

银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产 管理计划 2023 年第 2 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深圳分行

报告期间：2023 年 04 月 01 日-2023 年 06 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深圳分行

二、资产管理计划投资表现

	本期末
期末资产净值(元)	190,076,838.19
本期利润(元)	3,654,993.77
份额净值(元)	1.0497
份额累计净值(元)	1.0497

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	21,785,349.87	11.45
3	基金	168,324,342.19	88.44
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	115,756.51	0.06
8	其他资产	110,747.50	0.06
9	资产合计	190,336,196.07	100

(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

代码	名称	持仓数量(张)	市值(元)	市值占委托资产净值比例 (%)
143743	18 公用 04	100,000	10,475,224.66	5.51
175444	20 亦庄 02	40,000	4,122,725.48	2.17

143568	18 建材 12	20,000	2,068,345.21	1.09
149294	20 穗交 02	20,000	2,056,268.22	1.08
175625	21 航集 01	20,000	2,042,616.44	1.08

(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	银河融汇 8 号	28,898,911.44	32,522,834.93	17.11
YHLQ05	银河盛汇乐钱 5 号	24,016,079.84	29,045,046.96	15.28
GS0301	银河水星季享 1 号	24,355,854.91	29,005,387.61	15.26
GS0621	银河水星 6 号	20,796,082.30	23,299,930.61	12.26
ZX1003	银河盛汇尊享 3 号	17,002,840.93	20,189,173.32	10.62

(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) 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

本产品的杠杆为 100.14%。

(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。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。

张祖阁，加拿大维多利亚大学经济学硕士学历，具有多年金融行业从业经验，2015年7月加入银河金汇证券资产管理有限公司。已获得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施及行政处罚。

(二) 投资策略回顾与展望

债市方面，2023年二季度市场关注到部分经济数据分行业高频数据走弱，对于经济修复韧性和速度的预期产生摇摆，中短债收益率下行，其中低等级的信用债收益率下行较多、信用利差呈现V型走势，长债收益率向下。4月，市场对国内经济复苏节奏的分歧逐渐缩小，收益率总体走低，信用利差整体延续修复行情，但因经济恢复内生动力略显不足，月末信用利差出现小额回升；5月，债市成交活跃度总体小幅上升，但在经济弱复苏的背景下，投资者风险偏好下降，信用债收益率曲线趋于平坦，信用利差整体小幅上行；6月，当月债市波动加大，整体走强，长端利率围绕政策预期交易波动明显加大，收益率V型调整后企稳。

展望未来，欧美核心通胀保持韧性，美联储及欧央或再进行1-2次小幅加息，本轮加息周期从目前的市场预期看，接近尾声。分项来看，国内经济复苏动力偏弱，需要政策有效支持。央行发布问卷调查显示，房地产、基建、制造业信贷需求均走弱。但在国家的政策支持下，房地产市场有望逐渐企稳，房地产投资或将回暖，以提振消费和投资信心。展望三季度，影响债市的核心因素可能会出现政策预期和资金面的变化上，后续需要关注市场对7月政治局会议增量政策的预期和实际落地情况。债市方面，市场对于财政政策，货币政策的预期变化将对债市形成扰动，收益率维持震荡偏强走势，操作上可保持中性。预计短期内债券利率仍将维持低位震荡格局。产品配置上，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地复核，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 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划 2023 年第二季度报告中财务指标、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、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	资产管理费每日计提。
支付方式	按季支付

(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	资产托管费每日计提。
支付方式	按季支付

(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

自2023年5月17日起，本产品投资经理由周磊蕾先生变更为周磊蕾先生、张祖阁女士，相关信息已披露。

(二)重大关联交易情况

本产品涉及关联交易的情况于2023年4月11日、4月13日、4月19日、4月21日、4月28日、5月22日、5月29日、6月6日、6月12日做出披露。

(三) 报告期内其他事项说明

自 2023 年 6 月 5 日起，公司董事长及法定代表人变更为刘冰先生。

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

2023 年 07 月 31 日