

银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划 2023 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：中国工商银行股份有限公司深圳分行

报告期间：2023 年 10 月 01 日-2023 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)	281,935,239.34
本期利润(元)	3,849,859.10
份额净值(元)	1.0698
份额累计净值(元)	1.0698

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	0.00	0.00
	其中: 股票	0.00	0.00
2	固定收益投资	-	-
3	基金	3,524,047.54	1.25
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
6	信托投资	0.00	0.00
7	银行存款	152,055.50	0.05
8	其他资产	278,533,418.67	98.70
9	资产合计	282,209,521.71	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(%)
970125	银河优选六个月持有期债券型	3,044,795.25	3,276,504.17	1.16
006902	长盛安鑫中短债 A	223,162.93	246,483.46	0.09
004137	博时合惠货币 B	1,059.91	1,059.91	0.00

(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 100.10%

(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

利率债方面：10月，市场主线为特殊再融资债和1万亿国债增发落地，供给冲击，资金面处于紧平衡状态，整体利率上行，曲线熊平；11月下旬，央行重提金融防空转，市场对于跨年资金面较为担忧，债市防御心态较重；12月中旬后，市场主线为中央经济工作会议落地后刺激政策落空+银行存款利率下调+央行大量MLF投放，引发长端利率对经济复苏依然偏弱、政策利率下行的重新定价。同时在对2024年降准降息和跨年后资金面宽松的预期下，短端提前抢跑，整体利率震荡下行，曲线呈现牛陡。截至12月末，10年国债位于2.55%，高于MLF5bp。

信用债方面：7月份政治局会议要求“制定实施一揽子化债计划”，10月份重启特殊再融资券发行，35号文提出严控债务风险底线。多项政策密集出台的背景下，高票息城投供给缩量，城投下沉成为市场主流策略。在资金追逐下，信用利差、评级利差、期限利差全面收敛，城投各个区域及主体利差洼地均被抹平。

四季度，产品配置以固收小集合为主，同时均衡配置部分公募中短债基、保险资管计划等中低风险产品，维持产品净值稳步上涨。

(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星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划本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

无。

(二) 重大关联交易情况

报告期内，本产品投资了银河金汇证券资产管理有限公司管理的产品，管理人已于2023年10月13日、10月19日、10月24日、11月21日在公司官网披露相关公告。

具体投资产品情况如下表：

序号	投资产品名称
1	银河水星中短债 2 号集合资产管理计划
2	银河水星中短债 1 号集合资产管理计划
3	银河盛汇尊享 3 号集合资产管理计划
4	银河盛汇 18 号集合资产管理计划

5	银河水星添利 1 号集合资产管理计划
6	银河恒汇信用增强 3 号集合资产管理计划

(三) 报告期内其他事项说明

自 2023 年 12 月 14 日起，新任吴剑飞为公司执行委员会主任，新任王青、王东、杨柳、魏琦、牟珊珊为公司执行委员会委员。

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

2024 年 01 月 31 日