

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

报告期间：2023 年 01 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)	12,357,254.57
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

回顾 2023 年，依据 10 年期国债收益率走势债券市场总体可分为四个阶段。第一阶段为 1、2 月，经济数据和信贷数据改善明显，但复苏预期并未增强，债市未出现超预期利好，债券市场以震荡为主。第二阶段为 3-8 月份，经济基本面和资金面对债券市场先后出现超预期利好，10 年期国债收益率最低下行 2.54%，债券市场呈现“牛陡”态势。第三阶段为 9、10 月份，债市出现阶段性调整，稳汇率叠加资金空转等因素驱动，资金面超预期收紧，同时稳增长政策干扰，债券市场呈现“熊平”态势。第四阶段为 11、12 月份，货币政策宽松超预期，资金面边际转松，债券市场收益率再度进入下行通道。2023 年度，本产品以配置固收小集合为主，同时择时配置部分高等级信用债、公募中短债基、保险资管计划等收益相对稳健型产品，充分保障资产安全性与流动性的前提下，产品净值稳步增长。

展望 2024 年，上半年经济基本面大概率延续弱修复，制造业韧性有望维持，地产投资销售可能继续磨底，财政发力的持续性和实物工作量有待进一步观察；同时 2024 年上半年，欧美央行或将继续维持高利率，对我国出口支撑作用减弱。下半年经济可能会有向好回升势头，主因：一是美联储和欧洲央行下半年可能开启降息周期，欧美经济软着陆，外需有所改善，可能支撑我国出口；二是随着保障性住房建设、城中村改造、平急两用公共基础设施建设三大工程的落地实施，国内房地产行业对经济的拖累作用可能有所减弱。但是整体上，在新旧动能转换的周期中，经济内生动能可能依然不足，经济向好回升的强度依然不强。

货币政策方面：2023 年 10 月召开的中央金融工作会议提出，“始终保持货币政策的稳健性，更加注重做好跨周期和逆周期调节，充实货币政策工具箱”。预计 2024 年流动性整体仍将维持平稳宽松的状态，降准降息可能都在路上。央行将配合积极的财政政策托底经济，支持国债大量发行、地方政府化债和民企融资，进行逆周期调控；同时帮助经济新动能渐成气候，接棒房地产成为中国经济的支柱，实现跨周期发展。整体货币环境有望延续宽松态势，但要关注央行对资金空转的相关表述。

债券市场方面，2024 年上半年从宏观层面来看，债市环境偏利多，信用环境也有望维持稳定，供需矛盾下信用债“资产荒”或将进一步演绎。城投债方面，

预计一揽子化债仍为城投市场主线，在城投监管政策收紧的背景下，“遏增量”与“控存量”将限制城投债供给，短期内预计供小于需的格局难以改变，信用利差可能持续维持低位震荡。

综上，2024 年度我们的投资策略是在保障产品安全性与流动性的前提下，紧密跟踪经济基本面、货币政策动向和资金面的变化，把握利率波动节奏，适当调整产品久期及高等级信用债、公募债基的占比，选取相对收益稳健型产品进行投资，控制产品回撤，争取为客户获取良好的投资收益。

### (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本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） 2023 年 12 月 31 日	上年度末（元） 2022 年 12 月 31 日
银行存款	152,055.50	84,707.19
结算备付金	178,270.04	14,338.63
存出保证金	8,656.59	5,370.31
衍生金融资产	0.00	0.00
交易性金融资产	281,870,539.58	106,844,755.20
买入返售金融资产	0.00	10,204,889.21
发放贷款和垫款	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00
应收清算款	0.00	100,831.24
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
	0.00	0.00
	0.00	0.00
	0.00	0.00
	0.00	0.00
	0.00	0.00
	0.00	0.00
资产总计:	282,209,521.71	117,254,891.78
负债和净资产	本报告期末（元） 2023 年 12 月 31 日	上年度末（元） 2022 年 12 月 31 日
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00

衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	198,800.11	68,941.97
应付托管费	19,880.04	6,894.18
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	590.00	2,287.30
应付投资顾问费	0.00	0.00
应交税费	5,694.11	2,934.86
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	49,318.11	19,024.97
负债合计	274,282.37	100,083.28
实收基金	263,545,222.30	113,858,875.70
其他综合收益	0.00	0.00
未分配利润	18,390,017.04	3,295,932.80
所有者权益合计	281,935,239.34	117,154,808.50
负债与持有人权益总计:	282,209,521.71	117,254,891.78

(二) 利润表

项目	本期 (元)
	2023年01月01日至2023年12月31日
一、营业总收入	13,129,704.01
利息收入	34,215.57
投资收益 (损失以“-”填列)	7,700,786.05
其中: 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00
公允价值变动收益 (损失以“-”填列)	5,394,702.39
汇兑收益 (损失以“-”填列)	0.00
其他业务收入	0.00
二、营业总支出	772,449.44
管理人报酬	655,302.58
托管费	65,530.24
销售服务费	0.00
投资顾问费	0.00
利息支出	0.00
其中: 卖出回购金融资产利息支出	0.00
信用减值损失	0.00
税金及附加	2,298.51
其他费用	49,318.11

三、利润总额	12,357,254.57
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	12,357,254.57
五、其他综合收益的税后净额	0.00
六、综合收益总额	12,357,254.57

## 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	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。

## 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

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

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，涉及关联交易的具体情况详见管理人已于公司官网披露的相关公告。

## (三)报告期内其他事项说明

1、自 2023 年 3 月 9 日起，公司董事长及法定代表人变更为杜鹏飞先生。合规总监和首席风险官变更为潘多亮先生。魏琦女士代任公司总经理。

2、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。

3、自 2023 年 8 月 11 日起，公司总经理变更为王青女士。公司首席风险官变更为王东先生。

4、自 2023 年 8 月 31 日起，公司合规总监变更为杨柳女士。

5、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。

6、本报告期内，2023 年 9 月 1 日发生合同变更，签署《银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划补充协议》。

## 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

2024 年 04 月 30 日