

银河水星聚利中短债债券型集合资产管理  
计划  
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 04 月 21 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建设银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 04 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 12 月 05 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 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	银河水星聚利中短债债券
基金主代码	970201
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 12 月 5 日
报告期末基金份额总额	1,052,013,072.71 份
投资目标	本集合计划在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，重点投资中短期债券，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	1、资产配置策略 本集合计划采用专业的投资理念和分析方法，以系统化的研究为基础，通过对各类固定收益类资产的合理配置获取稳定收益。 本集合计划主要根据不同类别资产的收益率水平、流动性指标、市场偏好、收益目标等决定不同类别资产的目标配置比率。管理人在充分考虑各类资产的收益率、流动性、规模及风险的基础上，优先选择资产规模大、赎回到账速度快、收益率较高的资产。通过建立资产池，灵活调整投资组合中的投资品种及投资比例，在保证投

	资组合流动性的基础上，实现投资增值。 2、固定收益类投资策略 本集合计划将通过分析宏观经济形势、政策预期和资金供给，并结合债券久期策略和收益率曲线结构的变化趋势来构建债券投资组合，把握利率债行情。在此基础上，积极采用信用策略，发掘市场上价值被低估的高收益信用债，获取较好的信用收益，力争达到债券组合安全性与收益性的统一。 固定收益类投资策略还包括利率预测、收益曲线策略、跨市场套利策略、滚动配置策略及信用债投资策略。		
业绩比较基准	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*85%+一年期定期存款利率(税后)*15%		
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市场型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。		
基金管理人	银河金汇证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	银河水星聚利中短债债券 A	银河水星聚利中短债债券 C	银河水星聚利中短债债券 E
下属分级基金的交易代码	970201	970202	970203
报告期末下属分级基金的份额总额	1,008,385,847.93 份	24,461,324.12 份	19,165,900.66 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。银河水星聚利中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由中国银河证券水星 2 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]1366 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 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）		
	银河水星聚利中短债债券 A	银河水星聚利中短债债券 C	银河水星聚利中短债债券 E
1. 本期已实现收益	6,980,206.13	40,711.93	47,500.37
2. 本期利润	10,906,661.96	77,101.58	78,950.23
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0085	0.0092
4. 期末基金资产净值	1,018,065,908.49	24,674,424.06	19,342,724.31
5. 期末基金份额净值	1.0096	1.0087	1.0092

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. 本集合计划于 2022 年 12 月 05 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 03 月 31 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

银河水星聚利中短债债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.96%	0.02%	0.83%	0.02%	0.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.96%	0.02%	0.95%	0.03%	0.01%	-0.01%

银河水星聚利中短债债券 C

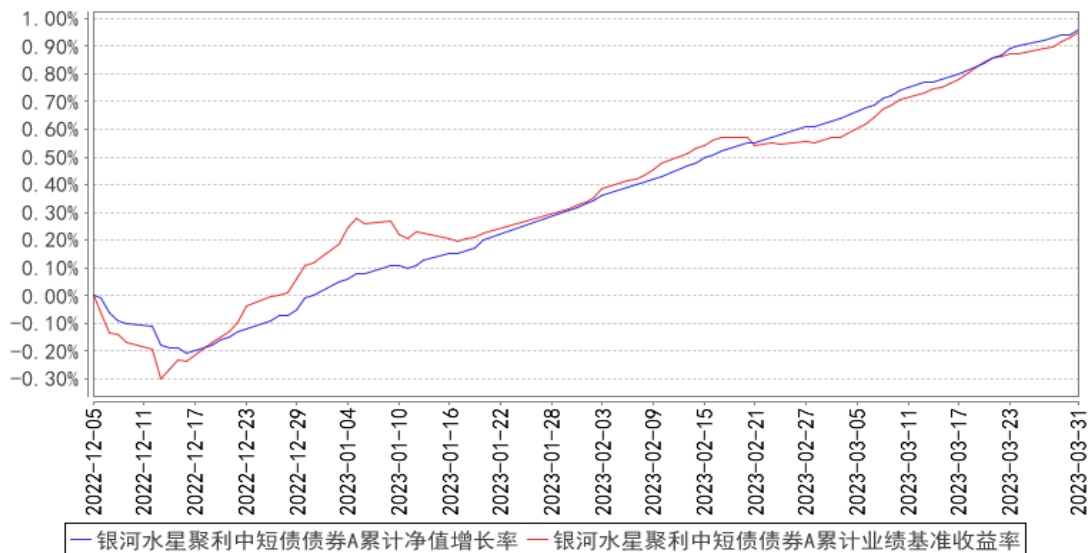
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.91%	0.02%	0.83%	0.02%	0.08%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.88%	0.02%	1.01%	0.03%	-0.13%	-0.01%

银河水星聚利中短债债券 E

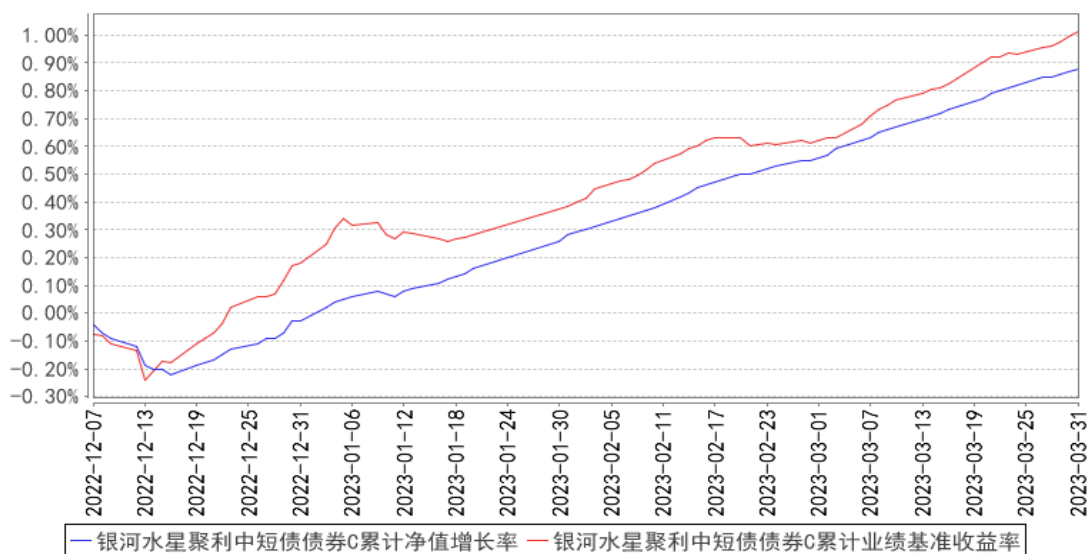
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.93%	0.02%	0.83%	0.02%	0.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.93%	0.02%	1.01%	0.03%	-0.08%	-0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率率变动的比较

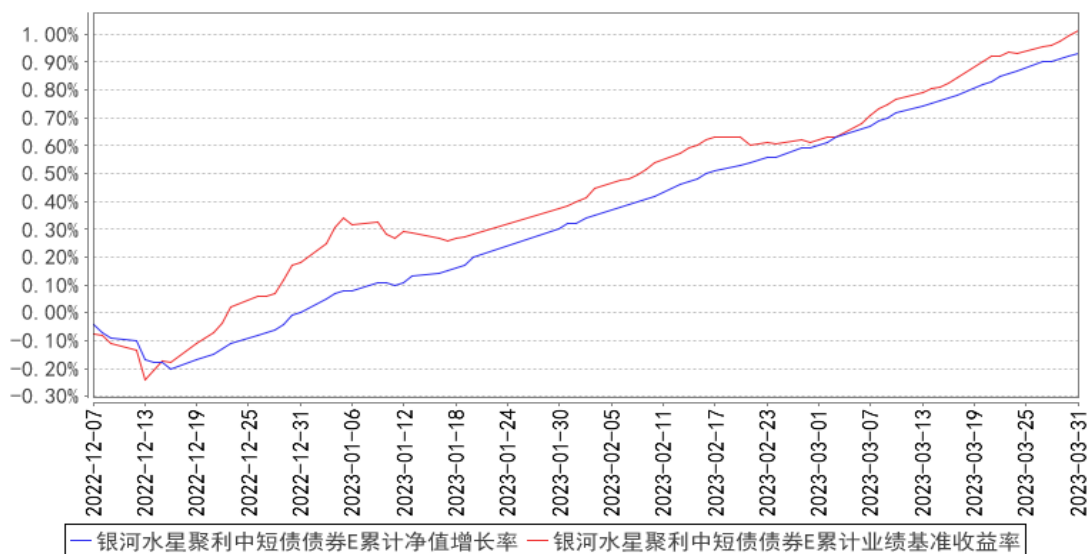
银河水星聚利中短债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



银河水星聚利中短债债券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



银河水星聚利中短债债券E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 12 月 05 日生效，截至本报告期末本集合计划处于建仓期内；
2. 按集合计划合同和招募说明书的约定，自集合计划合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合本集合计划合同的有关约定；
3. 本集合计划自中国银河证券水星 2 号集合资产管理计划变更生效后，新增 C 类、E 类份额，C 类、E 类份额自 2022 年 12 月 07 日起存续。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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	本集合计划的投资经理	2022 年 12 月 5 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。

#### 4.1.1 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 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】

一季度,国内经济呈现温和复苏态势,经济活力进一步释放,企业加快复工复产,银行信贷投放良好。2月,规模以上工业增加值同比大幅增长 18.77%,较上年末上涨 17.47 个百分点。全国固定资产投资 2 月份同比增长 5.5%,较上年末小幅上行 0.4 个百分点。其中,房地产投资增速继续下滑但下滑幅度有所减缓,2 月房地产开发投资累计同比增长-5.7%,降幅较上年末收敛 4.3 个百分点。2 月财政政策持续发力,在春季“基建开工潮”的带动下,基础设施建设投资增长 12.18%,较上年末上涨 0.66 个百分点。制造业投资同比增长 8.10%,较上年末回落 1.0 个百分点。对外贸易方面,出口回暖,出口增速同比下降-1.30%,较上年末大幅回升 8.72 个百分点。消费方面,疫情防控优化后消费动能逐步升温,特别是商旅出行带动下的居民出行修复改善明显,但汽车消费

方面，由于前期促消费政策对汽车需求的透支效应仍在持续，汽车消费拖累社会消费品零售增长读数。总体来看，2 月社会消费品零售总额同比增长 3.50%，较上年末回升 5.30 个百分点。2 月物价指数维持低位，CPI 同比上涨 1.00%，PPI 同比增长-1.40%，均低于市场预期。

#### 【市场方面】

一季度，宏观政策以稳经济为主，央行继续实施稳健货币政策，保持流动性合理充裕，保持了货币信贷合理增长。季度内央行开展 3 次 MLF 到期超额续作和 1 次降准，此外，在春节前、2 月末及 3 月末时点均通过逆回购向市场投放大量流动性，展现了央行维护银行间流动性平稳的态度。

整体来看，一季度疫后经济恢复，信贷需求相应改善，银行超储消耗较快，导致资金面较上年波动加大，货币市场利率中枢抬升，资金面边际有所收紧。银行间质押式回购 R001 均值 1.80%，较四季度上涨 39BP，R007 均值 2.35%，较四季度上涨 31BP，资金中枢回归到政策利率附近。利率债方面，短端利率跟随资金面收敛整体上行，长端利率先上后下，窄幅震荡，收益率曲线平坦化，期限利差处于中位数下方，季度末 1 年期和 10 年期国债收益率分别收于 2.23%和 2.85%，较上年末分别上行 13BP 和 1BP。信用债方面，信用利差整体快速收窄，目前中高等级各期限信用利差均处于中位数偏下，债市调整后的修复行情已接近尾声，短端信用债配置的性价比有所降低。

#### 【投资回顾】

一季度，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流动性为首要任务；配置一定比例的利率债、银行存单等高流动性资产，保障组合充足流动性；适当提高短期中高等级信用债的配置比例，组合久期保持低位，利率风险可控；密切跟踪持仓债券的信用资质，及时调整持仓，严控信用风险；根据资金波动，灵活调整组合杠杆水平，提高组合收益。整体看，一季度本集合计划投资业绩平稳，整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河水星聚利中短债债券 A 的份额净值为 1.0096 元，本报告期该类集合计划份额净值增长率为 0.96%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%；截至本报告期末银河水星聚利中短债债券 C 的份额净值为 1.0087 元，本报告期该类集合计划份额净值增长率为 0.91%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%；截至本报告期末银河水星聚利中短债债券 E 的份额净值为 1.0092 元，本报告期该类集合计划份额净值增长率为 0.93%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

### 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划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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,315,660,706.88	97.45
	其中：债券	1,305,466,720.58	96.69
	资产支持证券	10,193,986.30	0.76
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,233,365.26	0.31
8	其他资产	30,255,264.02	2.24
9	合计	1,350,149,336.16	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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。

#### 5.2.2 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末无股票投资。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（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	112,718,580.82	10.61
	其中：政策性金融债	112,718,580.82	10.61
4	企业债券	404,575,606.75	38.09

5	企业短期融资券	343,634,161.76	32.35
6	中期票据	444,538,371.25	41.86
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,305,466,720.58	122.92

#### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180211	18 国开 11	500,000	51,459,657.53	4.85
2	130231	13 国开 31	300,000	31,048,841.10	2.92
3	175175	20 招证 G5	300,000	30,761,515.07	2.90
4	102002203	20 广州城投 MTN001	300,000	30,632,210.96	2.88
5	220408	22 农发 08	300,000	30,210,082.19	2.84

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180876	招融 10 优	100,000	10,193,986.30	0.96

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

##### 5.9.3 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。

#### 5.10 投资组合报告附注

##### 5.10.1 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

产品前十大持仓中, 17 昆投 01 的主体昆明产业开发投资有限责任公司, 富民县自然资源局因其行政违法行为出具了富自然执罚(2022)18 号处罚决定, 1. 责令退还违法占用的款庄镇马街、青平村委会 32694.91 平方米(49.04 亩)土地, 2. 没收在违法占用符合规划的 32587.7 平方米(48.88 亩)城镇用地、居民点用地上新建的建筑物和其他设施, 3. 对违法占用村庄 6052.06 平方米, 建制镇 2319.44 平方米公路用地 21901.7 平方米的行为处以 1 元平方米的罚款, 共计人民币 30273.2 元(叁万零贰佰柒拾叁元贰角整), 对违法占用水田 2421.71 平方米的行为处以 10 元平方米的罚款, 共计人民币 24217.1 元(贰万肆仟贰佰壹拾柒元壹角整), 罚款合计人民币 54490.3 元(伍万肆仟肆佰玖拾元叁角整)。

20 招证 G5 的主体招商证券股份有限公司, 中国证监会因其内部制度不完善, 根据《证券发行上市保荐业务管理办法》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》、《证券公司投资银行类业务内部控制指引》, 决定对其采取出具警示函的行政监督管理措施; 因其未依法履行职责, 根据《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》、《证券法》, 出具中国证监会[2022]50 号, “一、责令招商证券改正违法行为, 没收业务收入 3,150 万元, 并处以 3,150 万元罚款; 二、对陈轩壁、俞新平给予警告, 并分别处以 5 万元罚款。”; 因公司 2014 年在开展上海飞乐股份有限公司(现中安科股份有限公司)独立财务顾问业务工作期间未勤勉尽责, 涉嫌违法违规, 根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国行政处罚法》, 中国证监会决定对公司立案(证监立案字 0382022020 号); 因其在 2022 年 5 月 16 日的网络安全事件中, 存在系统设计与升级变更未经充分论证和测试, 升级回退方案不完备等问题, 反映出公司内部管理存在漏洞、权责分配机制不完善的情况, 根据《信息安全保障管理办法》、《信息技术管理办法》《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》, 决定对其采取出具警示函的行政监管措施。因其在从事投资银行类业务过程中, 存在以下问题: 一是保荐业务中, 个别项目对发行人的收入确认、核心技术、研发费用核算尽职调查不充分。二是债券承销业务中, 个别项目对发行人的债务情况, 对外担保情况, 偿债能力, 关联交易情况, 重大仲裁、诉讼和其他重大事项及或有事项等尽职调查不充分。三是资产证券化业务中, 个别项目对原始权益人、托管人的资信水平等尽职调查不充分; 尽职调查报告未包含对重要债务人进行尽职调查的情况; 存续期管理对基础资产现金流监督检查不到位, 未发现涉及基础资产现金流的重大事项并发布临时公告。上述情形违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》(证监会令第 170 号, 以下简称《发行上市保荐业务办法》)第十七条, 《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第 113 号, 以下简称《债券管理办法》)第七条, 《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务管理规定》(证监会公告〔2014〕49 号, 以下简称《资产证券化业务管理规定》)

第十三条第（一）项、第（七）项、第（九）项，《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务尽职调查工作指引》（证监会公告〔2014〕49号）第七条、第九条、第十三条，《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务信息披露指引》（证监会公告〔2014〕49号）第十九条第（六）项的规定。根据《发行上市保荐业务办法》第六十五条、《债券管理办法》第五十八条、《资产证券化业务管理规定》第四十六条的规定，深圳证监局决定对其采取出具警示函的监管措施（行政监管措施决定书〔2022〕123号）；因其在2022年3月14日的网络安全事件中，存在变更管理不完善，应急处置不及时、不到位等问题，违反了《证券期货业信息安全保障管理办法》（证监会令82号，以下简称《信息安全保障管理办法》）第二十二条、第三十二条第一款以及《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》（证监会令179号，以下简称《信息技术管理办法》）第二十二条第一款、第三十六条、第四十二条的相关规定，依据《信息安全保障管理办法》第五十条，《信息技术管理办法》第五十七条，以及《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》（证监会公告〔2021〕12号）第二十八条的规定，深圳证监局决定对其采取责令改正的行政监管措施。因其内部制度不完善，深圳证券交易所根据《会员管理规则》、《会员管理业务指引第1号——会员交易及相关系统管理》，对其采取书面警示的自律监管措施；根据《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》、《会员管理业务指引第1号——会员交易及相关系统管理》、《会员管理规则》，对其采取书面警示的自律监管措施（深证函〔2022〕602号）。因其内部制度不完善，产品不合格，上海证券交易所根据《上海证券交易所会员管理规则》、《上海证券交易所会员管理规则适用指引第1号——会员交易及相关系统管理》、《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法（2019年修订）》，对其予以书面警示（上海证券交易所〔2022〕7号）；因其未依法履行职责，一是交易系统变更管理不完善，对正常交易产生较大影响，二是应急处置不及时、不到位，根据《上海证券交易所会员管理规则》第8.5条、《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》，对其予以书面警示（上海证券交易所〔2022〕4号）。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	51,940.10
2	应收证券清算款	30,137,433.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	65,889.95

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	30,255,264.02

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末无持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.10.5 报告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。

#### 5.10.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河水星聚利中短 债债券 A	银河水星聚利 中短债债券 C	银河水星聚利 中短债债券 E
报告期期初基金份额总额	1,318,549,364.04	215,540.29	2,414,598.81
报告期期间基金总申购份额	17,898,364.62	26,943,809.43	17,136,023.21
减：报告期期间基金总赎回份额	328,061,880.73	2,698,025.60	384,721.36
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	1,008,385,847.93	24,461,324.12	19,165,900.66

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

#### 7.2 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 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

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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中国银河证券水星 2 号集合资产管理合同变更的文件；
- 2、《银河水星聚利中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《银河水星聚利中短债债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《银河水星聚利中短债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。

### 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 4 月 21 日