

银河安心收益 1 号集合计划 2021 年第 4 季度报告

资产管理计划管理人：银河金汇证券资产管理有限公司

资产管理计划托管人：中国光大银行股份有限公司

报告期间：2021 年 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日

一、基本信息

资产管理计划名称:	银河安心收益1号集合资产管理计划
资产管理计划成立时间:	2012-12-13
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

二、资产管理计划投资表现

	本期末
期末资产净值(元)	55,732,615.49
本期利润(元)	139,567.85
份额净值(元)	1.142
份额累计净值(元)	1.412

三、资产管理计划投资组合报告

(一) 委托资产配置情况

序号	资产类别	市值(元)	占总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	40,504,530.00	71.73
3	基金	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	13,600,068.00	24.09
6	信托投资	-	-
7	银行存款	589,452.57	1.04
8	其他资产	1,771,295.40	3.14
9	资产合计	56,465,345.97	100.00

(二) 委托资产投资前十名股票(按市值)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(%)
-	-	-	-	-

(三) 委托资产投资前五名债券(按市值)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(%)
101900058	19 甘交建 MTN001	50,000	5,002,500.00	8.98
012103528	21 陕西建工 SCP001	50,000	4,996,500.00	8.97
155186	19 蓝星 02	40,000	4,010,000.00	7.20
101900115	19 上饶城投 MTN001	40,000	4,002,400.00	7.18

012103136	21 港兴港投 SCP004	40,000	4,001,200.00	7.18
-----------	-------------------	--------	--------------	------

(四) 委托资产投资前五名基金（按市值）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(%)
-	-	-	-	-

(五) 委托资产投资前五名买入返售金融资产（按市值）明细

代码	名称	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
204001	GC001	13,600,068.00	24.40

(六) 委托资产投资前五名买入信托资产（按市值）明细

代码	名称	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
-	-	-	-

(七) 资产管理计划运用杠杆情况

截至报告期末，本产品杠杆率为 101%，符合合同规定。

(八) 资产管理计划参与国债期货、股指期货交易的有关情况

无。

四、管理人报告

(一) 投资主办人简介情况

王跃文，二十年资管行业从业经验。先后就职于中国国际期货有限公司基金部、国信证券资产管理部、国都证券资产管理部；管理过多种不同规模、不同风格的理财产品。已取得证券从业资格。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) 投资策略回顾与展望

2021 年四季度，实体经济下行压力较大，内需中投资和消费依然疲弱，海外经济继续恢复，出口依然保持高增速。伴随“电荒”的逐步缓解以及美联储加息预期导致全球定价的资源品价格下调，PPI 月度增速由高点开始回落，政策层面上释放出积极的稳增长信号，社融增速有望触底回升。债券市场方面，10 月中上旬，因降准预期受挫、通胀担忧升温，长端利率出现了一轮较为明显的回升。

10月下旬至11月，发改委调控煤炭价格，同时伴随着宽松预期升温、地产违约风险逐步上升以及疫情反复等引发的避险情绪增强，收益率冲高回落。12月央行进一步做出宽松举动，包括再度降准以及下调再贷款利率和LPR利率，引发市场对货币政策宽松的预期的升温，10年国债收益率在12月底明显下行。报告期内，本产品继续维持中高评级、中短久期信用债的配置，并配合流动性管理。

展望2022年，一是地产下行拖累经济，虽然政策对地产行业有边际放松，但管控的大方向不会改变，预计2022年地产投资增速会有明显下滑；二是稳增长需求迫切，预计将出台一定的稳增长政策，流动性环境预计将由今年的“宽货币、紧信用”切换为“宽货币、宽信用”模式，对资本市场风险偏红的提升构成积极影响；三是美国通胀水平处于历史高位，美联储加息存隐忧，全球流动性或将整体面临收缩。后续操作方面，本产品将继续合理控制组合久期，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) 公平交易专项说明

报告期内，本资产管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

(四) 管理人履职报告

在报告期内，本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资产管理计划。

报告期内，本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风险管理制度，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，严格履行本计划合同规定。

在报告期内，投资主办人按照合同规定的投资范围进行投资，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。

(五) 报告期内资管计划投资收益分配情况

无。

五、托管人履职报告

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10月1日-2021年12月31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年第四季度资产管理报告》中的财务数据是真实、准确的。

六、管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

(一) 管理费

计提基准	年管理费率为0.7%
计提方式	管理费每日计算，逐日累计至每月月底
支付方式	按月支付，由管理人于次月首日起5个工作日内依据管理人划款指令从本集合资产管理计划中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(二) 托管费

计提基准	年托管费率为0.1%
计提方式	托管费每日计算，逐日累计至每月月底
支付方式	按月支付，由管理人于次月首日起5个工作日内依据管理人划款指令从本集合资产管理计划中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(三) 业绩报酬

计提基准	无
计提方式	无
支付方式	无

七、涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

(一) 投资经理变更

管理人于 2021 年 10 月 8 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，由李金敬女士，变更为王跃文先生。前述变更自 2021 年 10 月 11 日起实施。上述事项我公司已按有关规定向相关部门报告。

(二) 重大关联交易情况

无。

(三) 报告期内其他事项说明

无。

八、声明

郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。

银河金汇证券资产管理有限公司

2022 年 01 月 28 日