	0.34
64	601006	大秦铁路	125,200	826,320.00	0.34
65	601225	陕西煤业	41,900	806,156.00	0.33
66	600104	上汽集团	49,900	800,895.00	0.33
67	601628	中国人寿	19,400	799,086.00	0.32
68	002027	分众传媒	109,100	796,430.00	0.32
69	601985	中国核电	85,000	792,200.00	0.32
70	000100	TCL 科技	181,600	786,328.00	0.32
71	605499	东鹏饮料	2,500	785,125.00	0.32
72	688111	金山办公	2,680	750,534.00	0.31
73	600418	江淮汽车	18,700	749,683.00	0.30
74	600150	中国船舶	22,900	745,166.00	0.30
75	300476	胜宏科技	5,500	739,090.00	0.30
76	600760	中航沈飞	12,500	732,750.00	0.30
77	601988	中国银行	130,200	731,724.00	0.30
78	600436	片仔癀	3,500	700,035.00	0.28
79	688271	联影医疗	5,406	690,562.44	0.28
80	300033	同花顺	2,500	682,525.00	0.28
81	603288	海天味业	17,500	680,925.00	0.28
82	600111	北方稀土	26,700	664,830.00	0.27
83	601888	中国中免	10,800	658,476.00	0.27
84	603993	洛阳钼业	77,800	655,076.00	0.27
85	002241	歌尔股份	27,700	645,964.00	0.26
86	600905	三峡能源	149,600	637,296.00	0.26
87	000625	长安汽车	49,900	636,724.00	0.26
88	000792	盐湖股份	37,200	635,376.00	0.26
89	300015	爱尔眼科	50,600	631,488.00	0.26
90	600938	中国海油	24,100	629,251.00	0.26
91	002625	光启技术	15,700	627,686.00	0.26
92	000425	徐工机械	80,400	624,708.00	0.25
93	601658	邮储银行	113,100	618,657.00	0.25
94	002050	三花智控	23,300	614,654.00	0.25
95	601600	中国铝业	86,600	609,664.00	0.25
96	600048	保利发展	75,100	608,310.00	0.25

97	000977	浪潮信息	11,600	590,208.00	0.24
98	600089	特变电工	49,400	589,342.00	0.24
99	600547	山东黄金	18,200	581,126.00	0.24
100	601390	中国中铁	103,300	579,513.00	0.24
101	600019	宝钢股份	87,900	579,261.00	0.24
102	002463	沪电股份	13,600	579,088.00	0.24
103	600585	海螺水泥	26,800	575,396.00	0.23
104	601989	中国重工	120,900	560,976.00	0.23
105	600570	恒生电子	15,900	533,286.00	0.22
106	002384	东山精密	14,100	532,557.00	0.22
107	000538	云南白药	9,400	524,426.00	0.21
108	600893	航发动力	13,600	524,144.00	0.21
109	300014	亿纬锂能	11,300	517,653.00	0.21
110	600415	小商品城	24,700	510,796.00	0.21
111	000988	华工科技	10,600	498,306.00	0.20
112	002460	赣锋锂业	14,600	493,042.00	0.20
113	000938	紫光股份	20,500	491,795.00	0.20
114	601727	上海电气	66,500	491,435.00	0.20
115	002179	中航光电	12,000	484,320.00	0.20
116	002422	科伦药业	13,000	466,960.00	0.19
117	300433	蓝思科技	20,800	463,840.00	0.19
118	600584	长电科技	13,700	461,553.00	0.19
119	002049	紫光国微	7,000	461,020.00	0.19
120	002028	思源电气	6,300	459,333.00	0.19
121	601669	中国电建	94,000	457,780.00	0.19
122	002456	欧菲光	38,600	457,410.00	0.19
123	000002	万 科 A	70,900	455,178.00	0.19
124	300339	润和软件	8,900	452,387.00	0.18
125	600795	国电电力	91,600	443,344.00	0.18
126	603799	华友钴业	11,900	440,538.00	0.18
127	601689	拓普集团	9,300	439,425.00	0.18
128	000963	华东医药	10,800	435,888.00	0.18
129	600010	包钢股份	237,800	425,662.00	0.17
130	688036	传音控股	5,285	421,214.50	0.17
131	600489	中金黄金	28,600	418,418.00	0.17
132	600988	赤峰黄金	16,500	410,520.00	0.17
133	601058	赛轮轮胎	31,100	408,032.00	0.17
134	600009	上海机场	12,700	403,479.00	0.16
135	600886	国投电力	26,800	395,032.00	0.16
136	601186	中国铁建	49,200	394,092.00	0.16
137	600438	通威股份	23,400	391,950.00	0.16
138	300408	三环集团	11,600	387,440.00	0.16
139	688120	华海清科	2,278	384,298.60	0.16

140	002074	国轩高科	11,700	379,782.00	0.15
141	002517	恺英网络	19,600	378,476.00	0.15
142	688169	石头科技	2,411	377,442.05	0.15
143	000661	长春高新	3,800	376,884.00	0.15
144	600115	中国东航	92,400	372,372.00	0.15
145	300442	润泽科技	7,500	371,475.00	0.15
146	600183	生益科技	12,200	367,830.00	0.15
147	000408	藏格矿业	8,600	366,962.00	0.15
148	300394	天孚通信	4,520	360,876.80	0.15
149	600839	四川长虹	37,100	360,612.00	0.15
150	600482	中国动力	15,600	359,892.00	0.15
151	600989	宝丰能源	22,100	356,694.00	0.15
152	688126	沪硅产业	19,054	356,690.88	0.15
153	002156	通富微电	13,900	356,118.00	0.14
154	002466	天齐锂业	11,100	355,644.00	0.14
155	600745	闻泰科技	10,600	355,418.00	0.14
156	000975	山金国际	18,700	354,178.00	0.14
157	688608	恒玄科技	1,000	347,980.00	0.14
158	300418	昆仑万维	10,300	346,389.00	0.14
159	002648	卫星化学	19,900	344,867.00	0.14
160	002001	新 和 成	16,200	344,574.00	0.14
161	600029	南方航空	58,100	342,790.00	0.14
162	600160	巨化股份	11,800	338,424.00	0.14
163	688213	思特威	3,300	337,326.00	0.14
164	002252	上海莱士	49,100	337,317.00	0.14
165	000768	中航西飞	12,300	336,282.00	0.14
166	002920	德赛西威	3,270	333,965.10	0.14
167	601360	三六零	32,700	333,540.00	0.14
168	600362	江西铜业	14,200	332,706.00	0.14
169	002916	深南电路	3,060	329,898.60	0.13
170	688777	中控技术	7,334	329,369.94	0.13
171	600372	中航机载	27,300	329,238.00	0.13
172	600426	华鲁恒升	15,100	327,217.00	0.13
173	688235	百济神州	1,399	326,862.36	0.13
174	600196	复星医药	12,900	323,661.00	0.13
175	002236	大华股份	20,300	322,364.00	0.13
176	601168	西部矿业	19,300	320,959.00	0.13
177	600352	浙江龙盛	31,500	320,040.00	0.13
178	002601	龙佰集团	19,600	317,716.00	0.13
179	601100	恒立液压	4,400	316,800.00	0.13
180	002340	格林美	49,600	314,960.00	0.13
181	600011	华能国际	44,100	314,874.00	0.13
182	300896	爱美客	1,800	314,658.00	0.13

183	600039	四川路桥	31,500	311,850.00	0.13
184	601319	中国人保	35,700	310,947.00	0.13
185	001979	招商蛇口	35,400	310,458.00	0.13
186	002185	华天科技	30,600	309,060.00	0.13
187	600741	华域汽车	17,400	307,110.00	0.12
188	601111	中国国航	38,900	306,921.00	0.12
189	300474	景嘉微	4,200	306,600.00	0.12
190	601868	中国能建	137,200	305,956.00	0.12
191	002180	纳思达	13,300	305,102.00	0.12
192	600176	中国巨石	26,700	304,380.00	0.12
193	003816	中国广核	83,100	302,484.00	0.12
194	000157	中联重科	41,800	302,214.00	0.12
195	601800	中国交建	33,700	299,593.00	0.12
196	002195	岩山科技	52,800	297,264.00	0.12
197	688506	百利天恒	1,000	296,120.00	0.12
198	300251	光线传媒	14,600	295,942.00	0.12
199	300017	网宿科技	27,600	295,872.00	0.12
200	688002	睿创微纳	4,229	294,845.88	0.12
201	000066	中国长城	19,900	294,520.00	0.12
202	600256	广汇能源	48,900	294,378.00	0.12
203	600460	士兰微	11,800	292,876.00	0.12
204	688396	华润微	6,192	292,014.72	0.12
205	002555	三七互娱	16,800	290,472.00	0.12
206	600885	宏发股份	13,000	290,030.00	0.12
207	000933	神火股份	17,300	287,872.00	0.12
208	600879	航天电子	27,400	286,878.00	0.12
209	300207	欣旺达	14,300	286,858.00	0.12
210	000786	北新建材	10,800	285,984.00	0.12
211	600219	南山铝业	74,600	285,718.00	0.12
212	688617	惠泰医疗	958	284,526.00	0.12
213	300136	信维通信	12,700	284,480.00	0.12
214	002465	海格通信	20,400	284,376.00	0.12
215	603659	璞泰来	15,100	283,578.00	0.12
216	300450	先导智能	11,400	283,290.00	0.12
217	300454	深信服	3,000	282,540.00	0.11
218	688122	西部超导	5,444	282,434.72	0.11
219	600346	恒力石化	19,700	280,922.00	0.11
220	002129	TCL 中环	36,500	280,320.00	0.11
221	601117	中国化学	36,400	279,188.00	0.11
222	600066	宇通客车	11,200	278,432.00	0.11
223	000831	中国稀土	7,700	278,124.00	0.11
224	000807	云铝股份	17,400	278,052.00	0.11
225	601633	长城汽车	12,900	277,092.00	0.11

226	688099	晶晨股份	3,891	276,299.91	0.11
227	301236	软通动力	5,000	273,200.00	0.11
228	000630	铜陵有色	81,700	272,878.00	0.11
229	300866	安克创新	2,400	272,640.00	0.11
230	002558	巨人网络	11,500	270,825.00	0.11
231	300223	北京君正	3,900	269,880.00	0.11
232	002294	信立泰	5,700	269,781.00	0.11
233	600188	兖矿能源	22,100	268,957.00	0.11
234	603260	合盛硅业	5,600	265,440.00	0.11
235	300661	圣邦股份	3,640	264,882.80	0.11
236	300058	蓝色光标	40,300	264,368.00	0.11
237	600233	圆通速递	20,500	264,245.00	0.11
238	302132	中航成飞	3,000	263,820.00	0.11
239	002436	兴森科技	19,900	263,476.00	0.11
240	002078	太阳纸业	19,500	262,470.00	0.11
241	002493	荣盛石化	31,600	261,648.00	0.11
242	600515	海南机场	73,800	261,252.00	0.11
243	601615	明阳智能	22,700	260,823.00	0.11
244	603129	春风动力	1,200	259,800.00	0.11
245	002130	沃尔核材	10,878	259,113.96	0.11
246	600549	厦门钨业	12,300	257,316.00	0.10
247	601877	正泰电器	11,300	256,171.00	0.10
248	300347	泰格医药	4,800	255,936.00	0.10
249	002138	顺络电子	9,100	255,892.00	0.10
250	600862	中航高科	9,800	255,584.00	0.10
251	600674	川投能源	15,700	251,828.00	0.10
252	688578	艾力斯	2,700	251,208.00	0.10
253	002131	利欧股份	71,600	250,600.00	0.10
254	600487	亨通光电	16,200	247,860.00	0.10
255	002085	万丰奥威	15,500	246,295.00	0.10
256	002007	华兰生物	15,700	246,019.00	0.10
257	600845	宝信软件	10,400	245,648.00	0.10
258	300395	菲利华	4,800	245,280.00	0.10
259	600588	用友网络	18,200	243,334.00	0.10
260	002128	电投能源	12,200	241,316.00	0.10
261	002008	大族激光	9,900	241,263.00	0.10
262	002202	金风科技	23,500	240,875.00	0.10
263	688072	拓荆科技	1,567	240,863.57	0.10
264	688188	柏楚电子	1,824	240,147.84	0.10
265	688047	龙芯中科	1,787	238,367.93	0.10
266	688266	泽璟制药	2,200	236,522.00	0.10
267	002410	广联达	17,600	236,016.00	0.10
268	601618	中国中冶	78,600	234,228.00	0.10

269	601872	招商轮船	37,300	233,498.00	0.09
270	300759	康龙化成	9,500	233,130.00	0.09
271	300012	华测检测	19,900	232,631.00	0.09
272	600161	天坛生物	12,100	232,199.00	0.09
273	688223	晶科能源	44,711	232,050.09	0.09
274	600699	均胜电子	13,300	231,952.00	0.09
275	603605	珀莱雅	2,800	231,812.00	0.09
276	603087	甘李药业	4,200	230,076.00	0.09
277	002595	豪迈科技	3,800	225,036.00	0.09
278	600153	建发股份	21,600	223,992.00	0.09
279	002405	四维图新	26,200	223,748.00	0.09
280	300253	卫宁健康	21,100	223,660.00	0.09
281	605117	德业股份	4,240	223,278.40	0.09
282	600803	新奥股份	11,800	223,020.00	0.09
283	002065	东华软件	23,100	221,760.00	0.09
284	600085	同仁堂	6,100	219,966.00	0.09
285	002273	水晶光电	11,000	219,670.00	0.09
286	002738	中矿资源	6,800	218,688.00	0.09
287	000617	中油资本	29,800	217,540.00	0.09
288	600096	云天化	9,900	217,503.00	0.09
289	002223	鱼跃医疗	6,100	217,160.00	0.09
290	601216	君正集团	39,200	216,384.00	0.09
291	603596	伯特利	4,100	216,029.00	0.09
292	600895	张江高科	8,400	215,880.00	0.09
293	002271	东方雨虹	20,100	215,673.00	0.09
294	002353	杰瑞股份	6,100	213,500.00	0.09
295	601799	星宇股份	1,700	212,500.00	0.09
296	000623	吉林敖东	12,500	211,875.00	0.09
297	002821	凯莱英	2,400	211,800.00	0.09
298	000301	东方盛虹	25,300	210,749.00	0.09
299	688180	君实生物	6,197	210,574.06	0.09
300	601233	桐昆股份	19,800	209,880.00	0.09
301	300122	智飞生物	10,700	209,613.00	0.09
302	002414	高德红外	20,400	209,100.00	0.09
303	002409	雅克科技	3,800	207,822.00	0.08
304	002281	光迅科技	4,200	207,144.00	0.08
305	300782	卓胜微	2,900	206,973.00	0.08
306	300054	鼎龙股份	7,200	206,496.00	0.08
307	600765	中航重机	12,200	205,936.00	0.08
308	002155	湖南黄金	11,420	203,847.00	0.08
309	000426	兴业银锡	12,900	203,820.00	0.08
310	000999	华润三九	6,500	203,320.00	0.08
311	600521	华海药业	10,800	201,204.00	0.08

312	600143	金发科技	19,500	201,045.00	0.08
313	300724	捷佳伟创	3,700	200,910.00	0.08
314	000960	锡业股份	13,100	200,430.00	0.08
315	601021	春秋航空	3,600	200,340.00	0.08
316	300142	沃森生物	18,000	198,000.00	0.08
317	688599	天合光能	13,609	197,738.77	0.08
318	605589	圣泉集团	7,100	197,025.00	0.08
319	000519	中兵红箭	9,000	197,010.00	0.08
320	600563	法拉电子	1,800	196,362.00	0.08
321	002709	天赐材料	10,800	195,696.00	0.08
322	300558	贝达药业	3,300	191,235.00	0.08
323	000878	云南铜业	15,000	190,800.00	0.08
324	300627	华测导航	5,420	189,700.00	0.08
325	000932	华菱钢铁	43,000	189,200.00	0.08
326	002532	天山铝业	22,700	188,637.00	0.08
327	000034	神州数码	5,000	188,200.00	0.08
328	600398	海澜之家	27,000	187,920.00	0.08
329	002472	双环传动	5,600	187,544.00	0.08
330	603806	福斯特	14,400	186,624.00	0.08
331	002938	鹏鼎控股	5,800	185,774.00	0.08
332	600486	扬农化工	3,200	185,600.00	0.08
333	002025	航天电器	3,600	185,076.00	0.08
334	300699	光威复材	5,800	183,686.00	0.07
335	300763	锦浪科技	3,200	183,648.00	0.07
336	688303	大全能源	8,535	181,966.20	0.07
337	300383	光环新网	12,700	181,610.00	0.07
338	002812	恩捷股份	6,200	181,598.00	0.07
339	000039	中集集团	23,100	181,566.00	0.07
340	600177	雅戈尔	24,800	181,040.00	0.07
341	000738	航发控制	8,700	180,525.00	0.07
342	603486	科沃斯	3,100	180,513.00	0.07
343	001965	招商公路	15,000	180,000.00	0.07
344	300757	罗博特科	1,200	179,964.00	0.07
345	603392	万泰生物	2,900	176,900.00	0.07
346	600704	物产中大	33,500	176,545.00	0.07
347	300832	新产业	3,100	175,832.00	0.07
348	600332	白云山	6,600	173,976.00	0.07
349	002044	美年健康	33,800	173,732.00	0.07
350	002444	巨星科技	6,800	173,468.00	0.07
351	300037	新宙邦	4,900	172,480.00	0.07
352	600535	天士力	11,000	172,150.00	0.07
353	600392	盛和资源	13,000	171,210.00	0.07
354	600141	兴发集团	8,300	170,399.00	0.07

355	002624	完美世界	11,200	169,904.00	0.07
356	600497	驰宏锌锗	32,100	169,809.00	0.07
357	300088	长信科技	28,400	169,264.00	0.07
358	600763	通策医疗	4,100	169,248.00	0.07
359	300068	南都电源	10,600	168,752.00	0.07
360	688390	固德威	3,842	166,934.90	0.07
361	300413	芒果超媒	7,600	165,832.00	0.07
362	601238	广汽集团	22,100	165,529.00	0.07
363	300002	神州泰岳	14,000	165,200.00	0.07
364	300769	德方纳米	5,000	165,100.00	0.07
365	000009	中国宝安	18,500	164,280.00	0.07
366	300676	华大基因	3,300	164,241.00	0.07
367	002459	晶澳科技	16,100	160,678.00	0.07
368	300001	特锐德	6,700	160,599.00	0.07
369	688009	中国通号	31,181	160,270.34	0.07
370	000708	中信特钢	13,600	159,936.00	0.07
371	300628	亿联网络	4,600	159,896.00	0.07
372	601607	上海医药	8,800	157,344.00	0.06
373	601155	新城控股	11,500	157,320.00	0.06
374	000423	东阿阿胶	3,000	156,900.00	0.06
375	300346	南大光电	4,940	156,301.60	0.06
376	000733	振华科技	3,100	155,155.00	0.06
377	300496	中科创达	2,700	154,494.00	0.06
378	300285	国瓷材料	8,900	154,415.00	0.06
379	601018	宁波港	42,100	154,086.00	0.06
380	000683	博源化工	32,100	153,759.00	0.06
381	600998	九州通	29,700	152,658.00	0.06
382	300567	精测电子	2,500	151,525.00	0.06
383	000887	中鼎股份	8,600	151,274.00	0.06
384	601567	三星医疗	6,600	147,972.00	0.06
385	002607	中公教育	48,200	147,492.00	0.06
386	600018	上港集团	25,800	147,318.00	0.06
387	000400	许继电气	6,700	145,859.00	0.06
388	000998	隆平高科	14,800	145,780.00	0.06
389	002432	九安医疗	4,000	145,720.00	0.06
390	603885	吉祥航空	10,800	145,476.00	0.06
391	002176	江特电机	20,000	145,200.00	0.06
392	603606	东方电缆	2,800	144,788.00	0.06
393	300073	当升科技	3,300	144,771.00	0.06
394	300144	宋城演艺	16,900	144,495.00	0.06
395	002389	航天彩虹	5,600	143,360.00	0.06
396	600166	福田汽车	52,800	143,088.00	0.06
397	600498	烽火通信	6,800	143,004.00	0.06

398	300024	机器人	8,300	142,594.00	0.06
399	002245	蔚蓝锂芯	11,100	142,413.00	0.06
400	300459	汤姆猫	25,400	142,240.00	0.06
401	300315	掌趣科技	23,000	139,610.00	0.06
402	002312	川发龙蟒	12,100	138,908.00	0.06
403	002603	以岭药业	9,800	138,180.00	0.06
404	301358	湖南裕能	4,400	137,236.00	0.06
405	600170	上海建工	56,900	135,991.00	0.06
406	300568	星源材质	10,700	135,676.00	0.06
407	603833	欧派家居	2,400	135,480.00	0.06
408	300919	中伟股份	4,100	134,808.00	0.05
409	600312	平高电气	8,700	133,893.00	0.05
410	600008	首创环保	44,300	133,786.00	0.05
411	300003	乐普医疗	9,700	133,666.00	0.05
412	688005	容百科技	5,980	133,473.60	0.05
413	603979	金诚信	2,842	131,982.48	0.05
414	600038	中直股份	3,400	131,954.00	0.05
415	600820	隧道股份	21,600	131,760.00	0.05
416	300604	长川科技	2,900	130,239.00	0.05
417	600208	衢州发展	43,800	129,648.00	0.05
418	600026	中远海能	12,500	129,125.00	0.05
419	000629	钒钛股份	50,200	128,512.00	0.05
420	600637	东方明珠	17,200	128,484.00	0.05
421	300316	晶盛机电	4,700	127,605.00	0.05
422	002244	滨江集团	12,900	125,775.00	0.05
423	002497	雅化集团	11,000	125,400.00	0.05
424	300296	利亚德	20,500	125,050.00	0.05
425	600529	山东药玻	5,600	123,984.00	0.05
426	600859	王府井	8,800	122,232.00	0.05
427	002318	久立特材	5,200	121,628.00	0.05
428	601000	唐山港	29,800	120,988.00	0.05
429	002756	永兴材料	3,800	120,650.00	0.05
430	600516	方大炭素	25,900	120,176.00	0.05
431	000069	华侨城 A	53,400	120,150.00	0.05
432	603077	和邦生物	67,700	118,475.00	0.05
433	300751	迈为股份	1,700	118,252.00	0.05
434	601880	辽港股份	77,900	116,850.00	0.05
435	605358	立昂微	5,000	116,500.00	0.05
436	000563	陕国投 A	32,300	115,311.00	0.05
437	002439	启明星辰	7,200	115,128.00	0.05
438	603568	伟明环保	6,000	114,480.00	0.05
439	300182	捷成股份	20,700	114,057.00	0.05
440	300438	鹏辉能源	4,100	113,201.00	0.05

441	603816	顾家家居	4,400	112,288.00	0.05
442	002739	万达电影	9,700	110,871.00	0.05
443	601677	明泰铝业	8,900	110,538.00	0.04
444	601179	中国西电	17,900	109,906.00	0.04
445	300118	东方日升	11,300	108,254.00	0.04
446	600325	华发股份	22,200	108,114.00	0.04
447	601866	中远海发	43,700	107,939.00	0.04
448	600118	中国卫星	3,700	105,709.00	0.04
449	300573	兴齐眼药	2,040	105,651.60	0.04
450	601966	玲珑轮胎	7,200	105,624.00	0.04
451	002064	华峰化学	15,900	105,099.00	0.04
452	002292	奥飞娱乐	10,800	104,976.00	0.04
453	600323	瀚蓝环境	4,300	104,705.00	0.04
454	603939	益丰药房	4,200	102,774.00	0.04
455	600511	国药股份	3,500	102,060.00	0.04
456	603613	国联股份	4,300	101,867.00	0.04
457	600316	洪都航空	2,700	101,790.00	0.04
458	600867	通化东宝	12,400	101,680.00	0.04
459	600667	太极实业	14,800	97,384.00	0.04
460	002841	视源股份	2,800	96,880.00	0.04
461	002152	广电运通	7,200	96,768.00	0.04
462	002266	浙富控股	30,800	94,864.00	0.04
463	600007	中国国贸	4,600	94,668.00	0.04
464	002091	江苏国泰	12,900	93,783.00	0.04
465	002145	中核钛白	22,500	93,375.00	0.04
466	300070	碧水源	20,600	92,700.00	0.04
467	601636	旗滨集团	18,200	91,182.00	0.04
468	000032	深桑达 A	4,500	91,035.00	0.04
469	300529	健帆生物	4,200	90,594.00	0.04
470	000035	中国天楹	21,000	90,090.00	0.04
471	603650	彤程新材	2,800	90,020.00	0.04
472	688063	派能科技	1,992	89,799.36	0.04
473	002120	韵达股份	12,900	86,430.00	0.04
474	600315	上海家化	4,100	86,387.00	0.04
475	600655	豫园股份	15,300	84,915.00	0.03
476	600258	首旅酒店	5,800	81,954.00	0.03
477	300601	康泰生物	5,300	80,507.00	0.03
478	002508	老板电器	4,200	79,842.00	0.03
479	002572	索菲亚	5,600	78,456.00	0.03
480	600864	哈投股份	12,900	77,013.00	0.03
481	603899	晨光股份	2,600	75,374.00	0.03
482	000830	鲁西化工	7,000	72,100.00	0.03
483	600754	锦江酒店	3,200	71,808.00	0.03

484	300457	赢合科技	3,100	71,300.00	0.03
485	600131	国网信通	4,000	70,800.00	0.03
486	000547	航天发展	8,300	69,720.00	0.03
487	600499	科达制造	7,000	68,600.00	0.03
488	600004	白云机场	7,400	67,340.00	0.03
489	000967	盈峰环境	9,600	66,720.00	0.03
490	600129	太极集团	3,100	66,061.00	0.03
491	002407	多氟多	5,400	65,826.00	0.03
492	002831	裕同科技	2,800	65,576.00	0.03
493	000818	航锦科技	2,900	65,250.00	0.03
494	002544	普天科技	2,700	63,315.00	0.03
495	603000	人民网	2,700	54,567.00	0.02
496	300390	天华新能	2,700	51,489.00	0.02
497	002372	伟星新材	3,700	38,332.00	0.02
498	001914	招商积余	2,900	35,873.00	0.01
499	301381	赛维时代	1,400	27,930.00	0.01
500	600335	国机汽车	3,900	25,155.00	0.01

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	688775	影石创新	243	37,976.04	0.02
2	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
3	688755	汉邦科技	203	9,043.65	0.00
4	301590	优优绿能	51	7,762.71	0.00
5	301595	太力科技	196	7,028.56	0.00
6	603014	威高血净	177	6,223.32	0.00
7	603049	中策橡胶	138	5,932.62	0.00
8	001390	古麒绒材	178	3,827.00	0.00
9	603382	海阳科技	105	2,987.25	0.00
10	603400	华之杰	57	2,828.34	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	36,008,238.00	14.64
2	300750	宁德时代	25,171,520.64	10.24
3	601318	中国平安	17,968,190.89	7.31
4	600036	招商银行	17,320,250.00	7.04
5	000333	美的集团	13,290,323.00	5.40
6	002594	比亚迪	11,910,298.00	4.84

7	600900	长江电力	11,019,367.00	4.48
8	601166	兴业银行	10,636,883.32	4.33
9	300059	东方财富	10,345,914.34	4.21
10	000858	五粮液	10,128,196.00	4.12
11	601899	紫金矿业	9,540,902.00	3.88
12	600030	中信证券	8,414,580.00	3.42
13	601398	工商银行	7,732,735.00	3.14
14	002475	立讯精密	7,348,481.00	2.99
15	000651	格力电器	7,231,722.00	2.94
16	600276	恒瑞医药	7,007,555.00	2.85
17	688981	中芯国际	6,261,322.44	2.55
18	688041	海光信息	5,880,287.35	2.39
19	300760	迈瑞医疗	5,851,492.00	2.38
20	600887	伊利股份	5,722,134.00	2.33
21	601328	交通银行	5,620,687.00	2.29
22	000725	京东方 A	5,455,089.00	2.22
23	603259	药明康德	5,355,567.00	2.18
24	601816	京沪高铁	5,278,858.00	2.15
25	300124	汇川技术	5,225,886.00	2.13
26	601288	农业银行	5,047,571.00	2.05

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	17,007,236.00	6.92
2	000333	美的集团	8,818,390.00	3.59
3	002594	比亚迪	7,715,298.00	3.14
4	000858	五粮液	7,331,332.00	2.98
5	300059	东方财富	6,935,842.00	2.82
6	000651	格力电器	5,126,667.00	2.08
7	002475	立讯精密	4,388,248.00	1.78
8	300760	迈瑞医疗	4,229,132.00	1.72
9	300124	汇川技术	3,761,273.00	1.53
10	000725	京东方 A	3,646,334.00	1.48
11	002714	牧原股份	3,049,272.00	1.24
12	002371	北方华创	2,879,174.00	1.17
13	000001	平安银行	2,774,915.00	1.13
14	688256	寒武纪	2,739,551.97	1.11
15	002415	海康威视	2,728,185.00	1.11
16	002352	顺丰控股	2,597,099.00	1.06

17	000063	中兴通讯	2,593,927.00	1.05
18	000568	泸州老窖	2,396,896.00	0.97
19	300274	阳光电源	2,396,109.00	0.97
20	002230	科大讯飞	2,119,077.00	0.86

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	785,833,020.42
卖出股票收入（成交）总额	265,866,656.96

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未持有国债期货。

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	395,515.68
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	395,515.68

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	37,976.04	0.02	新股锁定
2	001388	信通电子	15,385.54	0.01	新股流通受限
3	688755	汉邦科技	9,043.65	0.00	新股锁定
4	301590	优优绿能	7,762.71	0.00	新股锁定
5	301595	太力科技	7,028.56	0.00	新股锁定

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

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（%）

924	263,079.18	177,338,060.00	72.95	65,747,100.00	27.05
-----	------------	----------------	-------	---------------	-------

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国农业银行股份有限公司—银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	69,902,300.00	28.76
2	新华人寿保险股份有限公司	50,003,000.00	20.57
3	中汇人寿保险股份有限公司—万能产品	30,001,800.00	12.34
4	中国人寿再保险有限责任公司	11,275,299.00	4.64
5	广发证券股份有限公司	6,590,061.00	2.71
6	国信证券股份有限公司	4,852,200.00	2.00
7	郑凯鹏	3,155,200.00	1.30
8	方正证券股份有限公司	2,125,000.00	0.87
9	郭晓红	2,000,000.00	0.82
10	卢婷	1,710,000.00	0.70

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000

8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 3 月 20 日）基金份额总额	735,085,160.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	75,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	567,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金	—

拆分变动份额	
本报告期期末基金份额总额	243,085,160.00

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：

2025 年 3 月 1 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》，徐琳女士不再担任基金管理公司副总经理。

二、报告期内基金托管人发生以下重大人事变动：

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
银河证券	5	1,051,289,339.05	100.00	190,426.41	100.00	-

- 注：1、本报告期内本基金设立的交易单元均为新增。
- 2、基金管理人租用证券公司交易单元进行证券投资业务或者委托证券公司办理证券投资业务，证券公司应当满足包括但不限于下列基本条件：
- （1）、具有相应的业务经营资格；
 - （2）、诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
 - （3）、财务状况良好，信誉良好；
 - （4）、合规风控能力良好，具备健全的合规风控管理制度；
 - （5）、具备证券交易所需的高效、安全的通讯及交易条件，交易设施、交易终端或资金结算服务能力等符合证券交易的需要，并能为公司提供交易结算支持服务；
 - （6）、如提供研究服务的，应当具备研究实力，有专业研究机构和研究人员，能及时全面地为基金管理人提供宏观经济、行业情况、证券分析等研究服务；
 - （7）、法律法规、监管及证券交易所要求的其他条件。

3、选择参与证券交易的证券公司程序：

- （1）、基金管理人依据上述标准对证券公司的资质、服务能力等开展调查及综合评估；
- （2）、经基金管理人内部程序审议，确定拟开展合作业务的证券公司；
- （3）、基金管理人与证券公司完成相关协议的签订，通知基金托管人。

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 (%)
银河证券	-	-	250,000,000.00	100.00	-	-

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	银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	《证券日报》、公司网站	2025 年 2 月 24 日

2	银河基金管理有限公司 2024 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	2025 年 3 月 28 日
3	银河基金管理有限公司 2025 年第 1 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	2025 年 4 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(%)
机构	1	20250625-20250630	50,003,000.00	0.00	0.00	50,003,000.00	20.57
	2	20250627-20250630	0.00	69,902,300.00	0.00	69,902,300.00	28.76
	3	20250414-20250420	100,000,000.00	0.00	100,000,000.00	0.00	0.00

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中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的文件
- 2、《银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
- 5、银河中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

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

2025 年 8 月 27 日