

银河安心收益 2 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27日。

第二节 集合资产管理计划概况

名称	银河安心收益 2 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	2013年5月31日
报告期末份额总额	16,014,136.18份
投资基准	3年期银行定期存款利率
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	156,610.30
净值增长率	0.44%
期末资产净值	18,261,839.41
期末每份额净值	1.140
期末每份累计净值	1.452

二、业绩表现

截止 2021 年 9 月 27 日，本集合计划单位净值 1.140 元，累计单位净值 1.452 元，本期集合计划收益率增长 0.44%。

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	0.44%	0.69%	-0.25%

四、收益分配情况

本期未进行收益分配。

第四节 管理人报告

一、投资主办人简介

李石先生：南开大学数学学士，金融工程硕士，多年证券从业经验。2010 年加入国信证券固定收益部，负责企业债发行、债券研究等工作。2012 年加入华夏基金固定收益部，先后任交易员、研究员、基金经理助理，协助管理多个社保、专户、年金组合。2016 年加入银河金汇证券资产管理有限公司固定收益投资部，主要从事固定收益类产品投资工作，具备证券从业资格和基金从业资格，3 年内没有被采取监管措施或处罚。现已通过基金经理考试。

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2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 2 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 2 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 27 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 2 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	254,698.97	1.36%
结算备付金	981,050.24	5.23%
债券投资	10,156,457.30	54.16%
买入返售金融资产	7,200,036.00	38.39%
应收利息	160,397.13	0.86%
证券清算款	470.47	0.00%
合计	18,753,110.11	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	019649	21 国债 01	38,010.00	3,803,280.60	20.83%
2	019645	20 国债 15	25,000.00	2,504,000.00	13.71%
3	132007	16 凤凰 EB	10,000.00	1,048,000.00	5.74%
4	132004	15 国盛 EB	10,030.00	1,032,989.70	5.66%
5	019628	20 国债 02	10,000.00	999,500.00	5.47%
6	132009	17 中油 EB	3,300.00	348,117.00	1.91%
7	132016	19 东创 EB	3,000.00	306,000.00	1.68%
8	110073	国投转债	1,000.00	114,570.00	0.63%

三、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

四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

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十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	7,200,036.00	39.43%

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	41,502,762.23
报告期间总参与份额	8,345,870.18
红利再投资份额	0
报告期间总退出份额	33,834,496.23
报告期末份额总额	16,014,136.18

第八节 重要提示

1、管理人自 2021 年 7 月 9 日起，于公司网站陆续发布《关于银河安心收益 2 号集合资产管理计划变更为银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划及其法律文件变更的公告》及补充公告。

2、管理人于 2021 年 8 月 25 日发布《关于银河安心收益 2 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 2 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，变更为李石先生。前述变更自 2021 年 8 月 25 日起实施。上述事项公司已按有关规定向相关部门报告。

3、管理人于 2021 年 9 月 24 日发布《关于对银河安心收益 2 号集合资产管理计

划产品份额安排强制退出的公告》，对部分产品份额安排强制退出。

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