

银河金星 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于2019年1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。

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	32,364,232.69份
投资基准	本集合计划业绩比较基准=沪深 300 指数*70%+中证债券指数*30%
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及收益分配情况

一、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	-3,224,946.38
净值增长率	-10.86%
期末资产净值	26,292,894.57
期末每份额净值	0.8124
期末每份累计净值	0.8384

二、业绩表现

截止 2018 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 0.8124 元，累计单位净值 0.8384 元，本期集合计划收益率增长-10.86%。

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	投资基准收益率②	① -②
2018 年第四季度	-10.86%	-7.94%	-2.92%

四、收益分配情况

无。

第四节 管理人报告

一、投资主办人简介

王跃文，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多策略投资部总经理。

二、投资主办人工作报告

1、市场回顾和投资操作

目前组合为 A 股基金、港股基金和非港海外基金三类，组合目标是跑赢业绩基准且风险显著低于基准。本报告期，净值增长率跑输基准 2.92%，主要原因是投资的 QDII 股票型基金跌幅大于 A 股基金。

2、市场展望和投资策略

本集合计划目前持仓主要为 A 股绩优主动管理型基金、QDII 美股基金、互认基金、QDII 港股基金。中长期看，多市场权益组合的稳定性强于单一市场的权益类指数，后期将以持有为主，以多市场权益组合投资的方式来降低单一权益市场的高波动性，为委托人提供长期收益。

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》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，管理人在严格控制风险的基础上，未出现风险事故或其他损害集合计划份额持有人利益的情形。

第五节 托管人报告

银河证券金星1号集合资产管理计划

2018年4季度托管人报告

编号：招银京托字【2018】第 04J1041

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、投资组合报告、份额变动等内容真实、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。

招商银行北京分行资产托管部

二〇一九年一月十八日

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	2,291,800.00	8.71%
基金	20,679,433.85	78.55%
银行存款	3,330,849.27	12.65%
其他资产	23,780.61	0.09%
合计	26,325,863.73	100.00%

（注：1. 其他资产包括：清算备付金、交易保证金、应收利息；
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	市值	市值占净值
1	603158	腾龙股份	140,000	2,291,800.00	8.72%

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

注：本集合计划报告期末未持有债券

四、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	市值	市值占净值
1	110011	易方达中小盘	1,198,068.90	3,930,384.83	14.95%
2	001668	汇添富全球移动互联	3,000,000.00	3,930,000.00	14.95%
3	968010	摩根太平洋证券基金	250,000.00	3,597,500.00	13.68%
4	166005	中欧价值发现 A	2,400,384.06	3,056,409.02	11.62%
5	510900	H 股 ETF	2,800,000	3,052,000.00	11.61%
6	512160	MSCI 基金	1,500,000	1,245,000.00	4.74%
7	513100	纳指 ETF	500,000	1,121,500.00	4.27%
8	167703	德邦量化优选股票 C	800,000.00	746,640.00	2.84%

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

注：本集合计划报告期末未持有买入返售金融资产

六、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

注：本集合计划报告期末未持有权证。

七、投资组合报告附注

无。

第七节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	32,778,404.94
报告期间总参与份额	0
红利再投资份额	0
报告期间总退出份额	414,172.25
报告期末份额总额	32,364,232.69

第八节 重要提示（包含以下内容）

2018年12月3日管理人公告《关于我司部分集合资产管理计划暂停有关业务的公告》，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》（中国证券监督管理委员会公告【2018】39号）相关规定，我司将从2018年12月3日（含）起对本集合资产管理计划申赎有关业务调整：原则上不得新增净申购额。

具体内容详见公司网站公告。

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