

央视 50 平衡集合资产管理计划季度报告

(2021 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中国光大银行股份有限公司于2021年7月16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4月1日至2021年6月30日。

第二节 集合资产管理计划概况

名称	央视50平衡集合资产管理计划
类型	开放式、非限定性、存续期十年
成立日	2012年9月27日
报告期末份额总额	7,152,047.26 份
投资目标	本集合计划主要采取恒定混合战略等资产配置策略,运用指数投资组合管理技术,在有效降低组合波动率的基础上,实现集合计划资产保值增值目标。
投资理念	在工业化和城镇化的推动下,中国经济在今后较长时期仍将保持较快增长态势,为资本市场的繁荣和发展奠定了坚实的基础。秉承被动投资理念,在资产配置和组合管理方面采用透明规则,能够有效克服人性弱点对投资绩效的负面影响。

投资基准	本集合计划的业绩比较基准为：60% × 央视财经 50 指数收益率+40% × 一年期存款基准利率。
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	201,531.40
净值增长率	1.64%
期末资产净值	12,428,204.19
期末每份额净值	1.738
期末每份额累计净值	1.953

二、业绩表现

截止 2021 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值 1.738 元，累计单位净值 1.953 元，本期集合计划净值增长率 1.64%。

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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① -③	②-④
2021 年 2 季度	1.64%	0.58%	-0.41%	0.55%	2.05%	0.03%

四、收益分配情况

本报告期末进行收益分配。

第四节 管理人报告

一、投资主办人简介

王宝娟，上海财经大学管理学硕士，复旦大学理学学士。曾任职德邦证券量化投资部、资产管理总部，从事量化策略交易、研究。2014年加入银河金汇，历任多只定向计划投资主办人，目前担任银河金星1号、银河央视50平衡、银河智远1号、银河安心收益1号、银河安心收益2号等集合资产管理计划投资主办人。

二、投资主办人工作报告

二季度经济复苏动能从总量上看有所减弱，但结构优化，流动性温和宽松，债券没有大的风险，权益持续反弹。产品配置上，本季度股票比例维持在60%基准比例左右，而此前长达两年的时间里，大部分时候是超配的。站在当下，虽然我们仍然看好持仓很多公司的长期表现，但无论从大部分股票的绝对估值水平、历史分位还是股债性价比来看，我们都倾向于维持中性配置而不是超配。下一季度将继续保持中性仓位，同时持股结构上，在合同允许范围内适度优化，以期超越基准并获取稳健回报。长期来看，在改革与转型的持续推进、居民权益资产配置比例偏低、海外资金持续增配中国等大背景下，我们仍然看好权益类资产的回报潜力，建议投资人着眼长期，坚定持有。

三、管理人履职报告

在本报告期内，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，投资主办人按照资产管理投资决策委员会授权的范围进行投资，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

央视 50 平衡集合资产管理计划 (2021 年第二季度) 托管报告

本计划托管人—中国光大银行在托管央视50平衡集合资产管理计划的过程中，严格遵守各项法律法规，对央视50平衡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4月1日至2021年6月30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《央视50平衡集合资产管理计划2021年第二季度资产管理报告》中的财务数据是真实、准确的。

根据托管人中国光大银行股份有限公司董事会2021年6月5日发布的《中国光大银行股份有限公司关于行长任职资格获中国银保监会核准的公告》（临2021-035），中国银保监会已核准付万军先生中国光大银行股份有限公司行长的任职资格。

中国光大银行 资产托管部

2021年7月15日

第六节 投资组合报告

一、资产组合情况

序号	资产类别	市值（元）	占总资产的比例（%）
1	权益投资	7,633,201.67	60.35
	其中：股票	7,633,201.67	60.35
2	固定收益投资	23,046.00	0.18
3	基金	2,230,232.52	17.63
7	银行存款	2,757,772.11	21.80

8	其他资产	3304.06	0.03
9	资产合计	12,647,556.36	100.00

(注: 1. 其他资产包括: 结算备付金、存出保证金、应收利息、应收申购款;
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

代码	名称	持仓数量(股)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
600519	贵州茅台	297	610,839.90	4.9149
002241	歌尔股份	13,400.00	572,716.00	4.6082
601166	兴业银行	19,900.00	408,945.00	3.2905
002415	海康威视	6,095.00	393,127.50	3.1632
600036	招商银行	6,700.00	363,073.00	2.9214
600887	伊利股份	9,438.00	347,601.54	2.7969
600276	恒瑞医药	5,088.00	345,831.36	2.7826
601318	中国平安	5,120.00	329,113.60	2.6481
601398	工商银行	59,617.00	308,219.89	2.4800
000002	万科A	11,400.00	271,434.00	2.1840

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

代码	名称	持仓数量(张)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
010107	21 国债(7)	230	23,046.00	0.19

四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

代码	名称	持仓数量(份)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
001328	鹏华弘华混合 C	726,598.24	911,081.53	7.33
519951	长信利泰混合	576,893.63	885,012.52	7.12
184801	鹏华前海	2,300.00	225,027.40	1.81
163109	申万深成	198,538.00	154,661.10	1.24
501186	华夏 3 年封闭运作战略配售混合(LOF)	27,000.00	29,457.00	0.24
169106	东证创优	24,968.00	24,992.97	0.20

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

本集合计划报告期末未持有买入返售资产。

六、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

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	7,249,328.30
报告期内总参与份额	1,727.96
报告期内总退出份额	99,009.00
报告期末份额总额	7,152,047.26

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

二〇二一年七月二十一日