

银河水星现金添利货币型集合资产管理计划

2023 年第 2 季度报告

2023 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

报告送出日期：2023 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

本集合计划管理人的董事会及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责任。

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 2023 年 07 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	23,749,292,429.98 份
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</p>

	<p>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 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。</p> <p>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。</p>
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。
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

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。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	81,323,040.76
2. 本期利润	81,323,040.76
3. 期末基金资产净值	23,749,292,429.98

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，由于按摊余成本法核算的货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2. 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 2023 年 04 月 01 日至 2023 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

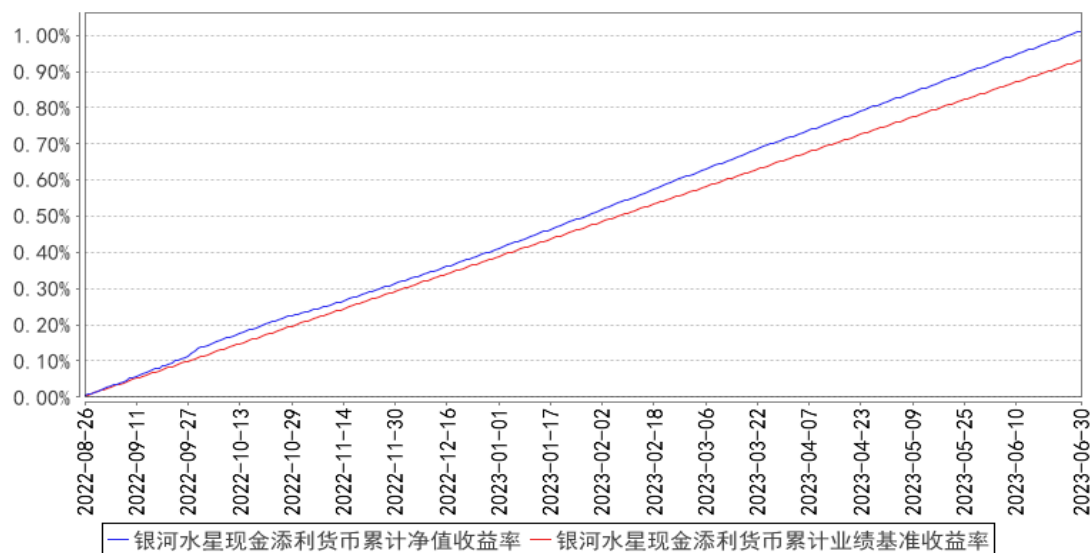
阶段	净值收益率①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.2943%	0.0001%	0.2742%	0.0000%	0.0201%	0.0001%
过去六个月	0.6017%	0.0002%	0.5455%	0.0000%	0.0562%	0.0002%
自基金合同 生效起至今	1.0116%	0.0005%	0.9312%	0.0000%	0.0804%	0.0005%

注：1. 本集合计划于 2022 年 08 月 26 日生效，截至本报告期末本集合计划生效未满一年；

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，截至本报告期末本集合计划变更生效未满一年；

2. 根据集合计划合同的约定，建仓期满，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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜海洋	本集合计划的基金经理	2022 年 8 月 26 日	-	12 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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

【宏观方面】

二季度，国内经济总体需求不足，经济恢复斜率放缓。5 月规模以上工业增加值同比增长 3.5%，较 4 月下降 2.1 个百分点。全国固定资产投资 5 月同比增长 4.0%，较 4 月下降 0.7 个百分点。其

中，房地产投资增速继续下滑且降幅有所增加，5月房地产开发投资累计同比增长-7.2%，降幅较4月扩大1.0个百分点。基建投资受地方政府收支紧平衡的制约增速有所放缓，但仍是托底经济的主要抓手。5月基础设施建设投资增长10.1%，较4月小幅上涨0.3个百分点。制造业受制于工业企业利润同比不断下滑、下游需求不足的影响，制造业投资同比增长6.0%，较4月回落0.4个百分点。对外贸易方面，受到外需走弱以及去年同期基数较高的影响，5月出口增速由正转负同比下降-7.5%，较4月大幅回落16.0个百分点。消费方面，随着一季度消费需求集中释放后，二季度受制于居民消费信心不足的影响，消费增速不及预期。总体来看，5月社会消费品零售总额同比增长12.7%，较4月回落5.7个百分点。5月物价指数维持低位，CPI同比上涨0.2%，较4月小幅上涨0.1个百分点；PPI同比增长-4.6%，较4月继续回落1.0个百分点。二季度以来CPI和PPI增幅持续走弱，显示出国内生产、耐用品消费等总体需求偏弱。

【市场方面】

二季度，在国内经济放缓的背景下，央行政策以稳经济为主，加大逆周期调节力度，保持流动性合理充裕。季度内央行开展3次MLF到期超额续作，并通过加大公开市场操作量，平滑季末时点流动性波动。此外，6月中旬央行将7天逆回购利率和MLF利率调降10BP，1年期LPR和5年期LPR同步报价调降10BP。

整体来看，二季度信贷需求放缓，银行资金较为充沛，整体流动性相对充裕，货币市场中枢较一季度有所下降。银行间质押式回购R001均值1.59%，较一季度回落49BP，R007均值2.16%，较一季度回落19BP。利率债方面，随着资金面的宽松以及经济增速环比放缓，二季度债券市场明显走强，收益率曲线陡峭化下移。季度末1年期和10年期国债收益率分别收于1.84%和2.64%，较一季度末分别下行39BP和21BP。信用债方面，二季度中高等级信用债各期限收益率在“资产荒”的背景下较一季度末继续下行20-30BP不等。信用利差整体低位震荡运行，4月初信用利差快速下行，5-6月由于利率债收益率下行速度快于信用债，信用利差较被动走阔。

【投资回顾】

二季度，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本集合计划份额净值收益率为0.2943%，业绩比较基准收益率为0.2742%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

合计资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	19,115,931,816.82	74.57
	其中：债券	19,115,931,816.82	74.57
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	6,519,126,752.65	25.43
4	其他资产	301,859.44	0.00
5	合计	25,635,360,428.91	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	3.17	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	1,850,226,305.84	7.79
	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

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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	103

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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。

5.3.2 报告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	22.33	7.79
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	19.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	43.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.45	7.79

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,570,799,077.42	6.61
	其中：政策性金融债	1,198,899,826.72	5.05
4	企业债券	752,780,454.71	3.17
5	企业短期融资券	1,569,419,864.90	6.61
6	中期票据	937,038,346.48	3.95
7	同业存单	14,285,894,073.31	60.15
8	其他	-	-
9	合计	19,115,931,816.82	80.49
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	220211	22 国开 11	3,300,000	335,224,893.40	1.41
2	180211	18 国开 11	3,000,000	310,502,723.84	1.31
3	112206227	22 交通银行 CD227	3,000,000	299,204,839.62	1.26
4	112311096	23 平安银行	3,000,000	298,403,660.94	1.26

		CD096			
5	112316041	23 上海银行 CD041	3,000,000	297,765,343.71	1.25
6	112311014	23 平安银行 CD014	3,000,000	297,219,167.63	1.25
7	112318040	23 华夏银行 CD040	3,000,000	297,156,267.38	1.25
8	200313	20 进出 13	2,800,000	288,203,158.63	1.21
9	112308037	23 中信银行 CD037	2,500,000	249,232,315.29	1.05
10	112217164	22 光大银行 CD164	2,500,000	249,106,390.42	1.05

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0744%
报告期内偏离度的最低值	-0.0175%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0349%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

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

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。

5.8 报告期末按摊余成本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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本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

（一）23 上海银行 CD041 的主体上海银行股份有限公司，在国家外汇管理局上海市分局行政处罚决定（上海汇管罚字〔2023〕3111221101 号）中，涉及如下违法事实：1、无结售汇业务资质的分支机构违规办理结售汇业务。2、已批准停止营业的分支机构违规办理结售汇业务。3、违规向境外个人销售外币理财产品。4、违规办理内保外贷业务。5、违规办理备用金结汇。6、未按

规定报送结售汇统计数据。7、虚增银行间外汇市场交易量。8、使用未经授权的通讯工具开展银行间外汇市场交易以及未按规定保存银行间外汇市场交易记录。根据相关法律法规给予警告，处罚款 9834.5 万元人民币，没收违法所得 19.9 万元人民币，罚没款合计 9854.4 万元人民币。

(二) 22 兴业银行 CD248 的主体兴业银行股份有限公司，根据《关于对兴业银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》(中国证券监督管理委员会福建监管局行政监管措施决定书(2023)18 号)，其基金销售业务在销售产品准入集中统一管理、基金销售业务数据统计质量等方面存在不足，分别违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(证监会令第 175 号，以下简称《基金销售办法》)第二十七条第一款、第四十二条第一款的相关规定。根据《基金销售办法》第五十三条规定，福建证监局决定对兴业银行采取责令改正的措施，兴业银行应进一步加强基金销售业务的合规管理，并采取切实有效的措施，对上述问题进行整改，并于 5 月 31 日前向福建证监局提交书面整改报告。

根据《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》(银保监罚决字(2022)50 号)显示，兴业银行理财业务存在以下违法违规行为：一、老产品规模在部分时点出现反弹；二、未按规定开展理财业务内部审计；三、同业理财产品未持续压降；四、单独使用区间数值展示业绩比较基准；五、理财托管业务违反资产独立性原则要求。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，罚款 450 万元。

根据《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》(银保监罚决字(2022)41 号)显示，兴业银行存在以下主要违法违规事实：债券承销业务严重违反审慎经营规则。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，罚款 150 万元。

兴业银行受到中国银行间市场交易商协会官网披露自律处分。作为债务融资工具主承销商及簿记管理人，在承销发行工作开展中，存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为：一是低价包销多期债务融资工具，影响了市场正常秩序。二是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成，发行工作程序执行不到位、工作开展不规范。自律处分会议还考量了兴业银行曾于 2020 年 5 月因承销环节违规受到自律处分的情况。根据银行间债券市场相关自律规定，经自律处分会议审议，对兴业银行予以警告；责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

(三) 22 建设银行 CD131 的主体中国建设银行股份有限公司，根据《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》(银保监罚决字(2023)10 号)显示，存在以下主要违法违规事实：一、公司治理和内部控制制度与监管规定不符；二、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改；三、向检查组提供企业出具的虚假证明材料；四、未按规定及时报送案件信息；五、违规发放房地产

贷款；六、贷款审查严重不尽职，违规办理虚假按揭贷款；七、违规发放固定资产贷款；八、违规为地方政府融资平台提供融资，后期以流动资金贷款承接前期融资；九、信用卡资金违规流入证券公司；十、违反产业政策为“两高一剩”企业提供融资；十一、小微企业统计数据与事实不符，企业划型不准确，将大中型企业纳入小微企业统计；十二、小微快贷业务违反审慎经营规则；十三、违规收取民营企业、小微企业费用；十四、违规借贷搭售理财产品；十五、精准扶贫小额贷款资金违规归集使用；十六、向关系人发放信用贷款；十七、违规发放贷款掩盖风险；十八、违规变相突破单一法人客户授信额度限制；十九、搭桥贷款业务不合规；二十、流动资金贷款管理违反审慎经营规则；二十一、固定资产贷款管理违反审慎经营规则；二十二、并购贷款管理违反审慎经营规则；二十三、个人贷款管理严重违反审慎经营规则；二十四、理财业务风险隔离不符合监管规定；二十五、理财业务投资运作不合规；二十六、违规通过理财业务实现不良资产虚假出表；二十七、违规虚增资本；二十八、面向一般个人客户销售的理财产品资金流向不符合规定，违规投资权益类资产；二十九、理财产品信息登记不及时，部分产品未登记底层资产；三十、理财业务统计数据与事实不符；三十一、理财资金投资非标准化债权资产的余额超过监管比例要求；三十二、同业投资业务管理违反审慎经营规则；三十三、债券投资业务未准确计量风险，个别债券风险加权资产计提比例低于监管要求；三十四、串用银行承兑汇票保证金掩盖信用风险；三十五、贴现资金违规回流出票人；三十六、违规向委托贷款借款人收取手续费；三十七、对信用卡业务异常交易行为监控不力导致频繁套现；三十八、银行集团并表统一授信管理流于形式。根据相关法律法规，没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元。其中，总行 7341.5626 万元，分支机构 12550 万元。

根据《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》（银保监罚决字〔2022〕51 号）显示，建设银行理财业务存在以下违法违规行为：老产品规模在部分时点出现反弹。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，罚款 200 万元。

根据《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表》（银保监罚决字〔2022〕44 号）显示，建设银行存在以下主要违法违规事实：一、个人经营贷款“三查”不到位；二、个人经营贷款制度不审慎；三、总行对分支机构管控不力承担管理责任。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，罚款 260 万元。

（四）23 平安银行 CD096、23 平安银行 CD014 的主体平安银行股份有限公司，受到中国银行间市场交易商协会官网披露自律处分。平安银行作为相关债务融资工具联席主承销商，未按发行文件约定，取利率区间上限开展余额包销，相关行为挤占了其他市场投资人的份额，损害了其他投资人权益，并影响了发行利率，对市场正常秩序造成了一定不良影响。根据银行间债券市场相

关自律规定，经自律处分会议初审、复审，对平安银行予以通报批评；责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

（五）22 交通银行 CD227 的主体交通银行股份有限公司，受到中国银行间市场交易商协会官网披露自律处分。交通银行作为债务融资工具主承销商及簿记管理人，在承销发行工作开展中，存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为：一是多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标，违背了公平公正原则，并影响了发行利率，对市场正常秩序造成了一定不良影响。二是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成，发行工作程序执行不到位、工作开展不规范。根据银行间债券市场相关自律规定，经自律处分会议初审、复审，对交通银行予以警告；责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2022〕46 号），交通银行存在下列主要违法违规事实：一、个人经营贷款挪用至房地产市场；二、个人消费贷款违规流入房地产市场；三、总行对分支机构管控不力承担管理责任。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，罚款 500 万元。

（六）23 农业银行 CD054 的主体中国农业银行股份有限公司，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2022〕52 号），农业银行理财业务存在以下违法违规行为：一、作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况；二、理财托管业务违反资产独立性原则要求，操作管理不到位。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，罚款 150 万元。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	301,859.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	301,859.44

5.9.4 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	24,634,295,818.49
报告期期间基金总申购份额	133,925,693,481.81
报告期期间基金总赎回份额	134,810,696,870.32
报告期期末基金份额总额	23,749,292,429.98

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本集合计划本报告期无管理人运用固有资金投资本集合计划的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划管理人于 2023 年 6 月 7 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司关于董事长及法定代表人变更的公告》，自 2023 年 6 月 5 日起，公司董事长及法定代表人变更为刘冰先生。

§ 9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

管理人处。

9.3 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
2023 年 7 月 20 日