银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）
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：北京银行股份有限公司

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。

基金托管人北京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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 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遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 19
§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 42
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 46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 52
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 52
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 52

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 52
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 52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 52
7.12 投资组合报告附注 53

§8 基金份额持有人信息 54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
8.2 期末上市基金前十名持有人 54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 54
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 55

§9 开放式基金份额变动 55

§10 重大事件揭示 55

10.1 基金份额持有人大会决议 55
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 55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
10.4 基金投资策略的改变 56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
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 56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 56
10.8 其他重大事件 57

§11 影响投资者决策的其他重要信息 58

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 58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 58

§12 备查文件目录 59

12.1 备查文件目录 59
12.2 存放地点 59
12.3 查阅方式 59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）	
基金简称	沪港深红利 LOF	
场内简称	红利 LOF	
基金主代码	501307	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2018 年 4 月 10 日	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	55,087,351.73 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	2018 年 4 月 25 日	
下属分级基金的基金简称	沪港深红利 LOF	银河高 C
下属分级基金的交易代码	501307	501308
报告期末下属分级基金的份额总额	49,742,281.32 份	5,345,070.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证沪港深高股息指数。在正常市场情况下，本基金力争将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绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	1、股票投资策略 本基金原则上采取指数完全复制法，进行被动指数化投资。 本基金力争将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绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。 2、债券投资策略；3、金融衍生品的投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深高股息指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数型基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金投资于法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，除需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。

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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	闫朝
	联系电话	021-38568989	010-66223587
	电子邮箱	qinchangjian@cgf.cn	yanzhao@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95526
传真		021-38568769	010-89661115
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码		200120	100033
法定代表人		胡泊	霍学文

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 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	沪港深红利 LOF	银河高 C
本期已实现收益	2,617,816.02	259,205.60
本期利润	5,058,597.37	324,613.23
加权平均基金份额本期利润	0.1648	0.0987
本期加权平均净值利润率	15.16%	9.20%
本期基金份额净值增长率	9.38%	9.24%

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	426,072.54	-48,514.41
期末可供分配基金份额利润	0.0086	-0.0091
期末基金资产净值	57,995,105.58	6,122,018.52
期末基金份额净值	1.1659	1.1454
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	16.59%	14.54%

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

沪港深红利 LOF

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.37%	0.58%	2.92%	0.57%	1.45%	0.01%
过去三个月	8.64%	0.89%	4.09%	1.32%	4.55%	-0.43%
过去六个月	9.38%	0.82%	4.15%	1.07%	5.23%	-0.25%
过去一年	15.48%	1.06%	8.60%	1.18%	6.88%	-0.12%
过去三年	18.26%	1.00%	14.57%	1.06%	3.69%	-0.06%
自基金合同生效起至今	16.59%	1.08%	-0.96%	1.11%	17.55%	-0.03%

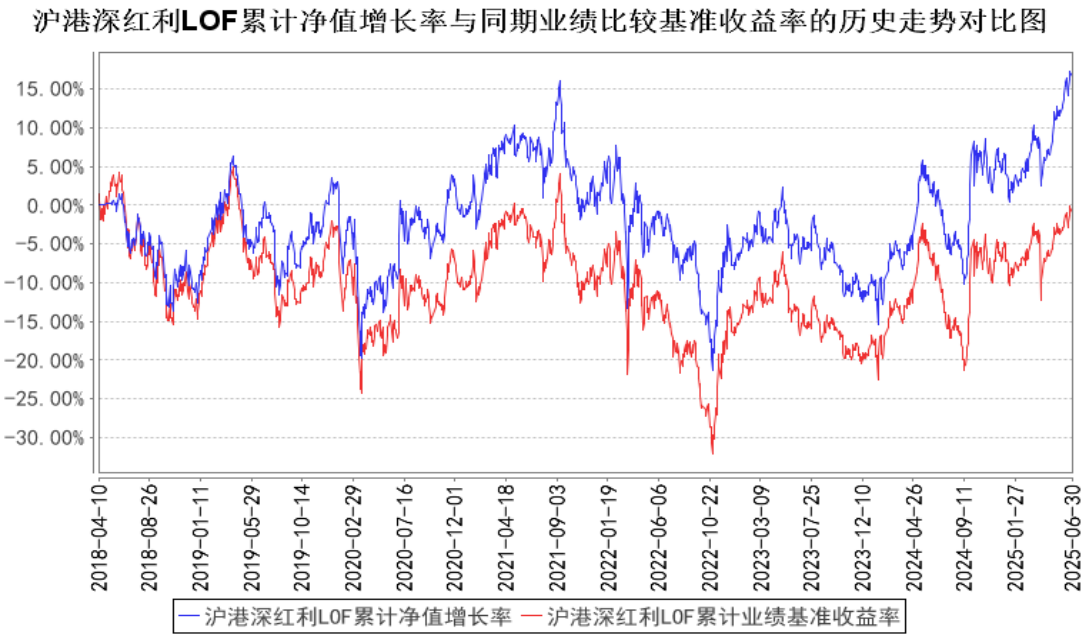
银河高 C

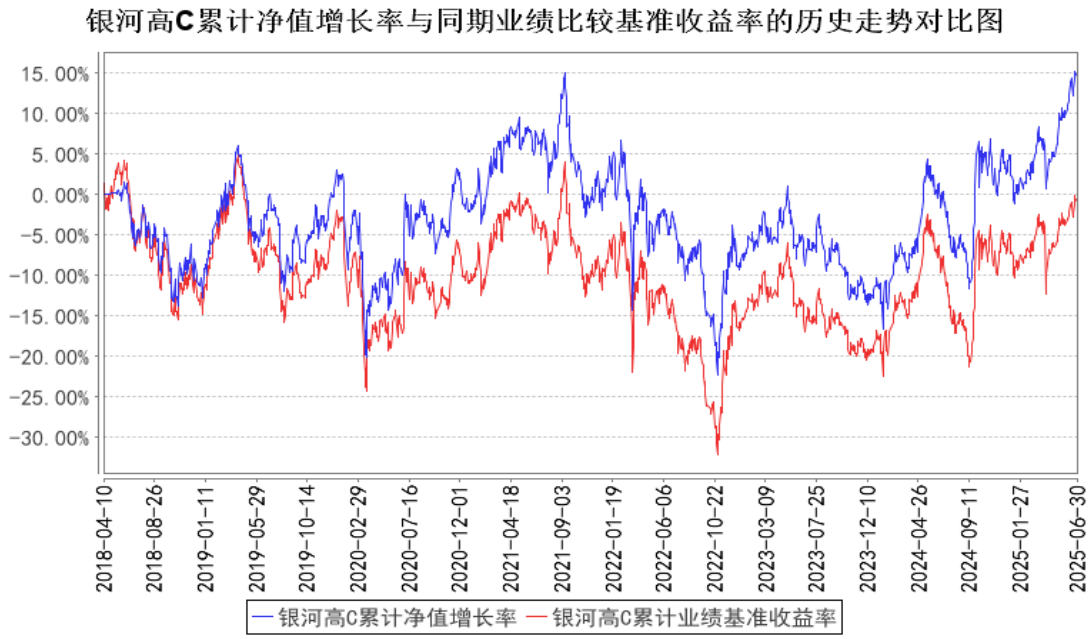
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	4.35%	0.58%	2.92%	0.57%	1.43%	0.01%
过去三个月	8.57%	0.89%	4.09%	1.32%	4.48%	-0.43%
过去六个月	9.24%	0.82%	4.15%	1.07%	5.09%	-0.25%
过去一年	15.19%	1.06%	8.60%	1.18%	6.59%	-0.12%
过去三年	17.37%	1.00%	14.57%	1.06%	2.80%	-0.06%
自基金合同生效起至今	14.54%	1.08%	-0.96%	1.11%	15.50%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：中证沪港深高股息指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%，每日进行再平衡过程。

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：根据本基金合同规定，本基金应自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定：本基金 90%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于中证沪港深高股息指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。截至本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司成立于 2002 年 6 月 14 日，是经中国证券监督管理委员会按照市场化机制批准成立的第一家基金管理公司（俗称："好人举手第一家"），是中央汇金公司旗下专业资产管理机构。

银河基金公司的经营范围包括发起设立、管理基金等，注册资本 2 亿元人民币，注册地中国上海。银河基金公司的股东分别为：中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团有限公司、首都机场集团有限公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

本报告期内公司管理的基金有：银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联系列证券投资

基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金（LOF）、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河泰利纯债债券型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河君辉 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 CFETSO-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		
卢轶乔	本基金的基金经理	2021 年 11 月 5 日	-	16 年	博士研究生学历，16 年证券行业从业经历。曾就职于建设银行。2008 年 7 月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理等职，现担任股票投资部基金经理。2012 年 12 月起担任银河消费驱动混合型证券投资基金基金经理，2015 年 5 月至 2016 年 12 月担任银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至 2025 年 1 月担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至 2023 年 4 月担任银河睿利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 7 月起担任银河君盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 10 月至 2021 年 10 月担任银河旺利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 10 月至 2024 年 9 月担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 4 月起担任银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起担任银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 12 月担任银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

黄栋	本基金的基金经理	2024 年 7 月 27 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。

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、勤奋律己、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金份额持有人的利益，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。

本基金原则上采取指数完全复制法，进行被动指数化投资。按照成份股在中证沪港深高股息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，未发现本基金与其他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

高股息板块在今年上半年表现较好。

操作层面上，本基金严格遵循基金基准，没有调整持仓个股成分和比例，但由于上半年本基金的 LOF 数次出现大涨大跌，导致基金被频繁申购赎回，具体表现在若干次市场的高股息板块上涨时，二级市场的 LOF 基金被交易者人为大幅拉涨，随之出现大量的基金份额申购，高峰时基金申购份额大幅高于基金存量份额，而在随后市场高股息板块回落时，基金又多次正恰巧处于被申

购后的低仓位状态，导致半年运行下来，基金净值高于基金基准，且偏离较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末沪港深红利 LOF 的基金份额净值为 1.1659 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.38%，同期业绩比较基准收益率为 4.15%；截至本报告期末银河高 C 的基金份额净值为 1.1454 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.24%，同期业绩比较基准收益率为 4.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为在海外贸易战风险对市场的影响不会再加重，而国内的政策和货币有表现为较为友好的状态，另外我们短期并未看到地产及基建等产业的大规模增长，市场没有宽信用的风险，在此逻辑下，下半年高股息资产的吸引力仍将继续增强，我们对市场不悲观。

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

根据本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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 2025 年 06 月 30 日，沪港深红利 LOF 可供分配利润为 426,072.54 元，银河高 C 可供分配利润为-48,514.41 元，本报告期未进行利润分配。

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

本基金本报告期内已连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，我司已将该基金情况向监管部门报告并提出解决方案，目前我司正积极加强营销，力争扩大本基金规模，本报告期内，本基金资产净值已恢复五千万元以上。

自 2024 年 6 月 27 日起至 2025 年 5 月 7 日，本基金所产生的信息披露费用、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费等各类固定费用，不从基金资产中列支，由基金管理人承担。

§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

在本报告期内，本基金托管人在托管银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有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

本基金托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容，复核内容真实、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：银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,004,082.39	1,560,337.93
结算备付金		25,583.42	1,783.74
存出保证金		45,762.88	18,867.18
交易性金融资产	6.4.7.2	60,240,574.26	17,583,738.65
其中：股票投资		59,939,647.22	17,583,738.65
基金投资		-	-
债券投资		300,927.04	-
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		588,411.56	190,384.88
应收股利		502,215.42	24,251.71
应收申购款		297,742.99	455,260.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		65,704,372.92	19,834,624.62
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 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		1,511,901.00	153,424.40
应付管理人报酬		20,998.68	8,077.06
应付托管费		7,559.49	2,907.78
应付销售服务费		1,050.44	258.05
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	45,739.21	64,889.79
负债合计		1,587,248.82	229,557.08
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	55,087,351.73	18,412,237.68
未分配利润	6.4.7.12	9,029,772.37	1,192,829.86
净资产合计		64,117,124.10	19,605,067.54
负债和净资产总计		65,704,372.92	19,834,624.62

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，沪港深红利 LOF 基金份额净值 1.1659 元，基金份额总额 49,742,281.32 份；银河高 C 基金份额净值 1.1454 元，基金份额总额 5,345,070.41 份。沪港深红利 LOF 份额总额合计为 55,087,351.73 份。

6.2 利润表

会计主体：银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间

		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,572,097.75	1,846,973.36
1.利息收入		7,060.93	2,515.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,060.93	2,515.48
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）		2,981,507.68	494,911.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,489,049.88	-120,482.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	236.46	-
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	1,492,221.34	615,393.45
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	2,506,188.98	1,348,731.74
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	77,340.16	814.73
减：二、营业总支出		188,887.15	171,593.33
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	92,525.07	41,773.29
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	33,308.97	15,038.46
3．销售服务费	6.4.10.2.3	4,306.45	1,343.63
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	58,746.66	113,437.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,383,210.60	1,675,380.03
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,383,210.60	1,675,380.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,383,210.60	1,675,380.03

6.3 净资产变动表

会计主体：银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 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	18,412,237.68	-	1,192,829.86	19,605,067.54
二、本期期初净资产	18,412,237.68	-	1,192,829.86	19,605,067.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	36,675,114.05	-	7,836,942.51	44,512,056.56
（一）、综合收益总额	-	-	5,383,210.60	5,383,210.60
（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）	36,675,114.05	-	2,453,731.91	39,128,845.96
其中：1.基金申购款	117,850,232.68	-	9,240,728.63	127,090,961.31
2.基金赎回款	-81,175,118.63	-	-6,786,996.72	-87,962,115.35
（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	55,087,351.73	-	9,029,772.37	64,117,124.10
项目	上年度可比期间 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	16,646,392.78	-	-1,677,505.98	14,968,886.80

二、本期期初净资产	16,646,392.78	-	-1,677,505.98	14,968,886.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,462,749.75	-	1,820,726.47	9,283,476.22
（一）、综合收益总额	-	-	1,675,380.03	1,675,380.03
（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）	7,462,749.75	-	145,346.44	7,608,096.19
其中：1.基金申购款	10,939,556.61	-	89,462.37	11,029,018.98
2.基金赎回款	-3,476,806.86	-	55,884.07	-3,420,922.79
（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	24,109,142.53	-	143,220.49	24,252,363.02

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	管良权
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

银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)(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》、《银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)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[2018]80 号文批准公开募集。本基金为契约型、上市开放式基金(LOF)，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 205,840,341.68 份经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为安永华明(2018)验字第

60821717_B07 号的验资报告。基金合同于 2018 年 4 月 10 日生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

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“银河高股息 LOF”)和 C 类基金份额(以下简称“银河高 C”)两类份额。其中，银河高股息 LOF 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；银河高 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《银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于中证沪港深高股息指数成份股、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)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(包括同业存单)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合为：本基金 90%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于中证沪港深高股息指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。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。

本基金的业绩比较基准为：中证沪港深高股息指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况、2025 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》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号

《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对证券投资基金从中国内地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。

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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上

述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

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。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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	4,004,082.39
等于：本金	4,003,521.82
加：应计利息	560.57
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,004,082.39

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	57,000,556.71	-	59,939,647.22	2,939,090.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	299,919.00	867.04	300,927.04	141.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	299,919.00	867.04	300,927.04	141.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		57,300,475.71	867.04	60,240,574.26	2,939,231.51

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	27,071.95
其中：交易所市场	27,071.95
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	18,667.26
合计	45,739.21

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

沪港深红利 LOF

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,205,083.01	17,205,083.01
本期申购	107,688,980.32	107,688,980.32
本期赎回（以“-”号填列）	-75,151,782.01	-75,151,782.01
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	49,742,281.32	49,742,281.32

银河高 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,207,154.67	1,207,154.67
本期申购	10,161,252.36	10,161,252.36

本期赎回（以“-”号填列）	-6,023,336.62	-6,023,336.62
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	5,345,070.41	5,345,070.41

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

沪港深红利 LOF

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,105,082.10	2,239,375.05	1,134,292.95
本期期初	-1,105,082.10	2,239,375.05	1,134,292.95
本期利润	2,617,816.02	2,440,781.35	5,058,597.37
本期基金份额交易产生的变动数	-1,086,661.38	3,146,595.32	2,059,933.94
其中：基金申购款	-4,148,170.72	12,488,301.04	8,340,130.32
基金赎回款	3,061,509.34	-9,341,705.72	-6,280,196.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	426,072.54	7,826,751.72	8,252,824.26

银河高 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-95,671.21	154,208.12	58,536.91
本期期初	-95,671.21	154,208.12	58,536.91
本期利润	259,205.60	65,407.63	324,613.23
本期基金份额交易产生的变动数	-212,048.80	605,846.77	393,797.97
其中：基金申购款	-474,670.89	1,375,269.20	900,598.31
基金赎回款	262,622.09	-769,422.43	-506,800.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-48,514.41	825,462.52	776,948.11

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,891.63
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	105.51

其他	63.79
合计	7,060.93

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1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,489,049.88
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	1,489,049.88

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	73,512,058.44
减：卖出股票成本总额	71,869,858.09
减：交易费用	153,150.47
买卖股票差价收入	1,489,049.88

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	236.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	236.46

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	1,492,221.34
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	1,492,221.34

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	2,506,188.98
股票投资	2,506,047.98
债券投资	141.00
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	2,506,188.98

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	77,340.16
合计	77,340.16

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	-5,815.74
信息披露费	17,187.66
证券出借违约金	-
银行费用	2,679.45
指数使用费	43,889.24
证券组合费	806.05
合计	58,746.66

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

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、基金销售机构
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
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

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	184,352,597.12	99.53	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
银河证券	299,919.00	100.00	-	-

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 2025年1月1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	33,183.38	99.53	27,071.95	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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（%）
-	-	-	-	-

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	92,525.07	41,773.29
其中：应支付销售机构的客户维护	21,181.01	14,454.94

费		
应支付基金管理人的净管理费	71,344.06	27,318.35

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×0.50%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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%÷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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,308.97	15,038.46

注：支付基金托管人北京银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.18%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×0.18%÷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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	沪港深红利 LOF	银河高 C	合计
北京银行	-	1,170.69	1,170.69
银河基金	-	16.49	16.49
银河证券	-	56.26	56.26
合计	-	1,243.44	1,243.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	沪港深红利 LOF	银河高 C	合计
北京银行	-	111.07	111.07
银河基金	-	17.13	17.13
银河证券	-	0.37	0.37
合计	-	128.57	128.57

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×0.25%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：银河高 C 的日销售服务费=前一日银河高 C 基金资产净值×0.25%÷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期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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	沪港深红利 LOF	银河高 C
基金合同生效日（ 2018 年 4 月 10 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	-
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	5,000,450.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.0527%	-
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	沪港深红利 LOF	银河高 C
基金合同生效日（ 2018 年 4 月 10 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,450.00	-

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	5,000,450.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.4242%	-

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
北京银行	4,004,082.39	6,891.63	3,210,727.44	2,281.53

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期末持有北京银行（代码 601169）71,500.00 股，期末公允价值为人民币 488,345.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.76%。

本基金本报告期末持有中国石油股份（代码 00857）86,000.00 股，期末公允价值为人民币 529,386.98 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.83%。

本基金本报告期末持有中国银河（代码 06881）59,000.00 股，期末公允价值为人民币 475,098.59 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.74%。

本基金本报告期末持有基金托管人（北京银行股份有限公司）关联方的股票：兴业银行（代码 601166）19,800.00 股，期末公允价值为人民币 462,132.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.72%。

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（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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603758	秦安股份	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	16.48	2025 年 7 月 11 日	16.00	59,400	762,869.29	978,912.00	-

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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	4,004,082.39	-	-	-	-	-	4,004,082.39
结算备付金	25,583.42	-	-	-	-	-	25,583.42
存出保证金	45,762.88	-	-	-	-	-	45,762.88
交易性金融资产	-	-	300,927.04	-	-	59,939,647.22	60,240,574.26
应收股利	-	-	-	-	-	502,215.42	502,215.42
应收申购款	-	-	-	-	-	297,742.99	297,742.99
应收清算款	-	-	-	-	-	588,411.56	588,411.56
资产总计	4,075,428.69	-	300,927.04	-	-	61,328,017.19	65,704,372.92
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,511,901.00	1,511,901.00

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,998.68	20,998.68
应付托管费	-	-	-	-	-	7,559.49	7,559.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,050.44	1,050.44
其他负债	-	-	-	-	-	45,739.21	45,739.21
负债总计	-	-	-	-	-	1,587,248.82	1,587,248.82
利率敏感度缺口	4,075,428.69	-	300,927.04	-	-	59,740,768.37	64,117,124.10
上年度末 2024 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	1,560,337.93	-	-	-	-	-	1,560,337.93
结算备付金	1,783.74	-	-	-	-	-	1,783.74
存出保证金	18,867.18	-	-	-	-	-	18,867.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	17,583,738.65	17,583,738.65
应收股利	-	-	-	-	-	24,251.71	24,251.71
应收申购款	-	-	-	-	-	455,260.53	455,260.53
应收清算款	-	-	-	-	-	190,384.88	190,384.88
资产总计	1,580,988.85	-	-	-	-	18,253,635.77	19,834,624.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	153,424.40	153,424.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,077.06	8,077.06
应付托管费	-	-	-	-	-	2,907.78	2,907.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	258.05	258.05
其他负债	-	-	-	-	-	64,889.79	64,889.79
负债总计	-	-	-	-	-	229,557.08	229,557.08
利率敏感度缺口	1,580,988.85	-	-	-	-	18,024,078.69	19,605,067.54

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

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。 2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）	上年度末 （2024 年 12 月

			31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	586.09	-
	市场利率上升 25 个基点	-586.09	-

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	31,069,945.54	-	31,069,945.54
资产合计	-	31,069,945.54	-	31,069,945.54
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	31,069,945.54	-	31,069,945.54
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	10,010,272.45	-	10,010,272.45
资产合计	-	10,010,272.45	-	10,010,272.45

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	10,010,272.45	-	10,010,272.45

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
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）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	所有外币相对人民币升值 5%	1,553,497.28	500,513.62
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,553,497.28	-500,513.62

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	59,939,647.22	93.48	17,583,738.65	89.69
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	59,939,647.22	93.48	17,583,738.65	89.69

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沪港深高股息指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定中证沪港深高股息指数变化 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）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	中证沪港深高股息指数上升 5%	2,964,436.48	527,868.70
	中证沪港深高股息指数下降 5%	-2,964,436.48	-527,868.70

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	58,960,735.22	17,583,738.65
第二层次	1,279,839.04	-
第三层次	-	-
合计	60,240,574.26	17,583,738.65

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	59,939,647.22	91.23
	其中：股票	59,939,647.22	91.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	300,927.04	0.46
	其中：债券	300,927.04	0.46
	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	4,029,665.81	6.13
8	其他各项资产	1,434,132.85	2.18
9	合计	65,704,372.92	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 31,069,945.54 元，占期末净值比例 48.46%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	6,983,609.00	10.89
C	制造业	10,928,808.40	17.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	611,064.00	0.95
E	建筑业	615,780.00	0.96
F	批发和零售业	650,294.00	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,505,189.00	3.91
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	4,794,120.28	7.48
K	房地产业	640,921.00	1.00
L	租赁和商务服务业	1,139,916.00	1.78
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	28,869,701.68	45.03

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	2,896,548.58	4.52
非周期性消费品	341,126.21	0.53
周期性消费品	1,073,967.04	1.68
能源	4,131,722.66	6.44
金融	9,170,093.51	14.30
医疗	-	-
工业	6,237,171.10	9.73
信息科技	1,166,790.00	1.82
电信服务	1,556,167.89	2.43

公用事业	1,043,069.21	1.63
房地产	3,453,289.34	5.39
合计	31,069,945.54	48.46

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	01919	中远海控	126,000	1,567,313.75	2.44
2	00316	东方海外国际	9,600	1,167,879.65	1.82
3	03668	兖煤澳大利亚	36,727	989,723.70	1.54
4	000937	冀中能源	170,700	981,525.00	1.53
5	603758	秦安股份	59,400	978,912.00	1.53
6	01308	海丰国际	41,000	940,357.24	1.47
7	01988	民生银行	207,045	840,225.36	1.31
8	002048	宁波华翔	44,900	826,609.00	1.29
9	00998	中信银行	120,278	820,462.67	1.28
10	00639	首钢资源	304,000	792,885.81	1.24
11	601825	沪农商行	81,600	791,520.00	1.23
12	600398	海澜之家	111,000	772,560.00	1.20
13	603156	养元饮品	34,500	730,020.00	1.14
14	06818	中国光大银行	198,313	708,938.04	1.11
15	601699	潞安环能	66,400	700,520.00	1.09
16	601077	渝农商行	94,342	673,601.88	1.05
17	03360	远东宏信	108,304	673,596.62	1.05
18	601000	唐山港	165,100	670,306.00	1.05
19	601225	陕西煤业	34,700	667,628.00	1.04
20	00939	建设银行	92,319	666,787.27	1.04
21	603565	中谷物流	69,100	659,905.00	1.03
22	601229	上海银行	62,100	658,881.00	1.03
23	01088	中国神华	23,632	656,234.11	1.02
24	00386	中国石油化工股份	175,050	656,107.44	1.02
25	01378	中国宏桥	40,000	655,874.44	1.02
26	600729	重庆百货	21,800	650,294.00	1.01
27	600971	恒源煤电	98,500	650,100.00	1.01
28	601006	大秦铁路	98,400	649,440.00	1.01
29	00303	VTECH HOLDINGS	12,354	641,611.82	1.00
30	000517	荣安地产	354,100	640,921.00	1.00
31	01288	农业银行	124,384	635,219.14	0.99

32	02343	太平洋航运	343,092	632,023.15	0.99
33	000983	山西焦煤	97,500	624,000.00	0.97
34	00546	阜丰集团	99,000	622,050.21	0.97
35	600919	江苏银行	51,900	619,686.00	0.97
36	600039	四川路桥	62,200	615,780.00	0.96
37	600750	江中药业	28,100	613,423.00	0.96
38	00363	上海实业控股	49,600	613,355.68	0.96
39	01336	新华保险	15,720	612,857.76	0.96
40	605368	蓝天燃气	62,100	611,064.00	0.95
41	01398	工商银行	107,648	610,614.87	0.95
42	00270	粤海投资	101,500	607,212.79	0.95
43	600066	宇通客车	24,400	606,584.00	0.95
44	01339	中国人民保险集团	111,365	606,309.09	0.95
45	00941	中国移动	7,620	605,263.04	0.94
46	601666	平煤股份	81,600	604,656.00	0.94
47	03988	中国银行	145,141	603,567.69	0.94
48	600546	山煤国际	68,800	600,624.00	0.94
49	03328	交通银行	89,000	592,493.92	0.92
50	600295	鄂尔多斯	67,140	584,789.40	0.91
51	600177	雅戈尔	79,800	582,540.00	0.91
52	600755	厦门国贸	96,200	582,010.00	0.91
53	600188	兖矿能源	47,600	579,292.00	0.90
54	600256	广汇能源	96,000	577,920.00	0.90
55	600901	江苏金租	94,840	574,730.40	0.90
56	600282	南钢股份	135,300	568,260.00	0.89
57	00142	第一太平	111,000	562,819.06	0.88
58	300389	艾比森	48,300	559,314.00	0.87
59	600153	建发股份	53,800	557,906.00	0.87
60	01908	建发国际集团	38,000	550,307.11	0.86
61	00010	恒隆集团	44,000	548,118.43	0.85
62	00683	嘉里建设	29,276	540,639.53	0.84
63	000651	格力电器	12,000	539,040.00	0.84
64	600997	开滦股份	91,000	535,990.00	0.84
65	002327	富安娜	72,100	534,982.00	0.83
66	00857	中国石油股份	86,000	529,386.98	0.83
67	600350	山东高速	49,300	525,538.00	0.82
68	600015	华夏银行	66,400	525,224.00	0.82
69	01888	建滔积层板	60,239	525,178.18	0.82
70	00144	招商局港口	39,935	520,787.74	0.81
71	002030	达安基因	86,000	520,300.00	0.81
72	00220	统一企业中国	59,000	511,147.98	0.80
73	03323	中国建材	149,375	510,834.49	0.80
74	600985	淮北矿业	45,000	510,300.00	0.80

75	002154	报 喜 鸟	133,600	502,336.00	0.78
76	000895	双汇发展	20,500	500,405.00	0.78
77	00728	中国电信	97,700	497,164.13	0.78
78	000830	鲁西化工	48,000	494,400.00	0.77
79	601169	北京银行	71,500	488,345.00	0.76
80	600123	兰花科创	74,700	487,044.00	0.76
81	02328	中国财险	35,000	485,157.40	0.76
82	600894	广日股份	45,600	478,344.00	0.75
83	06881	中国银河	59,000	475,098.59	0.74
84	601166	兴业银行	19,800	462,132.00	0.72
85	00017	新世界发展	87,432	454,481.59	0.71
86	00762	中国联通	53,500	453,740.72	0.71
87	00883	中国海洋石油	27,956	451,762.08	0.70
88	00101	恒隆地产	65,000	443,982.86	0.69
89	00081	中国海外宏洋集团	271,281	440,362.58	0.69
90	00371	北控水务集团	201,662	435,856.42	0.68
91	02611	国泰海通	37,800	434,343.55	0.68
92	00956	新天绿色能源	107,417	431,998.90	0.67
93	01898	中煤能源	50,300	416,509.45	0.65
94	00257	光大环境	116,700	406,541.84	0.63
95	01359	中国信达	330,947	404,421.54	0.63
96	01800	中国交通建设	83,131	388,912.05	0.61
97	00551	裕元集团	31,120	341,126.21	0.53
98	00914	海螺水泥	17,300	314,903.63	0.49
99	00123	越秀地产	76,503	299,997.72	0.47
100	00012	恒基地产	7,000	175,231.19	0.27
101	00813	世茂集团	200	134.97	0.00
102	01238	宝龙地产	124	33.36	0.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	01919	中远海控	2,567,462.74	13.10
2	600398	海澜之家	2,261,124.00	11.53
3	603758	秦安股份	2,252,532.00	11.49
4	603156	养元饮品	2,239,848.00	11.42
5	601825	沪农商行	2,128,668.00	10.86
6	601699	潞安环能	2,086,981.80	10.65

7	000937	冀中能源	2,069,989.00	10.56
8	603565	中谷物流	2,002,821.52	10.22
9	605368	蓝天燃气	1,935,089.00	9.87
10	601229	上海银行	1,870,401.00	9.54
11	601225	陕西煤业	1,832,822.00	9.35
12	601666	平煤股份	1,814,560.00	9.26
13	601000	唐山港	1,648,952.00	8.41
14	03668	兖煤澳大利亚	1,560,899.62	7.96
15	00316	东方海外国际	1,529,870.39	7.80
16	600729	重庆百货	1,527,039.00	7.79
17	002048	宁波华翔	1,407,337.00	7.18
18	600971	恒源煤电	1,362,699.00	6.95
19	600066	宇通客车	1,355,558.00	6.91
20	600546	山煤国际	1,335,918.00	6.81
21	601006	大秦铁路	1,331,914.00	6.79
22	01988	民生银行	1,330,211.83	6.79
23	601077	渝农商行	1,330,188.74	6.78
24	600188	兖矿能源	1,296,803.00	6.61
25	600755	厦门国贸	1,276,801.00	6.51
26	600282	南钢股份	1,259,988.00	6.43
27	600750	江中药业	1,250,072.00	6.38
28	000983	山西焦煤	1,239,464.00	6.32
29	000517	荣安地产	1,227,280.00	6.26
30	600177	雅戈尔	1,219,461.00	6.22
31	01308	海丰国际	1,218,370.07	6.21
32	00639	首钢资源	1,211,385.83	6.18
33	02343	太平洋航运	1,187,220.65	6.06
34	600015	华夏银行	1,186,692.00	6.05
35	600919	江苏银行	1,178,133.00	6.01
36	600153	建发股份	1,171,147.00	5.97
37	600039	四川路桥	1,168,465.00	5.96
38	600256	广汇能源	1,162,725.00	5.93
39	600295	鄂尔多斯	1,137,975.60	5.80
40	002327	富安娜	1,135,013.00	5.79
41	600350	山东高速	1,097,889.00	5.60
42	03360	远东宏信	1,085,013.82	5.53
43	00998	中信银行	1,067,867.43	5.45
44	600901	江苏金租	1,057,173.00	5.39
45	01088	中国神华	1,050,745.31	5.36
46	06818	中国光大银行	1,048,699.32	5.35
47	03988	中国银行	1,044,917.51	5.33

48	000651	格力电器	1,043,466.00	5.32
49	600123	兰花科创	1,035,885.00	5.28
50	01908	建发国际集团	1,033,987.12	5.27
51	002154	报 喜 鸟	1,021,112.00	5.21
52	600997	开滦股份	1,010,415.00	5.15
53	03328	交通银行	1,006,679.64	5.13
54	600894	广日股份	999,121.00	5.10
55	300389	艾比森	984,460.00	5.02
56	00386	中国石油化工股份	972,308.19	4.96
57	000895	双汇发展	968,204.00	4.94
58	03323	中国建材	967,732.01	4.94
59	00303	VTECH HOLDINGS	964,954.06	4.92
60	00728	中国电信	953,339.09	4.86
61	600985	淮北矿业	951,540.00	4.85
62	00546	阜丰集团	942,311.18	4.81
63	002030	达安基因	937,480.00	4.78
64	02328	中国财险	926,566.25	4.73
65	00270	粤海投资	920,730.87	4.70
66	000830	鲁西化工	920,656.00	4.70
67	00683	嘉里建设	919,605.26	4.69
68	00939	建设银行	912,346.33	4.65
69	01288	农业银行	883,737.36	4.51
70	01398	工商银行	882,530.74	4.50
71	00857	中国石油股份	874,690.39	4.46
72	00363	上海实业控股	868,406.78	4.43
73	00762	中国联通	859,317.36	4.38
74	00883	中国海洋石油	838,937.30	4.28
75	601166	兴业银行	835,954.00	4.26
76	601169	北京银行	833,233.00	4.25
77	00941	中国移动	832,056.33	4.24
78	01378	中国宏桥	827,811.32	4.22
79	00142	第一太平	756,122.39	3.86
80	00371	北控水务集团	747,598.76	3.81
81	01888	建滔积层板	734,050.68	3.74
82	01339	中国人民保险集团	730,718.43	3.73
83	00956	新天绿色能	727,070.40	3.71

		源		
84	00914	海螺水泥	721,701.08	3.68
85	02611	国泰海通	699,111.31	3.57
86	06881	中国银河	677,417.17	3.46
87	00220	统一企业中国	675,327.88	3.44
88	01336	新华保险	670,409.03	3.42
89	00081	中国海外宏洋集团	663,814.35	3.39
90	00257	光大环境	630,271.98	3.21
91	01800	中国交通建设	626,262.03	3.19
92	00010	恒隆集团	618,290.59	3.15
93	00144	招商局港口	614,397.12	3.13
94	01898	中煤能源	614,372.88	3.13
95	00012	恒基地产	543,897.80	2.77
96	00551	裕元集团	541,165.79	2.76
97	00017	新世界发展	538,519.35	2.75
98	00101	恒隆地产	534,056.89	2.72
99	00123	越秀地产	499,829.72	2.55
100	01359	中国信达	463,551.29	2.36

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	01919	中远海控	1,838,099.64	9.38
2	603758	秦安股份	1,805,591.00	9.21
3	600398	海澜之家	1,654,219.00	8.44
4	603156	养元饮品	1,614,716.95	8.24
5	601825	沪农商行	1,575,530.00	8.04
6	601699	潞安环能	1,498,134.00	7.64
7	605368	蓝天燃气	1,436,904.00	7.33
8	603565	中谷物流	1,432,931.00	7.31
9	601229	上海银行	1,411,120.00	7.20
10	000937	冀中能源	1,401,898.00	7.15
11	601666	平煤股份	1,312,714.00	6.70
12	601225	陕西煤业	1,307,204.00	6.67
13	601000	唐山港	1,129,728.00	5.76
14	03668	兖煤澳大利亚	1,029,181.60	5.25

15	600729	重庆百货	1,011,857.00	5.16
16	00316	东方海外国际	998,152.94	5.09
17	002048	宁波华翔	967,010.00	4.93
18	01988	民生银行	938,714.89	4.79
19	600066	宇通客车	896,091.00	4.57
20	600188	兖矿能源	876,071.10	4.47
21	601077	渝农商行	869,602.00	4.44
22	600546	山煤国际	866,399.00	4.42
23	02343	太平洋航运	854,750.47	4.36
24	600282	南钢股份	853,942.00	4.36
25	00639	首钢资源	835,888.96	4.26
26	601006	大秦铁路	834,806.00	4.26
27	600755	厦门国贸	830,587.00	4.24
28	600971	恒源煤电	826,697.00	4.22
29	600919	江苏银行	798,155.00	4.07
30	01308	海丰国际	791,415.37	4.04
31	600750	江中药业	784,089.00	4.00
32	600177	雅戈尔	774,997.00	3.95
33	600015	华夏银行	769,476.00	3.92
34	600039	四川路桥	766,647.00	3.91
35	000983	山西焦煤	762,392.00	3.89
36	600153	建发股份	754,943.00	3.85
37	600256	广汇能源	739,232.00	3.77
38	000517	荣安地产	737,964.00	3.76
39	002327	富安娜	728,774.00	3.72
40	03360	远东宏信	717,369.19	3.66
41	600350	山东高速	716,372.00	3.65
42	600295	鄂尔多斯	711,397.00	3.63
43	03988	中国银行	697,814.55	3.56
44	00728	中国电信	684,604.34	3.49
45	600901	江苏金租	682,440.00	3.48
46	06818	中国光大银行	678,843.25	3.46
47	00683	嘉里建设	673,253.06	3.43
48	00998	中信银行	671,760.06	3.43
49	02328	中国财险	667,026.97	3.40
50	03328	交通银行	664,992.40	3.39
51	000651	格力电器	659,471.00	3.36
52	002154	报 喜 鸟	656,573.00	3.35
53	01908	建发国际集团	653,134.81	3.33
54	600123	兰花科创	650,629.00	3.32
55	00762	中国联通	628,817.81	3.21

56	300389	艾比森	611,885.00	3.12
57	01088	中国神华	609,965.06	3.11
58	00546	阜丰集团	609,785.46	3.11
59	00303	VTECH HOLDINGS	609,046.47	3.11
60	002030	达安基因	602,178.40	3.07
61	600894	广日股份	599,702.00	3.06
62	600997	开滦股份	598,344.00	3.05
63	00883	中国海洋石油	597,806.07	3.05
64	03323	中国建材	593,212.86	3.03
65	00012	恒基地产	588,978.43	3.00
66	000895	双汇发展	560,785.00	2.86
67	01288	农业银行	560,490.90	2.86
68	00386	中国石油化工股份	559,304.02	2.85
69	01398	工商银行	558,818.15	2.85
70	00939	建设银行	553,303.06	2.82
71	600985	淮北矿业	552,096.00	2.82
72	00270	粤海投资	546,912.00	2.79
73	000830	鲁西化工	543,769.00	2.77
74	01378	中国宏桥	535,192.16	2.73
75	00363	上海实业控股	529,615.18	2.70
76	00914	海螺水泥	501,689.56	2.56
77	01339	中国人民保险集团	501,124.41	2.56
78	00956	新天绿色能源	487,917.63	2.49
79	01888	建滔积层板	483,709.53	2.47
80	02611	国泰海通	463,444.43	2.36
81	00142	第一太平	460,297.51	2.35
82	01336	新华保险	457,204.49	2.33
83	00941	中国移动	456,658.28	2.33
84	00371	北控水务集团	452,124.11	2.31
85	601166	兴业银行	444,857.00	2.27
86	00857	中国石油股份	425,437.35	2.17
87	601169	北京银行	410,515.00	2.09

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	111,719,718.68

卖出股票收入（成交）总额	73,512,058.44

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	300,927.04	0.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	300,927.04	0.47

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019773	25 国债 08	3,000	300,927.04	0.47

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

按照基金契约，本基金未从事股指期货交易。

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

按照基金契约，本基金未从事国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

按照基金契约，本基金未从事国债期货投资。

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	45,762.88
2	应收清算款	588,411.56
3	应收股利	502,215.42
4	应收利息	-
5	应收申购款	297,742.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,434,132.85

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

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	603758	秦安股份	978,912.00	1.53	重大事项停牌

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（%）
沪港深红利 LOF	2,295	21,674.20	6,597,215.00	13.26	43,145,066.32	86.74
银河高 C	1,331	4,015.83	1,771.82	0.03	5,343,298.59	99.97
合计	3,626	15,192.32	6,598,986.82	11.98	48,488,364.91	88.02

8.2 期末上市基金前十名持有人

沪港深红利 LOF

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	银河基金管理有限公司	5,000,450.00	10.05
2	王星宇	4,041,178.00	8.12
3	胥怀建	2,672,785.00	5.37
4	鲍刚	2,284,241.00	4.59
5	上海宁苑资产管理有限公司－宁苑沛华二号私募证券投资基金	1,414,763.00	2.84
6	张玉秀	1,279,320.00	2.57
7	赵杰	1,121,876.00	2.26
8	杨凯	1,100,000.00	2.21
9	邵伟彬	855,378.00	1.72
10	王莹	604,100.00	1.21

8.3 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	沪港深红利 LOF	6.00	0.0000
	银河高 C	-	-
	合计	6.00	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	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	沪港深红利 LOF	0
	银河高 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	沪港深红利 LOF	0
	银河高 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	沪港深红利 LOF	银河高 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 10 日）基金份额总额	164,948,483.01	40,891,858.67
本报告期期初基金份额总额	17,205,083.01	1,207,154.67
本报告期基金总申购份额	107,688,980.32	10,161,252.36
减：本报告期基金总赎回份额	75,151,782.01	6,023,336.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,742,281.32	5,345,070.41

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：

无。

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(%)	
银河证券	2	184,352,597.12	99.53	33,183.38	99.53	-
东北证券	1	879,180.00	0.47	158.24	0.47	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、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	299,919.00	100.00	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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关于银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）A 类基金份额场内溢价风险提示公告	《证券时报》、公司网站	2025 年 1 月 20 日
2	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)托管协议更新	《证券时报》、公司网站	2025 年 3 月 20 日
3	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
4	银河基金管理有限公司关于银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）A 类基金份额场内溢价风险提示公告	《证券时报》、公司网站	2025 年 4 月 7 日
5	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	2025 年 4 月 21 日

		报》、《证券日报》、公司网站	
6	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国邮政储蓄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活动的公告	《上海证券报》、公司网站	2025 年 4 月 25 日
7	银河基金管理有限公司关于银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）A 类基金份额场内溢价风险提示公告	《证券时报》、公司网站	2025 年 4 月 26 日
8	银河基金管理有限公司关于银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)投资关联方证券的公告	《证券时报》、公司网站	2025 年 5 月 6 日
9	银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	《证券时报》、公司网站	2025 年 5 月 23 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	20250101-20250119,20250205-20250406	5,000,450.00	0.00	0.00	5,000,450.00	9.08
个人	1	20250101-20250119,20250205-20250310	5,002,375.00	0.00	5,002,375.00	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沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）基金的文件

2、《银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）基金基金合同》

3、《银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）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、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）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