

银河智汇 F0F1 号集合资产管理计划 2021 年度报告

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：招商证券股份有限公司

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

一、基本信息

资产管理计划名称：	银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划
资产管理计划成立时间：	2019-06-06
管理人：	银河金汇证券资产管理有限公司
托管人：	招商证券股份有限公司

二、资产管理计划投资表现

	本期末
期末资产净值(元)	174,990,751.59
本期利润(元)	32,682,008.86
份额净值(元)	1.7495
份额累计净值(元)	1.7495

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	-	-
3	基金	173,997,347.55	96.71
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	信托投资	-	-
7	银行存款	5,918,400.22	3.29
8	其他资产	2,929.63	0.00
9	资产合计	179,918,677.40	100.00

(二) 委托资产投资前十名股票（按市值）明细

无。

(三) 委托资产投资前五名债券（按市值）明细

无。

(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(%)
SGN110	因诺天丰 3 号	13,125,037.60	29,806,960.39	17.03
SNP550	华软新动力智 汇星辰 1 号	22,709,556.27	29,220,386.05	16.70

SLB176	念空中证 500 指数增强 6 号	17,566,290.08	22,137,038.76	12.65
SLF121	赫富 500 指数增强六号	17,655,117.80	21,754,636.15	12.43
SNK809	幻方 500 指数增强欣享 3 号	15,159,500.05	17,028,666.41	9.73

(五)委托资产投资前五名买入返售金融资产（按市值）明细

无。

(六)委托资产投资前五名买入信托资产（按市值）明细

无。

(七)资产管理计划运用杠杆情况

无。

(八)股指期货投资情况报告

无。

四、管理人报告

(一)投资主办人简介情况

徐杰先生，经济学硕士。曾担任普华永道中天会计师事务所审计师，2010 年加入中国银河证券股份有限公司担任财务部预算管理经理，2014 年加入银河金汇证券资产管理有限公司担任研究员、投资经理。已取得基金从业资格。

张洪源，男，出生于 1981 年，北京大学金融学本科，北京师范大学管理硕士，持有 CPA 和 FRM 证书。2004 年参加工作，先后就职于德勤华永会计师事务所、工商银行。2017 年 6 月加入银河金汇，已取得证券从业资格、基金从业资格，具有投资主办人资格。张洪源投资经验丰富，管控流动性风险、信用风险和利率风险能力较强，擅长大类资产配置，其中德勤工作期间主要负责制造业类企业的财务审计工作，工商银行工作期间主要负责信用债券的投资和 T+0 理财产品的管理工作，加入金汇以来，管理的产品类型包括固定收益类产品、CPPI 策略类产品以及固收+FOF 类产品等。

(二)投资策略回顾与展望

本集合计划除保留必要的现金之外，绝大部分资产都投资于采用量化策略的

中证 500 指数增强私募证券投资基金。

本计划继续遵循核心+卫星的组合配置策略。核心子基金主要持仓国内量化私募界较高知名度、规模较大的私募基金，卫星子基金主要配置业绩较好、具备潜力的中型量化私募。通过卫星提供与核心持仓差异化的超额收益。如果卫星子基金表现优异，本计划可能加大其仓位，纳入核心基金的范围，同时剔除表现不如预期的核心基金。通过不断的优化调整，本计划希望实现更为平稳的、持久的超额收益。

2021 年市场跌宕起伏，整体波动较为平稳，但结构性局部震荡剧烈。全年来看，电力设备新能源、有色金属、煤炭等涨幅居前，家用电器、非银金融、房地产等跌幅居前。国内经济前高后低，政策前紧后松。海外经济持续复苏，海外通胀也同样不断走高，倒逼海外宽松政策加快退出进程。

整体来看，2021 年 A 股市场在海内外资金不断增配 A 股的过程中，较为平稳的度过了熊市高发期，整体表现出较强的韧性。回顾全年，产品策略上整体偏均衡，阶段性淘汰了部分管理人，以优化组合配置。

展望 2022 年，股票市场我们持谨慎乐观态度。全年来看，权益仍然会有一定的波动，故策略上可能适宜更均衡的配置，以降低组合波动。一季度时间维度内，价值型权益基金可能更占优，而全年来看，经济增长动能下行趋势未变，故小盘或仍继续跑赢大盘。

(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。

报告期间内，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，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

2021 年度，本托管人——招商证券股份有限公司在对银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划（下称“本计划”）的托管过程中，严格遵守相关法律法规和托管协议的有关规定，不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

2021 年度，本计划管理人在投资运作、资产净值计算、费用开支等问题上，不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，严格遵守有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。

本托管人依法对资产管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特此报告。

六、资产管理计划财务会计报告

本资产管理计划委托资产负债表所载财务信息系根据下列主要会计政策和会计估计编制。这些会计政策和会计估计系依照企业会计准则及应用指南，并参照《证券投资基金会计核算业务指引》中有关会计要素确认和计量的规定和中国证券监督管理委员会允许的财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定所拟定的。

1、会计期间

本资产管理计划采用公历年制，即自每年 1 月 1 日至 12 月 31 日为一个会计年度。

2、记账本位币

本资产管理计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

3、记账基础和计价原则

本资产管理计划会计核算以权责发生制为基础。除某些金融工具外，本财务

报表均以公允价值为计量基础。

(一) 资产负债表

项目	本年累计数	年初余额	负债和所有者权益	期末余额	年初余额
银行存款	5,918,400.22	3,308,524.28	短期借款	-	-
结算备付金	-	-	交易性金融负债	-	-
存出保证金	-	-	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	173,997,347.55	210,875,268.81	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	-	-	应付证券清算款	-	-
债券投资	-	-	应付赎回款	-	-
资产支持证券投资	-	-	应付管理人报酬	4,905,335.66	2,664,158.12
基金投资	173,997,347.55	210,875,268.81	应付托管费	12,590.15	15,211.70
可供出售类资产	-	-	应付销售服务费	-	-
其中：股票投资	-	-	应付交易费用	-	-
债券投资	-	-	应付税费	-	-
衍生金融资产	-	-	应付利息	-	-
买入返售金融资产	-	-	应付利润	-	-
应收证券清算款	-	-	其他负债	10,000.00	10,000.00
应收利息	2,929.63	1,637.68	负债总计	4,927,925.81	2,689,369.82
应收股利	-	-	所有者权益：	-	-
应收申购款	-	-	实收基金	100,022,976.58	146,728,274.49
长期股权投资	-	-	未分配利润	74,967,775.01	64,767,786.46
其他资产	-	-	资本公积	-	-
-	-	-	所有者权益总计	174,990,751.59	211,496,060.95
资产总计：	179,918,677.40	214,185,430.77	负债与持有人权益总计：	179,918,677.40	214,185,430.77

(二) 利润表

项目	本年累计数
一、收入	35,061,526.09
1、利息收入	95,231.27
其中：存款利息收入	95,231.27
债券利息收入	-
信托利息收入	-
资产支持证券利息收入	-

买入返售金融资产收入	-
2、投资收益（损失以“-”填列）	56,329,770.62
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	54,448,714.61
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
基金红利	1,881,056.01
金融商品转让税	-
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-21,363,475.80
4、其他收入（损失以“-”填列）	-
二、费用	2,379,517.23
1、管理人报酬	2,241,177.54
2、托管费	51,719.40
3、销售服务费	-
4、交易费用	58,554.14
5、利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6、其他费用	28,066.15
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	32,682,008.86

七、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	本集合计划应给付管理人固定管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年固定管理费率为 1.30%。
计提方式	管理人的固定管理费每日计提，逐日累计。
支付方式	按季度支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在下一季度首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。

（二）托管费

计提基准	本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为【0.03】%。
计提方式	托管人的托管费每日计提，逐日累计。

支付方式	按季度支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在下一季度首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。
------	---

(三) 业绩报酬

计提基准	<p>(1) 对委托人持有份额及退出份额（包括由于合同变更导致的份额退出）按份额认（申）购时间的不同，分别计算的每笔份额的实际年化收益率（R）计提业绩报酬。</p> <p>(2) 本集合计划业绩报酬计提日为委托人份额退出日或本集合计划终止日（含二次清算终止日，下同）。在本集合计划终止日，对集合计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在委托人份额退出日，仅对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。</p> <p>(3) 集合计划终止日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再分配剩余资金。在委托人份额退出日符合业绩报酬计提条件的，管理人应先将委托人申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除后，再向委托人分配退出款。</p> <p>(4) 本集合计划业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，但因投资者退出集合计划、本集合计划终止，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的除外。</p>
计提方式	<p>管理人于业绩报酬计提日，将按份额认（申）购时间的不同，针对委托人每笔份额分别核算其业绩报酬核算期。业绩报酬核算期是指针对委托人所持有的每笔份额，上一个管理人实际计提了业绩报酬的业绩报酬计提日（以下简称：上一业绩报酬计提日；如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日或委托人该笔份额申购确认日）至本次业绩报酬计提日期间。管理人根据当个业绩报酬核算期的委托人每笔份额实际年化收益率（R）情况，分段计提业绩报酬（H），委托人所持份额以认（申）购时间的不同分别进行业绩报酬的核算和计提</p>
支付方式	<p>业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人复核后据此计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>

八、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

我司于2021年9月13日官网发布【关于银河智汇FOF1号集合资产管理计划投资主办人变更的公告】。因内部工作调整的原因，经我公司研究决定，将我司管理的“银河智汇FOF1号集合资产管理计划”的投资主办人，由徐杰先生，变更为徐杰先生、张洪源先生。前述变更自2021年9月13日起实施。

(二) 重大关联交易情况

无。

(三) 报告期内其他事项说明

1、银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划于 2021 年 1 月投资于非标准化资产：华软新动力新智能智汇星辰 1 号私募证券投资基金。

2、我司作为“银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划”的管理人，于 2021 年 1 月与大连网金基金销售有限公司签署了产品代理相关协议，增加大连网金基金销售有限公司作为银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划的代销机构。

3、自 2021 年 2 月 1 日起，银河金汇证券资产管理有限公司通讯地址/联系地址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，联系电话：010-89623100；010-89623200。

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。

4、本计划所投子基金产品的托管方为本公司的母公司中国银河证券股份有限公司的包括：

代码	名称	持仓数量(份)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
SNS672	念空智汇星辰中证500指数增强1号	17,566,290.08	22,137,038.76	12.65%
NZ506A	量锐指数增强10号	8503401.36	8171768.71	4.67%

九、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04月29日