

银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划 2022 年第 3 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：中国工商银行股份有限公司

报告期间：2022 年 07 月 01 日-2022 年 09 月 30 日

一、基本信息

资产管理计划名称：	银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划
资产管理计划成立时间：	2021-12-09
管理人：	银河金汇证券资产管理有限公司
托管人：	中国工商银行股份有限公司

二、资产管理计划投资表现

	本期末
期末资产净值(元)	116,850,692.24
本期利润(元)	754,214.65
份额净值(元)	1.0277
份额累计净值(元)	1.0277

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	108,431,646.42	92.71
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	8,201,438.13	7.01
6	信托投资		
7	银行存款	104,335.74	0.09
8	其他资产	220,665.75	0.19
9	资产合计	116,958,086.04	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(%)
----	----	---------	-------	----------------

GSZD01	水星中短债 1 号	16,716,410.30	19,143,633.08	16.38
511360	海富通中证短融 ETF	144,610.00	15,299,882.61	13.09
GS0301	水星季享 1 号	11,298,417.35	13,118,592.39	11.23
YHLQ05	盛汇乐钱 5 号	10,973,085.35	12,938,364.94	11.07
GSTL01	水星添利 1 号	11,119,623.10	12,243,817.00	10.48

(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 (%)
204007	GC007	8,201,521.02	7.02
204001	GC001	-82.89	-0.00

(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) 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

周磊蕾，北京大学硕士，12 年证券从业经验。2010 年加入信达证券资产管理部，先后从事研究员、投资助理、投资管理工作。2015 年加入银河金汇证券资产管理有限公司固定收益投资部，从事投资管理工作。

(二) 投资策略回顾与展望

在投资方面，在基建投资增速高位趋稳的背景下，房地产复工需要在政府、企业、金融机构等的共同努力下进一步推进；在消费方面，社会消费品零售总额出现回升，消费者信心或有修复；进出口方面，随着海外疫情的放缓及经济衰退风险的上升，我国外贸出口增速在份额占比和海外需求不确定性的背景下，回落的压力仍然存在；就国内通胀而言，CPI 同比预计阶段性破“3”，之后仍将有所回落，CPI 方面的通胀压力或在明年上半年。PPI 受国内、国际大宗商品价格回落带动，预计将持续下行。市场流动性方面，社融同比有所增长，但融资结构仍然不理想，政策面宽货币的方向暂时没有改变。配置上，将继续维持现有投资策略，保持相对均衡的久期配置和更加稳健的投资组合。

(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 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

本报告期内,本托管人在对银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定,不存在任何损害资产管理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。

本报告期内,托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定,对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督,对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算,以及费用开支等方面进行了认真的复核。未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

本报告期内,本托管人依法对银河金汇证券资产管理有限公司编制和披露的银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划 2022 年度第三季度报告中财务指标、净值表现、利润分配状况、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。

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	本集合计划的年固定管理费率为【0.2】%。
计提方式	管理人的固定管理费每日计提，逐日累计至每月月底。
支付方式	按季度支付，托管人根据管理人出具的资金划拨指令或管理人和托管人一致同意的其他方式，在自然季度初前 10 个工作日支付上个季度的费用。

(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【0.02】%。
计提方式	托管人的托管费自本计划成立日起每日计提。
支付方式	按季度支付，托管人根据管理人出具的资金划拨指令或管理人和托管人一致同意的其他方式，在自然季度初前 10 个工作日支付上个季度的费用。

(三) 业绩报酬

计提基准	本计划不计提业绩报酬。
计提方式	本计划不计提业绩报酬。
支付方式	本计划不计提业绩报酬。

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

无。

(二) 重大关联交易情况

报告期内，银河金汇辰星FOF双周增利1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）继续投资了银河金汇证券资产管理有限公司（以下简称“银河金汇”）

管理的若干集合产品， 2022年三季度，投资情况如下：

序号	投资产品名称	投资金额（万元）
1	银河水星中短债 1 号集合资产管理计划	1395
2	银河水星中短债 2 号集合资产管理计划	763.8
3	银河水星季享 1 号集合资产管理计划	780
4	银河盛汇乐钱 5 号集合资产管理计划	766.8
5	银河水星添利 1 号集合资产管理计划	558
6	银河水星 6 号集合资产管理计划	1121
7	银河融汇 8 号集合资产管理计划	714.8
8	银河恒汇睿智 1 号集合资产管理计划	30
9	银河恒汇睿智 2 号集合资产管理计划	30

(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 10 月 28 日