

银河金星 1 号集合资产管理计划季度报告

(2020 年第二季度)

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2020年7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：2020年4月1日至2020年6月30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	20129310.85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	3,689,367.51
净值增长率	10.15%
期末资产净值	23,753,110.47
期末每份额净值	1.18
期末每份累计净值	1.206

二、业绩表现

截止 2020 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值 1.18 元，累计单位净值 1.206 元，本期集合计划收益率增长 10.15%。

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
2020 年 2 季度	16.60%	8.84%	7.76%

四、收益分配情况

无。

第四节 管理人报告

一、投资主办人简介

王宝娟女士，上海财经大学管理学硕士，复旦大学理学学士。曾任职德邦证券自营量化投资部、资产管理总部，从事量化策略研究、交易。2014 年加入银河金汇，历任多只产品投资主办人，具有股票、基金、可转债等权益类多品种投资经验。

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，净值增长率跑赢基准 7.76%，资产配置和

基金选择都有贡献。

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、A 股指数增强+打新策略基金、QDII 美股基金、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

2020 年 2 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北京分行严格遵守有关法律法规、托管人签署的资产管理合同、托管协议关于托管人职责的约定，尽职尽责地履行了托管职责。

在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下，在我行能够知悉和掌握的情况范围内，我行对资产管理人报告中的主要财务指标、投资组合报

告、份额变动等财务数据进行了复核，未发现存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的情形。

特此报告。

招商银行股份有限公司北京分行资产托管部

二〇二〇年七月十三日

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
基金	22,448,280.00	89.7300%
银行存款	2,342,898.64	9.86%
其他资产	226,414.02	0.9050%
合计	25,017,592.66	100.0000%

（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

注：本集合计划报告期末未持有股票

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	001668	汇添富全球互联混合(QDII)	2,050,000.00	4,651,450.00	19.5825%
2	110011	易方达中小盘混合	750,000.00	4,502,550.00	18.9556%
3	513100	国泰纳斯达克 100(QDII-ETF)	900,000.00	3,393,000.00	14.2844%
4	510900	易方达恒生中国企业 ETF(QDII)	2,750,000.00	3,118,500.00	13.1288%
5	166005	中欧价值发现混合 A	1,850,000.00	2,934,100.00	12.3525%
6	512160	MSCI 中国 A 股国际通 ETF	1,100,000.00	1,394,800.00	5.8721%
7	150022	深成指 A	1,300,000.00	1,287,000.00	5.4182%
8	167703	德邦量化优选股票(LOF)C	800,000.00	1,166,880.00	4.9125%

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	22,436,659.92
报告期间总参与份额	190,982.80
红利再投资份额	0
报告期间总退出份额	2,498,331.87
报告期末份额总额	20,129,310.85

第八节 重要提示

1. 管理人公告《关于银河金星1号集合资产管理计划关于自有资金拟部分退出征询委托人意见的公告》，银河金星1号集合资产管理计划于2009年4月8日正式成立，无固定管理期限，每个工作日开放，可进行参与及退出业务。2020年6月8日、6月9日，4位客户累计赎回403,243.77份，造成自有资金份额占比被动超过16%的监管指标要求。

为满足监管指标要求，银河金汇证券资产管理有限公司拟退出部分自有资金，使自有资金参与比例降至16%以下。具体退出份额将视退出时产品总份额确定。

鉴于该产品合同约定：“在本集合计划存续期间，管理人承诺不得退出参与资金，但按本集合计划管理合同约定取得的现金分红部分除外”，现特就该事项征询委托人意见。如委托人不同意自有资金退出，可于公告发布起5个工作日内申请退出本集合计划；如公告发布起5个工作日内未反馈意见、反馈意见不明确或未申请退出，则视为同意管理人为满足监管指标要求而所做的自有资金退出事项。

2. 管理人公告《银河金星1号集合资产管理计划自有资金被动超限并部分退出的公告》为符合监管要求，银河金汇证券资产管理有限公司拟于2020年7月3日退出部分自有资金，使自有资金占比降至16%以下。具体份额根据退出日资管计划总份额确定。

以上事项，管理人已在公司网站进行公告。

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

二〇二〇年七月二十一日