

# 银河金星 1 号集合资产管理计划季度报告

(2015 年第一季度)

## 第一节 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人招商银行股份有限公司于2015年4月13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。

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

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2015年1月1日至2015年3月31日。

## 第二节 集合资产管理计划概况

|          |  |
|----------|--|
| 名称       | 银河金星1号集合资产管理计划   |
| 类型       | 开放式、非限定性、无固定期限   |
| 成立日      | 2009年4月8日  |
| 报告期末份额总额 | 178,495,146.15份  |
| 投资目标     | 以股票投资为主，在主动控制风险的前提下，基于管理人对中国经济发展特征的洞察，投资于中国经济主导产业中的优势企业，以期最大限度地分享中国经济增长成果，实现集合计划资产的保值增值目标。 |
| 投资理念     | 分享中国经济增长成果   |
| 投资基准     | 本集合计划的业绩比较基准=70%×沪深 300 指数收益率+30%×中证债券指数收益率。   |
| 管理人      | 银河金汇证券资产管理有限公司   |

|        |                |
|--------|----------------|
| 托管人    | 招商银行股份有限公司     |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 |

### 第三节 集合资产管理计划主要财务指标和业绩表现

#### 一、主要财务指标（单位：人民币元）

|           |                |
|-----------|----------------|
| 本期利润      | 22,464,212.03  |
| 净值增长率     | 18.92%         |
| 期末资产净值    | 143,022,296.09 |
| 期末每份额净值   | 0.8013         |
| 期末每份额累计净值 | 0.8273         |

#### 二、业绩表现

截止 2015 年 3 月 31 日,本集合计划单位净值 0.8013 元,累计单位净值 0.8273 元,本期集合计划净值增长率 18.92%。

#### 三、本期每份额增长率与投资基准收益率的比较

| 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  |
|-----------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2015 年一季度 | 18.92% | 0.60%     | 10.57%     | 1.02%         | 8.35% | -0.42% |

### 第四节 管理人报告

#### 一、投资主办人简介

王跃文，七年期货、十一年证券从业经验。先后就职于中国国际期货有限公司基金部、国信证券资产管理部、国都证券资产管理部；管理过多种不同规模、不同风格的理财产品。现任银河金汇证券资产管理有限公司执行总经理。

#### 二、投资主办人工作报告

本季度业绩相对于基准的超额收益达 8.35%。权益类仓位贴近 70%，实现了

上季度季报所提到的贴近基准。管理人主要采取了核心-卫星的投资策略，以沪深 300 指数为核心资产（沪深 300 指数加强基金的持仓占比约 30%），以成长性权益类资产为卫星资产，核心、卫星互补，提高整体收益。

下季度，考虑维持 A 股权益类资产 70-80% 的仓位，择机增配主投港股的 QDII 类资产。

### 三、风险控制报告

在本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》等其他相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划。

报告期内，本集合计划管理人坚持规范运作、防范风险，保护投资者利益，严格执行银河金汇证券资产管理有限公司内部控制和 risk 管理制度，加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，严格履行本集合计划合同规定。

在报告期内，投资主办人按照资产管理投资决策委员会授权的范围进行投资，投资范围和投资比例符合产品说明书规定，无越权交易行为发生。管理人和托管人按照各方约定的统一记账方法和会计处理原则，分别独立设置账套，每日核对资产净值，互相监督，以保证集合资产安全，保护投资者利益。

## 第五节 托管人报告

### 银河金星 1 号集合资产管理计划

#### 2015 年第一季度托管人报告

银河金汇证券资产管理有限公司：

托管人声明，在本报告期内，资产托管人——招商银行股份有限公司不存在

任何损害计划份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券公司客户资产管理业务管理办法》及其他有关法律法规、资产管理合同、托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内资产管理人在投资运作、集合计划资产净值的计算、利润分配、计划份额申购赎回价格的计算、计划费用开支等问题上，不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，遵守了《证券公司客户资产管理业务管理办法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。

资产管理人报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特此报告。

招商银行北京分行同业金融部  
二〇一五年四月十三日

## 第六节 投资组合报告

### 一、资产组合情况

| 项目名称 | 项目市值（元）        | 占总资产比例  |
|------|----------------|---------|
| 股票   | 5,640,515.00   | 3.87%   |
| 基金   | 123,874,958.93 | 85.10%  |
| 银行存款 | 15,090,090.26  | 10.37%  |
| 其他资产 | 966,600.05     | 0.66%   |
| 合计   | 145,572,164.24 | 100.00% |

（注：1. 其他资产包括：应收利息、清算备付金、交易保证金、应收证券清算款、应收申购款；

2. 因四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。）

### 二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

| 序号 | 证券代码   | 证券名称 | 数量        | 证券市值       | 市值占净值% |
|----|--------|------|-----------|------------|--------|
| 1  | 000002 | 万科 A | 29,500.00 | 407,690.00 | 0.29%  |
| 2  | 002233 | 塔牌集团 | 33,000.00 | 391,710.00 | 0.27%  |
| 3  | 600801 | 华新水泥 | 32,000.00 | 383,040.00 | 0.27%  |

|    |        |      |           |            |       |
|----|--------|------|-----------|------------|-------|
| 4  | 000012 | 南玻 A | 33,700.00 | 366,319.00 | 0.26% |
| 5  | 002236 | 大华股份 | 9,500.00  | 347,225.00 | 0.24% |
| 6  | 600048 | 保利地产 | 30,000.00 | 344,700.00 | 0.24% |
| 7  | 600660 | 福耀玻璃 | 20,000.00 | 334,600.00 | 0.23% |
| 8  | 000538 | 云南白药 | 5,000.00  | 333,250.00 | 0.23% |
| 9  | 600030 | 中信证券 | 10,000.00 | 328,200.00 | 0.23% |
| 10 | 000776 | 广发证券 | 9,500.00  | 265,050.00 | 0.19% |

### 三、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

| 序号 | 证券代码   | 证券名称      | 数量            | 证券市值          | 市值占净值% |
|----|--------|-----------|---------------|---------------|--------|
| 1  | 000172 | 华泰柏瑞量化指数  | 23,819,504.46 | 39,326,001.86 | 27.50% |
| 2  | 150143 | 转债 A 级    | 17,000,001.00 | 15,011,000.88 | 10.50% |
| 3  | 166019 | 中欧价值智选    | 6,597,890.57  | 12,839,495.05 | 8.98%  |
| 4  | 000965 | 汇丰晋信新动力   | 10,001,000.10 | 10,636,063.61 | 7.44%  |
| 5  | 150029 | 信诚中证 500B | 6,802,168.00  | 10,373,306.20 | 7.25%  |
| 6  | 000697 | 汇添富移动互联   | 4,991,918.14  | 10,158,553.41 | 7.10%  |
| 7  | 150001 | 瑞福进取      | 4,506,081.00  | 7,565,710.00  | 5.29%  |
| 8  | 150210 | 国企改 B     | 4,173,212.00  | 6,385,014.36  | 4.46%  |
| 9  | 000541 | 华商创新成长    | 3,001,200.48  | 5,579,231.69  | 3.90%  |
| 10 | 159935 | 景顺 500    | 1,422,600.00  | 2,680,178.40  | 1.87%  |

### 四、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

本集合计划报告期末未持有权证。

### 五、期末市值占集合计划资产净值前十名买入返售金融资产明细

本集合计划报告期末未持有买入返售金融资产。

### 六、投资组合报告附注

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

## 第七节 集合计划份额变动

单位：份

|           |                |
|-----------|----------------|
| 期初份额总额    | 176,921,535.19 |
| 报告期间总参与份额 | 13,359,910.90  |
| 红利再投资份额   | -              |
| 报告期间总退出份额 | 11,786,299.94  |
| 报告期末份额总额  | 178,495,146.15 |

## 第八节 信息披露的查阅方式

网址：<http://www.yhjh.chinastock.com.cn>

热线电话：4008-888-888

银河金汇证券资产管理有限公司

二〇一五年四月十五日