

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
2023 年中期报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 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农业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 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 02 月 22 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 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	40

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	40
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	40
7.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.11	投资组合报告附注	40
§ 8	基金份额持有人信息	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3	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情况	42
§ 9	开放式基金份额变动	42
§ 10	重大事件揭示	43
10.1	基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4	基金投资策略的改变	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8	其他重大事件	44
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12	备查文件目录	45
12.1	备查文件目录	45
12.2	存放地点	46
12.3	查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	银河季季增利三个月滚动持有债券	
基金主代码	970136	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 2 月 22 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	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	75,972,374.07 份	
基金合同存续期	变更为本集合计划后，本集合计划存续期限为自本合同生效之日起 3 年。	
下属分级基金的基金简称	银河季季增利三个月滚动持有债券 A	银河季季增利三个月滚动持有债券 C
下属分级基金的交易代码	970136	970137
报告期末下属分级基金的份额总额	69,285,356.31 份	6,687,017.76 份

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。银河水星季季增利三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河水星 5 号月月盈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[2021]4004 号文准予变更。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现计划资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、利率策略</p> <p>利率是固定收益类品种最主要的风险来源和收益来源。因此利率策略的选择对集合计划的投资风险与收益尤为重要。利率策略的选择取决于利率的走势和收益率曲线变动两个方面。本集合计划通过对宏观经济状况和货币政策等因素的研究，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平；通过对债券市场具体情况的具体分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，相应地选择子弹型、哑铃型或梯形的组合期限配置，获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>本集合计划根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的历史数据比较，结合当时的市场环境，形成利差预期，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。其他投资策略还包括：券种的选择策略、动态增强策略、资产支持证券的投资策略及信用债投资策略。</p>

业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率×100%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵双	秦一楠
	联系电话	010-89623251	010-66060069
	电子邮箱	zhaoshuang_yhjh@chinastock.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-89623098	95599
传真		010-89623270	010-68121816
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)	北京市东城区建国门内大街69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	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		100073	100031
法定代表人		刘冰	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	银河季季增利三个月滚动持有债券 A	银河季季增利三个月滚动持有债券 C
本期已实现收益	951,352.14	80,043.28
本期利润	1,854,491.85	160,027.80
加权平均基金份额本期利润	0.0291	0.0281
本期加权平均净	2.79%	2.70%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	2.85%	2.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	3,947,823.66	360,502.17
期末可供分配基金份额利润	0.0570	0.0539
期末基金资产净值	73,233,179.97	7,047,519.93
期末基金份额净值	1.0570	1.0539
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.93%	2.95%

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 02 月 22 日生效，主要财务指标的实际计算期间为 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银河季季增利三个月滚动持有债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.31%	0.02%	0.18%	0.05%	0.13%	-0.03%

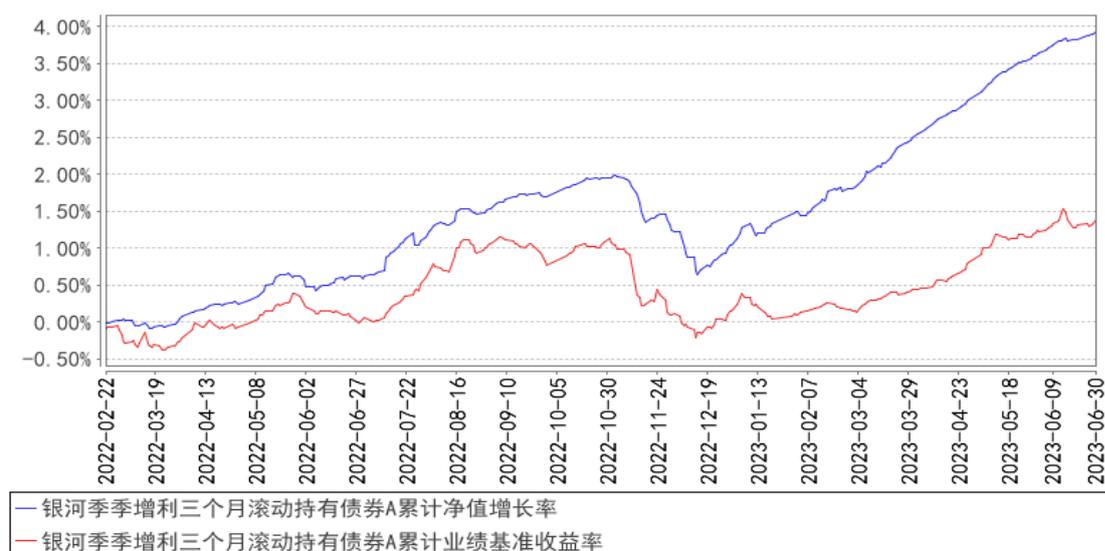
过去三个月	1.40%	0.02%	0.94%	0.04%	0.46%	-0.02%
过去六个月	2.85%	0.03%	1.22%	0.04%	1.63%	-0.01%
过去一年	3.32%	0.04%	1.35%	0.05%	1.97%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.93%	0.04%	1.39%	0.05%	2.54%	-0.01%

银河季季增利三个月滚动持有债券 C

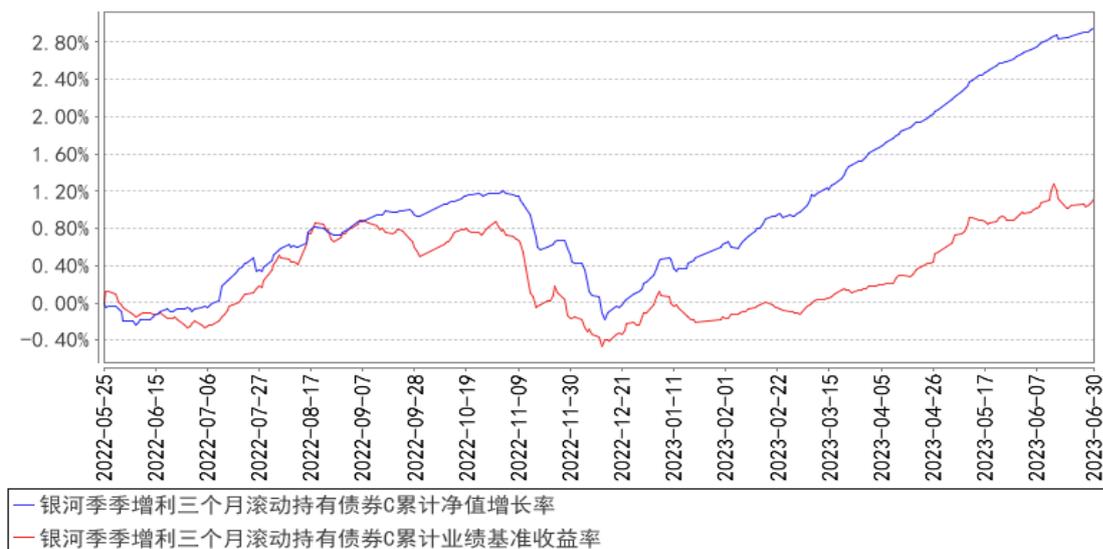
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.29%	0.02%	0.18%	0.05%	0.11%	-0.03%
过去三个月	1.33%	0.02%	0.94%	0.04%	0.39%	-0.02%
过去六个月	2.72%	0.03%	1.22%	0.04%	1.50%	-0.01%
过去一年	3.04%	0.04%	1.35%	0.05%	1.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.95%	0.04%	1.12%	0.05%	1.83%	-0.01%

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

银河季季增利三个月滚动持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



银河季季增利三个月滚动持有债券C累计净值增长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 02 月 22 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. 本集合计划自银河水星 5 号月月盈集合资产管理计划变更生效后，新增 C 类份额，C 类份额自 2022 年 05 月 25 日起存续。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河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		
刘锬	本集合计划的投资经理	2023 年 6 月 14 日	-	7 年	上海财经大学经济学硕士。曾任西部利得基金管理有限公司债券交易员、投资经理。2022 年 12 月加入银河金汇证券资产管理有限公司，现任投资经理。
李石	本集合计划的投资经理	2022 年 2 月 22 日	-	12 年	南开大学数学学士，金融工程硕士，多年证券从业经验。2010 年加入国信证券固定收益部，负责企业债发行、债券研究等工作。2012 年加入华夏基金固定收益部，先后任研究员、交易员、基金经理助理。2016 年加入银河金汇证券资产管理有限公司，主要从事固定收益类产品投资工作，具备证券从业资格和基金从业资格，近 3 年内没有被采取监管措施或处罚。

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

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

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

2023 年上半年，债券市场整体表现为在震荡中走强，债券收益率下行明显。经济基本面复苏程度不及预期以及资金面宽松是上半年债市走强的主要驱动因素，而去年底的债券市场大幅调整也为今年上半年债券收益率下行提供了空间。

具体而言，1 月至 2 月债券市场仍受到去年底债市情绪的波及，以及在经济基本面强预期的影响下债市震荡走弱；叠加资金面相对偏紧，信贷数据走强，市场情绪偏谨慎，债券收益率维持在相对高位。进入 3 月，政府工作报告中对于今年经济增长目标设定在 5%左右，市场预期逐渐下修，债市收益率迎来下行。3 月中旬，央行宣布降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，释放中长期流动性。相对宽松的货币政策对债券市场形成呵护。4 月份银行调降存款利率，以及经济复苏从强预期转为增长动能表现偏弱，经济基本面对债市的支撑逻辑逐渐明晰。5 月至 6 月，资金面的宽松带动债市收益率继续下行，央行在 6 月公告调降 7 天期逆回购利率 10 个基点，资金面维持在较为宽松的水平。

宏观经济方面，疫情过后今年将稳增长放在更加突出位置，随着社会经济活动恢复常态，消费在一季度表现为一定的反弹，但在二季度继续回落；一方面疫情期间积压的消费需求得到释放，另一方面，疫情期间居民形成的“预防性储蓄”需求短期难以完全释放，加之对经济复苏的不确定性均对消费复苏产生一定的抑制。投资方面，制造业投资和基建投资维持了较高的增速，但房地产投资表现出继续下滑的态势，仍是拖累项。出口方面，外需不足导致出口增速放缓，出口结构上表现出对主要发达国家及东盟等传统出口地的出口增速有所下滑。从上半年宏观经济的表现看，疫情对经济的影响已基本消退，但经济复苏仍存在内生动能不足和外需转弱的掣肘，下半年期待更多的稳增长政策发力。海外方面，地缘冲突持续，通胀高企，以及上半年国外银行破产风波等因素，给全球经济复苏带来不确定性。

报告期内，本基金采用了稳健的投资策略，以中高等级、中短久期信用债为主要投资标的。

可转债方面，主要配置偏债类品种，由于可转债整体估值仍较高，因此报告期内可转债维持较低的仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河季季增利三个月滚动持有债券 A 的份额净值为 1.0570 元，本报告期该类集合计划份额净值增长率为 2.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%；截至本报告期末银河季季增利三个月滚动持有债券 C 的份额净值为 1.0539 元，本报告期该类集合计划份额净值增长率为 2.72%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%。

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 2023 年下半年，经济基本面仍可能是债券市场最重要的主线，更多稳增长政策有望出台。消费方面，政策可能推动降低存量房贷利率等措施落地以带动消费需求；房地产投资方面，超大特大城市城中村改造的指导意见已出台，更多房地产方面的政策有望落地，房地产方面对于经济的拖累有望缓解；而出口受到外围需求不足的影响，在全球经济复苏放缓的背景下仍面临不确定性。目前债券收益率位于相对低位，继续大幅下行存在一定的阻力，考虑到市场已对经济基本面预期进行了向下调整，下半年存在稳增长政策超预期的可能性，继续以中高等级信用债为主要投资标的，控制产品久期，并根据经济基本面走势进行适当调整。可转债方面，现阶段建议维持较低的仓位，等待估值合适的时机，在权益市场情绪转暖时适当参与。

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。

会计师事务所对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

本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

在托管本集合计划的过程中，本集合计划托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及本集合计划合同、托管协议的约定，对本集合计划管理人银河金汇证券资产管理有限公司 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害集合计划份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，银河金汇证券资产管理有限公司在本集合计划的投资运作、集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、集合计划费用开支及利润分配等问题上，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照本集合计划合同的规定进行。

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

本托管人认为，银河金汇证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，本集合计划管理人所编制和披露的本集合计划年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害集合计划持有人利益的行为。

§ 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：银河水星季季增利三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	318,069.25	105,461.61
结算备付金		160,630.06	630,206.23
存出保证金		600.46	2,680.71
交易性金融资产	6.4.7.2	79,134,716.45	86,140,395.93
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		76,041,408.23	82,098,848.26

资产支持证券投资		3,093,308.22	4,041,547.67
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	3,899,610.11	-
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	-	11,760.98
资产总计		83,513,626.33	86,890,505.46
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,800,364.65	12,404,562.28
应付清算款		99,009.75	-
应付赎回款		10,138.55	-
应付管理人报酬		107,813.73	61,345.63
应付托管费		107,553.58	71,615.65
应付销售服务费		12,831.72	5,520.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24,075.86	234,352.34
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	71,138.59	160,722.69
负债合计		3,232,926.43	12,938,118.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	75,972,374.07	71,967,253.81
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,308,325.83	1,985,132.77
净资产合计		80,280,699.90	73,952,386.58
负债和净资产总计		83,513,626.33	86,890,505.46

注：（1）本集合计划合同变更生效日为 2022 年 02 月 22 日；

（2）报告截止日 2023 年 06 月 30 日，本集合计划份额总额为：75,972,374.07 份，其中

银河季季增利三个月滚动持有债券 A 集合计划份额为：69,285,356.31 份，集合计划份额净值为：1.0570 元。

银河季季增利三个月滚动持有债券 C 集合计划份额为：6,687,017.76 份，集合计划份额净值为：1.0539 元。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 2 月 22 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,335,547.25	709,240.78
1. 利息收入		10,777.65	43,684.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,886.75	33,467.77
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		6,890.90	10,216.69
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		1,341,645.37	875,092.02
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,271,425.42	872,602.33
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	70,219.95	2,489.69
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	983,124.23	-209,535.70
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	-	-
减: 二、营业总支出		321,027.60	193,198.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	107,813.73	90,089.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,937.93	30,029.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,311.43	148.12
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		89,253.88	2,829.01
其中: 卖出回购金融资产支出		89,253.88	2,829.01
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		5,117.70	2,559.60
8. 其他费用	6.4.7.23	75,592.93	67,542.33
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		2,014,519.65	516,041.98
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		2,014,519.65	516,041.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,014,519.65	516,041.98

6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 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

本报告期: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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 (基金净值)	71,967,253.81	-	1,985,132.77	73,952,386.58
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	71,967,253.81	-	1,985,132.77	73,952,386.58
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	4,005,120.26	-	2,323,193.06	6,328,313.32
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	2,014,519.65	2,014,519.65
(二)、 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)	4,005,120.26	-	308,673.41	4,313,793.67
其中:1. 基 金 申 购 款	14,847,827.76	-	732,279.49	15,580,107.25
2 .基 金 赎 回 款	-10,842,707.50	-	-423,606.08	-11,266,313.58
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留	-	-	-	-

存收益				
四、本期期末净资产(基金净值)	75,972,374.07	-	4,308,325.83	80,280,699.90
项目	上年度可比期间			
	2022年2月22日(基金合同生效日)至2022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(基金净值)	85,219,416.00	-	1,447,058.52	86,666,474.52
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	85,219,416.00	-	1,447,058.52	86,666,474.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,241,539.71	-	393,496.83	-4,848,042.88
(一)、综合收益总额	-	-	516,041.98	516,041.98
(二)、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)	-5,241,539.71	-	-122,545.15	-5,364,084.86
其中:1.	1,232,787.85	-	27,416.22	1,260,204.07

基金申购款				
2. 基金赎回款	-6,474,327.56	-	-149,961.37	-6,624,288.93
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	79,977,876.29	-	1,840,555.35	81,818,431.64

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：

王青

基金管理人负责人

王青

主管会计工作负责人

张红雨

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银河水星季季增利三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河水星 5 号月月盈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[2021]4004 号文准予变更，本集合计划托管人为中国农业银行股份有限公司。

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可

转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本集合计划不参与新股申购或增发新股,也不直接买入股票等权益类资产,因持有可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

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。

本集合计划的投资组合比例为:本集合计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%;本集合计划投资于同业存单的比例不超过集合计划资产的 20%;本集合计划投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例不超过集合计划资产的 20%;本集合计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划的业绩比较基准为:中债-综合全价(总值)指数收益率 \times 100%。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	318,069.25
等于：本金	317,866.34
加：应计利息	202.91
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	318,069.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	37,296,403.70	941,184.29	38,229,355.00	-8,232.99
	银行间市场	37,064,652.00	788,053.23	37,812,053.23	-40,652.00
	合计	74,361,055.70	1,729,237.52	76,041,408.23	-48,884.99
资产支持证券	3,000,000.00	94,508.22	3,093,308.22	-1,200.00	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	77,361,055.70	1,823,745.74	79,134,716.45	-50,084.99	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本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

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

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 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,899,610.11	-

银行间市场	-	-
合计	3,899,610.11	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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

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

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

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

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

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

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

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	27,904.97
其中：交易所市场	26,954.97
银行间市场	950.00

应付利息	-
预提费用	43,233.62
合计	71,138.59

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银河季季增利三个月滚动持有债券 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,657,806.40	67,657,806.40
本期申购	10,615,625.43	10,615,625.43
本期赎回（以“-”号填列）	-8,988,075.52	-8,988,075.52
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	69,285,356.31	69,285,356.31

银河季季增利三个月滚动持有债券 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,309,447.41	4,309,447.41
本期申购	4,232,202.33	4,232,202.33
本期赎回（以“-”号填列）	-1,854,631.98	-1,854,631.98
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	6,687,017.76	6,687,017.76

6.4.7.11 其他综合收益

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

银河季季增利三个月滚动持有债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,028,956.35	-3,155,995.05	1,872,961.30
本期利润	951,352.14	903,139.71	1,854,491.85
本期基金份额交易产生的变动数	198,663.28	21,707.23	220,370.51
其中：基金申购款	914,561.97	-347,997.25	566,564.72
基金赎回款	-715,898.69	369,704.48	-346,194.21

本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,178,971.77	-2,231,148.11	3,947,823.66

银河季季增利三个月滚动持有债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	199,226.14	-87,054.67	112,171.47
本期利润	80,043.28	79,984.52	160,027.80
本期基金份额交易产生的变动数	119,631.70	-31,328.80	88,302.90
其中：基金申购款	217,405.66	-51,690.89	165,714.77
基金赎回款	-97,773.96	20,362.09	-77,411.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	398,901.12	-38,398.95	360,502.17

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	1,635.95
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	2,238.86
其他	11.94
合计	3,886.75

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本集合计划本报告期无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,521,314.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-249,888.71
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	1,271,425.42

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,019,108.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,283,971.70
减：应计利息总额	982,274.72
减：交易费用	2,751.07
买卖债券差价收入	-249,888.71

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

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

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	70,219.95
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	0.00
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	70,219.95

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	1,038,465.75
减：卖出资产支持证券成本总额	1,000,000.00
减：应计利息总额	38,465.75
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	0.00

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

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

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**

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

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

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

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**

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

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

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

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	983,124.23
股票投资	-
债券投资	965,224.23
资产支持证券投资	17,900.00
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	983,124.23

6.4.7.21 其他收入

本集合计划本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	4,959.40
信息披露费	49,643.74
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
划款手续费	2,389.79
合计	75,592.93

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
中国农业银行股份有限公司	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

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年2月22日（基金合同生效日）至 2022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	15,499,708.03	100.00	56,660,898.20	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年2月22日（基金合同生效日） 至2022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	277,200,000.00	100.00	164,404,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

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 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	5,874.09	100.00	26,954.97	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年2月22日（基金合同生效日）至2022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	6,683.65	100.00	6,683.65	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	107,813.73	90,089.78
其中：支付销售机构的客户维护费	45,049.86	39,005.01

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×0.30%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×0.30%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	35,937.93	30,029.96

注：支付集合计划托管人中国农业银行股份有限公司的托管人报酬按前一日集合计划资产净值×0.10%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×0.10%÷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 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		
	银河季季增利三个月滚动持有债券 A	银河季季增利三个月滚动持有债券 C	合计
中国银河证券股份有限公司	-	7,293.63	7,293.63
合计	-	7,293.63	7,293.63
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2022 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河季季增利三个月滚动持有债券 A	银河季季增利三个月滚动持有债券 C	合计
中国银河证券股份有限公司	-	148.12	148.12
合计	-	148.12	148.12

注：本集合计划份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类份额不收取销售服务费。本集合计划 C 类份额销售服务费按前一日 C 类份额集合计划资产净值×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：C 类份额每日应计提的集合计划销售服务费=C 类份额前一日集合计划资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期内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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期内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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	银河季季增利三个月滚动持有债券 A	银河季季增利三个月滚动持有债券 C
基金合同生效日（2022 年 2 月 22 日）持有的基金份额	19,035,838.96	-
报告期初持有的基金份额	19,035,838.96	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份	-	-

额		
报告期末持有的基金份额	19,035,838.96	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.47%	-
项目	上年度可比期间 2022年2月22日（基金合同生效日）至2022年6月30日	上年度可比期间 2022年2月22日（基金合同生效日）至2022年6月30日
	银河季季增利三个月滚动持有债券 A	银河季季增利三个月滚动持有债券 C
基金合同生效日（2022年2月22日）持有的基金份额	19,035,838.96	-
报告期初持有的基金份额	19,035,838.96	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	19,035,838.96	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.07%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本集合计划本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年2月22日（基金合同生效日）至2022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
中国农业银行股份有限公司	318,069.25	1,635.95	71,155.69	15,746.29

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本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

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 2023 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 2023 年 06 月 30 日止，集合计划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 2,800,364.65 元，于 2023 年 07 月 11 日、2023 年 07 月 12 日（先后）到期。该类交易要求本集合计划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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本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的证券，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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	17,316,279.76	11,092,451.23
合计	17,316,279.76	11,092,451.23

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

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

本集合计划本报告期末未持有短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	30,912,948.45	38,347,241.99
AAA 以下	8,899,555.77	12,189,190.52
未评级	14,331,719.18	15,939,111.78
合计	54,144,223.40	66,475,544.29

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	3,093,308.22	4,041,547.67
未评级	-	-
合计	3,093,308.22	4,041,547.67

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	318,069.25	-	-	-	318,069.25
结算备付金	160,630.06	-	-	-	160,630.06
存出保证金	600.46	-	-	-	600.46
交易性金融资产	33,833,683.06	45,276,911.61	24,121.78	-	79,134,716.45
买入返售金融资产	3,899,610.11	-	-	-	3,899,610.11
资产总计	38,212,592.94	45,276,911.61	24,121.78	-	83,513,626.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,138.55	10,138.55
应付管理人报酬	-	-	-	107,813.73	107,813.73
应付托管费	-	-	-	107,553.58	107,553.58
应付清算款	-	-	-	99,009.75	99,009.75
卖出回购金融资产款	2,800,364.65	-	-	-	2,800,364.65
应付销售服务费	-	-	-	12,831.72	12,831.72
应交税费	-	-	-	24,075.86	24,075.86
其他负债	-	-	-	71,138.59	71,138.59
负债总计	2,800,364.65	-	-	432,561.78	3,232,926.43
利率敏感度缺口	35,412,228.29	45,276,911.61	24,121.78	-432,561.78	80,280,699.90
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	105,461.61	-	-	-	105,461.61
结算备付金	630,206.23	-	-	-	630,206.23
存出保证金	2,680.71	-	-	-	2,680.71
交易性金融资产	27,763,934.59	58,352,479.54	23,981.80	-	86,140,395.93
其他资产	-	-	-	11,760.98	11,760.98
资产总计	28,502,283.14	58,352,479.54	23,981.80	11,760.98	86,890,505.46
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	61,345.63	61,345.63
应付托管费	-	-	-	71,615.65	71,615.65
卖出回购金融资产款	12,404,562.28	-	-	-	12,404,562.28
应付销售服务费	-	-	-	5,520.29	5,520.29
应交税费	-	-	-	234,352.34	234,352.34
其他负债	-	-	-	160,722.69	160,722.69
负债总计	12,404,562.28	-	-	533,556.60	12,938,118.88
利率敏感度缺口	16,097,720.86	58,352,479.54	23,981.80	-521,795.62	73,952,386.58

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	128,145.68	234,648.19
	2. 市场利率上升 25 个基点	-127,510.53	-233,248.67

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

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

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,347,765.68	1,139,506.92
第二层次	314,191,100.12	85,000,889.01
第三层次	-	-
合计	316,538,865.80	86,140,395.93

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,134,716.45	94.76
	其中：债券	76,041,408.23	91.05
	资产支持证券	3,093,308.22	3.70
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,899,610.11	4.67
	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	478,699.31	0.57

8	其他各项资产	600.46	0.00
9	合计	83,513,626.33	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末无股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本集合计划本报告期末无股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本集合计划本报告期无股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本集合计划本报告期无股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期无股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	4,580,905.07	5.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	33,061,508.51	41.18
5	企业短期融资券	17,316,279.76	21.57
6	中期票据	20,495,773.47	25.53
7	可转债（可交换债）	586,941.42	0.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	76,041,408.23	94.72

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	163072	19 津投 26	60,000	5,838,989.59	7.27
2	102101733	21 甘公投	50,000	5,185,863.01	6.46

		MTN004			
3	152510	20 东通 01	50,000	5,169,719.18	6.44
4	012283992	22 贵州交通 SCP004	50,000	5,128,787.67	6.39
5	132280030	22 河钢集 GN001	50,000	5,072,885.25	6.32

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	135465	天星 07 优	30,000	3,093,308.22	3.85

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

产品前十大持仓中，20 东通 01 的主体柳州东通投资发展有限公司：

(1) 2023 年 6 月 12 日受到广西证监局行政监管措施。

涉嫌违法违规的事由：1、柳州东通 4 宗土地使用权账务处理不及时，涉及定期报告及发行文件信息披露不准确事项违反了《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号）《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 180 号）第四条的有关规定；2、柳州东通土地注销事项信息披露不及时事项违反了《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 180 号）《180 号办法》第四条、第五十四条第二款的规定。

有权机关调查进展情况：1、对柳州东通及相关责任人卓柳军、李积栋、陈海燕、袁帅、彭志春采取出具警示函的行政监管措施；2、柳州东通应当在收到决定书之日起 30 日内向广西监管局提交书面整改报告。

(2) 2022 年 12 月 22 日受到交易商协会的债券业务自律处分。

经查，柳州东通投资发展有限公司作为发行人，在债务融资工具发行及存续期间，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 4 宗土地涉及财务处理不及时，发行文件、定期报告信息披露不真实。二是土地注销事项信息披露不及时，且补充披露的公告信息不准确。三是未及时告知持有人会议召集人触发持有人会议召开情形的相关事项。

自律处分决定：对公司予以严重警告。责令公司针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改，并在收到处分决定书之日起 20 个工作日内向中国银行间市场交易协会提交书面整改报告。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划本报告期无股票投资。

7.11.3 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	600.46
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	600.46

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	586,941.42	0.73

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期无股票投资。

7.11.6 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

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
银河季季 增利三个 月滚动持 有债券 A	222	312,096.20	34,555,350.52	49.87	34,730,005.79	50.13
银河季季 增利三个 月滚动持 有债券 C	41	163,097.99	-	-	6,687,017.76	100.00
合计	263	288,868.34	34,555,350.52	45.48	41,417,023.55	54.52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	银河季季增利三个月滚动持有债券 A	320,131.49	0.46
	银河季季增利三个月滚动持有债券 C	-	-
	合计	320,131.49	0.42

8.3 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情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河季季增利三个月滚动持有债券 A	银河季季增利三个月滚动持有债券 C
基金合同生效日 (2022年2月22日) 基金份额总额	85,219,416.00	-
本报告期期初基金份 额总额	67,657,806.40	4,309,447.41
本报告期基金总申购 份额	10,615,625.43	4,232,202.33
减：本报告期基金总 赎回份额	8,988,075.52	1,854,631.98
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	69,285,356.31	6,687,017.76

§ 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 2023 年 3 月 11 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 2023 年 3 月 9 日起，郭卿不再担任公司董事长、总经理，聂润成不再担任公司合规总监、副总经理并不再代任公司首席风险官，杜鹏飞新任公司董事长，潘多亮新任公司合规总监、首席风险官，魏琦代任公司总经理；于 2023 年 3 月 11 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司关于法定代表人变更的公告》，自 2023 年 3 月 9 日起，杜鹏飞担任公司法定代表人；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。

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

本集合计划的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内，本集合计划未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中国银河证券股份有限公司	6	-	-	5,874.09	100.00	-

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	15,499,708.03	100.00	277,200,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河水星季季增利三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023年2月17日
2	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（C类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023年2月17日
3	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招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2023年2月17日
4	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 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年1月20日
5	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 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年3月30日
6	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 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年4月21日
7	银河水星季季增利三个月滚动持有债	中国证监会规定报刊及	2023年6月16日

	券型集合资产管理计划投资经理变更公告	网站	
8	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（银河季季增利三个月滚动持有债券 A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 19 日
9	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（银河季季增利三个月滚动持有债券 C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 19 日
10	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招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230630	19,035,838.96	0.00	0.00	19,035,838.96	25.06

产品特有风险

- 1、持有集合计划份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的集合计划份额净值波动风险；
- 2、持有集合计划份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；
- 3、持有集合计划份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；
- 4、持有集合计划份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的集合计划资产净值持续低于 5000 万元的风险。

11.2 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 8 月 12 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 2023 年 8 月 11 日起，潘多亮不再担任公司首席风险官，魏琦不再代任公司总经理，王青新任公司总经理，王东新任公司首席风险官。

§ 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 5 号月月盈集合资产管理合同变更的文件；
- 2、《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资产管理合同》；
- 3、《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托管协议》；

- 4、《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

2023 年 8 月 30 日