银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资 产管理计划 2024 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：2024 年 01 月 01 日-2024 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)	446,555,147.60
本期利润(元)	15,001,472.68
份额净值(元)	1.1077
份额累计净值(元)	1.1077

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	56,420,382.24	12.17
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	-	-
7	银行存款	17,142,143.51	3.70
8	其他资产	390,178,836.47	84.14
9	资产合计	463,741,362.22	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 (%)
008108	国联安短债债券 A	8,469,199.42	9,073,900.26	2.03
970201	银河水星聚利中短债债券 A	6,718,034.15	7,096,259.47	1.59
006677	中银稳汇短	5,661,375.66	6,147,121.69	1.38

	债债券 A			
005079	兴银鑫日享短债债券 A	4,888,388.55	5,332,743.07	1.19
006545	兴银中短债债券 A	2,531,402.48	3,102,233.74	0.69

(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 103.85%

(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 年加入银河金汇固定收益投资部，从事投资管理工作，现任银河金汇多资产投资部负责人。具备证券和基金从业资格，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，硕士，2015 年 7 月加入银河金汇证券资产管理有限公司。先后任职于固定收益投资部、公募投资一部，现任职多资产投资部投资经理，从事投资管理工作。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

债券方面：宏观经济方面，2024 年总体上维持出口、生产偏强，消费偏弱，通胀回升缓慢。年初经济数据空窗期，市场延续了去年底以来对经济趋势下行的悲观预期。一季度经济数据好于预期，PMI 连续 2 个月回升到扩张区间，市场预期有所修正。二季度经济基本面开始略有下行，金融数据因为防空转而超预期下滑，资金面持续宽松。二季度的政策加码力度不足，导致三季度基本面进一步

不达预期，9月底政治局会议边际改变了市场对楼市股市以及财政发力的预期，带动四季度经济企稳、但物价压力尚未缓解。货币政策方面，上半年受制于汇率压力，央行在2月降准和降LPR之后政策利率维持不变，直到三中全会后、同时美联储降息概率较大情况下、央行7月降息，又在9月下旬进一步降息降准、推出支持股市楼市工具，同时三季度开始央行逐步开展国债买卖和买断式回购作为流动性投放的新工具。财政政策方面，上半年地方政府债的发行节奏持续低于预期、导致市场资产荒持续，三季度地方政府债发行加速，11月人大批准财政部新一轮化债方案，四季度地方置换债快速集中发行完成。债市表现方面，9月下旬由于金融三部委、政治局两大重要会议，短时间内市场风险偏好急剧转变，债市利率承压；10月后进入横盘震荡，地方置换债集中供给亦未带来明显冲击，债市利率有所修复；12月随着政治局会议定调适度宽松的货币政策，以及财政政策以化债为主、增量偏慢的预期下，债市利率再快速下行。操作方面，报告期内，FOF产品通过配置不同策略、低相关性的资产控制组合波动率，降低回撤，同时抓住市场的交易性机会，力争在净值上实现稳健回报。

2025年经济和市场展望经济基本面展望。2025年，经济基本面预计仍将保持较强的韧性。尽管面临外部环境的不确定性，国内经济在促民生、稳增长的宏观政策背景下，预计将维持稳健的增长态势。财政政策方面，有望加大力度并提高效率，实施更为积极的财政政策。为了配合积极的财政政策，货币政策预计将保持适度宽松，以支持经济增长。利率走势在财政政策和货币政策的双重作用下，广谱利率水平预计将呈现稳中有降的态势。然而，当前债券市场的利率水平已处于历史低位，市场波动可能会放大。组合上仍以控制波动为首要目标，同时积极扩大资产边际，提升组合资产的多样性，抓住市场机会，力争在净值上实现稳健回报。

(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 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	上年度末
银行存款	17,142,143.51	152,055.50
结算备付金	0.00	178,270.04
存出保证金	0.00	8,656.59

衍生金融资产	0.00	0.00
交易性金融资产	446,498,424.93	281,870,539.58
买入返售金融资产	0.00	0.00
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	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	793.78	0.00
应收申购款	100,000.00	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:	463,741,362.22	282,209,521.71
负债和净资产	本报告期末	上年度末
	-	-
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	16,868,774.61	0.00
应付管理人报酬	233,040.77	198,800.11
应付托管费	23,304.11	19,880.04
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	590.00	590.00
应付投资顾问费	0.00	0.00
应交税费	0.00	5,694.11
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	60,505.13	49,318.11
负债合计	17,186,214.62	274,282.37
实收基金	403,133,774.76	263,545,222.30
其他综合收益	0.00	0.00
未分配利润	43,421,372.84	18,390,017.04
所有者权益合计	446,555,147.60	281,935,239.34
负债与持有人权益总计:	463,741,362.22	282,209,521.71

(二) 利润表

项目	本期
	-
一、营业总收入	16,082,409.16
利息收入	6,336.21
投资收益（损失以“-”填列）	6,375,630.33
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）	9,700,442.62
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	1,080,936.48
管理人报酬	927,619.35
托管费	92,762.00
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	0.00
其他费用	60,555.13
三、利润总额	15,001,472.68
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	15,001,472.68
五、其他综合收益的税后净额	0.00
六、综合收益总额	15,001,472.68

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

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，涉及关联交易的具体情况详见管理人公司官网披露的相关公告。

(三) 报告期内其他事项说明

1. 本报告期内，本计划管理人于 2024 年 2 月 8 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2024 年 2 月 26 日起，刘冰不再担任公司董事长，吴剑飞新任公司董事长。

2. 本报告期内，本计划管理人于 2024 年 6 月 29 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2024 年 6 月 27 日起，王青不再担任公司总经理和法定代表人，吴剑飞新任公司总经理和法定代表人。

3. 本报告期内，本计划管理人于 2024 年 7 月 13 日披露了《银河金汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2024 年 7 月 11 日起，王东不再担任公司首席风险官，史慧婷新任公司首席风险官。

4. 本报告期内，2024 年 10 月 25 日在公司网站公布《银河金汇证券资产管理有限公司关于董事变更的公告》。

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

2025 年 04 月 30 日