

# 银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产 管理计划 2023 年年度报告

2023 年 12 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。本年度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光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 03 月 27 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 2021 年 09 月 28 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。

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）对本集合计划出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>46</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
8.3 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 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
8.6 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 .....	50
8.7 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 .....	50
8.8 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 .....	50
8.9 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 .....	50
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
8.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.3 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 .....	52
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
11.2 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 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4 基金投资策略的改变 .....	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
12.1 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 .....	56
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
13.1 备查文件目录 .....	56
13.2 存放地点 .....	56
13.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划
基金简称	银河安丰九个月滚动持有混合
基金主代码	970051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 28 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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	63,608,373.82 份
基金合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不超过 3 年。

注：本报告所述“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河安心收益 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[2021]1867 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金流动性的基础上，追求集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划的投资是根据对宏观经济、宏观政策走势、行业景气变化及企业经营和财务状况、债券市场走势等动态分析，在限定投资范围内，决定债券类资产、股票类资产和现金类资产的配置比例，并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期对大类资产配置比例进行调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>在保持债券组合低波动性的前提下，综合运用多种策略参与市场所提供的投资机会，以期为持有人获取更高的收益。债券投资策略主要包括：（1）久期配置策略；（2）收益率曲线策略；（3）债券类属配置策略；（4）骑乘策略；（5）信用债投资策略及（6）可转换债券与可交换债券投资策略。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本计划中股票投资部分，主要根据价值、成长、趋势、市场情绪等多重因素的综合考虑来筛选行业和个股进行投资。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本集合计划在管理人认为在符合一定条件的市场环境中，有必要审</p>

	<p>慎灵活地综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>本集合计划进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数收益率×85%。
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合资产管理计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵双	石立平
	联系电话	010-89623251	010-63639180
	电子邮箱	zhaoshuang_yhjh@chinastock.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		010-89623098	95595
传真		010-89623270	010-63639132
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳前海商务秘书有限公司)	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市丰台区西营街8号新青海金融大厦7层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100073	100033
法定代表人		王青	王江

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://yhjh.chinastock.com.cn">http://yhjh.chinastock.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区安定门外大街189号首开广场安定门10层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年	2021 年 9 月 28 日（基金合
---------	--------	--------	---------------------

间数据和 指标			同生效日)-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	2,099,223.76	2,263,018.34	354,362.05
本期利润	2,727,271.85	935,482.98	989,645.07
加权平均 基金份额 本期利润	0.0498	0.0105	0.0171
本期加权 平均净值 利润率	4.16%	0.91%	1.49%
本期基金 份额净值 增长率	5.24%	-0.10%	0.97%
3.1.2 期 末数据和 指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供 分配利润	27,130,910.68	16,187,330.38	39,199,085.47
期末可供 分配基金 份额利润	0.4265	0.3662	0.3673
期末基金 资产净值	77,055,834.41	50,880,893.76	122,956,496.74
期末基金 份额净值	1.2114	1.1511	1.1522
3.1.3 累 计期末指 标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额 累计净值 增长率	6.23%	0.94%	0.97%

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 2021 年 09 月 28 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 12 月 31 日。

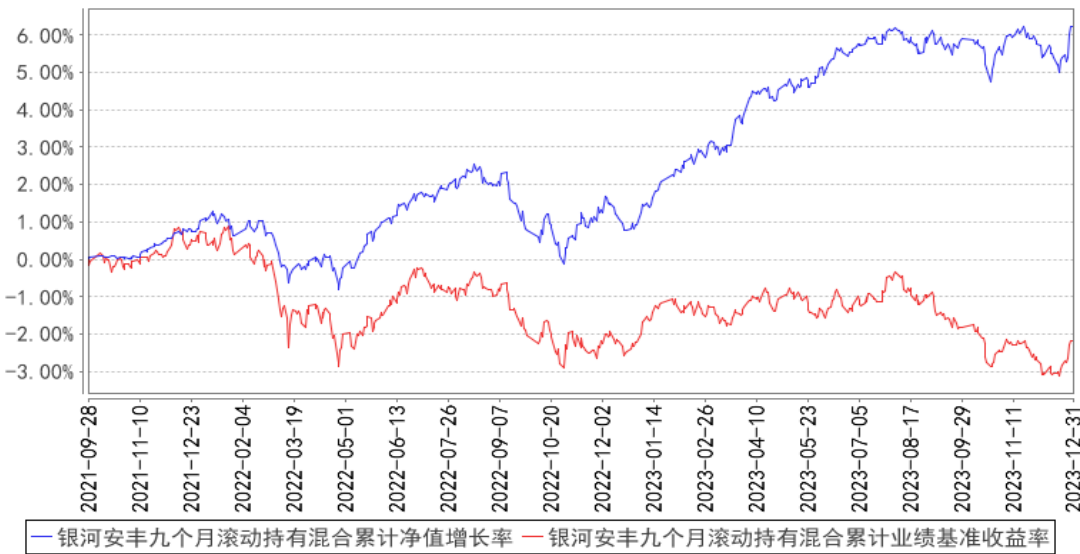
3.2 基金净值表现

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

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
过去三个月	0.31%	0.16%	-0.37%	0.13%	0.68%	0.03%
过去六个月	0.57%	0.13%	-0.93%	0.13%	1.50%	0.00%
过去一年	5.24%	0.13%	0.04%	0.13%	5.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.23%	0.13%	-2.18%	0.16%	8.41%	-0.03%

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

银河安丰九个月滚动持有混合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

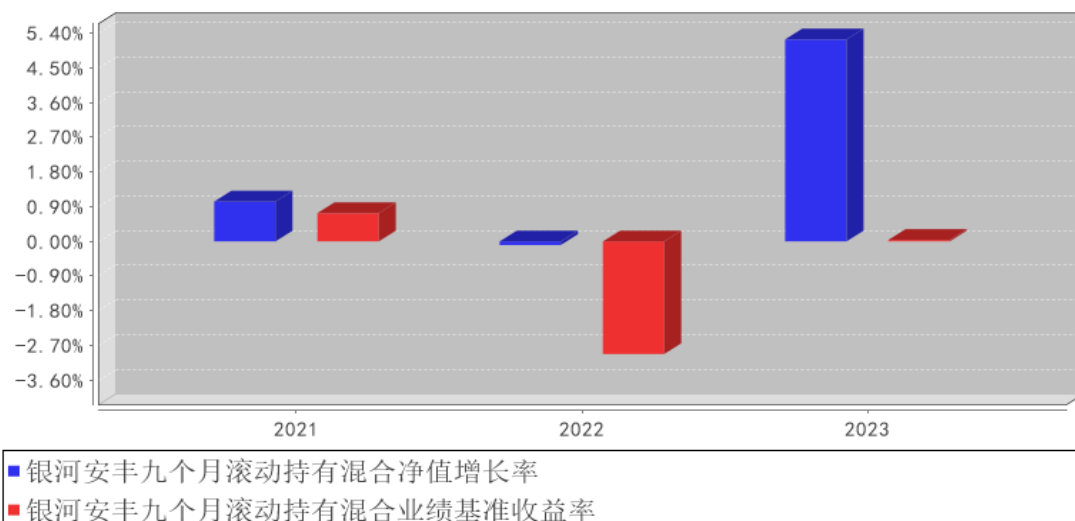


注：1. 本集合计划于 2021 年 09 月 28 日生效；  
2. 截至本报告期末，本集合计划的投资符合集合计划合同关于投资范围及投资限制的规定。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银河安丰九个月滚动持有混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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		
李卓轩	本集合计划的投资经理	2023 年 6 月 14 日	—	8 年	北京理工大学电子科学与技术专业学士，北京交通大学通信与信息系统专业博士，北京市优秀博士毕业生。曾就职于国家电网公司信息通信分公司、国泰君安证券研究所。2017 年 5 月加入银河金汇证券资产管理有限公司，从事股票投研工作，现任投资经理。
李石	本集合计划的投资经理	2021 年 9 月 28 日	2023 年 12 月 13 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。
刘锬	本集合计划的投资经理	2023 年 12 月 13 日	—	8 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。

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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本集合计划管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

### 4.3.3 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

债券投资策略和运作分析：

2023 年全年，债券市场整体表现为上涨行情；除了阶段性调整外，债券收益率整体表现为下行。疫情过后市场对于经济复苏的节奏预期过高，导致债券市场在 2022 年年底的超调，为 2023 年债市收益率下行提供空间，叠加 2023 年经济基本面预期修正及货币政策整体宽松，债市呈现出牛市格局。具体而言，1 月至 2 月债市受到 2022 年底大幅调整的情绪波及，以及基本面强预期和资金面偏紧的背景下，依然处于震荡调整。进入 3 月份后，随着基本面预期修正及货币政策宽松，债券收益率在上半年持续下行。下半年以来，债券市场经历了一定的震荡调整，主要驱动因素包括稳增长政策发力、资金面阶段性趋紧、国债增发等因素。但由于债市配置力量较强，叠加基本面数据及通胀等数据对债市偏利多，震荡调整后债市收益率继续下行。信用债方面，全年信用利

差收窄，收益率持续下行，尤其是下半年以来“一揽子化债方案”及特殊再融资债券的发行，引发城投债上演“资产荒”行情，城投债信用利差处于低位，短期内化债资金充裕的背景下城投债提前兑付现象增加。而利率债方面，2023 年收益率曲线大幅平坦化下行，期限利差收窄。

货币政策方面，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。6 月央行公告调降 MLF 及 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。8 月 15 日，1 年期 MLF 中标利率较上期下调 15 个基点至 2.5%，7 天逆回购利率较上期下调 10 个基点至 1.8%。全年货币政策整体宽松，流动性合理充裕，货币政策整体对债券市场较为呵护。

权益投资策略和运作分析：

2023 年一季度，国内经济延续疫后复苏态势，基建投资在 2022 年四季度达到 20%以上的高增长后，2023 年一季度有所回落，但仍保持在接近 20%的较高水平，2023 年二季度出现明显的下行压力，消费-地产链恢复情况低于预期，“弱现实”特征进一步突显，在保交楼政策加速推进下，住宅竣工同比保持高增长，但新开工和拿地数据依然较弱，股票和大宗商品价格出现显著回调。考虑到经济基本面恢复不及预期，以及市场风险并未有效释放，2023 年上半年产品权益仓位明显低于市场同类产品的平均水平。2023 年三季度宏观经济出现回升态势，传统工业、基建投资需求表现良好，稳增长政策支持下，制造业投资表现出了较强韧性，9 月制造业 PMI 指数为 23 年 4 月以来首次重返扩张区间。2023 年四季度表现较弱，制造业 PMI 继 9 月温和扩张后，连续三个月收缩。2023 年全年来看，制造业景气度呈现“一季度高预期，二季度弱现实，三季度小反弹，四季度往回踩”的走势。政策方面，前三个季度宽货币、紧财政，四季度紧货币、紧财政，10 月底推出了万亿国债计划，持续督促地方政府化债，并着力推进保交楼，但依然难以扭转市场下跌趋势。

权益投资坚持“翻石头”策略，包括：1）景气趋势；2）困境反转；3）错杀白马，选股采用“三好生”选股标准，即好行业、好公司、好价格，同时看重估值的安全边际。投资方向上聚焦高端制造和硬科技，加强个股基本面研究的广度和深度，从产业的角度看行业、从行业的角度看企业、从老板的角度看生意，从未来的角度看现在。

#### 4.4.2 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为 1.2114 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 5.24%，同期业绩比较基准收益率为 0.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储高利率环境下，欧美经济有一定的衰退可能，国内需求不足的压力仍在，资产缩水导致居民超额储蓄难以向消费有效转移，房地产开发投资经过两年多的大幅调整，2024 年预计能够企稳，基建投资一方面是经济逆周期调节的重要工具，但另一方面受到高额地方债的约束，预计

较 2023 年保持平稳增速，受益于国内汽车、光伏等高端制造能力的显著提升，预计 2024 年出口同比增长 5%-10%。

中央经济工作会议提出“稳中求进、以进促稳、先立后破，多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策”、“要强化宏观政策逆周期和跨周期调节，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，加强政策工具创新和协调配合”。预计货币政策层面仍将对市场有所呵护，经济基本面在政策推动下复苏节奏可能加快。目前债券收益率位于相对低位，且收益率曲线已经呈现出平坦化，可考虑采用中短久期信用债加上二级资本债和长端利率债策略，根据市场情况灵活调整久期。可转债方面，现阶段建议维持较低的仓位，在权益市场情绪转暖时适当参与。

在行业配置方面，重点关注：1) 汽车智能化进一步增强，高阶智能驾驶试点不断推进，智能化赛道将进入加速渗透期，小米汽车发布在即，有望提振市场热情，看好自动驾驶和智能化方向；2) 光伏产品价格低位，优质产能去化接近尾声，排产量有望在春季之后回升，看好凭借成本和现金储备优势保持盈利韧性的产业链一体化厂商；3) 随着美国限制的不断加码，国内半导体产业链核心环节国产化替代加速推进，半导体行业整体进入去库尾声阶段，看好估值低位的半导体细分空头；4) 生成式 AI 将从大模型训练阶段向应用推理阶段推进，当有 AI “杀手级”应用推出后，需求将显著增长，此外，随着大模型端侧部署持续推进，终端算力产品化落地有望带来产业机遇。看好 AI 算力服务器和关键设备厂商。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。合规管理方面，管理人积极跟踪法律法规变化和监管动态更新，及时向业务团队传达最新法律法规和监管政策，认真评估其对业务的影响并明确各项法规、监管要求的落实责任部门，使得管理人的从业人员知法、守法，合法合规展业；管理人不断完善内控制度建设，通过制度和流程明细合规管理要点并细化工作要求，确保在内控有效性的前提下稳健展业；继续开展合规宣导，不断增强管理员工的合规意识，促进合规文化的建设，通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训等各种多样形式，并结合最新的法律法规变化、监管政策更新及行业风险事件，加深员工对法律法规、监管政策及风险的理解，从而使得法律法规、监管政策等合规要点在管理人内部得到切实落实。风险管理方面，管理人严格落实事前严格监督审查、事中严格指标监控、事后及时分析管理的三阶段工作部署，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理和风控指标的强制合规管理，督促投研交易业务的合规开展。监察稽核方面，管理人定期和不定期开展多项内部稽核，对投资决策、投资研究、交易执行、基金销售、信息技术等关键业务和岗位进行监察监督，并关注内部控制的健全性和有效性，及时提出相应的改进性建议，促进管理人业务合规

运作、稳健经营。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

本报告期内集合计划出现连续 20 个工作日以上（2023 年 5 月 11 日-2023 年 6 月 20 日）集合计划资产净值低于 5000 万的情形。自 2023 年 6 月 21 日至本报告期末，本集合计划未出现连续 20 个工作日集合计划份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、集合计划合同、托管协议等的规定，依法安全保管了集合计划的全部资产，对本集合计划的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本集合计划运作情况报告，没有发生任何损害集合计划份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为集合计划托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、集合计划合同、托管协议等的规定，对集合计划管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、

监督，未发现集合计划管理人在投资运作、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、集合计划费用开支等方面存在损害集合计划份额持有人利益的行为。该集合计划在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据集合计划合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对集合计划管理人编制的《银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划 2023 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	众环审字(2024)0700078

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划全体份额持有人：
审计意见	我们审计了银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度利润表和净资产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企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》和在财务报表附注二中所列示的中国证券监督管理委员会颁布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度经营成果和集合计划净资产变动情况。
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，我们独立于银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划，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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	银河金汇证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理

	<p>人”)对其他信息负责。其他信息包括银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>集合计划管理人管理层负责按照企业会计准则及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而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,集合计划管理人管理层负责评估银河安丰九个月滚动持有混合型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,除非集合计划管理人管理层计划清算银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>集合计划管理人治理层负责监督银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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:</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(三)评价集合计划管理人管理层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。</p> <p>(四)对集合计划管理人管理层使用持续经营假设的恰当性</p>



	<p>得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对银河安丰九个月滚动持有混合型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安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>（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。</p> <p>我们与集合计划管理人治理层就计划的审计范围、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。</p>	
会计师事务所的名称	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	毛宝军	张慧
会计师事务所的地址	北京市东城区安定门外大街 189 号首开广场安定门 10 层	
审计报告日期	2024 年 3 月 8 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	140,361.71	86,052.68
结算备付金		264,805.78	490,147.60
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	74,933,861.98	42,875,577.36
其中：股票投资		12,751,162.00	5,265,876.00
基金投资		-	-
债券投资		62,182,699.98	37,609,701.36
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,899,752.17	7,902,366.76
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		901,043.29	12,931.67
应收股利		-	-
应收申购款		12.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		78,139,836.93	51,367,076.07
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-86.05
应付清算款		-	-
应付赎回款		976,333.97	-
应付管理人报酬		26,311.16	48,585.23
应付托管费		6,577.81	119,006.20
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,051.74	154,729.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	69,727.84	163,947.37
负债合计		1,084,002.52	486,182.31
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	49,924,923.73	34,693,563.38
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	27,130,910.68	16,187,330.38
净资产合计		77,055,834.41	50,880,893.76
负债和净资产总计		78,139,836.93	51,367,076.07

注：报告期截止日 2023 年 12 月 31 日，本集合计划份额净值 1.2114 元，集合计划份额总额为 63,608,373.82 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		3,235,940.17	1,810,289.24
1. 利息收入		119,829.56	185,849.24
其中：存款利息收入	7.4.7.13	9,934.20	22,141.70
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		109,895.36	163,707.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,488,062.52	2,951,975.36
其中：股票投资收益	7.4.7.14	85,055.55	-1,808,479.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,251,605.05	4,234,618.09
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	190,770.10
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	151,401.92	335,066.66
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）	7.4.7.20	628,048.09	-1,327,535.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		508,668.32	874,806.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	260,879.87	411,336.43
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	65,219.97	102,834.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		72,080.75	98,256.01
其中：卖出回购金融资产支出		72,080.75	98,256.01
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		8,374.38	10,772.39
8. 其他费用	7.4.7.23	102,113.35	251,607.22
<b>三、利润总额（亏损总额</b>		2,727,271.85	935,482.98

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,727,271.85	935,482.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,727,271.85	935,482.98

### 7.3 净资产变动表

会计主体：银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	34,693,563.38	-	16,187,330.38	50,880,893.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	34,693,563.38	-	16,187,330.38	50,880,893.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,231,360.35	-	10,943,580.30	26,174,940.65
（一）、综合收益总额	-	-	2,727,271.85	2,727,271.85
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	15,231,360.35	-	8,216,308.45	23,447,668.80
其中：1. 基金申购款	31,763,976.55	-	16,915,767.42	48,679,743.97
2. 基金赎回款	-16,532,616.20	-	-8,699,458.97	-25,232,075.17
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	49,924,923.73	-	27,130,910.68	77,055,834.41
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	83,757,411.27	-	39,199,085.47	122,956,496.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	83,757,411.27	-	39,199,085.47	122,956,496.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-49,063,847.89	-	-23,011,755.09	-72,075,602.98
(一)、综合收益总额	-	-	935,482.98	935,482.98
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-49,063,847.89	-	-23,947,238.07	-73,011,085.96
其中：1. 基金申购款	14,348,006.28	-	6,717,543.48	21,065,549.76
2. 基金赎回款	-63,411,854.17	-	-30,664,781.55	-94,076,635.72
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	34,693,563.38	-	16,187,330.38	50,880,893.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王青</u>	<u>王青</u>	<u>张红雨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河安心收益 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[2021]1867 号文准予变更，本集合计划托管人为中国光大银行股份有限公司。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、股指期货、国债期货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）。

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：股票资产占集合计划资产的 0%-30%；投资于同业存单的比例不超过集合计划资产的 20%；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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券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、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：沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数收益率×85%。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 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 12 月 31 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 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。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

#### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本集合计划成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本集合计划管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合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。集合计划持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于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。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且



符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本集合计划对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本集合计划持有的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按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资

产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示，除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于本集合计划申购确认日及赎回确认日确认。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 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确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率，在回购期内逐日计提；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的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变动计入当期损益的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；

(8) 其他收入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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配；

(2) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；投资者持有的集合计划份额（原份额）所获得的红利再投资份额的运作期起始日和运作期到期日与原份额相同；

(3) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一集合计划份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 分部报告

无。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	140,361.71	86,052.68
等于：本金	140,279.12	85,862.09
加：应计利息	82.59	190.59

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	140,361.71	86,052.68

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		12,979,894.42	-	12,751,162.00	-228,732.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	43,467,418.93	1,210,724.00	44,695,734.28	17,591.35
	银行间市场	16,941,986.00	415,365.70	17,486,965.70	129,614.00
	合计	60,409,404.93	1,626,089.70	62,182,699.98	147,205.35
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		73,389,299.35	1,626,089.70	74,933,861.98	-81,527.07
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,877,379.03	-	5,265,876.00	-611,503.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,946,124.16	645,740.11	26,499,093.14	-92,771.13
	银行间市场	10,967,401.00	148,508.22	11,110,608.22	-5,301.00
	合计	36,913,525.16	794,248.33	37,609,701.36	-98,072.13
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		42,790,904.19	794,248.33	42,875,577.36	-709,575.16

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 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。

#### 7.4.7.3.2 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。

#### 7.4.7.3.3 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。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,899,752.17	-
银行间市场	-	-
合计	1,899,752.17	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,902,366.76	-
银行间市场	-	-
合计	7,902,366.76	-

#### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末无债权投资。

#### 7.4.7.5.2 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。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末无债权投资。

**7.4.7.6.2 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。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 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。

**7.4.7.7.2 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。

**7.4.7.8 其他资产**

本集合计划本报告期末无其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	4,514.49	33,947.37
其中：交易所市场	4,196.99	32,842.37
银行间市场	317.50	1,105.00
应付利息	-	-
预提费用	65,213.35	130,000.00
合计	69,727.84	163,947.37

**7.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,202,439.04	34,693,563.38
本期申购	40,469,877.47	31,763,976.55
本期赎回（以“-”号填列）	-21,063,942.69	-16,532,616.20
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	63,608,373.82	49,924,923.73

**7.4.7.11 其他综合收益**

本集合计划本报告期末无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,350,303.34	-2,162,972.96	16,187,330.38
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	18,350,303.34	-2,162,972.96	16,187,330.38
本期利润	2,099,223.76	628,048.09	2,727,271.85
本期基金份额交易产生的变动数	8,710,491.43	-494,182.98	8,216,308.45
其中：基金申购款	18,006,435.13	-1,090,667.71	16,915,767.42
基金赎回款	-9,295,943.70	596,484.73	-8,699,458.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,160,018.53	-2,029,107.85	27,130,910.68

#### 7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,938.45	8,630.66
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	5,995.75	13,511.04
其他	-	-
合计	9,934.20	22,141.70

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	85,055.55	-1,808,479.49
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券	-	-



出借差价收入		
合计	85,055.55	-1,808,479.49

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	13,079,811.60	23,065,219.35
减：卖出股票成本总额	12,978,981.02	24,841,856.31
减：交易费用	15,775.03	31,842.53
买卖股票差价收入	85,055.55	-1,808,479.49

#### 7.4.7.14.3 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。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,124,850.01	3,105,823.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	126,755.04	1,128,794.82
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	2,251,605.05	4,234,618.09

##### 7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债	77,827,112.91	196,324,002.36

券到期兑付)成交总额		
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	75,428,165.75	190,831,564.51
减:应计利息总额	2,268,391.25	4,352,983.41
减:交易费用	3,800.87	10,659.62
买卖债券差价收入	126,755.04	1,128,794.82

#### 7.4.7.15.3 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。

#### 7.4.7.15.4 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。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
资产支持证券投资收益——利息收入	-	190,770.10
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	-	190,770.10

##### 7.4.7.16.2 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出资产支持证券成交总额	-	4,220,000.00
减:卖出资产支持证券成本总额	-	4,000,000.00
减:应计利息总额	-	220,000.00
减:交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	0.00

**7.4.7.16.3 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。

**7.4.7.16.4 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。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 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。

**7.4.7.17.2 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。

**7.4.7.17.3 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。

**7.4.7.17.4 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。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 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。

**7.4.7.18.2 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。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	151,401.92	335,066.66
其中：证券出借权益补偿收入	—	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	151,401.92	335,066.66

**7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
------	--	---

1. 交易性金融资产	628,048.09	-1,327,535.36
股票投资	382,770.61	-957,516.45
债券投资	245,277.48	-368,018.91
资产支持证券投资	-	-2,000.00
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	628,048.09	-1,327,535.36

#### 7.4.7.21 其他收入

本集合计划本报告期无其他收入。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	10,000.00	10,000.00
信息披露费	45,913.35	204,285.78
证券出借违约金	-	-
账户维护费	46,200.00	36,900.00
其他	-	421.44
合计	102,113.35	251,607.22

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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

中国光大银行股份有限公司	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
中国银河证券股份有限公司	33,176,089.29	100.00	43,799,065.05	100.00

##### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	61,008,418.13	100.00	138,991,714.29	100.00

##### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	755,850,000.00	100.00	1,703,649,000.00	100.00

##### 7.4.10.1.4 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。

## 7.4.10.1.5 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12月31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	14,600.10	100.00	4,196.99	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	27,786.81	100.00	32,842.37	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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	260,879.87	411,336.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	124,523.43	131,679.85
应支付基金管理人的净管理费	136,356.44	279,656.58

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×0.40%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×0.40%÷当年天数。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	65,219.97	102,834.21

注：支付集合计划托管人中国光大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。

**7.4.10.3 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。

**7.4.10.4 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****7.4.10.4.1 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。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
基金合同生效日（2021年9月28日）持有的基金份额	2,384,838.07	2,384,838.07
报告期初持有的基金份额	6,106,958.73	2,384,838.07
报告期间申购/买入总份额	—	3,722,120.66
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	3,722,120.66	—
报告期末持有的基金份额	2,384,838.07	6,106,958.73
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.75%	13.82%

**7.4.10.5.2 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。

**7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国光大银行股份有限公司	140,361.71	3,938.45	86,052.68	8,630.66
--------------	------------	----------	-----------	----------

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

#### 7.4.10.7 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未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000657	中钨高新	2023 年 12 月 26 日	重大事项停牌	8.48	2024 年 1 月 10 日	9.33	60,000	507,600.00	508,800.00	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本集合计划无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.4 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。



## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,215,621.43	7,023,800.55
合计	8,215,621.43	7,023,800.55

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。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	38,565,378.28	27,096,284.57

AAA 以下	2,727,263.36	811,282.71
未评级	7,201,490.72	—
合计	48,494,132.36	27,907,567.28

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。

#### 7.4.13.2.5 按长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长期信用评级的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	140,361.71	-	-	-	140,361.71
结算备付金	264,805.78	-	-	-	264,805.78
交易性金融资产	47,799,310.96	14,383,389.02	-	12,751,162.00	74,933,861.98
买入返售金融资产	1,899,752.17	-	-	-	1,899,752.17
应收申购款	-	-	-	12.00	12.00
应收清算款	-	-	-	901,043.29	901,043.29
资产总计	50,104,230.62	14,383,389.02	-	13,652,217.29	78,139,836.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	976,333.97	976,333.97
应付管理人报酬	-	-	-	26,311.16	26,311.16
应付托管费	-	-	-	6,577.81	6,577.81
应交税费	-	-	-	5,051.74	5,051.74
其他负债	-	-	-	69,727.84	69,727.84
负债总计	-	-	-	1,084,002.52	1,084,002.52
利率敏感度缺口	50,104,230.62	14,383,389.02	-	12,568,214.77	77,055,834.41
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					
货币资金	86,052.68	-	-	-	86,052.68
结算备付金	490,147.60	-	-	-	490,147.60
交易性金融资产	19,877,091.61	17,732,609.75	-	5,265,876.00	42,875,577.36
买入返售金融资产	7,902,366.76	-	-	-	7,902,366.76
应收清算款	-	-	-	12,931.67	12,931.67
资产总计	28,355,658.65	17,732,609.75	-	5,278,807.67	51,367,076.07
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	48,585.23	48,585.23

应付托管费	-	-	-	119,006.20	119,006.20
卖出回购金融资产款	-86.05	-	-	-	-86.05
应交税费	-	-	-	154,729.56	154,729.56
其他负债	-	-	-	163,947.37	163,947.37
负债总计	-86.05	-	-	486,268.36	486,182.31
利率敏感度缺口	28,355,744.70	17,732,609.75	-	4,792,539.31	50,880,893.76

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	66,037.89	73,054.39
	2. 市场利率上升 25 个基点	-65,756.29	-72,606.94

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 7.4.13.4.3 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。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的资产损失的可能性。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本集合计划管理人对本集合计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	12,751,162.00	16.55	5,265,876.00	10.35
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	62,182,699.98	80.70	37,609,701.36	73.92
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	74,933,861.98	97.25	42,875,577.36	84.27

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	743,943.25	265,121.53
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-743,943.25	-265,121.53

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	16,779,504.25	6,551,176.67
第二层次	58,154,357.73	36,324,400.69
第三层次	—	—
合计	74,933,861.98	42,875,577.36

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	12,751,162.00	16.32
	其中：股票	12,751,162.00	16.32
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	62,182,699.98	79.58
	其中：债券	62,182,699.98	79.58
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—

6	买入返售金融资产	1,899,752.17	2.43
	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	405,167.49	0.52
8	其他各项资产	901,055.29	1.15
9	合计	78,139,836.93	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,095,602.00	14.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,655,560.00	2.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,751,162.00	16.55

### 8.2.2 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。

## 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002959	小熊电器	15,000	778,950.00	1.01
2	300532	今天国际	45,000	738,900.00	0.96

3	300003	乐普医疗	45,000	727,200.00	0.94
4	002508	老板电器	27,000	588,060.00	0.76
5	000333	美的集团	10,100	551,763.00	0.72
6	603486	科沃斯	12,400	513,856.00	0.67
7	000657	中钨高新	60,000	508,800.00	0.66
8	600438	通威股份	20,000	500,600.00	0.65
9	002831	裕同科技	18,000	495,180.00	0.64
10	002353	杰瑞股份	17,000	477,870.00	0.62
11	300598	诚迈科技	11,000	472,230.00	0.61
12	002129	TCL 中环	30,000	469,200.00	0.61
13	601012	隆基绿能	20,000	458,000.00	0.59
14	688777	中控技术	9,800	444,430.00	0.58
15	000400	许继电气	20,000	439,200.00	0.57
16	603855	华荣股份	20,000	399,200.00	0.52
17	002594	比亚迪	2,000	396,000.00	0.51
18	002597	金禾实业	18,000	394,380.00	0.51
19	000738	航发控制	18,000	358,200.00	0.46
20	603833	欧派家居	5,000	348,050.00	0.45
21	300791	仙乐健康	10,000	346,600.00	0.45
22	000063	中兴通讯	12,600	333,648.00	0.43
23	600699	均胜电子	18,000	323,280.00	0.42
24	300450	先导智能	11,500	294,400.00	0.38
25	000651	格力电器	8,000	257,360.00	0.33
26	601877	正泰电器	10,000	215,100.00	0.28
27	002078	太阳纸业	15,000	182,550.00	0.24
28	688357	建龙微纳	3,000	155,070.00	0.20
29	688169	石头科技	520	147,134.00	0.19
30	002048	宁波华翔	10,000	130,100.00	0.17
31	000988	华工科技	3,800	113,088.00	0.15
32	600529	山东药玻	4,000	102,400.00	0.13
33	301330	熵基科技	2,730	90,363.00	0.12

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002959	小熊电器	799,640.00	1.57
2	300532	今天国际	793,889.00	1.56
3	300003	乐普医疗	734,937.00	1.44
4	002508	老板电器	646,546.00	1.27
5	002202	金风科技	644,060.00	1.27
6	300450	先导智能	558,300.00	1.10
7	002555	三七互娱	554,980.00	1.09



8	300598	诚迈科技	531,697.00	1.04
9	000657	中钨高新	507,600.00	1.00
10	603486	科沃斯	505,372.00	0.99
11	688777	中控技术	500,700.62	0.98
12	002594	比亚迪	472,538.00	0.93
13	600438	通威股份	464,900.00	0.91
14	002129	TCL 中环	459,140.00	0.90
15	002831	裕同科技	444,311.00	0.87
16	603565	中谷物流	430,439.08	0.85
17	000400	许继电气	425,290.00	0.84
18	002353	杰瑞股份	421,830.00	0.83
19	601012	隆基绿能	419,980.00	0.83
20	603040	新坐标	405,552.00	0.80

#### 8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002555	三七互娱	1,009,380.00	1.98
2	002202	金风科技	577,156.00	1.13
3	300450	先导智能	473,448.00	0.93
4	300308	中际旭创	457,053.00	0.90
5	300271	华宇软件	416,155.00	0.82
6	300503	昊志机电	378,542.00	0.74
7	300750	宁德时代	378,244.00	0.74
8	002876	三利谱	373,116.00	0.73
9	601668	中国建筑	372,939.00	0.73
10	603565	中谷物流	363,922.04	0.72
11	688390	固德威	363,180.00	0.71
12	000988	华工科技	362,086.00	0.71
13	603040	新坐标	357,208.00	0.70
14	688557	兰剑智能	345,113.74	0.68
15	300763	锦浪科技	339,650.00	0.67
16	002597	金禾实业	322,424.00	0.63
17	600030	中信证券	312,840.00	0.61
18	688169	石头科技	304,040.00	0.60
19	000547	航天发展	291,710.00	0.57
20	603259	药明康德	268,039.00	0.53

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	20,081,496.41
卖出股票收入（成交）总额	13,079,811.60

## 8.5 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	5,472,946.19	7.10
2	央行票据	—	—
3	金融债券	9,316,366.58	12.09
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	27,409,973.25	35.57
5	企业短期融资券	8,215,621.43	10.66
6	中期票据	7,230,650.28	9.38
7	可转债（可交换债）	4,537,142.25	5.89
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	62,182,699.98	80.70

## 8.6 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	175830	21 诚通 K1	50,000	5,165,623.29	6.70
2	188150	21 海通 04	50,000	5,117,000.00	6.64
3	042380050	23 云能投 CP001	40,000	4,200,641.10	5.45
4	185322	22 天风 01	40,000	4,199,366.58	5.45
5	175794	21 黔铁 01	40,000	4,158,531.51	5.40

## 8.7 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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划本报告期末无股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 8.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划本报告期无国债期货投资。

## 8.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期无国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

21 海通 04 的主体海通证券股份有限公司在保荐江苏沃得农业机械股份有限公司（以下简称发行人）首次公开发行股票并上市过程中，未勤勉尽责履行相关职责，未及时向深圳证券交易所报告和披露发行人实际控制人股份冻结情况，未发现发行人会计基础薄弱、内部控制不完善、资金拆借信息披露不完整等情况，未经中国证监会或者深圳证券交易所同意改动招股说明书。证监会于 2023 年 11 月 7 日对其采取出具警示函的监督管理措施。

其作为湖北超卓航空科技股份有限公司（以下简称超卓航科）保荐机构之一，在开展募集资金核查时，发现超卓航科全资子公司上海超卓金属材料有限公司存放于招商银行股份有限公司南京城北支行账户中的资金使用情况披露不真实、银行存款处于冻结状态，未及时开展有效的调查和监督。2023 年 8 月 31 日，公司出具《2023 年度持续督导半年度跟踪报告》未能真实、准确反映超卓航科募集资金管理使用情况。湖北证监局于 2023 年 11 月 17 日对其采取出具警示函的行政监管措施，上海证券交易所同日对其予以监管警示。

### 8.12.2 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

本集合计划投资的前十名股票中，没有投资超出集合计划合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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	—
2	应收清算款	901,043.29
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	12.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	901,055.29

### 8.12.4 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	128035	大族转债	2,092,494.79	2.72
2	113052	兴业转债	1,846,712.46	2.40
3	113044	大秦转债	597,935.00	0.78

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000657	中钨高新	508,800.00	0.66	重大事项停牌

## 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
626	101,610.82	3,242,148.84	5.10	60,366,224.98	94.90

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	433,111.51	0.68

## 9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年9月28日）基金份额总额	16,014,136.18
本报告期期初基金份额总额	44,202,439.04
本报告期基金总申购份额	40,469,877.47
减：本报告期基金总赎回份额	21,063,942.69
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	63,608,373.82

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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；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；于 2023 年 9 月 1 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 31 日起，潘多亮不再担任公司合规总监，杨柳新任公司合规总监；于 2023 年 12 月 16 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 12 月 14 日起，公司执行委员会主任由吴剑飞先生担任，公司执行委员会委员由王青女士、王东先生、杨柳女士、魏琦女士、牟珊珊女士担任。

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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中国银河证券股份有限公司	2	33,176,089.29	100.00	14,600.10	100.00	-

注：1. 本报告期内，本集合计划无新增或减少交易单元；

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

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

3. 集合计划交易单元的选择程序如下：

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

### 11.7.2 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	61,008,418.13	100.00	755,850,000.00	100.00	-	-

## 11.8 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	银河安丰九个月滚动持有混合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
2	银河金汇证券资产管理有限公司关于增加部分销售机构为银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划销售机构且开通申购费率优惠业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 8 日
3	银河安丰九个月滚动持有混合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
4	银河安丰九个月滚动持有混合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
5	银河金汇证券资产管理有限公司关于旗下银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划参与中国银河证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 6 日
6	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划投资经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 16 日
7	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 19 日
8	银河安丰九个月滚动持有混合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
9	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 20 日
10	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划 2023 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 30 日
11	关于银河金汇证券资产管理有限公司旗下资产管理计划增加浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构且开通申购费率优惠业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 5 日
12	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 25 日
13	银河金汇证券资产管理有限公司关于旗下部分资产管理计划可投资于北京证券交易所上市股票的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 28 日
14	关于银河金汇证券资产管理有限公司旗下资产管理计划增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构且开通申购费率优惠业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 1 日
15	关于银河金汇证券资产管理有限公司旗下资产管理计划增加上海利得基金销售有限公司为销售机构且开通申购	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 5 日

	费率优惠业务的公告		
16	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划投资经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 15 日
17	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 18 日
18	银河安丰九个月滚动持有混合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 12 月 18 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本集合计划管理人于 2024 年 2 月 28 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2024 年 2 月 26 日起，刘冰不再担任公司董事长，吴剑飞新任公司董事长。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准银河安心收益 2 号集合资产管理合同变更的文件；
- 2、《银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《银河安丰九个月滚动持有混合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。

### 13.2 存放地点

管理人处。

### 13.3 查阅方式

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

银河金汇证券资产管理有限公司

2024 年 3 月 29 日