

# 银河水星现金添利货币型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：银河金汇证券资产管理有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

本集合计划管理人的董事会、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董事签字同意，并由董事长签发。

本集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 08 月 28 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。

本集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利。

本集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，本集合计划于 2022 年 08 月 26 日合同变更生效。按照相关法律法规的规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	35
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	36
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	37

7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细.....	37
7.9 投资组合报告附注.....	37
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	43
10.9 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</b>
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.....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>44</b>
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划
基金简称	银河水星现金添利货币
基金主代码	970164
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 8 月 26 日
基金管理人	银河金汇证券资产管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	23,121,377,884.48 份
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。

注：本报告所述“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。银河水星现金添利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河水星 1 号集合资产管理计划变更而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2022]579 号文准予变更。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	<p>本集合计划主要为投资人提供现金管理工具，在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，通过积极的投资组合管理，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1、资产配置策略 通过对国家宏观政策和利率变化趋势的深入分析，综合考量市场资金面走向、存款银行的信用资质、信用债券的信用评级以及各类资产的收益水平，确定各类资产在组合中的比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产在各资产类别中的比例。</p> <p>2、久期控制策略 根据对货币市场利率走势的分析预测，动态调整投资组合的平均剩余期限。预测市场利率上升时，适度缩短投资组合的平均剩余期限，预测市场利率下降时，适度延长投资组合的平均剩余期限。</p> <p>3、杠杆投资策略 当预期货币市场利率下跌或者走势平稳时，通过正回购融资买入债券，在回购资金成本低于债券收益率的前提下，实现杠杆放大的套利目标。</p> <p>4、收益率曲线策略 根据债券市场收益率曲线变化，结合对当期和远期资金面的分析，相应地选择子弹型、哑铃型或梯形的组合期限配置，获取收益率曲线变动所带来的投资收益。</p> <p>5、滚动配置策略</p>

	根据投资品种的市场特性，采用持续滚动投资方法，实现长久期品种的短期化投资，以提高投资组合整体收益和持续变现能力。 6、流动性管理策略 通过对本集合计划申购/赎回数据的统计跟踪，并结合对市场资金面的预测分析，动态调整投资组合中流动性资产和收益性资产之间的配置比例，在保持本集合计划资产充分流动性的基础上，力争提供稳定收益。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的 3 个月定期存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划为货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

### 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		银河金汇证券资产管理有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	赵双	陈晨
	联系电话	010-89623251	010-50938723
	电子邮箱	zhaoshuang_yhjh@chinastock.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		010-89623098	4008-058-058
传真		010-89623270	-
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳前海商务秘书有限公司）	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		北京市丰台区西营街 8 号新青海金融大厦 7 层	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码		100073	100033
法定代表人		吴剑飞	于文强

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://yhjh.chinastock.com.cn
基金中期报告备置地点	北京市丰台区西营街 8 号新青海金融大厦 7 层

### 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	128,646,574.47

本期利润	128,646,574.47
本期净值收益率	0.5492%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末基金资产净值	23,121,377,884.48
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
累计净值收益率	2.1507%

注：1. 本期已实现收益指本集合计划本期利息收入、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. 上述集合计划业绩指标已扣除了本集合计划的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申赎本集合计划的各项费用，计入认购或申赎本集合计划各项费用后，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余额的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

4. 本集合计划于 2022 年 08 月 26 日生效，主要财务指标的实际计算期间为 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

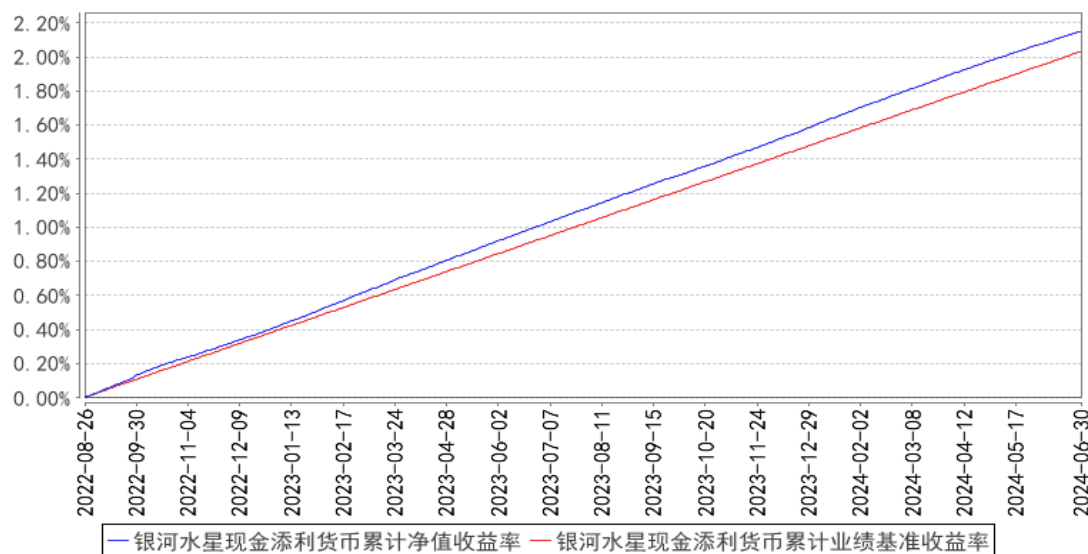
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.0806%	0.0001%	0.0902%	0.0000%	-0.0096%	0.0001%
过去三个月	0.2578%	0.0002%	0.2735%	0.0000%	-0.0157%	0.0002%
过去六个月	0.5492%	0.0002%	0.5470%	0.0000%	0.0022%	0.0002%
过去一年	1.1276%	0.0002%	1.1015%	0.0000%	0.0261%	0.0002%
自基金合同生效起至今	2.1507%	0.0004%	2.0327%	0.0000%	0.1180%	0.0004%

注：1. 本集合计划于 2022 年 08 月 26 日生效；

2. 本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为现金分红。

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

银河水星现金添利货币累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1. 本集合计划于 2022 年 08 月 26 日生效；  
 2. 截至本报告期末，本集合计划的投资符合集合计划合同关于投资范围及投资限制的规定。

### 3.3 其他指标

注：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

银河金汇证券资产管理有限公司（以下简称“银河金汇资管”或“公司”）是中国银河证券股份有限公司的全资子公司，经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1556 号文批准设立，于 2014 年 4 月 25 日取得企业法人营业执照，注册资本人民币 10 亿元，注册地为深圳前海，经营范围为证券资产管理。

银河金汇证券资产管理有限公司经营证券资产管理业务，对客户受托资产实行统一管理，为客户提供多样化、专业化和个性化的资产管理服务。依托自身的业务发展优势、完善的内控制度、多元化的业务模式以及优秀的业务团队，银河金汇证券资产管理有限公司已与多家银行以及其他相关金融机构建立合作关系。

银河金汇资管根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求，旗下七只大集合产品已完成公募化改造，为“银河安丰九个月滚动持



有混合型集合资产管理计划”、“ 银河安益 9 个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划”、“ 银河水星季季增利三个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“ 银河水星双季增利六个月持有期债券型集合资产管理计划”、“ 银河优选六个月持有期债券型集合资产管理计划”、“ 银河水星现金添利货币型集合资产管理计划”、“银河水星聚利中短债债券型集合资产管理计划”。

#### 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		
姜海洋	本集合计划的投资经理	2022 年 8 月 26 日	-	14 年	姜海洋女士，悉尼大学专业会计硕士和商学硕士，多年证券从业经验，2010 年加入中国银河证券资产管理总部，先后从事市场营销、产品研发、投资管理等工作。现任银河水星现金添利、银河水星聚利中短债投资经理。具备证券从业资格和基金从业资格，3 年内没有被采取监管措施或处罚。现已通过基金经理考试。

注：1. 本集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为本集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 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：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法律法规及本集合计划合同、招募说明书等有关法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，在控制风险的基础上，为本集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害本集合计划份额持有人利益的行为。

#### 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

公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。本报告期内本集合计划严格遵守公司的公平交易制度，

未发现违反公平交易原则的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划存在异常交易行为。

## 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

#### 【宏观方面】

上半年，GDP 同比增长 5.0%，持平于今年目标，其中二季度 GDP 同比增长 4.7%，低于市场预期。整体来看，工业生产增长较快，装备制造业支撑作用明显，上半年工业增加值同比增长 6.0%，较去年同期加快 2.2 个百分点。投资方面，固定资产投资上半年累计同比增长 3.9%，较去年同期小幅提升 0.1 个百分点，其中房地产投资拖累作用持续，上半年同比下降 10.1%；基建投资增速较去年同期有所放缓，上半年累计同比增长 7.7%，但仍是托底经济的主要抓手；制造业投资增速维持相对较快水平，上半年累计同比增长 9.5%。对外贸易方面，受益于海外需求改善，出口复苏势头良好，上半年累计同比增长 3.6%，较去年同期大幅提升 7.1 个百分点。消费方面，上半年社会消费品零售总额累计同比增长 3.7%，较去年同期下降 4.5 个百分点，居民消费略显承压。通胀方面，今年以来物价指数仍维持低位，6 月 CPI 同比增速 0.2%，PPI 同比负增长 0.8%，或表明国内经济景气上行动力仍然偏弱。

#### 【市场方面】

上半年，在国内经济复苏偏弱的背景下，稳增长政策持续发力，货币政策维持中性宽松基调。期间央行开展 1 次降准和 1 次 LPR 降息，并通过总体适度加大 OMO 投放向市场投放流动性，平滑节假日、季末等特殊时点对资金面的扰动，保持流动性合理充裕。整体看，上半年资金面均衡偏宽松，资金利率中枢小幅下移，但仍维持在政策利率上方，波动收敛，银行和非银流动性分层阶段性弱化。二季度银行间质押式回购 R001 均值 1.84%，R007 均值 1.94%，分别较一季度下行 1BP 和 19BP。

债券市场方面，收益率总体走低，期间经历两次回调，利率曲线走陡，1Y 和 10Y 国债收益率分别收于 1.54%和 2.21%，较年初下行 58BP 和 35BP。信用债方面，“资产荒”现象仍较为明显，收益率整体压缩，1 月、2 月信用债收益率持续震荡下行，3 月机构止盈情绪渐浓，信用债收益率触底后低位窄幅波动，4 月以来收益率整体压缩，下行幅度大于利率债，各期限、等级利差全面收窄，其中，中低等级收窄幅度较大。

#### 【投资回顾】

上半年，本集合计划秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和高流动性为首要任

务。持续优化组合资产和期限结构，积极寻求与多家银行合作，价格择优开展存款、存单业务，整体来看，组合保持了较高的流动性和稳定的收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本集合计划份额净值收益率为 0.5492%，同期业绩比较基准收益率为 0.5470%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我国经济仍将处于地产震荡下行筑底、中游制造业产能过剩、全球产业链重构等多重周期的叠加过程，经济或将延续弱复苏基调。预计地产投资、销售仍有调整压力，出口短期仍维持一定的韧性，在地产尚未出清、收入预期仍然偏弱的影响下，居民消费意愿趋于谨慎，消费弱修复或将延续。政策上，预计货币政策和财政政策仍将共同发力，稳固经济复苏势头，提振市场信心。债券市场方面，在基本面复苏偏弱的背景下，债券收益率上行空间较为有限，可适度把握债券供给、货币政策工具操作等带来的交易机会。信用债方面，“资产荒”行情下各期限及品种的利差均处于历史低位，考虑到供需失衡格局或将持续，在流动性宽松、资产欠配的背景下，预计各期限及品种的信用利差将维持低位震荡。

策略方面，管理人将继续秉持稳健投资原则，以确保组合安全性和流动性为首要任务，兼顾收益性。密切关注宏观数据、政策动向、资金面变化等市场情况，把握利率波动节奏，抓住季末时点利率高位的有利时机，并综合考虑债券、回购、同业存单和存款的收益情况，选择收益水平较高的品种进行配置，争取为客户获取良好的投资收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。

本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。

会计师事务所在估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本集合计划合同约定，本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为现金分红。本集合计划本报告期已实现收益分配金额为 130,544,118.05 元。

#### 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

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划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，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害本集合计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了本集合计划托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本集合计划合同和托管协议的有关规定，对本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、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：银河水星现金添利货币型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,775,749,645.40	6,991,899,340.90
结算备付金		2,001,831.32	8,595,619.50
存出保证金		96,455.75	240,354.88
交易性金融资产	6.4.7.2	15,057,178,252.65	12,538,018,403.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		15,057,178,252.65	12,538,018,403.60
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	1,317,300,008.35	479,466,669.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		23,152,326,193.47	20,018,220,387.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付管理人报酬		18,187,499.91	17,351,909.86
应付托管费		1,010,416.64	963,995.02
应付销售服务费		5,052,083.28	4,819,974.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		148,060.51	114,455.54
应付利润		6,223,791.40	8,121,334.98
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	326,457.25	399,503.02
负债合计		30,948,308.99	31,771,173.39
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	23,121,377,884.48	19,986,449,214.49
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		23,121,377,884.48	19,986,449,214.49
负债和净资产总计		23,152,326,193.47	20,018,220,387.88

注：1. 报告期截止日 2024 年 06 月 30 日，本集合计划份额净值 1.0000 元，集合计划份额总额为 23,121,377,884.48 份；

2. 本集合计划合同变更生效日为 2022 年 08 月 26 日。

## 6.2 利润表

会计主体：银河水星现金添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		273,386,981.26	326,890,667.26
1. 利息收入		107,008,897.28	77,293,028.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	102,085,947.42	73,764,635.60
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		4,922,949.86	3,528,393.34
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		166,378,083.98	249,597,633.33
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	166,378,083.98	249,597,633.33
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-	-
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	-	4.99
<b>减：二、营业总支出</b>		144,740,406.79	158,588,901.81
1. 管理人报酬		105,380,491.54	125,048,333.17
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		5,854,471.76	6,947,129.65
3. 销售服务费		29,272,358.62	19,043,405.60
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,981,918.86	7,285,915.40

其中：卖出回购金融资产支出		3,981,918.86	7,285,915.40
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		99,837.23	107,984.03
8. 其他费用	6.4.7.23	151,328.78	156,133.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		128,646,574.47	168,301,765.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		128,646,574.47	168,301,765.45
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		128,646,574.47	168,301,765.45

### 6.3 净资产变动表

会计主体：银河水星现金添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	19,986,449,214.49	-	-	19,986,449,214.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	19,986,449,214.49	-	-	19,986,449,214.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,134,928,669.99	-	-	3,134,928,669.99
（一）、综合收益总额	-	-	128,646,574.47	128,646,574.47
（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）	3,134,928,669.99	-	-	3,134,928,669.99
其中：1. 基金申	240,694,843,60	-	-	240,694,843,609

购款	9.12			.12
2. 基金赎回款	-237,559,914.93 39.13	-	-	-237,559,914.93 9.13
(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)	-	-	-128,646,574.47	-128,646,574.47
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	23,121,377,884.48	-	-	23,121,377,884.48
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	24,274,421,041.77	-	-	24,274,421,041.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	24,274,421,041.77	-	-	24,274,421,041.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-525,128,611.79	-	-	-525,128,611.79
(一)、综合收益总额	-	-	168,301,765.45	168,301,765.45
(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)	-525,128,611.79	-	-	-525,128,611.79
其中：1. 基金申购款	270,461,360.40 3.22	-	-	270,461,360.40 .22



2. 基金赎回款	-270,986,489.01	-	-	-270,986,489.01
	15.01			5.01
(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)	-	-	-168,301,765.45	-168,301,765.45
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	23,749,292,429.98	-	-	23,749,292,429.98

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：

吴剑飞

牟珊珊

张红雨

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

银河水星现金添利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河水星 1 号集合资产管理计划变更而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2022]579 号文准予变更，本集合计划托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

本集合计划投资于以下金融工具：（1）现金；（2）期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；（3）期限在 1 个月以内的债券回购；（4）剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；（5）中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本集合计划投资于前款第 4 项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。信用评级主要参照最近一个会计年度的信用评级，发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。因债券信用评级调整等管理人之外的因素，致使本集合计划投资范围不符合上述规定，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，中国证监会另有规定的除外。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的 3 个月定期存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和集合计划净值变动情况等有关信息。

#### 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 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

本集合计划本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

##### （1）印花税

证券（交易）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### （2）增值税

参照财政部、税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》：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暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。该通知自 2018 年 1 月 1 日起施行，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得税暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,703,478,880.47
等于：本金	1,702,191,289.44
加：应计利息	1,287,591.03
减：坏账准备	-
定期存款	5,072,270,764.93
等于：本金	5,050,000,000.00
加：应计利息	22,270,764.93
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	5,072,270,764.93
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,775,749,645.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	360,316,541.32	360,516,147.96	199,606.64	0.0009
	银行间市场	14,696,861,711.33	14,705,584,224.33	8,722,513.00	0.0377
	合计	15,057,178,252.65	15,066,100,372.29	8,922,119.64	0.0386

资产支持证券	-	-	-	-
合计	15,057,178,252.65	15,066,100,372.29	8,922,119.64	0.0386

**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**

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产。

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

注：本集合计划本报告期末未持有期货合约。

**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

注：本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

**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**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,317,300,008.35	-
合计	1,317,300,008.35	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本报告期末，本集合计划未持有通过买断式逆回购交易取得的债券。

**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**

无。
----

**6.4.7.5 债权投资**

**6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本集合计划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**

注：本集合计划本报告期末无债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资**

**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本集合计划本报告期末无债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本集合计划本报告期末无债权投资。

#### 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

注：本集合计划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

注：本集合计划本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	73,983.95
其中：交易所市场	19,209.68
银行间市场	54,774.27
应付利息	-
预提费用	252,473.30
合计	326,457.25

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,986,449,214.49	19,986,449,214.49
本期申购	240,694,843,609.12	240,694,843,609.12
本期赎回（以“-”号填列）	-237,559,914,939.13	-237,559,914,939.13
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	23,121,377,884.48	23,121,377,884.48

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本集合计划本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	128,646,574.47	-	128,646,574.47
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-128,646,574.47	-	-128,646,574.47
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	51,499,373.90
定期存款利息收入	50,508,237.83
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	77,366.74
其他	968.95
合计	102,085,947.42

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：本集合计划本报告期无股票投资收益—买卖股票差价收入。

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	165,792,727.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	585,356.35
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	166,378,083.98

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,579,098,435.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,437,090,121.58
减：应计利息总额	141,422,557.65
减：交易费用	400.00
买卖债券差价收入	585,356.35

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本集合计划本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本集合计划本报告期无债券投资收益—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**

注：本集合计划本报告期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**

注：本集合计划本报告期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**

注：本集合计划本报告期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**

注：本集合计划本报告期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**

注：本集合计划本报告期无贵金属投资。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益—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**

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益—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**

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

注：本集合计划本报告期无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

注：本集合计划本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.21 其他收入**

注：本集合计划本报告期无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	4,972.24
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,900.00
汇款费	67,784.20
合计	151,328.78

**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，本集合计划无需要披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准报出日，本集合计划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**

本集合计划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
银河金汇证券资产管理有限公司	基金管理人
中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人
中国银河证券股份有限公司	基金管理人的母公司、基金销售机构

注：下述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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期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 (%)
中国银河证券股份有限公司	502,149,530.00	100.00	1,465,288,410.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
中国银河证券股份有限公司	7,320,155,000.00	100.00	13,612,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
中国银河证券股份有限公司	104,328.28	100.00	19,209.68	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中国银河证券股份有限公司	289,224.49	100.00	115,182.78	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，并已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，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	105,380,491.54	125,048,333.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	52,270,831.53	62,052,885.23
应支付基金管理人的净管理费	53,109,660.01	62,995,447.94

注：支付集合计划管理人银河金汇证券资产管理有限公司的管理人报酬按前一日集合计划资产净值×0.90%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划管理费=前一日集合计划资产净值×0.90%÷当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,854,471.76	6,947,129.65

注：支付集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司的托管人报酬按前一日集合计划资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×0.05%÷当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费
	银河水星现金添利货币
中国银河证券股份有限公司	29,272,358.62
合计	29,272,358.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	银河水星现金添利货币
中国银河证券股份有限公司	19,043,405.60
合计	19,043,405.60

注：1. 本集合计划销售服务费按前一日集合计划资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划销售服务费=前一日集合计划资产净值×0.25%÷当年天数。

2. 自 2022 年 8 月 26 日起，至 2022 年 9 月 25 日止，投资者持有本集合计划份额的销售服务费率从 0.25%降至 0.05%。自 2022 年 9 月 26 日起，至 2022 年 10 月 27 日止，本集合计划按 0.00% 计提销售服务费；自 2022 年 11 月 10 日起，至 2023 年 2 月 26 日止，本集合计划按 0.00% 计提销售服务费；自 2023 年 2 月 27 日起，至 2023 年 3 月 27 日止，投资者持有本集合计划份额的销售服务费率从 0.25%降至 0.10%；自 2023 年 3 月 28 日起，至 2023 年 4 月 28 日止，投资者持有本集合计划份额的销售服务费率从 0.25%降至 0.20%。自 2023 年 4 月 29 日起，投资者持有本集合计划份额的销售服务费率为 0.25%。销售服务费费率调整公告详见官网。

#### 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

注：本集合计划本报告期无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 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本集合计划本报告期无管理人运用自有资金投资本集合计划的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
中国银河证券 股份有限公司	125,653,029.00	0.54	172,954,203.00	0.87

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	542,645.72	720,096.92	579,197.20	1,412,939.33

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本集合计划本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
-	130,544,118.05	-1,897,543.58	128,646,574.47	-

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划本报告期末未持有流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本集合计划无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本集合计划无因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。

#### 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

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控

制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本集合计划管理人建立了由风险管理部、审计部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、审计部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划根据合同约定，投资于具有良好信用等级证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划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，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	81,798,082.46
A-1 以下	-	-
未评级	1,931,325,134.10	931,630,364.84
合计	1,931,325,134.10	1,013,428,447.30

注：1、以上列示债券不包括国债、政策性金融债、央行票据。

2、未评级债券为部分短期融资券及超短期融资券。

3、以上信用评级系根据第三方评估机构的债券评级报告确定。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有短期信用评级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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	11,750,563,598.84	9,171,716,966.88
合计	11,750,563,598.84	9,171,716,966.88

##### 6.4.13.2.4 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	-------------------	---------------------

AAA	771,933,690.25	1,059,870,732.83
AAA 以下	-	-
未评级	155,244,588.60	123,175,572.20
合计	927,178,278.85	1,183,046,305.03

注：1、以上列示债券不包括国债、政策性金融债、央行票据。

2、以上信用评级系根据第三方评估机构的债券评级报告确定。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有长期信用评级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

注：本集合计划本报告期末未持有长期信用评级的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，本集合计划资产无法以适当价格及时变现的风险或本集合计划无法应付集合计划赎回支付的要求所引起的风险。本集合计划坚持组合持有、分散投资的原则，集合计划管理人根据市场运行情况和集合计划运行情况制定本集合计划的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”（如有）中列示的流通暂时受限的证券外，本集合计划所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本集合计划持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本集合计划的负债水平也严格按照集合计划合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

在资产端，本集合计划主要投资于合同约定的具有良好流动性的金融工具。集合计划管理人持续监测本集合计划持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，集合计划管理人持续监测本集合计划开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持集合计划资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，集合计划管理人将采用本集合计划合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月 30日	6个月以内	6个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产						
货币资金	4,869,273,645.12	1,906,476,000.28	-	-	-	6,775,749,645.40
结算备付金	2,001,831.32	-	-	-	-	2,001,831.32
存出保证金	96,455.75	-	-	-	-	96,455.75
交易性金融资产	12,506,033,481.09	2,551,144,771.56	-	-	-	15,057,178,252.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,317,300,008.35	-	-	-	-	1,317,300,008.35
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,694,705,421.63	4,457,620,771.84	-	-	-	23,152,326,193.47
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	18,187,499.91	18,187,499.91
应付托管费	-	-	-	-	1,010,416.64	1,010,416.64
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服	-	-	-	-	5,052,083.28	5,052,083.28

务费						
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	6,223,791.40	6,223,791.40
应交税费	-	-	-	-	148,060.51	148,060.51
其他负债	-	-	-	-	326,457.25	326,457.25
负债总计	-	-	-	-	30,948,308.99	30,948,308.99
利率敏感度缺口	18,694,705,421.63	4,457,620,771.84	-	-	-30,948,308.99	23,121,377,884.48
上年度末 2023年12月 31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	6,991,899,340.90	-	-	-	-	6,991,899,340.90
结算备付金	8,595,619.50	-	-	-	-	8,595,619.50
存出保证金	240,354.88	-	-	-	-	240,354.88
交易性金融资产	10,627,715,556.43	1,910,302,847.17	-	-	-	12,538,018,403.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	479,466,669.00	-	-	-	-	479,466,669.00
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,107,917,540.71	1,910,302,847.17	-	-	-	20,018,220,387.88
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	17,351,909.86	17,351,909.86
应付托管费	-	-	-	-	963,995.02	963,995.02
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	4,819,974.97	4,819,974.97
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	8,121,334.98	8,121,334.98
应交税费	-	-	-	-	114,455.54	114,455.54
其他负债	-	-	-	-	399,503.02	399,503.02
负债总计	-	-	-	-	31,771,173.39	31,771,173.39



利率敏感度缺口	18,107,917,540.71	1,910,302,847.17	-	-31,771,173.39	19,986,449,214.49
---------	-------------------	------------------	---	----------------	-------------------

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	11,619,633.37	10,702,370.27
2. 市场利率上升 25 个基点	-11,593,505.89	-10,679,330.89	

#### 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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无。

#### 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	15,057,178,252.65	12,538,018,403.60
第三层次	-	-
合计	15,057,178,252.65	12,538,018,403.60

注：无。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。
----

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。
----

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。
----

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	固定收益投资	15,057,178,252.65	65.04
	其中：债券	15,057,178,252.65	65.04
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	1,317,300,008.35	5.69
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	6,777,751,476.72	29.27
4	其他各项资产	96,455.75	0.00
5	合计	23,152,326,193.47	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.72	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本报告期内债券正回购的资金余额未超过本集合计划资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	110
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 120 天的情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	23.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	16.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	43.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	99.81	-
----	-------	---

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

#### 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	448,111,240.86	1.94
	其中：政策性金融债	448,111,240.86	1.94
4	企业债券	380,972,034.96	1.65
5	企业短期融资券	1,931,325,134.10	8.35
6	中期票据	546,206,243.89	2.36
7	同业存单	11,750,563,598.84	50.82
8	其他	-	-
9	合计	15,057,178,252.65	65.12
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	200203	20 国开 03	2,300,000	235,125,315.62	1.02
2	112306210	23 交通银行 CD210	2,000,000	199,255,827.39	0.86
3	112303197	23 农业银行 CD197	2,000,000	199,056,243.59	0.86
4	112308209	23 中信银行 CD209	2,000,000	199,031,197.40	0.86
5	112305235	23 建设银行 CD235	2,000,000	198,874,501.11	0.86
6	112303207	23 农业银行 CD207	2,000,000	198,874,495.83	0.86
7	112304047	23 中国银行 CD047	2,000,000	198,705,613.75	0.86
8	112403043	24 农业银行 CD043	2,000,000	198,213,507.21	0.86

9	112308196	23 中信银行 CD196	1,500,000	149,298,925.76	0.65
10	112314158	23 江苏银行 CD158	1,500,000	149,212,037.91	0.65

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0651%
报告期内偏离度的最低值	-0.0042%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0312%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内，本集合计划未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内，本集合计划未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本集合计划通过每日计算集合计划收益并分配的方式，使集合计划份额净值保持在人民币 1.00 元。本集合计划估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

#### 7.9.2 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

1、23 农业银行 CD135、23 农业银行 CD082、23 农业银行 CD117 的主体中国农业银行股份有限公司

(1) 披露日期：2023-12-01

文号：金罚决字[2023]21 号

违规事由：违规经营（流动资金贷款被用于固定资产投资等）

处罚类型：罚款，没收违法所得

罚没金额：2710.97 万元

处罚日期：2023-11-16

处理人：国家金融监督管理总局

(2) 披露日期：2023-11-17

文号：京汇罚[2023]32 号

违规事由：未依法履行职责（办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等）

处罚类型：警告，罚款，没收违法所得

罚没金额：694.85 万元

处罚日期：2023-11-17

处理人：国家外汇管理局北京市分局

(3) 披露日期：2023-08-18

文号：金罚决字[2023]8 号

违规事由：内部制度不完善，违规经营（农户贷款发放后流入房地产企业等）

处罚类型：罚款，没收违法所得

罚没金额：4420.18 万元

处罚日期：2023-08-15

处理人：国家金融监督管理总局

2、23 浙商银行 CD132 的主体浙商银行股份有限公司

(1) 披露日期：2024-02-05

文号：浙金罚决字[2024]4 号

违规事由：向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费；向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押登记费

处罚类型：罚款

罚款金额：55.00 万元

处罚日期：2024-02-02

处理人：国家金融监督管理总局浙江监管局

(2) 披露日期：2023-09-26

文号：浙税三罚[2023]1 号

违规事由：扣缴义务人不履行代扣代缴义务，应扣未扣、应收而不收税款

处罚类型：罚款

罚款金额：38.89 万元

处罚日期：2023-09-26

处理人：国家税务总局浙江省税务局第三税务分局

3、23 中信银行 CD080、23 中信银行 CD169 的主体中信银行股份有限公司

(1) 披露日期：2024-01-05

文号：金罚决字[2023]69 号

违规事由：信息报送异常不及时整改

处罚类型：罚款

罚款金额：400.00 万元

处罚日期：2023-12-29

处理人：国家金融监督管理总局

(2) 披露日期：2023-12-01

文号：金罚决字[2023]15 号

违规事由：违规提供担保及财务资助，违规经营

处罚类型：罚款, 没收违法所得

罚没金额：15705.18 万元

处罚日期：2023-11-16

处理人：国家金融监督管理总局

4、23 民生银行 CD281 的主体中国民生银行股份有限公司

(1) 披露日期：2023-08-18

文号：金罚决字[2023]7 号

违规事由：内部制度不完善，违规经营

处罚类型：罚款

罚款金额：4780 万元

处罚日期：2023-08-02

处理人：国家金融监督管理总局

(2) 披露日期：2023-08-16

文号：2023 年第 16 次自律处分会议审议决定

违规事由：作为债务融资工具主承销商违反银行间债券市场相关自律管理规则

处罚类型：限期改正，一般警告

处罚日期：2023-08-16

处理人：中国银行间市场交易商协会

5、23 交通银行 CD210 的主体交通银行股份有限公司

披露日期：2024-06-21

文号：金罚决字[2024]29 号

违规事由：安全测试存在薄弱环节、运行管理存在漏洞、数据安全管理制度不足、灾备管理不足

处罚类型：罚款

罚款金额：160.00 万元

处罚日期：2024-06-03

处理人：国家金融监督管理总局

### 7.9.3 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	96,455.75
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	96,455.75

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
406,620	56,862.37	517,900,323.07	2.24	22,603,477,561.41	97.76

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	个人	196,282,643.86	0.85
2	机构	125,653,029.00	0.54
3	机构	59,930,527.75	0.26



4	机构	51,689,177.46	0.22
5	个人	45,304,088.83	0.20
6	个人	42,357,371.31	0.18
7	个人	34,014,671.45	0.15
8	机构	31,732,701.06	0.14
9	产品	28,462,576.02	0.12
10	个人	28,149,790.43	0.12

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	354,997.82	0.00

注：本集合计划管理人所有从业人员持有本集合计划 354,997.82 份，占本集合计划总份额比例的 0.002%。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 8 月 26 日） 基金份额总额	29,737,202,163.76
本报告期期初基金份额总额	19,986,449,214.49
本报告期基金总申购份额	240,694,843,609.12
减：本报告期基金总赎回份额	237,559,914,939.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	23,121,377,884.48

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

### 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

本报告期内，本集合计划管理人于 2024 年 2 月 28 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2024 年 2 月 26 日起，刘冰不再担任公司董事长，吴剑飞新任公司董事长；本集合计划管理人于 2024 年 6 月 29 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2024 年 6 月 27 日起，王青不再担任公司总经理、法定代表人，吴剑飞

新任公司总经理、法定代表人。

本报告期内，本集合计划托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本集合计划管理人、本集合计划财产、本集合计划托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本集合计划未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 10,000.00 元，该审计机构已连续 3 年为本集合计划提供审计服务。

### 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

注：本报告期内，本集合计划管理人及其高级管理人员在开展参照公募基金管理业务过程中无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本集合计划托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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 (%)	
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	104,328.28	100.00	-

注：1. 本报告期内，本集合计划无新增或减少交易单元；

2. 本集合计划管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本集合计划的交易单元。集合计划交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

3. 集合计划交易单元的选择程序如下：

- (1) 本集合计划管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 集合计划管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中国银河证券股份有限公司	502,149,530.00	100.00	7,320,155,000.00	100.00	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内，本集合计划未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 10.9 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	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
2	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
3	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 2 月 21 日
4	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 21 日
5	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
6	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 19 日
7	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 19 日
8	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 21 日
9	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
10	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 6 月 25 日
11	银河水星现金添利货币型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 6 月 25 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

注：本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有本集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本集合计划管理人于 2024 年 7 月 13 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2024 年 7 月 11 日起，王东不再担任首席风险官，史慧婷新任首席风险官。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准银河水星 1 号集合资产管理合同变更的文件；
- 2、《银河水星现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《银河水星现金添利货币型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《银河水星现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内在规定信息披露媒体上公开披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

管理人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可在本集合计划管理人的网站进行查阅，网址为 <http://yhjh.chinastock.com.cn>。

银河金汇证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日