

银河基金-金银 1 号集合资产管理计划 2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

资产管理计划管理人：银河基金管理有限公司

资产管理计划托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 07 月 19 日

§ 1 重要提示

资产管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

资产托管人上海银行股份有限公司根据本计划合同规定，于 2024 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用专户资产，但不保证专户资产一定盈利。

专户产品的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划的投资说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 资产管理计划资产概况

| | |
|----------------|---|
| 资产管理计划简称 | 银河基金-金银 1 号集合资产管理计划 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 158155 |
| 前端交易代码 | - |
| 后端交易代码 | - |
| 资产管理计划运作方式 | 契约型开放式 |
| 资产管理计划合同生效日 | 2023 年 2 月 8 日 |
| 报告期末资产管理计划份额总额 | 82,400,540.83 份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险与追求计划资产稳定增值的前提下，力争为各投资者谋求与其风险公正匹配的投资回报。 |
| 投资策略 | 1、优化配置策略 根据本资产管理计划的投资目标和管理风格，分析符合投资标准的债券的各种量化指标，包括预期收益指标、预期风险指标、流动性指标等，利用模型确定投资组合配置比例，实现既定条件下投资收益的最优化。 |

| | |
|--|--|
| | <p>2、个券选择策略</p> <p>本资产管理计划认为普通债券，如国债、金融债、企业债、公司债等的估值，主要基于收益率曲线的拟合。在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并找出因投资者偏好、资金供求、流动性、信用利差等导致债券价格偏离的原因；同时，基于收益率曲线判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，选择出估值较低的债券品种。</p> <p>3、现金流管理策略</p> <p>统计和预测市场交易数据和产品未来现金流，并在投资组合配置中考虑这些因素，使投资组合具有充分的流动性，满足未来产品运作的要求。本资产管理计划的流动性管理主要体现在交易金额控制和久期控制三个方面。</p> <p>4、股票多头策略</p> <p>根据对经济基本面和政策面的深入研判，把握 A 股市场系统性机会，采取自上而下与自下而上相结合的方式，挖掘景气行业具有较高性价比和成长性的个股，并通过量化分析权益市场的投资者结构、资金仓位以及市场情绪等来判断市场位置，合理调整仓位与组合配置。</p> <p>5、国债期货套保套利策略</p> <p>期现套保：根据持仓利率债久期及数量，放空相应远期合约以对冲利率波动风险。</p> <p>期现套利：监控国债期货与现货之间的基差，当存在套利空间时，买入现货，卖出期货，赚取国债期货与现货之间的基差收敛带来的净价收益以及持有现货的利息收益，并通过回购融资提高资金使用效率。</p> <p>跨期套利：在同一国债期货的不同期限合约上建立反向头寸，当价差向预期的方向变动时实现盈利。</p> <p>跨品种套利：在不同国债期货品种之间的套利（目前市场可操作的为 5 年期国债期货与 10 年期国债期货之间的套利）。在不同的国债期货品种之间建立反向头寸，当价差向预期方向变动时实现盈利。</p> <p>6、可转债、可交换债策略</p> <p>可转债、可交换债资产具有债权和期权的双重属性，相对普通债券具有更高的弹性。从条款、基本面、股性与债性、估值等方面分析可转债（可交换债）的投资价值，挖掘具有估值优势或成长预期的个券，同时，结合条款博弈策略、转股套</p> |
|--|--|

| | |
|-----------|--|
| | 利策略等做出投资决策。 7、权益类证券投资基金策略 采取定量与定性相结合的分析方法综合筛选投资风格鲜明、业绩卓越的公募权益类证券投资基金产品，作为投资标的备选池，并适时调整各产品的比例，以实现权益类资产的分散化投资以及策略补充。 |
| 业绩比较基准 | 本计划的业绩比较基准为同期中证全债指数收益率*95%+沪深 300 指数收益率*5%。 |
| 风险收益特征 | 本计划具有中低风险特征，适合风险等级为【C2】或以上的投资者。 |
| 资产管理计划管理人 | 银河基金管理有限公司 |
| 资产管理计划托管人 | 上海银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和资产管理计划净值表

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日） |
|---------------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 652, 679. 49 |
| 2. 本期利润 | 827, 904. 87 |
| 3. 加权平均资产管理计划份额本期利润 | 0. 0128 |
| 4. 期末资产管理计划资产净值 | 87, 920, 831. 60 |
| 5. 期末资产管理计划份额净值 | 1. 067 |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和减值准备后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 资产管理计划净值表现

3.2.1 本报告期资产管理计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

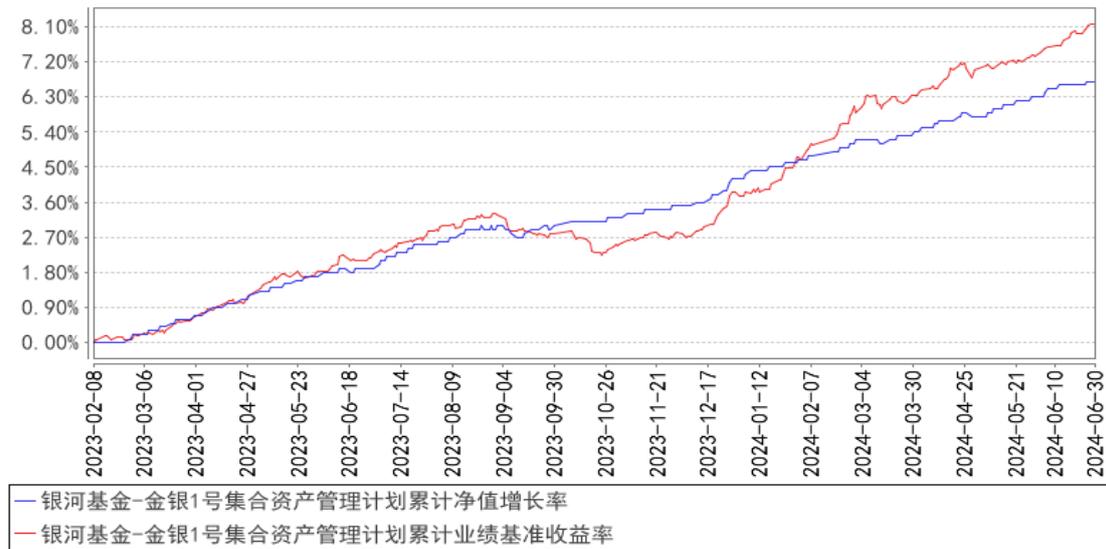
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 | ①—③ | ②—④ |
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| | | | | 准差④ | | |
| 过去三个月 | 1.23% | 0.04% | 1.72% | 0.07% | -0.49% | -0.03% |

注：中证全债指数收益率×95%+沪深 300 指数收益率×5%

3.2.2 自资产管理计划合同生效以来资产管理计划累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

银河基金-金银1号集合资产管理计划累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 资产管理计划经理（或资产管理计划经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本资产管理计划的资产管理计划经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|---------------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 叶佳波 | 投资经理 | 2023年2月8日 | - | 9年 | 硕士研究生学历，9年证券从业经历。历任富安达基金专户经理、富安达资产项目经理助理、鹏华资产资管五部高级经理。2019年9月加入银河基金管理有限公司，现任专户投资部总监助理、投资经理。 |

注：1、上表中任职日期为我公司作出决定之日。

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.2 管理人对报告期内本资产管理计划运作遵规守信情况的说明

资产管理人声明: 在本报告期内, 本资产管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》等有关法律法规的规定以及本特定客户资产管理合同等相关法律文件的约定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托财产, 在严格控制风险的前提下, 为资产委托人谋求最大利益。本报告期内, 本委托资产运作整体合法合规, 无损害资产委托人利益的行为。委托资产的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 公司旗下管理的所有投资组合严格执行相关法律法规及公司制度, 在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实, 确保公平对待不同投资组合。同时, 公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析。

针对同向交易部分, 本报告期内, 公司对旗下管理的所有投资组合(完全复制的指数基金除外), 连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公开竞价交易的证券进行了价差分析, 并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析, 未发现重大异常情况。

针对反向交易部分, 公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易(包括股票和债券)的交易时间、交易价格进行了梳理和分析, 未发现重大异常情况。本报告期内, 不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况(完全复制的指数基金除外)。

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易, 各投资组合经理均严格按照制度规定, 事前确定好申购价格和数量, 按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 未发现本投资组合与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内资产管理计划投资策略和运作分析

回顾 2024 年二季度, 全球经济温和增长, 通胀压力有所缓解, 除美联储外, 其他发达

经济体央行已经陆续开启降息，美国经济数据和就业韧性好于预期，再通胀风险仍存，降息预期不断被修正。国内消费和 PMI 在 4-5 月份有一定季节性脉冲，但是社融持续收缩，政府债券发行不及预期，影响了市场供需格局及交易情绪。地产松绑政策频出，带动二手房成交量脉冲式提升，需要进一步观察量价是否企稳。进出口、服务消费和制造业正逐步成为经济支撑，但是也面临着需求偏弱，地方政府债务约束加大，基建后继乏力等困难与挑战。

具体来看，债市方面，虽然政策利率和资金价格维持相对高位，但是流动性持续稳定充裕，供需缺口进一步走阔，资产荒加剧，总体仍处于牛市趋势当中。尽管对长债利率风险和利率曲线过于平滑存在担忧，但市场流动性并没有实质性转向，且市场杠杆率不高，普遍保持谨慎乐观。转债市场在权益市场走弱后，进一步下行，脆弱的流动性叠加对中小盘正股退市的担忧，催生部分双低转债发生较大幅度回撤。

展望 2024 年三季度，在外需方面，虽然进出口数据持续回升，但地缘摩擦不断，贸易保护主义盛行，随着通胀压力回落，海外大选逐步落幕，预计下半年出口摩擦可能加剧。内需方面，居民资产负债表衰退仍有隐忧，预期走弱影响终端消费，下游竞争格局加剧或进一步向上传导。从领先指标来看，经济总体仍要固本培元，需要财政与货币政策的双管齐下，因此，资产荒背后的供需格局短期或仍难以打破，叠加禁止手工补息带来的理财资金回流，影响可能还将持续一段时间。因此债市总体仍然顺风，在趋势中可顺势而为。但需要密切关注三季度政策面的变化，和央行公开市场操作对供需格局的影响与改变，保持组合的灵活性，便于快速调整。

4.5 报告期内资产管理计划的业绩表现

截至本报告期末银河基金-金银1号集合资产管理计划基金份额净值为 1.067 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.23%；同期业绩比较基准收益率为 1.72%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占资产管理计划总资产的比例（%） |
|----|--------|----------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 13,800.00 | 0.01 |
| | 其中：股票 | 13,800.00 | 0.01 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 130,999,636.41 | 98.17 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中： 债券 | 130,999,636.41 | 98.17 |
| | 资产支持证券 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,195,779.68 | 0.90 |
| 8 | 其他资产 | 1,233,641.44 | 0.92 |
| 9 | 合计 | 133,442,857.53 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占资产管理计划资产净值比例（%） |
|----|------------------|-----------|------------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 13,800.00 | 0.02 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|-----------|------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 13,800.00 | 0.02 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本资管计划本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占资产管理计划资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|-----------|------------------|
| 1 | 600297 | 广汇汽车 | 20,000 | 13,800.00 | 0.02 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占资产管理计划资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|------------------|
| 1 | 国家债券 | 1,307,637.51 | 1.49 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 6,390,901.64 | 7.27 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,292,901.64 | 1.47 |
| 4 | 企业债券 | 53,940,864.69 | 61.35 |
| 5 | 企业短期融资券 | 6,011,753.42 | 6.84 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 431,422.99 | 0.49 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 62,917,056.16 | 71.56 |

| | | | |
|----|----|----------------|--------|
| 10 | 合计 | 130,999,636.41 | 149.00 |
|----|----|----------------|--------|

5.5 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占资产管理计划资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|------------|---------------|------------------|
| 1 | 250376 | 23 西投 01 | 120,000.00 | 12,682,241.10 | 14.42 |
| 2 | 196557 | G21 万盛 4 | 100,000.00 | 10,723,000.00 | 12.20 |
| 3 | 162331 | 19 渝合 01 | 100,000.00 | 10,543,465.75 | 11.99 |
| 4 | 188152 | 21 安租 06 | 100,000.00 | 10,100,383.56 | 11.49 |
| 5 | 163612 | 20 长控 01 | 100,000.00 | 10,020,679.45 | 11.40 |

5.6 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本资管计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本资管计划本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本资管计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本资产管理计划投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

二季度，久期策略占优，长端利率下行较快，因此拉长了组合久期，但考虑到经济持续的温和复苏，且汇率压力不减，利率曲线过于平坦化会加剧交易的拥挤度和脆弱性，因此同步做了一定仓位的国债期货对冲防御，在现券获得较好下行收益的同时，对冲敞口有少量负贡献，符合策略预期。

5.9.2 报告期末本资产管理计划投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动 | 风险指标说明 |
|----|----|----------|---------|--------|--------|
|----|----|----------|---------|--------|--------|

| | | | | (元) | |
|-------------------|------------------|-----|----------------|------------|------------|
| T2409 | 10年期国债期货 2409 | -11 | -11,589,600.00 | -92,502.88 | - |
| T2503 | 10年期国债期货 2503 | 3 | 3,153,300.00 | 16,450.00 | - |
| TS2412 | 2年期国债期货 2412 | 3 | 6,115,680.00 | 5,680.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -70,372.88 |
| 国债期货投资本期收益(元) | | | | | -7,028.76 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -55,188.06 |

5.9.3 本期国债期货投资评价

二季度，久期策略占优，长端利率下行较快，因此拉长了组合久期，但考虑到经济持续的温和复苏，且汇率压力不减，利率曲线过于平坦化会加剧交易的拥挤度和脆弱性，因此同步做了一定仓位的国债期货对冲防御，在现券获得较好下行收益的同时，对冲敞口有少量负贡献，符合策略预期。

5.10 报告期末本资产管理计划投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 本资产管理计划投资股指期货的交易情况

本计划未投资股指期货。

5.10.2 本资产管理计划投资股指期货的投资政策

本计划未投资股指期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本资产管理计划投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本计划投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 资产管理计划投资的前十名股票超出资产管理计划合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本计划投资的前十名股票中没有在资产管理计划合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 240,086.45 |
| 2 | 应收证券清算款 | 992,374.99 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,180.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,233,641.44 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占资产管理计划资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|-----------|------------------|
| 1 | 127018 | 本钢转债 | 99,875.70 | 0.11 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 99,249.04 | 0.11 |
| 3 | 110047 | 山鹰转债 | 94,774.66 | 0.11 |
| 4 | 123128 | 首华转债 | 56,610.41 | 0.06 |
| 5 | 127046 | 百润转债 | 32,461.03 | 0.04 |
| 6 | 113655 | 欧22转债 | 21,602.41 | 0.02 |
| 7 | 110072 | 广汇转债 | 16,206.82 | 0.02 |
| 8 | 128129 | 青农转债 | 10,642.92 | 0.01 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式资产管理计划份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|---------------|
| 报告期期初资产管理计划份额总额 | 39,567,319.42 |
| 报告期期间资产管理计划总申购份额 | 42,833,221.41 |
| 减：报告期期间资产管理计划总赎回份额 | - |
| 报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末资产管理计划份额总额 | 82,400,540.83 |

§ 7 资产管理计划管理人运用固有资金投资本资产管理计划情况

7.1 资产管理计划管理人持有本资产管理计划份额变动情况

管理人本报告期末未运用固有资金投资本计划。

7.2 资产管理计划管理人运用固有资金投资本资产管理计划交易明细

管理人本报告期末未运用固有资金投资本计划。

§ 8 资产管理计划的费用情况

8.1 资产管理人的固定管理费

注：本计划的管理费按前一日资产管理计划财产净值的年费率计提。

计算方法如下：

本资产管理计划年管理费率为 0.6%

$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$,

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日资产管理计划资产净值

本计划管理费自本计划成立日起，每日计提，按自然季支付。由资产管理人于次季度首日起 5 个工作日内向资产托管人发送资产管理计划管理费划付指令，经资产托管人复核后于从资产管理计划中一次性支付给资产管理人。

8.2 资产管理人的业绩报酬

资产管理人按每笔参与份额分别考核并计提业绩报酬，业绩报酬计提基准日为开放日或计划终止日（含提前终止），管理人将从退出金额或清算财产中收取。业绩报酬计提期间为份额注册日（即认购份额为产品成立日，参与份额为份额确认日）至退出确认日（不含当日）或计划终止日（不含当日），期间可能涵盖多个周期，业绩报酬的计算将会综合考虑不同周期的业绩报酬计提基准的影响。

本计划首个业绩比较周期业绩的报酬计提基准为：4.0%/年，管理人可以在本计划每开放期前以公告的形式调整业绩报酬计提基准，两次调整间隔时间不低于 6 个月。

具体计算方法如下：

R 为该笔份额参考其份额注册日起至业绩报酬计提基准日所经历的 n 个周期计提基准所得的总超额收益率，详细计算方法为：

$$R = \sum_{k=1}^n [(R_k - r_k) \times \frac{D_k}{\text{当年实际天数}}]$$

R_k 为该笔份额所经历的 n 个周期中第 k 个周期年化收益率；

r_k 为该笔份额所经历的 n 个周期中第 k 个周期业绩报酬计提基准；

D_k 为上述的第 k 个周期初至第 k 个周期末的实际持有天数；

另外：

$$R_k = \frac{P_{t,k} - P_{0,k}^*}{P_0} \times \frac{\text{当年实际天数}}{D_k} \times 100\%$$

P_0 为该笔份额的份额注册日份额净值；

$P_{t,k}$ 为上述的第 k 个周期末累计份额净值；

$P_{0,k}^*$ 为上述的第 k 个周期初累计份额净值；

| | |
|------------|--------------------------------------|
| 总超额收益率区间 | 业绩报酬 |
| $R > 0$ | $B = P_0 \times S \times l \times R$ |
| $R \leq 0$ | $B = 0$ |

其中：

B 为该笔份额计提的业绩报酬值；

S 为该笔份额数；

l 为业绩报酬计提比例，本计划业绩报酬计提比例为 30%；

业绩报酬由资产管理人负责计算。每个退出确认日或清盘处理日后 15 个工作日内由资产管理人向资产托管人发送业绩报酬划款指令，资产托管人根据指令于 3 个工作日内从资产管理计划财产中支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期相应顺延至该日后第一个工作日，若遇不可抗力或计划财产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

8.3 资产托管人的托管费

注：本计划的托管费按前一日资产管理计划财产净值的年费率计提。

计算方法如下：

本资产管理计划年托管费率为 0.01%

$H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$ ，

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日资产管理计划资产净值

本资产管理计划托管费自本计划成立日起，每日计提，按自然季支付。由资产管理人于次季度首日起 5 个工作日内向资产托管人发送资产管理计划托管费划付指令，经资产托管人复核后从资产管理计划财产中一次性支付给资产托管人。

8.4 投资顾问的投资顾问费

注：本资产管理计划无投资顾问费。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

本计划本报告期末，资产管理人实际控制人持有本计划份额 32,195,121.95 份，资产管理人从业人员持有本计划份额 482,160.08 份。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准银河基金-金银1号集合资产管理计划的备案文件；
2. 《银河基金-金银1号集合资产管理计划资产管理合同》；
3. 中国证监会核准银河基金管理有限公司从事特定资产管理业务的文件；
4. 银河基金-金银1号集合资产管理计划财务报表及报表附注。

10.2 存放地点

上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼22楼

10.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本计划管理人银河基金管理有限公司，咨询电话：
(021) 38568516

银河基金管理有限公司

2024年07月19日