

银河金汇证券资产管理有限公司

中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划
2020 年年度报告



管理人：银河金汇证券资产管理有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日



重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中国建设银行股份有限公司于 2021 年 3 月 18 日复核了本报告中除审计报告和财务报告外的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理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资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料已经审计。

本报告期间：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。



一、集合资产管理计划概况

1、 基本资料

名称	中国银河证券水星2号集合资产管理计划
类型	开放式、限定性、无固定存续期限
成立日	2012年4月27日
报告期末份额总额	4,902,614,049.41 份
投资目标	在确保资金安全和适当流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的回报。
投资策略	1、通过对流动性较好的短期固定收益品种的投资实现资产的安全性和高度流动性，最大限度规避市场风险，为投资者提供类似活期存款的资金灵活性和便捷性。 2、通过组合久期控制、资产类别配置、滚动配置、新股申购等手段实现收益增强，追求高于同期银行存款利率的稳定收益。
投资基准	同期三个月银行定期存款利率（税后）

2、 管理人

名称	银河金汇证券资产管理有限公司
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦
法定代表人	郭卿
联系地址	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦7层
联系电话	4008-888-888
网址	http://yhjh.chinastock.com.cn



3、 托管人

名称	中国建设银行股份有限公司
注册地址	北京市西城区金融大街25号
办公地址	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人	王洪章
托管业务批准文号	中国证监会证监基字【1998】12号
托管部门联系人	田青
联系电话	010-67595096

4、 注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	北京市西城区太平桥大街17号
公司网址	http://www.chinaclear.cn

5、 会计师事务所和经办注册会计师

名称	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）
地址	武汉市武昌区东湖路169号2-9层
执行事务合伙人	石文先；管云红；杨荣华
经办注册会计师	毛宝军，张慧
联系电话	027-86791215
传真	027-85424329



二、主要财务指标及收益分配情况

1、主要财务指标（单位：人民币元）

期间：2020.01.01—2020.12.31

集合计划本期净收益	174,438,338.53
水星2号1天期份额本期净收益	0.03028708
水星2号7天期份额本期净收益	0.03189897
水星2号14天期份额本期净收益	0.03270686
期末集合计划资产净值	4,902,614,049.41

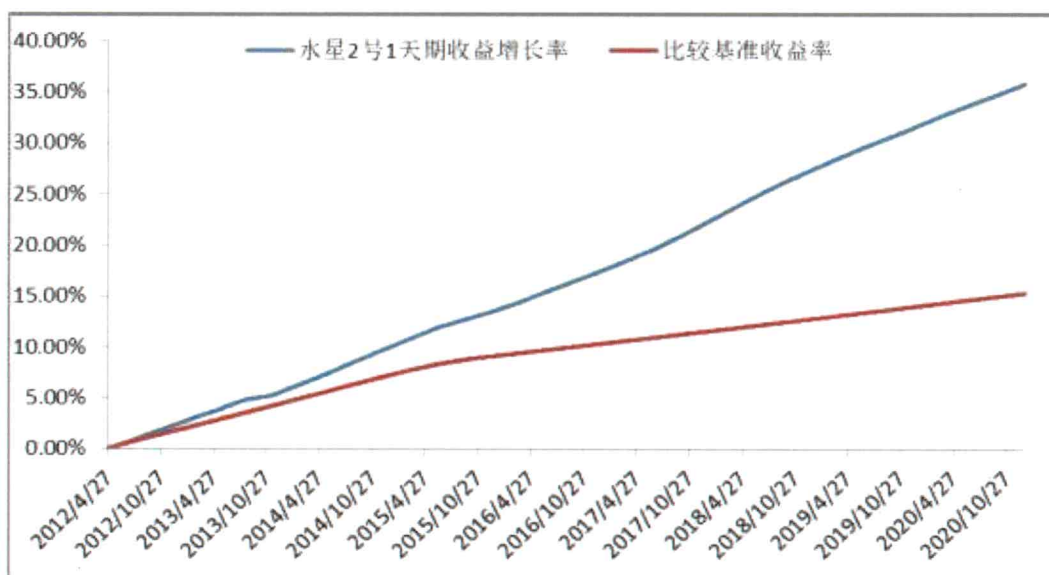
2、本报告期集合计划份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

份额类别	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
水星2号1天期份额	3.0749%	0.0013%	1.1091%	0.0000%	1.9658%	0.0013%
水星2号7天期份额	3.2412%	0.0014%	1.1091%	0.0000%	2.1321%	0.0014%
水星2号14天期份额	3.3246%	0.0014%	1.1091%	0.0000%	2.2155%	0.0014%

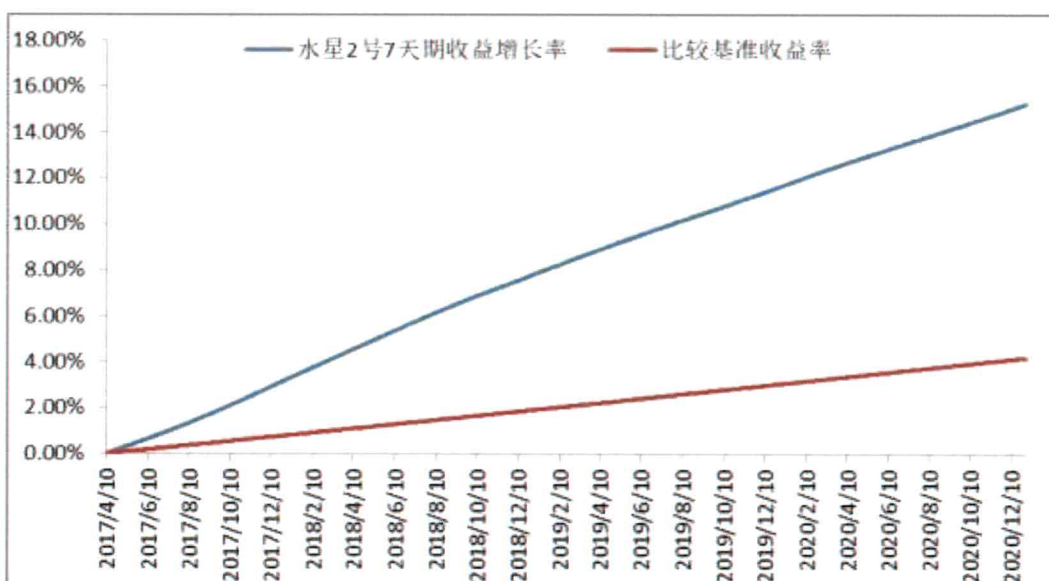
（注：本期份额净值收益率 = $\left\{ \left[\prod_{i=1}^n (1 + R_i / 10000) \right] - 1 \right\} \times 100\%$ ，其中， R_1 为期初的每万份基金净收益， R_i 为日每万份基金净收益， R_n 为报告期末的每万份基金净收益。）

3、自集合计划合同生效以来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



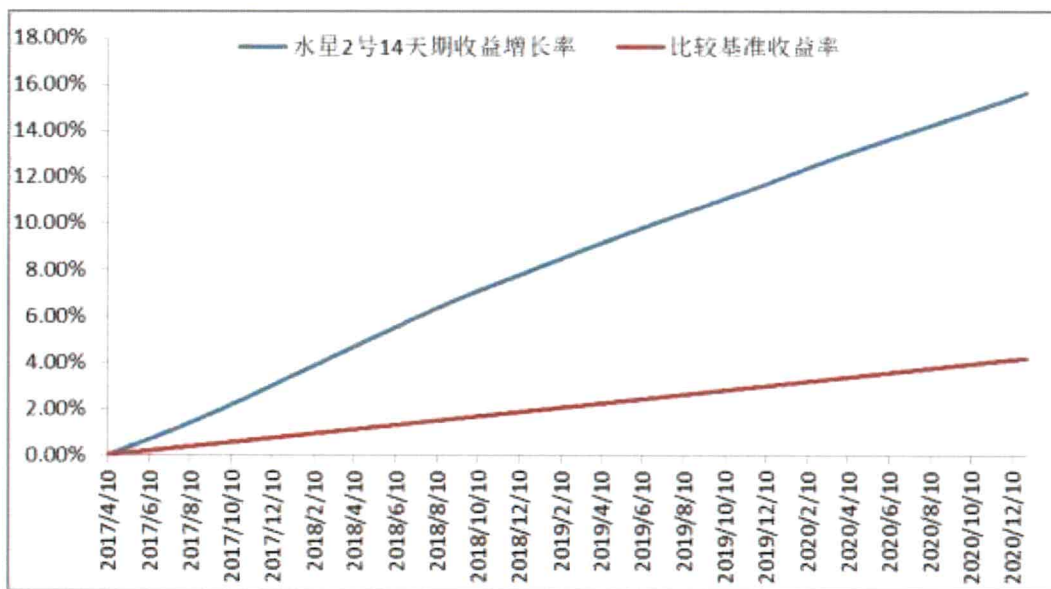


(2012年4月27日至2020年12月31日)



(2017年4月10日至2020年12月31日)





(2017年4月10日至2020年12月31日)

4、收益分配情况

从2020年1月1日至2020年12月31日，水星2号1天期份额为持有人每万份实现收益302.8708元，折合年化收益率为3.0204%，超出同期业绩比较基准1.9204个百分点；从2020年1月1日至2020年12月31日，水星2号7天期份额为持有人每万份实现收益318.9897元，折合年化收益率为3.1812%，超出同期业绩比较基准2.0812个百分点；从2020年1月1日至2020年12月31日，水星2号14天期份额为持有人每万份实现收益327.0686元，折合年化收益率为3.2617%，超出同期业绩比较基准2.1617个百分点。

三、管理人报告

1、投资主办人简介

魏琦女士，经济学硕士，21年证券从业经验。1999年加入华夏证券研究所，历任分析师、高级分析师、金融工程部负责人，8年宏观经济、债券市场研究经验，2006年获新财富最佳债券分析师第四名。2007年加入中国人寿资产管理有限公司，从事近两年的交易管理工作，主要负责固定收益及境外市场交易管理事



宜。2008年10月加入中国银河证券股份有限公司资产管理总部，任职执行总经理，现任银河金汇证券资产管理有限公司固定收益投资部负责人。

张建先生，硕士，多年从业经验，具有投资主办人资格、基金从业资格。2013年加入中国银河证券资产管理总部，先后从事交易和投资管理工作。自2014年4月起担任银河水星2号投资助理，2017年6月起担任银河水星2号投资主办人。

2、投资主办人工作报告

1) 市场回顾和投资操作

2020年，国内经济增长受新冠疫情影响呈现V型走势。上半年，受新冠疫情冲击，国内经济增长大幅下滑，加之国际疫情的严峻形势，投资、消费、进出口等均受到严重拖累。进入5月份，随着疫情逐步得到有效控制，疫情对经济增长的影响逐渐减弱。与此同时，国际方面疫情控制不够理想，新增感染人数和新增死亡人数屡创新高。2020年欧美各主要经济体经济增长遭受严重冲击，经济出现不同程度的倒退。国际人口流动导致下半年国内疫情出现多次局部性复发。受益于国内成熟的管控机制和优越的医疗条件，国内疫情反复并未对经济增长形成反复的打击。

全年来看，国内经济呈现前低后高的走势，全年实现经济正增长。1-12月份规模以上工业增加值累计同比上涨2.8%，12月份规模以上工业增加值当月同比上涨7.3%，经济延续复苏趋势。1-12月份固定资产投资完成额累计同比上涨2.9%，其中房地产投资上涨7.0%，制造业投资下降2.2%，基础设施建设投资上涨3.41%。整体看，房地产投资和基础设施建设投资对经济增长形成较好的支撑，投资增速逐步上升，制造业受疫情影响，仍处于下降通道，随着疫情的有效控制，降幅逐步缩窄。随着疫情缓解，叠加贸易战影响逐步减弱，进出口贸易恢复明显。出口方面，1-12月份累计同比上涨3.6%，较前年上涨3.09个百分点；进口方面，1-12月累计同比下降1.1%，较前年降幅缩窄1.58个百分点。受益于疫情缓解，国内消费也有明显恢复，12月份社会消费品零售总额当月同比增长4.6%。物价水平相对稳定，1-12月CPI累计同比上涨2.5%，处于合宜水平。



2020年，央行坚持稳健中性的货币政策，疫情的冲击在一定程度上打乱了央行原有的货币政策。一季度，疫情肆虐，几乎所有经济活动均遭受不同程度冲击，尤其中小微企业，影响更为明显。央行快速反应，及时调整货币政策，阶段性宽松的货币政策较好的缓解了各类经济体面临的压力。央行同时创新货币政策直达工具，有效支持实体经济复工复产。二季度开始，随着疫情逐步缓解，央行通过多个场合引导市场预期，并开始边际上逐步收紧货币政策，有效防止了通胀和局部的泡沫风险。全年来看，央行坚持稳健中性的货币政策，同时结合疫情走势，根据市场情况适时做出调整，引导市场预期，维持流动性整体稳定。

在上述背景下，2020年，收益率曲线呈现先下后上的V型走势，各期限收益率不同程度上行。以国开债和AA+的中短期票据为例，国开债方面，1年期收益率上行5.98BP至2.5577%，3年期收益率上行6.58BP至2.9817%，5年期收益率下行10.86bp至3.2631%，10年期收益率下行4.29bp至3.5338%；AA+中短期票据方面，1年期收益率上行16.31BP至3.4396%，3年期收益率上行47.10BP至4.0229%，5年期收益率上行34.53BP至4.3574%。

本集合计划在操作中，根据市场情况，主要配置了优质的短期债券，并适当配置货币市场基金及国债质押式回购，提高资金使用效率，同时积极参与可转债一级市场打新，增加客户收益，在保持产品高流动性的基础上，实现了集合计划收益率的稳定增长。

2) 市场展望和投资策略

当前，我国经济增速处于触底回升阶段。受疫情影响，经济增长恢复的节奏有所放缓。随着疫情逐步缓解及疫苗接种的普及，经济恢复情况整体较好，投资、消费、进出口均有明显好转。受部分企业债券违约的影响，原本逐步边际收紧的货币政策出现了阶段性的放松。同时，疫情对经济增长的影响尚未完全恢复，政策总基调短期内难有实质转向。预计央行将保持稳健的货币政策，在违约冲击和疫情对经济的影响逐步消退后，适时做出调整。操作上，通过OMO及MLF等货币政策工具及时向市场注入流动性，维持流动性合理充裕，有效降低实体经济资金利率。



基于以上分析，预计 2021 年，债券市场仍将以震荡行情为主，债券市场将面临一定的压力。我们将继续关注信用风险，控制组合久期，在有效规避信用风险的基础上，积极把握投资机会，为投资人争取良好的收益。

3、 管理人履职报告

在报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等其他相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划。

本报告期内，管理人严格执行中国银河证券股份有限公司内部控制和风险管理制度，加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，严格履行本集合计划合同规定，保护投资者利益。

本集合计划在报告期内，管理人严格控制风险，未出现风险事故或其他损害集合计划份额持有人利益的情形。



四、托管人报告

中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划托管报告

(2020 年 1 月 1 日-2020 年 12 月 31 日)

中国建设银行根据《中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划合同》和《中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划托管协议》，自 2012 年 4 月 27 日起托管中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划（以下称“本计划”）资产。

2020 年年度期间，中国建设银行及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

2020 年年度期间，中国建设银行对管理人的投资运作行为按合同约定进行了监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

2020 年年度期间，中国建设银行对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

中国建设银行复核了本计划资产管理报告(2020 年年度报告)中的有关财务数据部分（不包含子份额财务指标、净值表现、关联方交易），内容真实、准确和完整。

中国建设银行资产托管业务部

2021 年 3 月 18 日



五、审计报告和财务报告

银河金汇证券资产管理有限公司
中国银河证券水星2号集合资产管理计划

审 计 报 告



银河金汇证券资产管理有限公司
中国银河证券水星2号集合资产管理计划

审计报告

众环审字[2021]0710006号

目 录

	起始页码
审计报告	1
财务报表	
资产负债表	1
利润表	2
持有人权益变动表	3
财务报表附注	4

审计报告

众环审字[2021] 0710006 号

中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划全体份额持有人：

一、审计意见

我们审计了后附的银河金汇证券资产管理有限公司（以下简称“银河金汇”）作为管理人按照财务报表附注二所述编制基础编制的中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和持有人权益（净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照财务报表附注二所述编制基础编制，公允反映了中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和持有人权益（净值）变动情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师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，我们独立于中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划，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。

三、强调事项

我们提醒财务报表使用者关注财务报表附注二对编制基础的说明。同时，如该附注所述，后附的银河水星 2 号集合资产管理计划专用财务报表仅供银河水星 2 号集合资产管理计划资产管理合同委托资产按照《银河水星 2 号集合资产管理计划标准条款》及有关法规要求提交份额持有人（委托人）、托管人以及相关监管部门之用，不适用于其他用途。相应地，本报告仅为银河水星 2 号集合资产管理计划资产管理合同按照有关法规要求提交集合计划份额持有人（委托人）、托管人、管理人以及相关监管部门之用，不做其他用途。

四、管理人对财务报表的责任

管理人（银河金汇）负责按照后附的财务报表附注二所述的编制基础编制财务报表，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。

在编制财务报表时，管理人负责评估银河水星 2 号集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理人计划清算银河水星 2 号集合资产管理计划、终止运营或别无其他现实的选择。

五、注册会计师对财务报表审计的责任

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。

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：

（一）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。

（二）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。

（三）评价管理人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。

（四）对管理人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，就可能对银河水星 2 号集合资产管理计划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水星 2 号集合资产管理计划不能持续经营。

（五）评价财务报表的总体列报、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。

我们与管理人就计划的审计范围、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。



中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）



中国注册会计师：



毛宝军

中国注册会计师：



张慧

中国·武汉

2021年3月23日

资产负债表

银河水星2号集合资产管理计划专用表
2020年12月31日

编制单位：银河金汇证券资产管理有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	年末数	年初数
资产：			
银行存款	六、1	17,607,410.58	104,450,105.45
结算备付金	六、2	7,708,294.54	9,613,101.33
存出保证金	六、3	14,277.05	20,745.14
交易性金融资产	六、4	470,343,704.15	883,799,183.61
其中：股票投资			
债券投资			
基金投资		470,343,704.15	883,799,183.61
权证投资			
资产支持证券投资			
衍生金融工具			
买入返售金融资产			
应收证券清算款	六、5	29,983,289.92	
应收利息	六、6	96,299,723.39	88,667,502.91
应收股利	六、7	262,278.88	3,461,583.11
应收申购款	六、8		71,997,266.31
其他资产	六、9	4,656,936,944.31	4,318,878,099.43
资产合计		5,279,155,922.82	5,480,887,587.29
负债：			
短期借款			
交易性金融负债			
衍生金融负债			
卖出回购金融资产款	六、10	359,968,580.04	309,998,830.00
应付证券清算款	六、11	27,344.07	40,011,706.83
应付赎回费			
应付管理人报酬	六、12	12,981,833.51	
应付托管费	六、13	442,067.47	445,273.49
应付销售服务费			
应付交易费用	六、14	312,241.49	81,078.22
应交税费	六、15	2,168,011.07	795,513.91
应付利息	六、16	25,906.81	33,564.30
应付利润	六、17	445,034.04	630,870.32
其他负债	六、18	170,854.91	1,675,684.76
负债合计		376,541,873.41	353,672,521.83
持有人权益：			
实收基金	六、19	4,902,614,049.41	5,127,215,065.46
未分配利润	六、20		
持有人权益合计		4,902,614,049.41	5,127,215,065.46
负债及持有人权益合计		5,279,155,922.82	5,480,887,587.29

利润表

银河水星2号集合资产管理计划专用表
2020年度

编制单位：银河金汇证券资产管理有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	本年数	上年数
一、收入		205,365,812.03	217,431,248.32
1、利息收入	六、21	186,358,386.66	180,413,728.38
其中：存款利息收入		1,034,155.33	747,203.56
债券利息收入		184,303,949.42	178,347,691.95
资产支持证券利息收入			
买入返售证券收入		1,020,281.91	1,318,832.87
2、投资收益	六、22	19,007,425.37	37,017,519.94
其中：股票投资收益			
债券投资收益		3,085,567.96	2,682,752.33
基金投资收益		15,978,065.93	34,450,442.91
权证投资收益			
资产支持证券投资收益			
衍生工具收益			
股利收益			
金融商品转让税		(56,208.52)	(115,675.30)
3、公允价值变动收益			
4、其他收入			
二、费用		30,927,446.50	30,632,910.75
1、管理人报酬	六、23	19,621,140.16	19,774,492.84
2、托管费	六、24	5,453,717.89	5,323,626.22
3、销售服务费			
4、交易费用	六、25		1,391.00
5、利息支出	六、26	4,768,319.37	4,632,390.12
其中：卖出回购金融资产支出		4,768,319.37	4,632,390.12
6、其他费用	六、27	1,084,269.08	901,010.57
三、利润总额		174,438,365.53	186,798,337.57

持有人权益（净值）变动表

银河水星2号集合资产管理计划专用表

2020年度

编制单位：银河金证证券资产管理有限公司

金额单位：人民币元

项目	本年数			上年数		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、年初持有人权益（净值）	5,127,215,065.46	-	5,127,215,065.46	4,595,751,051.69	-	4,595,751,051.69
二、本年经营活动产生的净值变动数（本年净利润）		174,438,365.53	174,438,365.53		186,798,337.57	186,798,337.57
三、本年份额交易产生的净值变动数（减少以“-”号填列）	-224,601,016.05	-	-224,601,016.05	531,464,013.77	-	531,464,013.77
其中：1. 集合计划申购款	16,593,806,925.74		16,593,806,925.74	20,625,163,139.56		20,625,163,139.56
2. 集合计划赎回款	16,818,407,941.79		16,818,407,941.79	20,093,699,125.79		20,093,699,125.79
四、本年份额交易产生的计划净值变动数（减少以“-”号填列）		-174,438,365.53	-174,438,365.53		-186,798,337.57	-186,798,337.57
五、年末持有人权益（净值）	4,902,614,049.41	-	4,902,614,049.41	5,127,215,065.46	-	5,127,215,065.46

银河金汇证券资产管理有限公司

银河水星2号集合资产管理计划

2020年度财务报表附注

(除特别说明外, 金额单位为人民币元)

一、 集合计划基本情况

根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2011年10月8日《关于核准中国银河证券股份有限公司设立中国银河证券水星2号集合资产管理计划的批复》,中国银河证券水星2号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)于2012年4月27日募集成立。集合计划类型为限定性,存续期为5年。产品成立时,中国银河证券股份有限公司是本集合计划的管理人,2014年5月16日,管理人变更为银河金汇证券资产管理有限公司(以下简称“银河金汇”),中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)是本集合计划的托管人,银河证券、建设银行是本集合计划的推广机构。2016年9月13日,存续期限变更为无固定期限,本集合计划成立后每满1年时,管理人视市场情况,有权决定是否提前终止或继续运作。

根据《证券公司客户资产管理业务试行办法》和《银河水星2号基金精选集合资产管理计划说明书》约定,本集合计划为货币增强型理财产品,通常情况下收益低于债券型产品、股票型产品,属于风险较低、收益较低的理财产品。集合计划每份额面值为人民币1.00元。截至2012年4月23日止,集合计划已收到委托人认购参与金额扣除参与费用后的净参与金额为人民币116,070,000.00元,折合116,070,000.00份集合计划份额;参与金额在推广期内产生的利息为人民币15,800.40元,折合15,800.40份集合计划份额;以上的实收资金共计人民币116,085,800.40元,折合116,085,800.40份集合计划份额。设立投资已经安永华明会计师事务所验证,并出具安永华明(2012)验字第60688537_A01号验资报告。

截至报告日2020年12月31日止,本集合计划份额净值为人民币0.9077元,集合计划总份额为4,902,614,049.41份。

二、 财务报表的编制基础

本集合计划财务报表以持续经营假设为基础,根据实际发生的交易和事项,按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《银河水星2号集合资产管理计划标准条款》及《银河水星2号集合资产管理计划说明书》约定的核算方法、财务报表附注四所述的重要会计政策和会计估计,并参照《证券投资基金会计核算业务指引》有关要求编制。

本财务报表仅供银河水星2号集合资产管理计划按照有关法规要求提交集合计划份额持有人(委托人)、托管人以及相关监管部门之用,不适用于其他用途。

三、 遵循附注二所述编制基础的声明

银河金汇证券资产管理有限公司作为管理人编制的集合计划财务报表符合财务报表附注二所述编制基础的要求，真实、完整地反映了集合计划于2020年12月31日的财务状况及2020年度的经营成果和持有人权益（净值）变动情况。

四、 集合计划采用的主要会计政策、会计估计

1、 会计期间

集合计划采用公历年制，即自每年1月1日至12月31日为一个会计年度。

2、 记账本位币

集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

3、 记账基础和计价原则

集合计划会计核算以权责发生制为基础。除某些金融工具外，本财务报表均以历史成本为计量基础。资产如果发生减值，则按照相关规定计提相应的减值准备。

4、 金融工具的分类

在集合计划成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关的交易费用直接计入损益，对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本计划目前持有的基金投资、股票投资、债券投资、资产支持证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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（1） 金融资产的分类

以常规方式买卖金融资产，按交易日进行会计确认和终止确认。金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、买入返售金融资产、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本计划对金融资产的持有意图和持有能力。

本集合计划目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划持有的贷款及应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产，包括应收利息、应收股利、其他应收款等各类应收款项。

（2） 金融负债的分类

集合计划的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本计划目前暂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。本计划持有的其他金融负债主要为各类应付款项等。

5、金融工具的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本计划成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量；直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权

上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6、金融工具的估值原则及估值方法

(1) 上市交易品种的估值

上市流通的股票、净价交易的债券、交易型指数基金 ETF、权证、场内购买的上市型开放式基金 LOF 和封闭式基金，以估值日证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一交易日的收盘价计算。其中逆回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息；上市的非净价交易的债券按交易所提供的该证券收盘价减去其中所含应收利息后得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日该证券的收盘价计算得到的净价估值。

(2) 未上市品种的估值

①未上市的属于送、转赠、配股和公开增发新股的股票

以估值日证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近一日收盘价计算；

②未上市的属于首次公开发行的股票、债券、权证和银行票据

采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

③首次公开发行有明确锁定期的股票

同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日收盘价计算；

④非公开发行有明确锁定期股票的估值方法：

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同

一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应按以下公式确定该股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$$

其中：FV为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；C为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D_l为非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易天数；D_r为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

（3）配股权证

从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价低于配股价，则估值为零。

（4）在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券及交易所固定收益平台上市的债券等品种采用估值技术确定公允价值。

（5）开放式证券投资基金（包括场外购买的上市型开放基金LOF）

以估值日前一日基金净值估值。如遇到基金拆分、到期、转型及封转开等情况，管理人应于实施前3个工作日根据基金公告与托管人共同协商确定估值办法。

（6）银行存款

以成本列示，按商定的存款利率以当日银行营业终了的存款余额为基数，在实际持有期间内逐日计提应收利息。

估值技术是指管理人与托管人协商一致的，被市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的确定公允价值的方法。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

7、金融工具的成本计价方法

按移动加权平均法计算库存证券的成本。当日有买入和卖出时，先计算成本后计算买卖证券价差。

（1）股票

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的价款入账，相关费用计入损益。卖出股票于成交日确认证券差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2) 债券

于成交日确认为债券投资，按应支付的价款入账，相关费用计入损益。如果应支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

卖出债券于成交日确认债券差价收入，出售债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(3) 买入返售证券

通过证券交易所进行融券业务，按成交日应支付的价款确认买入返售证券投资；通过银行间市场进行融券业务，按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

(4) 权证

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的价款入账；配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证在确认日，记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零。

(5) 基金

基金买入于成交日确认为基金投资，基金成本按成交日应支付的价款入账，相关费用计入损益。卖出基金于成交日确认基金差价收入。卖出基金按移动加权平均法结转成本。

基金的认/申购于确认日确认为基金投资，基金成本按确认日公允价值入账，取得时发生的费用计入损益。基金赎回于确认日确认基金差价收入。赎回基金按移动加权平均法结转成本。

(6) 其他投资

买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后按上述会计处理方法核算。

8、收入的确认和计量

(1) 股票投资收益

于卖出股票成交日确认，并按卖出股票价款与其成本的差额入账。

(2) 债券投资收益

于卖出债券成交日确认债券差价收入，并按应收取的价款与其成本、应收利息的差额入账。

(3) 基金投资收益

于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账。

(4) 债券利息收入

按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

(5) 存款利息收入

按存款本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

(6) 股利收益

于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额于除息日确认。

(7) 买入返售金融资产收入

按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账。

(8) 衍生工具投资收益

于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账。

(9) 公允价值变动损益

系集合计划持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、交易性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。

(10) 其他收入

系除上述收入以外的其他各项收入，如赎回费扣除基本手续费后的余额、配股手续费返还等。在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

9、费用的确认和计量

集合计划投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为集合计划费用计入集合计划的损益。

(1) 集合计划管理费

本集合计划的管理费，按前一日的资产净值计提。本集合计划采用浮动管理费率，各子份额每日管理费率计算方法如下：

$$M_i = \max(D \text{日当日年化收益率} - r, 0\%) * x_i + 0.3\%$$

$$D \text{日当日年化收益率} = D \text{日的每万份收益（计提管理费、托管费前）} / 10000 * 365$$

其中： M_i 为 i 类份额 D 日管理费率（ $i=a, b, c$ ，对应 A、B、C 份额）；

x_i 为 i 类份额浮动管理费计提比率；

r 为集合计划浮动管理费计提基准，管理人可参照同期银行定期存款基准利率设定。

x_i 、 r 初始取值如下： $x_a=12\%$ ； $x_b=8\%$ ； $x_c=5\%$ ； $r=1.1\%$

管理人有权根据市场情况，设定 x_i 、 r 的取值。 x_i 、 r 变动的，管理人至少提前 2 个工作日在管理人指定网站公告。

$$\text{管理费计算方法如下：} H_i = E_i \times M_i \div 365$$

H_i 为 i 类份额当日应支付的管理费； E_i 为前一日 i 类份额资产净值。

(2) 集合计划托管费

本集合计划的托管费按前一日的集合计划资产净值的 0.1% 计提。计算方法如下： $H = E \times 0.1\%$

÷365，其中：

H为每日应计提的托管费；E为前一日集合计划资产净值。

（3）卖出回购证券支出

按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在证券回购期内逐日计提。

（4）证券交易费用

集合计划投资运作期间发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、集合资金信托计划的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，在收取时从集合计划中扣除。交易佣金的费率由管理人本着保护委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定，交易佣金按月支付，支付流程同管理费托管费。

（5）其他费用

本集合计划成立后的审计费、律师费、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，按费用实际支付金额，列入当期集合计划费用。

10、集合计划申购、赎回的确认

在收到集合计划投资人申购或赎回申请之日后，于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。于确认日按照实收集合计划、未分配净收益的余额占集合计划净值的比例，将确认有效的申购或赎回款项分割为两部分，分别确认为实收基金、损益平准金的增加或减少。

11、实收基金

每份集合计划份额面值为人民币1元。实收基金为对外发行的集合计划份额总额。

对于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于集合计划申购确认日、赎回确认日确认。

12、损益平准金

损益平准金为申购、赎回款中所含的按集合计划未分配净收益占集合计划净值比例计算的金额，于集合计划申购、赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配收益。

13、集合计划的收益分配政策

（1）同类集合计划份额享有同等分配权；

（2）分红以份额（红利再投资）形式进行；

（3）T日参与的集合计划份额不享有当日分红收益权，T+1日起享有收益；T日退出的集合计划份额享有当日分红收益。

（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

14、关联方

银河金汇、集合计划的托管人等与集合计划存在重大利益关系的公司或个人均被视为集合计划的关联方。

五、 税项

1、印花稅

产品管理人运用产品买卖股票税率为1%，为单边征收。

2、增值稅

参照财政部、税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值稅有关问题的通知》：资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值稅应税行为暂适用简易計稅方法，按照3%的征收率繳納增值稅。該通知自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稅应税行为，未繳納增值稅的，不再繳納；已繳納增值稅的，已繳稅額从资管产品管理人以后月份的增值稅應納稅額中抵減。

3、企业所得稅

参照财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得稅若干优惠政策的規定》，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、債券的差价收入，股權的股息、紅利收入，債券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得稅。

六、 财务报表主要项目注释

以下注释项目除非特别指出，“年初”指2020年1月1日，“年末”指2020年12月31日；“本年”指2020年度，“上年”指2019年度。

1、銀行存款

开户行	年末余额	年初余额
中国建设银行股份有限公司	17,607,410.58	104,450,105.45
合计	17,607,410.58	104,450,105.45

2、結算备付金

项 目	年末余额	年初余额
上海最低备付金	4,854,316.07	6,255,643.58
深圳最低备付金	2,853,978.47	3,357,457.75
合计	7,708,294.54	9,613,101.33

3、存出保證金

项 目	年末余额	年初余额
-----	------	------

上交所结算保证金	12,668.09	19,629.43
深交所结算保证金	1,608.96	1,115.71
合计	14,277.05	20,745.14

4、交易性金融资产

项目	年末余额		年初余额	
	成本	公允价值	成本	公允价值
基金	470,343,704.15	470,343,704.15	883,799,183.61	883,799,183.61
合计	470,343,704.15	470,343,704.15	883,799,183.61	883,799,183.61

5、应收证券清算款

项目	年末余额	年初余额
深圳证券清算款	29,983,289.92	
合计	29,983,289.92	

6、应收利息

项目	年末余额	年初余额
银行存款利息	18,457.92	32,121.58
结算备付金利息	3,815.57	5,676.52
保证金利息	7.04	10.23
债券利息	96,277,442.86	88,629,694.58
合计	96,299,723.39	88,667,502.91

7、应收股利

项目	年末余额	年初余额
应收货币基金红利	262,278.88	3,461,583.11
合计	262,278.88	3,461,583.11

8、应收申购款

项目	年末余额	年初余额
应收申购款		71,997,266.31
合计		71,997,266.31

9、其他资产

项目	年末余额	年初余额
债券	4,571,924,267.21	4,301,305,094.15

其他应收款	85,012,677.10	17,573,005.28
合计	4,656,936,944.31	4,318,878,099.43

注：其他资产债券系成本法估值的私募债、企业债及银行间债。

10、卖出回购金融资产款

项 目	年末余额	年初余额
上交所质押式回购	79,999,600.00	29,999,850.00
深交所质押式回购	79,999,600.00	
银行间质押式回购	199,969,380.04	279,998,980.00
合计	359,968,580.04	309,998,830.00

11、应付证券清算款

项 目	年末余额	年初余额
上海证券清算款		40,011,706.83
深圳证券清算款	27,344.07	
合计	27,344.07	40,011,706.83

12、应付管理人报酬

项 目	年末余额	年初余额
银河金汇证券资产管理有限公司	12,981,833.51	
合计	12,981,833.51	

13、应付托管费

项 目	年末余额	年初余额
中国建设银行股份有限公司	442,067.47	445,273.49
合计	442,067.47	445,273.49

14、应付交易费用

项 目	年末余额	年初余额
应付佣金	296,785.58	57,852.72
银行间交易费用	15,455.91	23,225.50
合计	312,241.49	81,078.22

15、应交税费

项 目	年末余额	年初余额
应交增值税	1,935,724.16	710,280.27
应交附加税	232,286.91	85,233.64

合计	2,168,011.07	795,513.91
----	--------------	------------

16、应付利息

项 目	年末余额	年初余额
上交所质押式卖出回购利息支出	-12,720.06	-6,028.41
深交所质押式卖出回购利息支出	-20,808.05	
银行间质押式回购利息支出	59,434.92	39,592.71
合计	25,906.81	33,564.30

17、应付利润

项 目	年末余额	年初余额
应付利润	445,034.04	630,870.32
合计	445,034.04	630,870.32

18、其他负债

项 目	年末余额	年初余额
其他应付款	99.07	1,288,766.26
审计费用	10,000.00	10,000.00
上清所账户维护费	5,100.00	5,100.00
中债登账户维护费	4,500.00	4,500.00
电子合同服务费	2,000.00	8,000.00
中登 TA 服务费	149,155.84	359,318.50
合计	170,854.91	1,675,684.76

19、实收基金

项 目	本 年	上 年
年初数	5,127,215,065.4	4,595,751,051.69
本年增加	16,593,806,925.74	20,625,163,139.56
本年减少	16,818,407,941.79	20,093,699,125.79
年末数	4,902,614,049.41	5,127,215,065.46

20、未分配利润

项 目	本 年	上 年
年初数		
加：本年净收益	174,438,365.53	186,798,337.57

项 目	本 年	上 年
持有人份额交易产生净值变动数		
本年向持有人分配产生的净值变动数（减少以“-”号填列）	-174,438,365.53	-186,798,337.57
年末数		

21、存款利息收入

项 目	本年发生额	上年发生额
银行存款利息收入	904,659.45	622,138.75
清算备付金利息收入	129,257.14	124,462.37
保证金利息收入	238.74	602.44
债券利息收入	184,303,949.42	178,347,691.95
买入返售证券收入	1,020,281.91	1,318,832.87
合计	186,358,386.66	180,413,728.38

22、投资收益

项 目	本年发生额	上年发生额
债券投资收益	3,085,567.96	2,682,752.33
基金投资收益	15,978,065.93	34,450,442.91
金融商品转让税	-56,208.52	-115,675.30
合计	19,007,425.37	37,017,519.94

23、管理人报酬

项 目	本年发生额	上年发生额
管理费	19,621,140.16	19,774,492.84
合计	19,621,140.16	19,774,492.84

24、托管费

项 目	本年发生额	上年发生额
托管费	5,453,717.89	5,323,626.22
合计	5,453,717.89	5,323,626.22

25、交易费用

项 目	本年发生额	上年发生额
交易所交易费用		391.00

开放式基金交易费用		1,000.00
合计		1,391.00

26、利息支出

项 目	本年发生额	上年发生额
上交所质押式卖出回购利息支出	899,160.61	456,604.89
深交所质押式卖出回购利息支出	305,887.01	219,071.27
银行间质押式卖出回购利息支出	3,563,271.75	3,956,713.96
合计	4,768,319.37	4,632,390.12

27、其他费用

项 目	本年发生额	上年发生额
银行汇划费用	134,719.74	149,272.75
审计费	10,000.00	10,000.00
银行账户维护费	20,291.85	
上清所账户维护费	17,268.15	18,700.00
中债登账户维护费	450,000.00	18,600.00
税费及附加	451,989.34	580,437.82
其他		124,000.00
合计	1,084,269.08	901,010.57

七、 关联方关系及其交易**1、关联方关系**

企业名称	与集合计划的关系
银河金汇证券资产管理有限公司	管理人
中国建设银行股份有限公司	托管人
中国银河证券股份有限公司	管理人母公司

2、关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(1) 通过关联方席位进行的交易

关联方名称	本年发生额		上年发生额	
	证券买卖成交金额	占本年间交易金额比例	证券买卖成交金额	占本年间交易金额比例

中国银河证券股份有 限公司	22,834,379,910.37	100%	34,992,169,513.17	100%
------------------	-------------------	------	-------------------	------

(2) 交易佣金

关联方名称	本年发生额		上年发生额	
	交易佣金	占本年间佣 金比例	交易佣金	占本年间佣 金比例
中国银河证券股份有 限公司	238,932.86	100%	405,859.23	100%

(3) 集合计划管理人报酬

集合计划管理人银河金汇按约定比例提取管理人报酬。

关联方名称	本年发生额	上年发生额
	管理人报酬	管理人报酬
银河金汇证券资产管理有限公司	19,621,140.16	19,774,492.84

(4) 集合计划托管人托管费

集合计划托管人建设银行按约定比例提取托管人托管费。

关联方名称	本年发生额	上年发生额
	托管费	托管费
中国建设银行股份有限公司	5,453,717.89	5,323,626.22

(5) 由关联方保管的银行存款余额及其产生的利息收入

集合计划的银行存款由集合计划托管人建设银行保管，并按银行规定利率计息。

关联方名称	年末余额	年初余额
	银行存款余额	银行存款余额
中国建设银行股份有限公司	17,607,410.58	104,450,105.45

关联方名称	本年发生额	上年发生额
	利息收入	利息收入
中国建设银行股份有限公司	904,659.45	622,138.75

(6) 托管银行收取的手续费

关联方名称	本年发生额	上年发生额
	手续费	手续费

中国建设银行股份有限公司	155,011.59	149,272.75
--------------	------------	------------

(7) 关联方应付款项余额

项目	账项	年末余额	年初余额
银河金汇证券资产管理有限公司	应付管理人报酬	12,981,833.51	
中国建设银行股份有限公司	应付托管费	442,067.47	445,273.49
中国银河证券股份有限公司	应付交易费	312,241.49	81,078.22
合计		13,736,142.47	526,351.71

八、 资产负债表日后事项

无。

九、 财务报表之批准

本集合计划财务报表于2021年3月23日经本集合计划管理人银河金汇证券资产管理有限公司批准。

六、投资组合报告

1、资产组合情况

项目名称	金额（元）	占总资产比例
银行存款	17,607,410.58	0.33%
债券投资	4,571,924,267.21	86.60%
基金投资	470,343,704.15	8.91%
其他资产	219,280,540.88	4.15%
合计	5,279,155,922.82	100.00%

（注：1. 其他资产包括：应收利息、应收红利、结算备付金、存出保证金、证券清算款；
2. 因四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。）

2、报告期末按摊余成本占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券 明细

序号	代码	证券名称	数量（张）	期末摊余成本 （元）	占资产净值 比例
1	019535	16 国债 07	1,000,000	100,213,903.44	2.04%
2	112006038	20 交通银行 CD038	1,000,000	99,484,208.75	2.03%
3	112006090	20 交通银行 CD090	1,000,000	98,644,358.50	2.01%
4	019530	16 国债 02	700,000	70,007,797.08	1.43%
5	180208	18 国开 08	600,000	60,243,057.97	1.23%
6	101900541	19 天安煤业 MTN002	600,000	60,105,221.20	1.23%
7	112375	16 昆投 01	600,000	59,897,934.73	1.22%
8	200010	20 付息国债 10	600,000	59,843,736.18	1.22%
9	112003022	20 农业银行 CD022	600,000	59,706,832.28	1.22%
10	112003020	20 农业银行 CD020	600,000	59,690,847.72	1.22%

3、期末市值占集合计划资产净值前五名债券逆回购明细

本报告期无债券逆回购交易。

4、期末市值占集合计划资产净值前五名基金明细

序号	科目代码	科目名称	数量	成本	成本占净值比例
1	675062	天添富货币 B	105,725,992.72	105,725,992.72	2.16%
2	003474	南方天天利 B	97,386,953.60	97,386,953.60	1.99%
3	000575	兴全添利宝	85,185,330.50	85,185,330.50	1.74%
4	004417	兴全货币 B	65,715,169.09	65,715,169.09	1.34%
5	000010	易方达天天 B	61,753,970.68	61,753,970.68	1.26%



5、重大关联交易状况

中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于2020年8月26日通过一级市场买入管理人母公司中国银河证券股份有限公司联席主承的“20首钢03”，买入金额为2000万元。截止2020年8月26日，本集合计划持有的“20首钢03”关联交易证券占产品资产净值比例为0.3556%。

6、远期交易情况说明

本报告期内无远期交易。

7、投资组合报告附注

1、本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未到受到公开谴责、处罚。

2、集合计划的其他资产构成。

序号	名称	金额（元）
1	应收红利	262,278.88
2	应收利息	96,299,723.39
3	其他应收款	85,012,677.10
4	证券清算款	29,983,289.92
5	结算备付金	7,708,294.54
6	存出保证金	14,277.05
	合计	219,280,540.88

七、集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	5,127,215,065.46
报告期间总参与份额	16,591,684,435.72
报告期间总退出份额	16,816,285,451.77
报告期末份额总额	4,902,614,049.41

（注：总参与份额含红利再投资份额）



八、重要事项提示

1、本集合计划管理人及托管人相关事项

1) 本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

2) 本集合计划管理人办公地址于2021年2月1日起，变更为北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦7层。。

3) 本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

4) 银河金汇证券资产管理有限公司于2020年12月18日召开董事会并表决通过：同意选举郭卿同志为银河金汇证券资产管理有限公司董事长，并确认郭卿同志为公司法定代表人。该任职自董事会批准之日起生效。

5) 银河金汇证券资产管理有限公司于2020年10月30日召开董事会并表决通过：聘任付振全为银河金汇证券资产管理有限公司总经理、执行委员会主任。聘任魏琦、牟珊珊为银河金汇证券资产管理有限公司副总经理、执行委员会委员。

因工作调整，吴坤强不再担任银河金汇证券资产管理有限公司总经理、执行委员会委员等职务。

具体内容详见管理人网站公告。

2、本集合计划相关事项

1) 根据中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）说明书和管理合同的有关约定，以及《国务院办公厅关于2020年部分节假日安排的通知》中有关2020年“春节”假期的放假安排，为了保护现有集合计划份额持有人利益，本集合计划份额：水星2号1天期（代码：AA0006）、水星2号7天期（代码：AA0111）、水星2号14天期（AA0112）自2020年1月22日起暂停参与。自2020年1月31日起，本集合计划恢复正常参与业务。

2) 根据国务院关于延长2020年春节假期的通知，春节假期延长至2月2日（农历正月初九，星期日），2月3日（星期一）起正常上班。据此，中国银河证券水



星2号集合资产管理计划各类份额：水星2号1天期（代码：AA0006）、水星2号7天期（代码：AA0111）、水星2号14天期（AA0112）恢复申购的日期将由原定的1月31日调整为2月3日，与此同时，可赎回份额的赎回日期也由1月31日顺延至2月3日。

3) 根据中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）说明书和管理合同的有关约定，以及《国务院办公厅关于2020年部分节假日安排的通知》中有关2020年“清明节”假期的放假安排，为了保护现有集合计划份额持有人利益，本集合计划份额：水星2号1天期（代码：AA0006）、水星2号7天期（代码：AA0111）、水星2号14天期（AA0112）自2020年4月2日起暂停参与。自2020年4月7日起，本集合计划恢复正常参与业务。

4) 根据中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）说明书和管理合同的有关约定，以及国务院办公厅《国务院办公厅关于2020年部分节假日安排的通知》及《国务院办公厅关于调整2020年劳动节假期安排的通知》中有关2020年“劳动节”假期的放假安排，为了保护现有集合计划份额持有人利益，本集合计划份额：水星2号1天期（代码：AA0006）、水星2号7天期（代码：AA0111）、水星2号14天期（AA0112）自2020年4月29日起暂停参与。自2020年5月6日起，本集合计划恢复正常参与业务。

5) 根据中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）说明书和管理合同的有关约定，以及国务院办公厅《国务院办公厅关于2020年部分节假日安排的通知》中有关2020年“端午节”假期的放假安排，为了保护现有集合计划份额持有人利益，本集合计划份额：水星2号1天期（代码：AA0006）、水星2号7天期（代码：AA0111）、水星2号14天期（AA0112）自2020年6月23日起暂停参与。自2020年6月29日起，本集合计划恢复正常参与业务。

6) 根据银河金汇证券资产管理有限公司（以下简称“本公司”）与北京恒天明泽基金销售有限公司（以下简称“恒天明泽”）签署的代销协议，决定于2020年7月8日起增加恒天明泽为本公司管理的中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）代销机构。

7) 中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于



2020年8月26日通过一级市场买入管理人母公司中国银河证券股份有限公司联席主承的“20首钢03”，买入金额为2000万元。截止2020年8月26日，本集合计划持有的“20首钢03”关联交易证券占产品资产净值比例为0.3556%。

8) 根据中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）说明书和管理合同的有关约定，以及国务院办公厅《国务院办公厅关于2020年部分节假日安排的通知》中有关2020年“国庆节”和“中秋节”假期的放假安排，为了保护现有集合计划份额持有人利益，本集合计划份额:水星2号1天期（代码：AA0006）、水星2号7天期（代码：AA0111）、水星2号14天期（AA0112）自2020年9月29日起暂停参与。自2020年10月9日起，本集合计划恢复正常参与业务。

9) 根据中国银河证券水星2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）说明书和管理合同的有关约定，以及《国务院办公厅关于2021年部分节假日安排的通知》中有关2021年“元旦节”假期的放假安排，为了保护现有集合计划份额持有人利益，本集合计划份额:水星2号1天期（代码：AA0006）、水星2号7天期（代码：AA0111）、水星2号14天期（AA0112）自2020年12月30日起暂停参与。自2021年1月4日起，本集合计划恢复正常参与业务。

10) 银河金汇证券资产管理有限公司于2020年12月18日召开董事会并表决通过：同意选举郭卿同志为银河金汇证券资产管理有限公司董事长，并确认郭卿同志为公司法定代表人。该任职自董事会批准之日起生效。

11) 银河金汇证券资产管理有限公司于2020年10月30日召开董事会并表决通过：聘任付振全为银河金汇证券资产管理有限公司总经理、执行委员会主任。聘任魏琦、牟珊珊为银河金汇证券资产管理有限公司副总经理、执行委员会委员。因工作调整，吴坤强不再担任银河金汇证券资产管理有限公司总经理、执行委员会委员等职务。

除上述重大事项外，报告期间，本集合计划未出现其他可能对本集合计划的持续运作产生重大影响的情形。

九、备查文件目录

1、本集合计划备查文件目录



- 1) 中国证监会《关于核准银河证券股份有限公司设立中国银河证券水星2号集合资产管理计划的批复》
- 2) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划说明书》
- 3) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划合同》
- 4) 《中国银河证券水星2号集合资产管理风险揭示书》
- 5) 《水星2号集合资产管理计划发行公告》
- 6)《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划提前结束推广募集的公告》
- 7) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划成立的公告》
- 8) 《中国银河证券水星2号正式开放公告》
- 9) 《关于发布<关于修改中国银河证券水星2号集合资产管理计划管理合同、说明书和风险揭示书的征求意见函>的公告》
- 10) 《关于“中国银河证券水星2号集合资产管理计划”变更管理合同、说明书和风险揭示书的公告》
- 11) 《银河水星2号2012年第二季度季报》
- 12) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划重大事项公告》
- 13) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划“中秋、国庆”假期暂停参与的公告》
- 14) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划暂停大额参与的公告》
- 15) 《银河水星2号2012年第三季度报告》
- 16) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划恢复大额参与的公告》
- 17) 《银河水星2号集合资产管理计划重大事项公告》
- 18) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划2012年第四季度报告》
- 19) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划“春节”假期暂停参与的公告》
- 20) 《银河水星2号集合资产管理计划2012年年度报告》
- 21) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划“清明节”假期暂停参与的公告》
- 22) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划暂停大额参与的公告》



- 23) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划2013年第一季度报告》
- 24) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划“劳动节”假期暂停参与的公告》
- 25) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划“端午节”假期暂停参与的公告》
- 26) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划暂停退出的公告》
- 27) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划恢复大额参与的公告》
- 28) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划偏离度的公告》
- 29) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划恢复退出的公告》
- 30) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划暂停大额参与的公告》
- 31) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划2013年第二季度报告》
- 32) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划恢复大额参与的公告》
- 33) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划偏离度的公告》
- 34) 《关于中国银河证券股份有限公司管理的集合资产管理计划重大事项公告》
- 35) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划季度报告(2013年第三季度)》
- 36) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划偏离度的公告》
- 37) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划偏离度的公告》
- 38) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划偏离度的公告》
- 39) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划2013年第四季度报告》
- 40) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划2014年春节假期暂停参与的公告》
- 41) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划暂停大额参与的公告》
- 42) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划管理人变更的公告》
- 43) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划2013年年度报告》
- 44) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划季度报告(2014年第一季度)》
- 45) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划2014年“劳动节”假期暂停参与的公告》



- 46 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划管理人变更的第二次提示公告》
- 47 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划管理人变更的第三次提示公告》
- 48) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划2014年“端午节”假期暂停参与的公告》
- 49) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划2014年二季度报告》
- 50) 《关于发布<修改中国银河证券水星2号集合资产管理计划管理合同、说明书和风险揭示书的征求意见函>的公告》
- 51) 《关于“中国银河证券水星2号集合资产管理计划”变更管理合同、说明书和风险揭示书的公告》
- 52) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划2014年“国庆节”假期暂停参与的公告》
- 53) 《银河水星2号集合资产管理计划季度报告（2014年第三季度）》
- 54) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 55) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2015年元旦假期暂停参与的公告》
- 56) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划2014年第四季度报告》
- 57) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 58) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2015年“春节”假期暂停参与的公告》
- 59) 《银河水星2号集合资产管理计划2014年年度报告》
- 60) 《中国银河水星2号集合资产管理计划季度报告（2015年一季度）》
- 61) 《银河水星2号集合资产管理计划季度报告2015年第二季度季报》
- 62) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2015年“抗战胜利纪念日”假期暂停参与的公告》
- 63) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2015年“国庆节”假期暂停参与的公告》
- 64) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划季度报告（2015第三季度）》



- 65) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 66) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2016年“元旦节”假期暂停参与的公告》
- 67) 《中国银河证券水星2号集合资产管理计划季度季报(2015年第四季度)》
- 68) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2016年“春节”假期暂停参与的公告》
- 69) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2016年“清明节”假期暂停参与的公告》
- 70) 《银河水星2号集合资产管理计划2015年年度报告》
- 71) 《银河水星2号集合资产管理计划2016年第1季度季报》
- 72) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划2016年“劳动节”假期暂停参与的公告》
- 73) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 74) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划2016年“端午节”假期暂停参与的公告》
- 75) 《银河水星2号集合资产管理计划2016年第2季度季报》
- 76) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 77) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 78) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 79) 《关于发布《修改中国银河证券水星2号集合资产管理计划管理合同、说明书和风险揭示书的征求意见函》的公告》
- 80) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划2016年“中秋节”假期暂停参与的公告》
- 81) 《关于“中国银河证券水星2号集合资产管理计划”变更管理合同、说明书和风险揭示书的报告》
- 82) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 83) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》



- 84) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划2016年“国庆节”假期暂停参与的公告》
- 85) 《银河水星2号集合资产管理计划2016年第3季度季报》
- 86) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 87) 《关于中国银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 88) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 89) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划2017年“元旦节”假期暂停参与的公告》
- 90) 《银河水星2号集合资产管理计划2016年第4季度季报》
- 91) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2017年“春节”假期暂停参与的公告》
- 92) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 93) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 94) 《关于银河水星2号集合资产管理计划放开大额参与的公告》
- 95) 《关于发布《修改中国银河证券水星2号集合资产管理计划管理合同和说明书的征求意见函》的公告》
- 96) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2017年“清明节”假期暂停参与的公告》
- 97) 《银河水星2号集合资产管理计划2016年年度报告》
- 98) 《关于银河水星2号集合资产管理计划调整大额参与限制的公告》
- 99) 《关于“中国银河证券水星2号集合资产管理计划”变更管理合同和说明书的公告》
- 100) 《银河水星2号集合资产管理计划2017年第1季度季报》
- 101) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2017年“劳动节”假期暂停参与的公告》
- 102) 《关于银河水星2号集合资产管理计划调整参与限制的公告》
- 103) 《关于银河水星2号集合资产管理计划调整管理费率参数的公告》
- 104) 《关于银河水星2号集合资产管理计划份额转换功能上线的公告》



- 105) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2017年“端午节”假期暂停参与的公告》
- 106) 《关于银河水星2号集合资产管理计划投资主办人变更的公告》
- 107) 《银河水星2号集合资产管理计划2017年第2季度季报》
- 108) 《关于银河水星2号集合资产管理计划调整管理费率参数的公告》
- 109) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划调整参与限制的公告》
- 110) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2017年中秋节、国庆节假期暂停参与的公告》
- 111) 《银河水星2号集合资产管理计划2017年第3季度季报》
- 112) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2018年元旦节假期暂停参与的公告》
- 113) 《银河金汇证券资产管理有限公司关于旗下产品实施增值税政策的公告》
- 114) 《关于银河水星2号集合资产管理计划新增代销机构公告》
- 115) 《关于银河水星2号集合资产管理计划买入17民通01、17民通02的公告》
- 116) 《银河水星2号集合资产管理计划2017年第4季度季报》
- 117) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2018年春节假期暂停参与的公告》
- 118) 《银河水星2号集合资产管理计划2017年年度报告》
- 119) 《关于银河水星2号集合资产管理计划买入18泰通债的公告》
- 120) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2018年清明节假期暂停参与的公告》
- 121) 《银河水星2号集合资产管理计划2018年第1季度季报》
- 122) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2018年劳动节假期暂停参与的公告》
- 123) 《关于银河水星2号集合资产管理计划买入18泰通02的公告》
- 124) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2018年端午节假期暂停参与的公告》



- 125) 《关于增加上海天天基金销售有限公司为中国银河证券水星2号集合资产管理计划代销机构的公告》
- 126) 《银河水星2号集合资产管理计划2018年第2季度季报》
- 127) 《关于银河水星2号集合资产管理计划新增代销机构公告》
- 128) 《关于增加上海陆金所基金销售有限公司为中国银河证券水星2号集合资产管理计划代销机构的公告》
- 129) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2018年中秋节假期暂停参与的公告》
- 130) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2018年国庆节假期暂停参与的公告》
- 131) 《关于银河水星2号集合资产管理计划设定单日申购规模上限的公告》
- 132) 《关于银河水星2号集合资产管理计划买入18建投02的公告》
- 133) 《银河水星2号集合资产管理计划2018年第3季度季报》
- 134) 《关于我司部分集合资产管理计划调整业务及控制规模的公告》
- 135) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2019年元旦节假期暂停参与的公告》
- 136) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2019年春节假期暂停参与的公告》
- 137) 《银河水星2号集合资产管理计划2018年第4季度季报告》
- 138) 《关于银河水星2号集合资产管理计划买入浙商转债的公告》
- 139) 《银河水星2号集合资产管理计划2018年年度报告》
- 140) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2019年清明节假期暂停参与的公告》
- 141) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2019年劳动节假期暂停参与的公告》
- 142) 《银河水星2号集合资产管理计划2019年第1季度季报》
- 143) 《关于银河水星2号集合资产管理计划新增代销机构公告》
- 144) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2019年端午节假期暂停参与的公告》



- 145) 《关于托管行中国建设银行股份有限公司托管部负责人任免的公告》
- 146) 《银河水星2号集合资产管理计划2019年第2季度季报》
- 147) 《关于增加北京肯特瑞基金销售有限公司为中国银河证券水星2号集合资产管理计划代销机构的公告》
- 148) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2019年”中秋节“假期暂停参与的公告》
- 149) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2019年国庆节假期暂停参与的公告》
- 150) 《关于增加大连网金基金销售有限公司为中国银河证券水星2号集合资产管理计划代销机构的公告》
- 151) 《银河水星2号集合资产管理计划2019年第3季度季报》
- 152) 《银河水星2号集合资产管理计划2019年第4季度季报》
- 153) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2020年春节假期暂停参与的公告》
- 154) 《关于调整银河水星2号集合资产管理计划开放期的公告》
- 155) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2020年”清明节“假期暂停参与的公告》
- 156) 《银河水星2号集合资产管理计划2019年年度报告》
- 157) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2020年劳动节假期暂停参与的公告》
- 158) 《银河水星2号集合资产管理计划2020年第1季度报告》
- 159) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2020年”端午节“假期暂停参与的公告》
- 160) 《关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为中国银河证券水星2号集合资产管理计划代销机构的公告》
- 161) 《银河水星2号集合资产管理计划2020年第2季度季报告》
- 162) 《关于中国银河证券水星2号集合资产管理计划买入20首钢03的公告》
- 163) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2020年”国庆节“、“中秋节”假期暂停参与的公告》



164) 《银河水星2号集合资产管理计划2020年第3季度季报告》

165) 《关于银河水星2号集合资产管理计划2021年元旦假期暂停参与的公告》

2、查阅方式

网址：yhjh.chinastock.com.cn

热线电话：4008-888-888

银河金汇证券资产管理有限公司

二〇二一年三月三十一日

