

银河银泰理财分红证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 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.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
8.6 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.....	60

8.7 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	60
8.8 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	60
8.9 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	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	62
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息	71
12.1 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	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河银泰理财分红证券投资基金
基金简称	银河银泰混合
场内简称	-
基金主代码	150103
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 3 月 30 日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,320,918,364.30 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	追求资产的安全性和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	<p>1（一）资产配置策略</p> <p>本基金采用多因素分析框架，合理配置股票、债券和现金等各类资产间的投资比例，确定风格资产、行业资产的投资比例布局。</p> <p>在遵循多因素分析框架的评估程序的同时，本基金将运用优化CPPI策略以实现控制股票投资风险暴露的目的。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金将在投资风险控制计划的指导下，获取股票市场投资的较高收益。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>（四）存托凭证投资策略</p>
业绩比较基准	上证A股指数×40%+中证全债指数×55%+金融同业存款利率×5%。
风险收益特征	本基金属于风险较低的投资品种，风险-收益水平介于债券基金与股票基金之间

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	郭明
	联系电话	021-38568989	010-66105799

	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95588
传真		021-38568769	010-66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		刘立达	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	1、中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层 2、北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
注册登记机构	银河基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	208,788,265.35	609,799,299.55	158,813,562.09
本期利润	111,150,130.08	703,620,206.87	412,951,801.45
加权平均基金份额本期利润	0.0839	0.6895	0.3840
本期加权平均净值利润率	7.31%	51.75%	36.75%
本期基金份额净值增长率	7.64%	67.13%	46.33%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	211,056,869.67	657,293,346.52	198,482,483.65
期末可供分配基金份额利润	0.1598	0.7098	0.1961
期末基金资产净值	1,531,975,233.97	1,583,335,156.07	1,210,674,171.83
期末基金份额净值	1.1598	1.7098	1.1961
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	1,220.83%	1,127.04%	634.19%

注：1、本期已实现收益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、上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（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

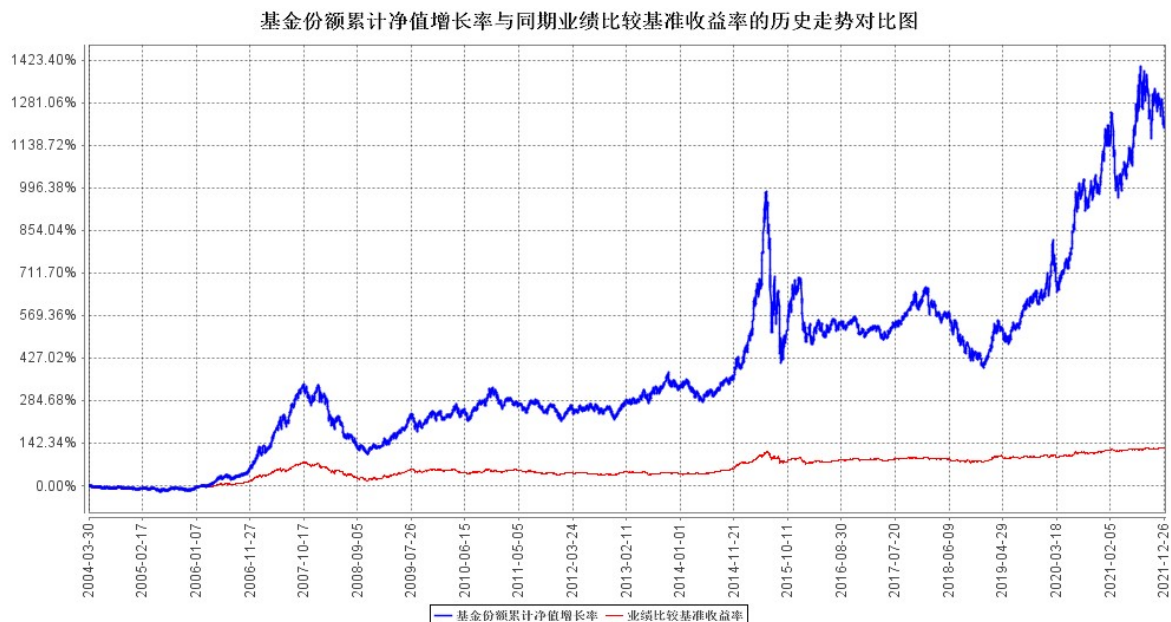
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-2.71%	1.54%	1.59%	0.25%	-4.30%	1.29%
过去六个月	1.24%	1.89%	2.44%	0.33%	-1.20%	1.56%
过去一年	7.64%	1.80%	5.29%	0.35%	2.35%	1.45%
过去三年	163.25%	1.57%	26.80%	0.44%	136.45%	1.13%
过去五年	115.61%	1.41%	22.26%	0.42%	93.35%	0.99%
自基金合同生效起至今	1,220.83%	1.49%	127.93%	0.62%	1,092.90%	0.87%

注：本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数×40%+中证全债指数×55%+金融同业存款利率×5%，

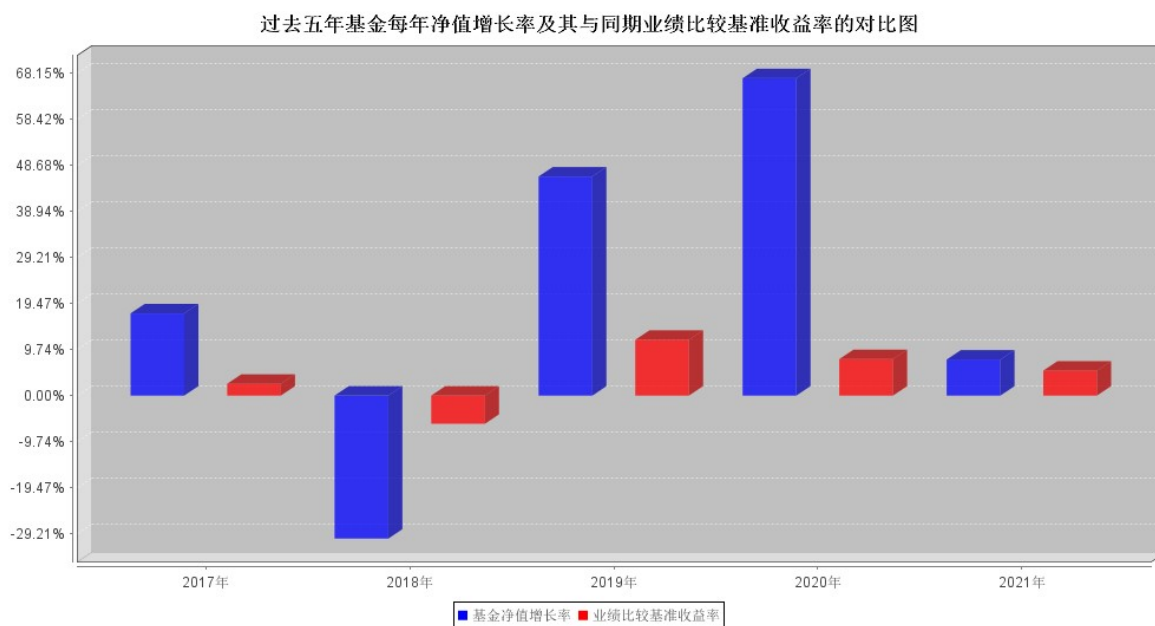
每日进行再平衡过程。

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：2004年3月30日本基金成立，根据《银河银泰理财分红证券投资基金基金合同》规定：基金成立6个月之后，本基金资产配置比例的基本范围是：股票投资的比例范围为基金资产净值的20%至80%；债券投资的比例范围为基金资产净值的20%至80%；现金的比例范围为基金资产净值的0%至20%。但由于我国资本市场的局限性，证券市场系统性风险较大，且缺乏避险工具，因此，本基金管理人将保留在极端市场情况下债券投资最高比例为95%，股票投资最低比例为0%的权利。截止本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 其他指标

注：无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	6.4300	128,252,306.69	459,261,568.67	587,513,875.36	
2020	1.7800	45,182,738.02	133,845,034.21	179,027,772.23	
2019	-	-	-	-	
合计	8.2100	173,435,044.71	593,106,602.88	766,541,647.59	

§ 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、银河久益回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、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、银河鸿利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、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资

基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金 (LOF)、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金、银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银河和美生活主题混合型证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金、银河中债-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、银河龙头精选股票型发起式证券投资基金、银河臻优稳健配置混合型证券投资基金、银河聚利 87 个月定期开放债券型证券投资基金、银河产业动力混合型证券投资基金、银河医药健康混合型证券投资基金、银河颐年稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银河兴益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银河悦宁稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张杨	基金经理	2011 年 10 月 10 日	-	17	硕士研究生学历，CFA，17 年证券从业经历，曾先后就职于上海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司，从事宏观经济及股票策略研究工作。2008 年 9 月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、总监助理、副总监等职务，现任公司投资业务总监兼股票投资部总监、基金经理。2011 年 10 月起担任银河银泰理财分红证券投资基金的基金经理，2016 年 2 月起担任银河主题策略混合型证券投资

					基金的基金经理，2016年3月起担任银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019年11月起担任银河新动能混合型证券投资基金的基金经理，2021年11月起担任银河成长优选一年持有期混合型证券投资基金基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上表中任职、离职日期均为我公司作出决定之日。

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

注：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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

无

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过制定严格的公平交易管理制度、投资管理制度，投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等一系列制度，从授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控和分析评估等各个环节予以落实，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

在投资决策环节，公司实行统一研究平台和统一的授权管理，所有投资组合经理在获取研究成果及投资建议等方面享有均等机会。公司分不同投资组合类别分别建立了投资备选库，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行方面，本基金管理人旗下管理的所有投资组合指令均执行集中交易制度，遵循“时间优先、价格优先”的原则，在满足系统公平交易的条件时自动进入公平交易程序，最大程度上确保公平对待各投资组合。在同日反向交易方面，除法规规定的特殊情况外，公司原则上禁止不同投资组合（完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合除外）之间的同日反向交易。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.3 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

2021 年市场出现震荡的走势，上证指数上涨 4.8%，创业板指数上涨 12.02%，上证 50 下跌 10.06%。全年来看，市场存在结构性行情，硬科技有较好的表现，新能源行业景气持续向上，带动电新行业指数表现突出；同时，疫情冲击下经济回暖带来顺周期行业表现更好一些，使得市场风格相对均衡。

从行业表现排名来看，居前的是电气设备、有色和化工等，居后的是休闲服务、农业和非银等。从这一行业表现分布来看，市场分化很大，结构性机会突出。

操作层面上，本基金维持了较高仓位，

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1598 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.64%，业绩比较基准收益率为 5.29%。

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 2022 年，全球主要国家疫情都有所反复，但是对经济的影响相对于德尔塔已经减弱；海外经济整体还处于复苏通道上，对中国影响主要是在两块：出口的分流效应和流动性收紧。市场预期美联储在 TAPER 的基础上明年甚至有可能加息，海外流动性会边际收紧；2022 年不少主要国家和地区都有各种形式的选举活动，关注政治力量变化对经济活动影响。2022 年，中国经济继续稳定增长，经济工作会议“三重压力”的表述也让市场更加相信政策维稳的取向确定性很高，政策稳增长诉求强烈，但是在节奏和方式上仍有分歧，宏观节奏上会比较类似于 19 年，即前低后高，稳增长见效要在下半年，货币政策上整体偏宽松，地产和基建是否会再度成为稳增长的抓手分歧较大，我们倾向于力度上会弱于历史经验。

展望 2022 年 A 股市场，市场预期为弱势震荡，但结构性行情依旧，整体上我们认为，市场 22 年不会太差，可能前低后高。居民增配权益资产的趋势没有结束，结构性分化会弱于前 2 年。从长周期的维度看，新经济替代老经济，科技周期延续的趋势没有改变，因此高景气度行业有望成为市场亮点；此外，我们相对看好疫情结束后消费服务。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 结合新颁布的法律法规及监管要求变化，定期开展合规培训，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照公司制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，确保独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对

现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

(4) 公司按照监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，针对投研交易、销售、运营、人员规范、反洗钱等重点业务领域开展例行或专项检查，坚持以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了由公司相关领导、监察部投资风控岗、研究部数量研究员、行业研究员、支持保障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。

4.8 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：基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%；基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益可不分配；基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

截至本报告期末，可分配收益为 211,056,869.67 元。

本基金于 2021 年 1 月 12 日实施分红，分红方案为每 10 份基金发放红利 6.43 元，收益分配比例不低于基金净收益的 90%。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对银河银泰理财分红证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，银河银泰理财分红证券投资基金的管理人——银河基金管理有限公司在银河银泰理财分红证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银河基金管理有限公司编制和披露的银河银泰理财分红证券投资基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2202093 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河银泰理财分红证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的银河银泰理财分红证券投资基金（以下简称“银河银泰混合”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了银河银泰混合 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银河银泰混合，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银河银泰混合管理人银河基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括银河银泰混合 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会

责任	<p>计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银河银泰混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非银河银泰混合计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银河银泰混合的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银河银泰混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如</p>

	<p>果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致银河银泰混合不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	王国蓓 汪霞
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2022年3月23日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银河银泰理财分红证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	14,655,777.24	6,268,089.87
结算备付金		4,527,842.34	4,943,556.34
存出保证金		616,074.91	488,772.50
交易性金融资产	7.4.7.2	1,541,268,042.72	1,574,767,542.15
其中：股票投资		1,212,027,412.72	1,257,832,217.01
基金投资		-	-
债券投资		329,240,630.00	316,935,325.14
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,624,342.47	10,203,952.23
应收利息	7.4.7.5	6,945,113.50	6,387,565.41
应收股利		-	-
应收申购款		133,260.78	235,684.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,571,770,453.96	1,603,295,162.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		34,000,000.00	2,000,000.00
应付证券清算款		-	9,648,369.08
应付赎回款		323,921.82	2,230,381.03
应付管理人报酬		1,999,632.94	1,909,200.21
应付托管费		333,272.15	318,200.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,782,094.67	2,487,907.89
应交税费		1,172,998.40	1,172,999.24
应付利息		7,248.48	-1,984.93

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	176,051.53	194,934.00
负债合计		39,795,219.99	19,960,006.52
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,320,918,364.30	926,041,809.55
未分配利润	7.4.7.10	211,056,869.67	657,293,346.52
所有者权益合计		1,531,975,233.97	1,583,335,156.07
负债和所有者权益总计		1,571,770,453.96	1,603,295,162.59

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1598 元，基金份额总额 1,320,918,364.30 份。

7.2 利润表

会计主体：银河银泰理财分红证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		154,477,375.99	742,964,335.90
1. 利息收入		11,164,197.00	11,068,924.58
其中：存款利息收入	7.4.7.11	185,301.77	251,763.68
债券利息收入		10,978,895.23	10,817,160.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		240,483,533.45	637,677,811.76
其中：股票投资收益	7.4.7.12	243,891,107.26	633,932,953.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-7,962,700.27	316,506.25
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,555,126.46	3,428,352.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-97,638,135.27	93,820,907.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	467,780.81	396,692.24
减：二、费用		43,327,245.91	39,344,129.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	22,840,780.78	20,334,196.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,806,796.75	3,389,032.64

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	15,924,419.08	14,976,830.96
5. 利息支出		551,408.47	416,365.41
其中：卖出回购金融资产支出		551,408.47	416,365.41
6. 税金及附加		1.36	4.75
7. 其他费用	7.4.7.20	203,839.47	227,699.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		111,150,130.08	703,620,206.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		111,150,130.08	703,620,206.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河银泰理财分红证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	926,041,809.55	657,293,346.52	1,583,335,156.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	111,150,130.08	111,150,130.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	394,876,554.75	30,127,268.43	425,003,823.18
其中：1. 基金申购款	583,727,270.87	67,924,777.50	651,652,048.37
2. 基金赎回款	-188,850,716.12	-37,797,509.07	-226,648,225.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-587,513,875.36	-587,513,875.36
五、期末所有者权益（基金净值）	1,320,918,364.30	211,056,869.67	1,531,975,233.97
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,012,191,688.18	198,482,483.65	1,210,674,171.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	703,620,206.87	703,620,206.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-86,149,878.63	-65,781,571.77	-151,931,450.40
其中：1. 基金申购款	205,869,358.61	31,728,902.89	237,598,261.50
2. 基金赎回款	-292,019,237.24	-97,510,474.66	-389,529,711.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-179,027,772.23	-179,027,772.23
五、期末所有者权益（基金净值）	926,041,809.55	657,293,346.52	1,583,335,156.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘立达	_____ 秦长建	_____ 刘晓彬
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银河银泰理财分红证券投资基金(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》、《银河银泰理财分红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[2004]12 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 6,013,222,027.96 份,经中瑞华恒信会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为中瑞华恒信验字[2004]第 2006 号的验资报告。基金合同于 2004 年 3 月 30 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《银河银泰理财分红证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的债券、

股票、央行票据、回购等金融工具，以及未来法律法规和中国证监会许可的其他金融工具。其中，债券投资包括国债、金融债、信用评级在投资级以上的企业债(包含可转换公司债券)等。本基金的投资组合为：(1) 本基金持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；(3) 投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；(4) 投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；(6) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；(7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；(8) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；(9) 遵守法律、法规或中国证监会规定的其他比例限制。在本基金成立后六个月内，达到上述比例限制及基金合同中规定的本基金投资组合的比例范围。除上述第(7)、(8)项外，因基金规模或市场的变化等原因导致的投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理期限内调整基金的投资组合，以符合上述规定。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数 $\times 40\%$ + 中证全债指数 $\times 55\%$ + 金融同业存款利率 $\times 5\%$ 。

7.4.2 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的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。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。

本基金持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

7.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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成本的差额确认。

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。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

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变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的单位基金资产净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利；

3) 基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益可不分配；

4) 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

5) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

6) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

7) 每一基金份额享有同等分配权；

8) 在符合上述有关基金分红条件的前提下，如果已经实现收益，则本基金可进行多次分红；

9) 基金的收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

10) 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者一定的比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在分红公告中规定；

11) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红实施日的基金份额净值转为基金份额；

12) 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个

人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	14,655,777.24	6,268,089.87
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	14,655,777.24	6,268,089.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		1,036,310,173.35	1,212,027,412.72	175,717,239.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	310,025,522.20	309,110,630.00	-914,892.20
	银行间市场	19,956,000.00	20,130,000.00	174,000.00
	合计	329,981,522.20	329,240,630.00	-740,892.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,366,291,695.55	1,541,268,042.72	174,976,347.17
项目	上年度末 2020年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		980,116,691.93	1,257,832,217.01	277,715,525.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	302,080,367.78	296,491,325.14	-5,589,042.64
	银行间市场	19,956,000.00	20,444,000.00	488,000.00
	合计	322,036,367.78	316,935,325.14	-5,101,042.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,302,153,059.71	1,574,767,542.15	272,614,482.44

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	1,667.56	695.49
应收定期存款利息	-	-

应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,241.25	2,447.06
应收债券利息	6,940,871.80	6,384,168.93
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	27.86	12.04
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	305.03	241.89
合计	6,945,113.50	6,387,565.41

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,781,972.17	2,487,907.89
银行间市场应付交易费用	122.50	-
合计	1,782,094.67	2,487,907.89

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,051.53	5,934.00
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费用	45,000.00	60,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提账户维护费	9,000.00	9,000.00
合计	176,051.53	194,934.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	926,041,809.55	926,041,809.55
本期申购	583,727,270.87	583,727,270.87
本期赎回（以“-”号填列）	-188,850,716.12	-188,850,716.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,320,918,364.30	1,320,918,364.30

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	661,703,044.97	-4,409,698.45	657,293,346.52
本期利润	208,788,265.35	-97,638,135.27	111,150,130.08
本期基金份额交易产生的变动数	43,582,132.71	-13,454,864.28	30,127,268.43
其中：基金申购款	89,908,171.79	-21,983,394.29	67,924,777.50
基金赎回款	-46,326,039.08	8,528,530.01	-37,797,509.07
本期已分配利润	-587,513,875.36	-	-587,513,875.36
本期末	326,559,567.67	-115,502,698.00	211,056,869.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	101,782.22	180,162.15
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	74,193.61	62,717.33
其他	9,325.94	8,884.20
合计	185,301.77	251,763.68

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	5,316,397,851.13	5,060,426,562.30
减：卖出股票成本总额	5,072,506,743.87	4,426,493,609.05
买卖股票差价收入	243,891,107.26	633,932,953.25

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,962,700.27	316,506.25
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	-7,962,700.27	316,506.25

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	468,192,439.24	148,255,276.88
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	466,936,363.29	144,328,274.82
减：应收利息总额	9,218,776.22	3,610,495.81
买卖债券差价收入	-7,962,700.27	316,506.25

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
股票投资产生的股利收益	4,555,126.46	3,428,352.26
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	4,555,126.46	3,428,352.26

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	-97,638,135.27	93,820,907.32
——股票投资	-101,998,285.71	96,982,455.56
——债券投资	4,360,150.44	-3,161,548.24
——资产支持证券投资	-	-
——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	-97,638,135.27	93,820,907.32

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
基金赎回费收入	466,782.36	388,246.53
基金转换费收入	998.45	8,146.92
其他	-	298.79
合计	467,780.81	396,692.24

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
交易所市场交易费用	15,923,819.08	14,976,830.96
银行间市场交易费用	600.00	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	15,924,419.08	14,976,830.96

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	1,200.00	1,200.00
银行间账户维护费	36,000.00	45,000.00
银行费用	1,639.47	1,499.10
合计	203,839.47	227,699.10

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

基金于资产负债表日之后、年度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 2022 年 1 月 8 日发布的分红公告，本基金向 2022 年 1 月 11 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 1.4600 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。

7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司（“银河金控”）	基金管理人的控股股东
中国石油天然气集团有限公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司（“首都机场”）	基金管理人的股东

上海城投(集团)有限公司(“上海城投”)	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司(“银河证券”)	同受基金管理人控股股东控制、基金代销机构

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	573,820,076.57	5.51%	34,987,539.85	0.36%

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
银河证券	243,000,000.00	21.00%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

注：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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31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	534,397.05	5.58%	175,415.17	9.84%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	32,584.40	0.37%	-	-

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	22,840,780.78	20,334,196.17
其中：支付销售机构的客户维护费	10,461,017.42	6,678,397.73

注：支付基金管理人银河基金的基金管理费按前一日基金资产净值×1.50%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×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,806,796.75	3,389,032.64

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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**7.4.10.4.1 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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	工商银行	14,655,777.24	101,782.22	6,268,089.87

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序	除息日	每 10 份	现金形式	再投资形式	本期利润分配

号	权益 登记日	场内	场外	基金份额分 红数	发放总额	发放总额	合计	备注
1	2021 年 1 月 12 日	-	2021 年 1 月 12 日	6.4300	128,252,306.69	459,261,568.67	587,513,875.36	
合计	-	-		6.4300	128,252,306.69	459,261,568.67	587,513,875.36	

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	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
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁定	8.86	23.76	555	4,917.30	13,186.80	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁定	11.48	67.37	4,926	56,550.48	331,864.62	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	8.29	26.02	782	6,482.78	20,347.64	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	10.64	30.38	421	4,479.44	12,789.98	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	9.46	41.39	290	2,743.40	12,003.10	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股锁定	6.96	12.44	2,064	14,365.44	25,676.16	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定	1.55	20.84	403	624.65	8,398.52	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股锁定	18.03	62.64	203	3,660.09	12,715.92	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股锁定	11.45	16.61	286	3,274.70	4,750.46	-
688501	青达环保	2021 年 7 月 9 日	2022 年 1 月 17 日	新股锁定	10.57	21.05	1,759	18,592.63	37,026.95	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股锁定	5.31	13.49	733	3,892.23	9,888.17	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定	14.14	89.74	462	6,532.68	41,459.88	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定	6.10	31.45	242	1,476.20	7,610.90	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股锁定	15.14	59.93	108	1,635.12	6,472.44	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定	4.97	12.49	513	2,549.61	6,407.37	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	新股锁定	22.04	56.23	644	14,193.76	36,212.12	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	新股锁定	23.38	29.80	205	4,792.90	6,109.00	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	14.82	24.17	193	2,860.26	4,664.81	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	新股锁定	4.57	20.90	444	2,029.08	9,279.60	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	11.90	45.42	420	4,998.00	19,076.40	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股锁定	7.31	28.18	215	1,571.65	6,058.70	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	8.34	48.96	290	2,418.60	14,198.40	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	新股锁定	4.13	12.95	843	3,481.59	10,916.85	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	19.34	32.88	196	3,790.64	6,444.48	-

301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定	11.87	28.77	155	1,839.85	4,459.35	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定	8.03	19.01	218	1,750.54	4,144.18	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定	8.09	19.29	259	2,095.31	4,996.11	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定	4.17	30.91	587	2,447.79	18,144.17	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定	9.96	27.28	203	2,021.88	5,537.84	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定	17.40	36.13	153	2,662.20	5,527.89	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	5.17	44.15	539	2,786.63	23,796.85	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	13.98	28.36	144	2,013.12	4,083.84	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定	7.46	33.38	181	1,350.26	6,041.78	-
688272	富吉瑞	2021年10月8日	2022年4月18日	新股锁定	22.56	43.56	1,263	28,493.28	55,016.28	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定	11.92	29.17	140	1,668.80	4,083.80	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股锁定	93.09	75.43	848	78,940.32	63,964.64	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股锁定	33.16	24.99	704	23,344.64	17,592.96	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股锁定	36.50	31.42	524	19,126.00	16,464.08	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	58.08	50.21	409	23,754.72	20,535.89	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	36.31	35.50	323	11,728.13	11,466.50	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股锁定	13.00	23.25	647	8,411.00	15,042.75	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定	60.66	116.58	1,054	63,935.64	122,875.32	-
688049	炬芯科技	2021年11月22日	2022年5月30日	新股锁定	42.98	58.05	3,260	140,114.80	189,243.00	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定	21.76	34.24	262	5,701.12	8,970.88	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	10.48	43.93	379	3,971.92	16,649.47	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	12.37	21.35	662	8,188.94	14,133.70	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	29.28	33.50	402	11,770.56	13,467.00	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定	43.99	52.42	295	12,977.05	15,463.90	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	30.08	297	9,126.81	8,933.76	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	116.88	122.05	792	92,568.96	96,663.60	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	26.17	53.55	285	7,458.45	15,261.75	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定	27.81	34.57	599	16,658.19	20,707.43	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	90.93	280	19,569.20	25,460.40	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	66.18	57.13	435	28,788.30	24,851.55	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	95.89	253	21,773.18	24,260.17	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年1月7日	新股流通受限	22.98	22.98	29,578	679,702.44	679,702.44	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 10,000,000.00 元、24,000,000 元, 于 2022 年 1 月 4 日、1 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注: 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	296,456,450.00	88,991,100.00
合计	296,456,450.00	88,991,100.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	706,055.14
未评级	32,784,180.00	227,238,170.00
合计	32,784,180.00	227,944,225.14

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	14,655,777.24	-	-	-	-	-	14,655,777.24
结算备付金	4,527,842.34	-	-	-	-	-	4,527,842.34
存出保证金	616,074.91	-	-	-	-	-	616,074.91
交易性金融资产	236,047,200.00	-	93,193,430.00	-	-	1,212,027,412.72	1,541,268,042.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,624,342.47	3,624,342.47
应收利息	-	-	-	-	-	6,945,113.50	6,945,113.50
应收申购款	700.00	-	-	-	-	132,560.78	133,260.78
资产总计	255,847,594.49	-	93,193,430.00	-	-	1,222,729,429.47	1,571,770,453.96
负债							
卖出回购金融资 产款	34,000,000.00	-	-	-	-	-	34,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	323,921.82	323,921.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,999,632.94	1,999,632.94
应付托管费	-	-	-	-	-	333,272.15	333,272.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,782,094.67	1,782,094.67
应付利息	-	-	-	-	-	7,248.48	7,248.48
应交税费	-	-	-	-	-	1,172,998.40	1,172,998.40
其他负债	-	-	-	-	-	176,051.53	176,051.53
负债总计	34,000,000.00	-	-	-	-	5,795,219.99	39,795,219.99
利率敏感度缺口	221,847,594.49	-	93,193,430.00	-	-	1,216,934,209.48	1,531,975,233.97
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,268,089.87	-	-	-	-	-	6,268,089.87
结算备付金	4,943,556.34	-	-	-	-	-	4,943,556.34
存出保证金	488,772.50	-	-	-	-	-	488,772.50
交易性金融资产	88,991,100.00	-	194,687,285.14	33,256,940.00	-	1,257,832,217.01	1,574,767,542.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,203,952.23	10,203,952.23
应收利息	-	-	-	-	-	6,387,565.41	6,387,565.41
应收申购款	200.00	-	-	-	-	235,484.09	235,684.09
资产总计	100,691,718.71	-	194,687,285.14	33,256,940.00	-	1,274,659,218.74	1,603,295,162.59
负债							
卖出回购金融资 产款	2,000,000.00	-	-	-	-	-	2,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,648,369.08	9,648,369.08
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,230,381.03	2,230,381.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,909,200.21	1,909,200.21

应付托管费	-	-	-	-	318,200.00	318,200.00
应付交易费用	-	-	-	-	2,487,907.89	2,487,907.89
应付利息	-	-	-	-	-1,984.93	-1,984.93
应交税费	-	-	-	-	1,172,999.24	1,172,999.24
其他负债	-	-	-	-	194,934.00	194,934.00
负债总计	2,000,000.00	-	-	-	17,960,006.52	19,960,006.52
利率敏感度缺口	98,691,718.71	-194,687,285.14	33,256,940.00	-	-1,256,699,212.22	1,583,335,156.07

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	139,246.99	390,823.38
市场利率上升 25 个基点	-139,246.99	-390,823.38	

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日		2020 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	1,212,027,412.72	79.12	1,257,832,217.01	79.44
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	1,212,027,412.72	79.12	1,257,832,217.01	79.44

7.4.13.4.3.2 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上证 A 股指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	2、假定上证 A 股指数变化 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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	上证 A 股指数上升 5%	82,387,996.26	82,905,760.56
	上证 A 股指数下降 5%	-82,387,996.26	-82,905,760.56

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1 以公允价值计量的资产和负债

(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。

(2) 持续的以公允价值计量的金融工具

(a) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属

于第一层次的余额为人民币 1,208,028,651.86 元,第二层次的余额为人民币 333,239,390.86 元,无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日:第一层次的余额为人民币 1,253,321,463.59 元,第二层次的余额为人民币 316,701,157.53 元,第三层次的余额为人民币 4,744,921.03 元)。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时,本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值的层次。

(c) 第三层次公允价值计量的金融工具

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下:上年度末余额为人民币 4,744,921.03 元,本期转入第三层次金额为人民币 0.00 元,转出第三层次金额为人民币 4,744,921.03 元,当期计入损益的利得或损失总额为人民币 -2,376,930.09 元,本期购买金额为人民币 0.00 元,出售金额为人民币 0.00 元,本期末余额为人民币 0.00 元,本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动金额为人民币 0.00 元。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020 年 12 月 31 日:无)。

2 其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

3 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定,对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据,将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,212,027,412.72	77.11
	其中：股票	1,212,027,412.72	77.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	329,240,630.00	20.95
	其中：债券	329,240,630.00	20.95
	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	19,183,619.58	1.22
8	其他各项资产	11,318,791.66	0.72
9	合计	1,571,770,453.96	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	63,210,588.12	4.13
B	采矿业	1,301,500.00	0.08
C	制造业	919,420,497.76	60.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,453,800.13	1.01
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	220,933.85	0.01
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	67,425,691.19	4.40
J	金融业	90,618,149.68	5.92
K	房地产业	49,166,572.35	3.21
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,673,643.56	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	1,077,261.92	0.07

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	416,144.17	0.03
R	文化、体育和娱乐业	37,916.19	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,212,027,412.72	79.12

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	300751	迈为股份	217,500	139,700,250.00	9.12
2	002241	歌尔股份	1,990,000	107,659,000.00	7.03
3	300059	东方财富	2,440,000	90,548,400.00	5.91
4	603688	石英股份	1,351,914	85,319,292.54	5.57
5	603105	芯能科技	4,686,400	77,887,968.00	5.08
6	300750	宁德时代	126,000	74,088,000.00	4.84
7	002812	恩捷股份	277,823	69,566,879.20	4.54
8	688536	思瑞浦	85,375	65,568,000.00	4.28
9	300498	温氏股份	3,281,962	63,210,588.12	4.13
10	603501	韦尔股份	196,300	61,004,151.00	3.98
11	688598	金博股份	167,000	59,291,680.00	3.87
12	002006	精功科技	2,093,000	56,259,840.00	3.67
13	600641	万业企业	1,477,805	49,166,572.35	3.21
14	600745	闻泰科技	330,000	42,669,000.00	2.79
15	002025	航天电器	388,000	32,572,600.00	2.13
16	600111	北方稀土	405,000	18,549,000.00	1.21
17	002594	比亚迪	68,600	18,393,032.00	1.20
18	600703	三安光电	471,300	17,702,028.00	1.16
19	600905	三峡能源	2,057,763	15,453,800.13	1.01
20	603893	瑞芯微	74,800	10,240,120.00	0.67
21	600460	士兰微	180,000	9,756,000.00	0.64
22	600702	舍得酒业	40,000	9,092,000.00	0.59
23	002460	赣锋锂业	60,000	8,571,000.00	0.56
24	300568	星源材质	200,000	7,346,000.00	0.48
25	003022	联泓新科	190,000	6,923,600.00	0.45

26	603259	药明康德	30,000	3,557,400.00	0.23
27	300661	圣邦股份	5,875	1,815,375.00	0.12
28	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.11
29	002192	融捷股份	10,000	1,301,500.00	0.08
30	000888	峨眉山 A	160,000	1,056,000.00	0.07
31	002475	立讯精密	20,000	984,000.00	0.06
32	688176	亚虹医药	29,578	679,702.44	0.04
33	688981	中芯国际	10,000	529,900.00	0.03
34	300896	爱美客	852	456,765.72	0.03
35	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.03
36	600887	伊利股份	10,000	414,600.00	0.03
37	600763	通策医疗	2,000	398,000.00	0.03
38	688239	航宇科技	4,926	331,864.62	0.02
39	688049	炬芯科技	3,260	189,243.00	0.01
40	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.01
41	301155	海力风电	1,054	122,875.32	0.01
42	301177	迪阿股份	792	96,663.60	0.01
43	688210	统联精密	2,218	91,958.28	0.01
44	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
45	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
46	301087	可孚医疗	848	63,964.64	0.00
47	688272	富吉瑞	1,263	55,016.28	0.00
48	300973	立高食品	360	47,548.80	0.00
49	301029	怡合达	462	41,459.88	0.00
50	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
51	688501	青达环保	1,759	37,026.95	0.00
52	301035	润丰股份	644	36,212.12	0.00
53	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
54	301039	中集车辆	2,064	25,676.16	0.00
55	301221	光庭信息	280	25,460.40	0.00
56	301189	C 奥尼	435	24,851.55	0.00
57	301166	C 优宁维	253	24,260.17	0.00
58	301069	凯盛新材	539	23,796.85	0.00
59	301100	风光股份	599	20,707.43	0.00
60	301093	华兰股份	409	20,535.89	0.00
61	301018	申菱环境	782	20,347.64	0.00
62	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
63	300994	久祺股份	420	19,076.40	0.00
64	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00

65	301060	兰卫医学	587	18,144.17	0.00
66	301088	戎美股份	704	17,592.96	0.00
67	301111	粤万年青	379	16,649.47	0.00
68	301091	深城交	524	16,464.08	0.00
69	301179	泽宇智能	295	15,463.90	0.00
70	301138	华研精机	285	15,261.75	0.00
71	301188	力诺特玻	647	15,042.75	0.00
72	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
73	301046	能辉科技	290	14,198.40	0.00
74	301126	达嘉维康	662	14,133.70	0.00
75	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
76	301199	迈赫股份	402	13,467.00	0.00
77	301017	漱玉平民	555	13,186.80	0.00
78	301020	密封科技	421	12,789.98	0.00
79	301026	浩通科技	203	12,715.92	0.00
80	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
81	301021	英诺激光	290	12,003.10	0.00
82	301092	争光股份	323	11,466.50	0.00
83	301048	金鹰重工	843	10,916.85	0.00
84	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
85	301028	东亚机械	733	9,888.17	0.00
86	300774	倍杰特	444	9,279.60	0.00
87	301198	喜悦智行	262	8,970.88	0.00
88	301193	家联科技	297	8,933.76	0.00
89	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
90	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
91	301025	读客文化	403	8,398.52	0.00
92	301030	仕净科技	242	7,610.90	0.00
93	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
94	301033	迈普医学	108	6,472.44	0.00
95	301049	超越科技	196	6,444.48	0.00
96	301032	新柴股份	513	6,407.37	0.00
97	301036	双乐股份	205	6,109.00	0.00
98	301041	金百泽	215	6,058.70	0.00
99	301072	中捷精工	181	6,041.78	0.00
100	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
101	300854	中兰环保	203	5,537.84	0.00
102	301063	海锅股份	153	5,527.89	0.00
103	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00

104	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
105	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
106	301059	金三江	259	4,996.11	0.00
107	301027	华蓝集团	286	4,750.46	0.00
108	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
109	301037	保立佳	193	4,664.81	0.00
110	301053	远信工业	155	4,459.35	0.00
111	301057	汇隆新材	218	4,144.18	0.00
112	301068	大地海洋	144	4,083.84	0.00
113	301079	邵阳液压	140	4,083.80	0.00
114	688777	中控技术	10	758.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002241	歌尔股份	215,269,586.95	13.60
2	002460	赣锋锂业	208,935,346.68	13.20
3	300661	圣邦股份	166,685,719.64	10.53
4	601012	隆基股份	161,037,984.89	10.17
5	002594	比亚迪	156,163,959.36	9.86
6	603259	药明康德	155,508,541.11	9.82
7	300059	东方财富	155,365,768.24	9.81
8	600460	士兰微	149,661,530.00	9.45
9	300274	阳光电源	148,836,396.84	9.40
10	603501	韦尔股份	136,950,035.88	8.65
11	002415	海康威视	127,435,605.48	8.05
12	600111	北方稀土	118,252,798.01	7.47
13	000009	中国宝安	114,004,658.27	7.20
14	300750	宁德时代	110,476,964.04	6.98
15	603806	福斯特	97,241,410.34	6.14
16	300568	星源材质	96,502,031.34	6.09
17	000858	五粮液	96,461,028.04	6.09
18	603517	绝味食品	89,076,163.92	5.63
19	688390	固德威	83,428,508.86	5.27

20	603260	合盛硅业	77,209,889.00	4.88
21	600309	万华化学	76,498,412.40	4.83
22	002812	恩捷股份	76,404,984.97	4.83
23	603688	石英股份	76,050,867.60	4.80
24	601633	长城汽车	73,059,076.56	4.61
25	600031	三一重工	72,288,870.22	4.57
26	003022	联泓新科	71,296,161.85	4.50
27	603799	华友钴业	70,087,849.39	4.43
28	603105	芯能科技	69,333,912.57	4.38
29	600703	三安光电	66,244,264.56	4.18
30	688598	金博股份	62,274,495.64	3.93
31	002006	精功科技	60,042,208.00	3.79
32	002079	苏州固锴	58,664,868.74	3.71
33	688536	思瑞浦	57,590,125.52	3.64
34	300498	温氏股份	56,645,341.48	3.58
35	603993	洛阳钼业	54,434,862.00	3.44
36	601966	玲珑轮胎	52,331,021.28	3.31
37	600641	万业企业	50,365,707.10	3.18
38	300751	迈为股份	47,921,803.00	3.03
39	600176	中国巨石	47,810,156.44	3.02
40	300655	晶瑞电材	47,115,141.55	2.98
41	600346	恒力石化	46,427,457.49	2.93
42	300346	南大光电	45,565,947.70	2.88
43	600745	闻泰科技	44,097,213.91	2.79
44	601888	中国中免	42,478,687.60	2.68
45	002466	天齐锂业	42,070,249.48	2.66
46	300390	天华超净	41,273,668.77	2.61
47	600597	光明乳业	39,693,578.12	2.51
48	002352	顺丰控股	38,835,310.04	2.45
49	601899	紫金矿业	35,929,864.00	2.27
50	600426	华鲁恒升	35,334,787.00	2.23
51	600519	贵州茅台	34,487,112.00	2.18

注：本项及下项 8.4.2，8.4.3 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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002460	赣锋锂业	320,799,895.40	20.26
2	603259	药明康德	238,793,613.54	15.08
3	002241	歌尔股份	196,391,717.68	12.40
4	601012	隆基股份	153,491,308.16	9.69
5	300661	圣邦股份	150,942,589.50	9.53
6	300274	阳光电源	137,715,007.21	8.70
7	600460	士兰微	134,876,560.38	8.52
8	300750	宁德时代	127,841,937.01	8.07
9	002594	比亚迪	125,722,363.78	7.94
10	300751	迈为股份	122,863,146.72	7.76
11	300568	星源材质	120,852,263.13	7.63
12	002415	海康威视	120,009,963.00	7.58
13	000009	中国宝安	117,006,402.48	7.39
14	600111	北方稀土	109,685,270.99	6.93
15	688390	固德威	106,271,363.43	6.71
16	603501	韦尔股份	101,531,683.96	6.41
17	603806	福斯特	100,723,674.21	6.36
18	003022	联泓新科	98,534,980.05	6.22
19	601899	紫金矿业	98,527,338.74	6.22
20	600754	锦江酒店	97,534,114.81	6.16
21	300073	当升科技	94,315,764.81	5.96
22	000858	五粮液	92,249,771.36	5.83
23	000568	泸州老窖	83,599,637.77	5.28
24	603517	绝味食品	75,882,686.82	4.79
25	688408	中信博	70,794,614.12	4.47
26	300059	东方财富	69,550,630.35	4.39
27	601633	长城汽车	69,379,611.43	4.38
28	002352	顺丰控股	69,272,651.80	4.38
29	601966	玲珑轮胎	67,933,288.13	4.29
30	600703	三安光电	67,602,325.55	4.27
31	603799	华友钴业	66,415,995.62	4.19
32	600426	华鲁恒升	65,377,948.46	4.13
33	603260	合盛硅业	64,914,103.12	4.10
34	600309	万华化学	64,609,658.02	4.08

35	601888	中国中免	62,065,237.80	3.92
36	002475	立讯精密	60,626,358.95	3.83
37	600031	三一重工	56,162,986.00	3.55
38	300037	新宙邦	56,003,893.44	3.54
39	600438	通威股份	55,821,564.84	3.53
40	002079	苏州固锝	49,326,414.00	3.12
41	603993	洛阳钼业	49,312,667.47	3.11
42	300346	南大光电	46,188,046.67	2.92
43	600346	恒力石化	41,456,092.00	2.62
44	002466	天齐锂业	40,897,617.24	2.58
45	300390	天华超净	40,342,204.25	2.55
46	600176	中国巨石	39,657,925.95	2.50
47	300655	晶瑞电材	38,208,401.63	2.41
48	600519	贵州茅台	37,230,460.10	2.35
49	002709	天赐材料	36,313,001.80	2.29
50	600584	长电科技	36,031,111.55	2.28
51	600597	光明乳业	35,480,119.85	2.24

8.4.3 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	5,128,700,225.29
卖出股票收入（成交）总额	5,316,397,851.13

8.5 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	296,456,450.00	19.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	32,784,180.00	2.14
	其中：政策性金融债	32,784,180.00	2.14
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	329,240,630.00	21.49

8.6 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	019649	21 国债 01	2,360,000	236,047,200.00	15.41
2	019658	21 国债 10	605,000	60,409,250.00	3.94
3	120222	12 国开 22	200,000	20,130,000.00	1.31
4	018006	国开 1702	126,000	12,654,180.00	0.83

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金依据基金合同未进行股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金依据基金合同未进行股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 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	616,074.91
2	应收证券清算款	3,624,342.47
3	应收股利	-
4	应收利息	6,945,113.50
5	应收申购款	133,260.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,318,791.66

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
27,238	48,495.42	8,561,223.04	0.65%	1,312,357,141.26	99.35%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,130.43	0.0001%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年3月30日）基金份额总额	6,013,222,027.96
本报告期期初基金份额总额	926,041,809.55
本报告期基金总申购份额	583,727,270.87
减:本报告期基金总赎回份额	188,850,716.12
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,320,918,364.30

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2021 年 3 月 13 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》，钱睿南先生个人原因辞职，自 2021 年 3 月 12 日起不再担任银河基金管理有限公司副总经理职务。

2、2021 年 7 月 8 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2021 年 7 月 6 日起陈勇先生离任基金管理人副总经理、首席信息官职务。

3、2021 年 9 月 16 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》，高见先生个人原因辞职，自 2021 年 9 月 15 日起不再担任银河基金管理有限公司总经理职务。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资范围增加存托凭证投资品种，投资策略相应改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金审计工作。

本基金本期报告内应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 45,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
东方证券	1	1,909,297,441.68	18.34%	1,739,941.98	18.16%	-
国金证券	1	1,504,267,201.69	14.45%	1,400,921.58	14.62%	-
长城证券	2	1,413,051,597.24	13.58%	1,315,974.99	13.73%	-
国信证券	1	1,186,584,222.64	11.40%	1,081,334.35	11.29%	-
招商证券	1	1,183,540,875.64	11.37%	1,078,559.39	11.26%	-
中金公司	2	727,949,815.87	6.99%	672,216.78	7.02%	-
国泰君安	1	637,396,496.07	6.12%	593,606.22	6.20%	-
银河证券	6	573,820,076.57	5.51%	534,397.05	5.58%	-
海通证券	1	445,759,782.42	4.28%	406,222.39	4.24%	-
太平洋证券	1	357,370,311.82	3.43%	325,670.05	3.40%	-
长江证券	1	186,653,137.99	1.79%	170,098.46	1.78%	-
川财证券	1	146,741,448.53	1.41%	136,661.61	1.43%	-
华泰联合	2	135,730,411.11	1.30%	126,405.90	1.32%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

注：1、专用席位的选择标准和程序

选择证券公司专用席位的标准

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

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

11.7.2 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
东方证券	1,822,029.85	0.44%	-	-	-	-
国金证券	70,474,910.00	16.93%	384,600,000.00	33.24%	-	-
长城证券	252,791,761.90	60.74%	288,000,000.00	24.89%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	418,519.68	0.10%	20,000,000.00	1.73%	-	-
国泰君安	16,035,200.00	3.85%	100,000,000.00	8.64%	-	-
银河证券	-	-	243,000,000.00	21.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	14,166,672.50	3.40%	90,000,000.00	7.78%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	5,000,000.00	0.43%	-	-
华泰联合	60,462,600.00	14.53%	26,500,000.00	2.29%	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	银河银泰理财分红证券投资基金 暂停大额申购、定期定额投资及 转换转入业务的公告	《中国证券报》、公 司网站	2021年1月7日
2	银河银泰理财分红证券投资基金 分红公告	《中国证券报》、公 司网站	2021年1月9日
3	银河基金管理有限公司 2020 年	《中国证券报》、《上	2021年1月21日

	第四季度报告提示性公告	海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、 公司网站	
4	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉兴银行股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、公 司网站	2021 年 2 月 3 日
5	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金开通嘉兴银行股份有限公司基金转换业务的公告	《上海证券报》、公 司网站	2021 年 2 月 23 日
6	银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 3 月 13 日
7	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 3 月 23 日
8	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 3 月 23 日
9	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在安信证券股份有限公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、公 司网站	2021 年 3 月 23 日
10	银河基金管理有限公司 2020 年年度报告提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2021 年 3 月 30 日
11	银河基金管理有限公司 2021 年	《中国证券报》、《上	2021 年 4 月 21 日

	第一季度报告提示性公告	海证券报》、《证券时报》、公司网站	
12	银河银泰理财分红证券投资基金招募说明书（更新）	《中国证券报》、公司网站	2021 年 5 月 12 日
13	银河银泰理财分红证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、公司网站	2021 年 5 月 12 日
14	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修订基金合同及托管协议的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 7 月 6 日
15	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修订基金合同及托管协议的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 7 月 6 日
16	银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券日报》、公司网站	2021 年 7 月 8 日
17	银河基金管理有限公司 2021 年第二季度报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 7 月 20 日
18	银河基金管理有限公司 2021 年中期报告提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2021 年 8 月 27 日
19	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通定投业务并参加申购、定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、公司网站	2021 年 8 月 27 日
20	银河基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《证券日报》、公司网站	2021 年 9 月 15 日
21	银河基金管理有限公司 2021 年第三季度提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券	2021 年 10 月 26 日

		时报》、公司网站	
--	--	----------	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立银河银泰理财分红证券投资基金的文件
- 2、《银河银泰理财分红证券投资基金基金合同》
- 3、《银河银泰理财分红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、银河银泰理财分红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

13.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1568 号 15 楼

13.3 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.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司

2022 年 3 月 29 日