

# 银河安心收益 1 号集合资产管理计划季度报告

(2021 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中国光大银行股份有限公司于2021年4月14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：2021年1月01日至2021年3月31日。

## 第二节 集合资产管理计划概况

名称	银河安心收益 1 号集合资产管理计划
类型	开放式、限定性、无限存续期
成立日	2012年12月13日
报告期末份额总额	97,443,924.32份
投资基准	中证债券基金指数百分比收益率×70%+中证股票基金指数百分比收益率×20%+人民币活期存款利息×10%
管理人	银河金汇证券资产管理有限公司
托管人	中国光大银行股份有限公司
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	946,470.87
净值增长率	0.81%
期末资产净值	109,423,980.27
期末每份额净值	1.123
期末每份累计净值	1.393

#### 二、业绩表现

截止 2021 年 3 月 31 日，本集合计划单位净值 1.123 元，累计单位净值 1.393 元，本期集合计划收益率增长 0.81%。

#### 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
过去 3 个月	0.81%	-0.60%	1.41%

#### 四、收益分配情况

本期并未进行收益分配。

### 第四节 管理人报告

#### 一、投资主办人简介

张煜先生，毕业于北京航空航天大学，管理学博士学位，中央财经大学、北京银行博士后，10 年银行、券商、基金从业经验。历任北京银行总行资金运营中心首席宏观经济研究员、投资经理。2016 年起担任中邮创业基金资产管理股份有限公司固定收益部总经理助理兼任投资经理，管理规模逾百亿，业绩优良。2017 年加入银河金汇证券资产管理有限公司，对宏观经济有深刻理解，投资风格稳健。

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

在去年年末资金面宽松的背景下，1月上旬债券市场利率小幅震荡，10年期国债收益率在3.1%-3.2%的区间内波动。随后1月末央行公开市场投放不及预期，债券市场投资者担忧货币政策收紧，资金利率快速飙升，带动债券市场利率走高，10年期国债收益率突破3.2%。春节假期期间海外疫情逐步得到控制、疫苗接种进度超预期，全球进行复苏交易，美债利率大幅上行，油价涨幅明显，国内债券市场利率走高，10年期国债收益率冲高到3.29%。春节后资金利率仍持续宽松，市场投资者对货币政策收紧的担忧下降，加之欧洲疫情卷土重来，全球复苏交易受挫，债券市场利率总体下行。总结来看，一季度债券市场利率呈现冲高回落的走势。

操作上，账户主要以持有中短久期、收益率相对较好的信用债品种，并配合流动性管理。

### 2、市场展望和投资策略

展望二季度，短期来看，市场对经济基本面带来的利空有所钝化，资金市场利率与央行态度将是市场投资者关注的焦点。短期内市场利率大概率仍将维持区间震荡的态势。中长期来看，不利于债券市场的因素仍未反转，债市拐点尚未到来，对长端利率仍需保留谨慎的态度。未来需关注经济复苏的变化、新冠疫情、中美关系等对债券市场的影响。信用债方面，优先选择中短久期抵御利率风险，获取稳定的票息收入。

综上，我们继续维持账户中短的组合久期，采用动态增强的策略，同时密切关注已发生的风险事件，做好控制流动性风险，适当把握市场投资机会。

## 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

### 银河安心收益 1 号集合资产管理计划

#### (2021 年第一季度) 托管报告

本计划托管人—中国光大银行在托管银河安心收益 1 号集合资产管理计划的过程中，严格遵守各项法律法规，对银河安心收益 1 号集合资产管理计划管理人—银河金汇证券资产管理有限公司 2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害计划份额持有人利益的行为。

管理人所编制和披露的《银河安心收益 1 号集合资产管理计划 2021 年第一季度资产管理报告》中的财务数据是真实、准确的。

托管人中国光大银行股份有限公司行长刘金先生因工作调整，于 2021 年 3 月 16 日辞去行长职务。副行长卢鸿先生因工作调整，于 2021 年 3 月 2 日辞去副行长职务。

中国光大银行 资产托管部

2021 年 4 月 14 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	2,967,779.56	2.67%
结算备付金	1,042,000.00	0.94%
债券投资	69,422,250.00	62.37%
买入返售金融资产	5,900,029.50	5.30%

应收利息	1,436,395.33	1.29%
其他应收款	29,446,687.04	26.45%
证券清算款	1,100,855.34	0.99%
合计	111,315,996.77	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债券明细

序号	证券代码	证券名称	数量	市值(元)	市值占净值
1	101800188	18 黄冈城投 MTN001	80,000.00	8,138,400.00	7.44%
2	101800080	18 咸宁高新 MTN001	80,000.00	8,118,400.00	7.42%
3	012003265	20 泉州台商 SCP003	80,000.00	8,001,600.00	7.31%
4	042000202	20 资阳水投 CP001	80,000.00	7,985,600.00	7.30%
5	019640	20 国债 10	71,000.00	7,096,450.00	6.49%
6	101800386	18 景国资 MTN001	50,000.00	5,064,500.00	4.63%
7	012004153	20 滁州同创 SCP003	50,000.00	5,014,500.00	4.58%
8	012101122	21 淮北建投 SCP002	50,000.00	5,003,000.00	4.57%
9	102100516	21 新余城建 MTN002	50,000.00	5,002,500.00	4.57%
10	012002666	20 蚌埠投资 SCP002	50,000.00	5,001,000.00	4.57%

## 三、期末市值占集合计划资产净值前三名股票明细

注：本集合计划报告期末未持有股票

## 四、期末市值占集合计划资产净值前三名基金明细

注：本集合计划报告期末未持有基金。

## 五、期末市值占集合计划资产净值前三名买入返售金融资产明细

序号	代码	名称	市值(元)	占净值比例
1	204001	GC001	5,900,029.50	5.39%

## 六、期末市值占集合计划资产净值前三名权证明细

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	133,908,960.12
报告期内总参与份额	6,386,170.67
红利再投资份额	0
报告期内总退出份额	42,851,206.47
报告期末份额总额	97,443,924.32

## 第八节 重要提示

本计划管理人办公地址于2021年2月1日起，变更为北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦7层。

以上事项银河金汇证券资产管理有限公司已按照规定在官网公告。

## 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

二〇二一年四月二十二日