

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

报告期间：2022 年 01 月 01 日-2022 年 12 月 31 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)	117,154,808.50
本期利润(元)	1,456,001.17
份额净值(元)	1.0289
份额累计净值(元)	1.0289

## 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	106,844,755.20	91.12
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	10,204,889.21	8.70
6	信托投资		
7	银行存款	84,707.19	0.07
8	其他资产	120,540.18	0.10
9	资产合计	117,254,891.78	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 (%)
RH0898	融汇 8 号	19,005,935.45	20,817,201.10	17.77
GS0621	水星 6 号	19,001,716.61	20,810,680.03	17.76
GSZD02	水星中短债 2 号	13,216,563.70	14,472,137.25	12.35
GS0301	水星季享 1 号	11,298,417.35	13,188,642.57	11.26
YHLQ05	盛汇乐钱 5 号	10,973,085.35	13,020,663.08	11.11

(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	9,005,087.12	7.69
204001	GC001	999,976.75	0.85
204004	GC004	200,078.43	0.17
204003	GC003	-253.09	-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) 委托资产投资前五名金融衍生品投资（按市值）明细

无。

(八) 资产管理计划运用杠杆情况

无。

(九) 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、投资管理等工作。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。已取得基金从业资格，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) 投资策略回顾与展望

回顾2022年，前十个月信用债收益率整体震荡下行，信用债结构性资产荒延续，机构配置需求强，但供给相对不足，导致各品种利差大幅压缩，尤其短端交易拥挤，收益率大幅下行并触底，进而机构行为由信用下沉转为拉久期。2022年11月地产和疫情政策变化，债市快速进入调整，理财负反馈效应放大债市波动，信用债收益率拉升迅速，导致2022年11-12月收益率特别是短端快速拉升，本产品由于产品特性和投资策略原因，主要配置短久期产品，因此经历了自成立以来最大回撤，但本产品在过程中通过逐步降低短久期产品仓位，一定程度上控制了回撤幅度。

展望2023年，由于国家在经济刺激政策上相对克制，立足于长远可持续性

而不是短期大力度刺激，因此 2023 年全年应该是相对温和的复苏。回看现在经济修复情况和库存周期的位置，中美库存都在中等偏高位，草根数据调研经济修复情况弱于 2021 年，优于 2019 年，十年国债大幅超越 MLF 的概率不高，因此认为十年国债上限不会太高。同时由于目前国债国开收益率曲线都较为平坦，在短端资金扰动依然较大、利率互换价格依然高位的情况下，长端下行空间也有限。当下市场来看，由于前期市场对于经济复苏、财政、货币强刺激有较高预期，但是当下的数据和两会对于预期形成了一定程度上的纠偏，十年利率有继续下行空间，短期有利率出现回调的可能，但是回调幅度预计有限，届时或许也是配置的较好时机。

### (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年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

## 六、资产管理计划财务会计报告

### (一) 资产负债表

资产	本报告期末（元） 2022年12月31日	上年度末（元） 2021年12月31日
银行存款	84,707.19	390,369.82
结算备付金	14,338.63	
存出保证金	5,370.31	
衍生金融资产		
交易性金融资产	106,844,755.20	12,816,793.21
买入返售金融资产	10,204,889.21	
发放贷款和垫款		
债权投资		
其他债权投资		
应收清算款	100,831.24	
应收利息		
应收股利		2,952.32
应收申购款		
其他资产		
资产总计:	117,254,891.78	13,210,115.35
负债和净资产	本报告期末（元） 2022年12月31日	上年度末（元） 2021年12月31日
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款		
应付清算款		
应付赎回款		
应付管理人报酬	68,941.97	1,652.87
应付托管费	6,894.18	165.28
应付销售服务费		
应付交易费用	2,287.30	
应付投资顾问费		

应交税费	2,934.86	
应付利息		
应付利润		
其他负债	19,024.97	94.98
负债合计	100,083.28	1,913.13
	-	-
实收资金	113,858,875.70	13,190,000.00
其他综合收益		
未分配利润	3,295,932.80	18,202.22
所有者权益总计	117,154,808.50	13,208,202.22
负债与持有人权益总计:	117,254,891.78	13,210,115.35

## (二) 利润表

项目	本期金额 (元)	累计金额 (元)
	2022年01月01日-2022年12月31日	2022年01月01日-2022年12月31日
一、营业总收入	1,640,796.88	1,640,796.88
利息收入	57,772.82	57,772.82
投资收益 (损失以“-”填列)	749,315.65	749,315.65
其中: 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		
公允价值变动收益 (损失以“-”填列)	833,708.41	833,708.41
汇兑收益 (损失以“-”填列)		
其他业务收入		
二、营业总支出	184,795.71	184,795.71
管理人报酬	150,414.80	150,414.80
托管费	15,041.50	15,041.50
销售服务费		
投资顾问费		
利息支出		
其中: 卖出回购金融资产利息支出		
信用减值损失		
税金及附加	314.44	314.44
其他费用	19,024.97	19,024.97
三、利润总额	1,456,001.17	1,456,001.17
减: 所得税费用	0	0
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	1,456,001.17	1,456,001.17
五、其他综合收益的税后净额		
六、综合收益总额	1,456,001.17	1,456,001.17

## 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。

## 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

经公司研究决定，本集合资产管理计划的投资经理由易千先生变更为周磊蕾先生。前述变更自 2022 年 3 月 1 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

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年总体投资情况情况如下：

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	3554
2	银河水星中短债 2 号集合资产管理计划	3443.2
3	银河水星季享 1 号集合资产管理计划	1192
4	银河盛汇乐钱 5 号集合资产管理计划	1176.8
5	银河水星添利 1 号集合资产管理计划	1473
6	银河水星 6 号集合资产管理计划	2068
7	银河融汇 8 号集合资产管理计划	2071.8
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

## 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

2023 年 04 月 30 日