

银河宏汇添享挂钩1号集合资产管理计划季度报告

(2018年第四季度)

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北京分行于2019年1月11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：2018年10月01日至2018年12月31日。

第二节 集合资产管理计划概况

名称	银河宏汇添享挂钩1号集合资产管理计划
类型	集合资产管理计划
成立日	2018年9月27日
报告期末份额总额	87,177,794.00份
投资目标	主要投资固定收益类资产，闲置资金投资于现金类资产，在严格把控风险的前提下，为投资者寻求长期稳定收益。
投资策略	管理人将综合运用固定收益类资产和金融衍生品类资产进行资产配置。通过构建固定收益类资产低风险组合和挂钩特定标的资产的期权组合，在锁定组合整体下行风险的前提下获得更好的收益。
风险收益特征	本集合计划为中高风险，风险水平较高。

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北京分行
注册登记机构	中国银河证券股份有限公司

第三节 集合资产管理计划主要财务指标和业绩表现及收益分配情况

一、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	854,357.68 元
净值增长率	0.98%
期末资产净值	88,079,503.56 元
期末每份额净值	1.0103
期末每份额累计净值	1.0103

二、收益分配情况

无。

第四节 管理人报告

一、投资主办人简介

杨喆，清华大学工商管理硕士，曾在国富投资、瑞泰人寿从事投资工作，在中信证券资产管理部历任行业研究员、策略组负责人、相对收益集合账户主办人、绝对收益集合主办人、对冲账户主办人、小集合与量化组负责人。2014年12月至今担任银河金汇证券资产管理有限公司权益及量化投资部总经理、投资主办人，超过14年证券从业经验，有多种类型账户的管理经验和优秀的排名业绩。

二、投资主办人工作报告

1、业绩表现

截止2018年12月31日，本集合计划单位净值1.0103元，累计单位净值1.0103元，本期集合计划净值增长率为0.98%。

2、投资策略与运作分析

本集合计划于 2018 年 9 月 27 日成立，于 2018 年 10 月 15 日完成备案并于 2018 年 10 月 16 日执行场外期权交易。场外期权交易的期初观察日为 2018 年 10 月 16 日，挂钩标的为沪深 300 指数(000300.SH)，挂钩标的期初收盘价为 3100.97。截至 2018 年最后一个交易日，挂钩标的收盘价为 3010.65。自期初观察日至本报告期末，挂钩标的在任一交易日的收盘价相对于期初收盘价的涨幅均未超过 10%。

3、市场展望与投资策略

管理人将综合运用固定收益类资产和金融衍生品类资产进行资产配置。通过构建固定收益类资产低风险组合和挂钩特定标的资产的期权组合，在锁定组合整体下行风险的前提下获得更好的收益。固定收益类资产投资现金、货币市场基金、银行存款、大额存单，期限在七天以内（含七天）的债券逆回购、同业存单等低风险投资品种；金融衍生品投资场外期权，管理人综合考虑市场情况进行场外期权投资操作。

三、管理人履职报告

在报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》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，严格执行管理人内部控制和 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，投资主办人按照合同规定的投资范围进行投资，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

银河宏汇添享挂钩1号集合资产管理计划 2018年四季度托管人报告

编号：招银京托字【2018】第 04J8001

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。

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。

特此报告。

招商银行北京分行资产托管部

二〇一九年一月十一日

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
银行存款	87,177,594.06	98.44%
场外期权	102,520.00	0.12%
应收利息	1,278,604.80	1.44%
资产合计	88,558,718.86	100.00%

(注：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基金明细

注：本集合计划报告期内未持有基金。

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

注：本集合计划报告期内未持有债券。

四、期末市值占集合计划资产净值前十名信托计划

注：本集合计划报告期内未持有信托计划。

五、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的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	0
报告期间总参与份额	87,177,794.00
报告期间总退出份额	0.00
报告期末份额总额	87,177,794.00

第八节 重要事项提示

无。

第九节 信息披露的查阅方式

网址：<http://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

二〇一九年一月二十三日