

银河安心收益 1 号集合资产管理计划季度报告

(2021 年第三季度)

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10月19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7月01日至2021年9月30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	63,247,758.09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	593,091.85
净值增长率	0.80%
期末资产净值	72,032,577.73
期末每份额净值	1.139
期末每份累计净值	1.409

二、业绩表现

截止 2021 年 9 月 30 日，本集合计划单位净值 1.139 元，累计单位净值 1.409 元，本期集合计划收益率增长 0.80%。

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	0.80%	0.00%	0.80%

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

李金敬女士，北京大学硕士，CFA，2015年加入银河金汇证券资产管理有限公司，多年券商资管金融行业从业经验，主要从事固定收益类产品的投资以及债券、基金的研究工作，历任银河稳盈8-20号、银河稳汇1-11号等多只资管计划投资主办人及助理。已取得证券从业资格、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、投资主办人工作报告

1、市场回顾和投资操作

2021 年三季度，宏观经济继续走弱，货币和信贷增速也在持续走低。央行在 7 月初超预期的降低了存款准备金率，债券收益率 7 月份大幅度下行，10 年

期国债收益率从接近 3.10% 下降到 2.80% 附近，之后 8-9 月份整整两个月 10 年期国债收益率在 2.80-2.90% 之间波动。权益市场虽然指数整体变化不大，但结构性行情显著，周期股尤其是能源类股票从 8 月份以来大幅度上行，9 月份之后逐步进入调整下行阶段。可转债市场则经历了估值持续提升的过程，中证转债指数在 8 月初至 9 月中旬的涨幅超过 10%。

三季度，本产品的策略继续维持短久期，中间增加了转债品种的配置。

2、市场展望和投资策略

展望四季度，宏观经济仍会继续下行，但宽货币和宽信用的政策信号已然十分清晰，预计货币和社融在 10 月份大概率企稳并在四季度反弹，预计宏观经济最早可能在 2022 年一季度企稳。从金融市场来看，在信用宽松的预期假设下，我们判断对于权益类市场继续利好，对于债券市场则逐步利空。

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，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 年第三季度) 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7月1日-2021年9月30日的投资运作，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年第三季度资产管理报告》中的财务数据是真实、准确的。

中国光大银行 资产托管部

2021年10月19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	1,734,034.43	2.36%
结算备付金	2,602,691.88	3.54%
债券投资	40,155,340.70	54.56%
买入返售金融资产	28,500,712.50	38.73%
应收利息	603,233.88	0.82%
合计	73,596,013.39	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	132004	15 国盛 EB	59,540.00	6,160,008.40	8.55%
2	132007	16 凤凰 EB	58,110.00	6,092,833.50	8.46%
3	019628	20 国债 02	60,000.00	6,003,000.00	8.33%
4	019649	21 国债 01	55,000.00	5,509,900.00	7.65%
5	101664064	16 桂投资 MTN001	50,000.00	4,998,500.00	6.94%
6	132009	17 中油 EB	39,770.00	4,189,371.80	5.82%
7	112012125	20 北京银行 CD125	40,000.00	3,877,200.00	5.38%
8	132015	18 中油 EB	26,700.00	2,798,427.00	3.88%
9	132008	17 山高 EB	5,000.00	526,100.00	0.73%

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	204007	GC007	28,500,712.50	39.57%

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	72,472,093.13
报告期间总参与份额	1,177,415.20
红利再投资份额	0
报告期间总退出份额	10,401,750.24
报告期末份额总额	63,247,758.09

第八节 重要提示

1、管理人于 2021 年 8 月 16 日发布《关于银河安心收益 1 号集合资产管理计划投资主办人变更的公告》，因产品投资需要，经我司研究决定，将我司管理的“银河安心收益 1 号集合资产管理计划”的投资主办人，由张煜先生、王宝娟女士，变更为王宝娟女士。前述变更自 2021 年 8 月 16 日起实施。上述事项我公司已按有关规定向相关部门报告。

2、管理人于 2021 年 9 月 1 日发布《关于银河安心收益 1 号集合资产管理计划投资主办人变更的公告》，因产品投资需要，经我司研究决定，将我司管理的“银河安心收益 1 号集合资产管理计划”的投资主办人，由王宝娟女士，变更为李金敬女士。前述变更自 2021 年 9 月 1 日起实施。上述事项我公司已按有关规定向相关部门报告。

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

二〇二一年十月二十七日