

银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划

第 3 季度报告

资产管理计划管理人：银河金汇证券资产管理有限公司

资产管理计划托管人：招商证券股份有限公司

报告期间：2019 年 07 月 01 日-2019 年 09 月 30 日

一、基本信息

资产管理计划名称:	银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划
资产管理计划成立时间:	2019-6-6
管理人:	银河金汇证券资产管理有限公司
托管人:	招商证券股份有限公司

二、资产管理计划投资表现

	本期末
期末资产净值(元)	142,990,190.46
自成立日至本期末利润(元)	5,029,386.84
份额净值(元)	1.033
份额累计净值(元)	1.033

三、资产管理计划投资组合报告

(一) 委托资产配置情况

序号	资产类别	市值 (元)	占总资产的比例
1	私募证券投资基金	141,642,326.83	98.67%
2	银行存款	1,902,017.03	1.33%
3	其他资产	855.90	0.00%
4	合计	143,545,199.76	100.00%

注：其他资产包括应收利息等。

(二) 委托资产投资前十名股票（按市值）明细

本计划未投资股票。

(三) 委托资产投资前五名债券（按市值）明细

本计划未投资债券。

(四) 委托资产投资前五名基金（按市值）明细

代码	名称	市值(元)	市值占委托资产净值比例
SGK234	红墙泰和指数 19 期	36,233,436.57	25.3%
SGP452	锐天指数增强 60 号	35,432,474.54	24.8%

SGM913	幻方量化 9 号	34,909,415.71	24.4%
SGK931	致远私享 9 号	25,465,803.60	17.8%
SGN110	因诺天丰 3 号	9,601,196.41	6.7%

至 9 月 30 日，除了上述投资之外，本计划在此期间未进行过其他私募证券投资基金的投资。

(五)委托资产投资前五名买入返售金融资产（按市值）明细

本计划未投资买入返售资产。

(六)资产管理计划运用杠杆情况

本计划未运用杠杆。

四、管理人报告

(一)投资主办人简介情况

王跃文先生：七年期货、十九年证券从业经验。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。已取得基金从业资格。最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

徐杰先生：经济学硕士。CPA，已通过 CFA 三级考试。曾担任普华永道中天会计师事务所审计师，2010 年加入中国银河证券股份有限公司担任财务部预算管理经理，2014 年加入银河金汇证券资产管理有限公司担任研究员、投资经理。已取得基金从业资格。最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

(二)投资策略回顾与展望

本集合计划除保留必要的现金之外，主要投资于采用量化策略的中证 500 指数增强私募证券投资基金。

目前持仓的私募基金，其管理人在国内量化私募界均具有较高的知名度，其策略的成熟度较好，投资风格上存在一定的差异性。从总管理规模上看，所选私募管理人既有排名靠前的大型私募，也有规模中等的中型私募。投资风格上看，

不同私募管理人在数据来源、量化因子的开发和组合优化各环节均存在差异化，其投资风格之间存在互补性，超额收益时间分布表现出了差异化特征，总体超额收益较为平滑。

自本计划7月初建仓以来至3季度末，相对于中证500指数的累计超额收益绝对值达到了5%以上。符合管理人的预期。

展望未来，虽然今年以来量化私募管理规模显著增长，对量化超额收益的争夺更加激烈，但我们相信随着新数据源的挖掘、信息技术投入的增加、投资人员整体素质的提高以及投资策略的迭代进化，领先量化私募管理人仍然有能力获得较为稳定的超额收益。我们对本集合计划未来持续获取超额收益的能力保持乐观态度。

(三) 公平交易专项说明

报告期内，本资产管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配各环节得到公平对待。

(四) 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。

(五) 报告期内资管计划投资收益分配情况

本计划不进行投资收益分配。

五、托管人履职报告

2019年第3季度，本托管人——招商证券股份有限公司在对银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划（下称“本计划”）的托管过程中，严格遵守相关法律法规和托管协议的有关规定，不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

2019年第3季度，本计划管理人在投资运作、资产净值计算、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，严格遵守有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。

本托管人依法对资产管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、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。

招商证券股份有限公司托管部

2019年10月22日

六、管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

（一）管理费

计提基准	管理费:管理人按集合计划资产前一日净值的 1.30%年费率收取集合计划管理费。
计提方式	集合计划管理费每日计提，逐日累计。
支付方式	按季支付。经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划托管人于下一季度首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给集合计划管理人。

（二）托管费

计提基准	按集合计划资产前一日资产净值的 0.03%的年费率计提。
计提方式	集合计划托管费每日计提，逐日累计。

支付方式	按季支付。经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划托管人于下一季度首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给集合计划托管人。
------	---

(三) 业绩报酬

本产品没有计提业绩报酬。

七、涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

(一) 投资经理变更

无。

(二) 重大关联交易情况

无。

(三) 报告期内其他事项说明

1. 管理人于 2019 年 7 月 2 日公告《关于银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划投资非标准化资产的公告》，银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“智汇 FOF1 号”）近日进行了以下非标准化资产投资：

- (1) 致远私享九号私募证券投资基金
- (2) 幻方量化专享 9 号私募证券投资基金
- (3) 上海锐天投资指数增强六十号私募证券投资基金

2. 管理人于 2019 年 7 月 9 日公告《关于银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划投资非标准化资产的公告》，银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“智汇 FOF1 号”）近日进行了以下非标准化资产投资：红墙泰和指数增强十九期私募证券投资基金

3. 管理人于 2019 年 7 月 22 日公告《关于银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划投资非标准化资产的公告》，银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“智汇 FOF1 号”）近日进行了以下非标准化资产投资：

- (1) 致远私享九号私募证券投资基金
- (2) 幻方量化专享 9 号私募证券投资基金
- (3) 上海锐天投资指数增强六十号私募证券投资基金
- (4) 红墙泰和指数增强十九期私募证券投资基金

4. 管理人于 2019 年 9 月 24 日公告《关于银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划投资非标准化资产的公告》，银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“智汇 FOF1 号”）近日进行了以下非标准化资产投资：因诺天丰 3 号私募证券投资基金

5. 管理人于 2019 年 7 月 11 日公告《关于增加深圳市前海排排网基金销售有限公司作为银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划代销机构的公告》，我司作为“银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）的管理人，与深圳市前海排排网基金销售有限公司签署了产品代理相关协议，增加深圳市前海排排网基金销售有限公司作为本集合计划的代销机构。

八、声明

郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。

银河金汇证券资产管理有限公司
2019 年 10 月 30 日