

# 银河安益 FOF 集合资产管理计划

## 2025 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：兴业银行股份有限公司

报告期间：2025 年 04 月 01 日-2025 年 06 月 30 日

## 一、基本信息

资产管理计划名称:	银河安益 FOF 集合资产管理计划
资产管理计划成立时间:	2025-03-03
管理人:	银河金汇证券资产管理有限公司
托管人:	兴业银行股份有限公司

## 二、资产管理计划投资表现

	本期末
期末资产净值(元)	4,402,108.04
本期利润(元)	357,093.80
份额净值(元)	1.1919
份额累计净值(元)	1.1919

## 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	4,329,285.49	97.91
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	82,643.30	1.87
8	其他资产	9,549.36	0.22
9	资产合计	4,421,478.15	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(%)
013328	嘉实全球价值股票(QDII)人民币	823,207.31	1,081,776.73	24.57
001668	汇添富全球互联混合(QDII)	265,935.00	1,080,733.25	24.55
518880	华安黄金易(ETF)	50,500.00	369,357.00	8.39
016701	银华海外数字经济量化选股混合发起式(QDII)A	233,800.00	365,522.92	8.30

008694	平安元盛超短债 A	290,000.00	330,107.00	7.50
--------	-----------	------------	------------	------

(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 100.44%。

(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

赵满思，硕士，2014 年加入银河金汇证券资产管理有限公司，曾担任多只产品投资助理、投资经理。已取得证券从业资格、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。目前主要从事 FOF 类产品的投资以及基金的研究工作。

(二) 投资策略回顾与展望

二季度全球市场在关税政策、美联储鹰派转向、地缘冲突反复及亚洲政策刺激中剧烈分化。美股方面，美联储 6 月意外降息 25BP 但释放鹰派信号是关键转折点，引发高估值科技股震荡。AI 产业链出现分化——硬件端因 GB200 芯片交付放量维持强势，软件端因客户支出收缩显著回调。日本央行 7 月意外加息至 0.25% 终结负利率时代，叠加日元升值至 142，出口企业承压。但企业治理改革红利持续，半导体设备商受益于全球资本开支上行。欧洲部分，受到法国右翼政党选举胜利引发欧盟解体担忧，德法国债利差走阔至 85BP 压制指数。实际利率反弹压制金价，但中东冲突扩散及全球央行季度购金量达 873 吨提供支撑，震荡区间收窄至 2150-2250 美元。

本季度随着美股重回新高，本产品逢低增加欧洲、日本区域的配置，优化内部结构，进一步分散。同时，逐渐增配大中华地区配置。未来，在面临众多不确

定性，将在防御中寻找结构型机会。重点关注港股类资产的配置机会。

### (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

本托管人在履行财产托管职责过程中，严格遵守国家法律、法规及其他相关规定，诚实信用、勤勉尽责地履行了托管人职责，不存在任何违反法律法规、托管协议及损害委托人利益的行为。

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，本托管人依法对本报告中财务指标、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	本计划的年固定管理费率为【0.8】%。
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	本计划业绩报酬计提基准为10%/年，管理人对超过业绩报酬计提基准10%的超额部分提取10%作为管理人业绩报酬。
计提方式	<p>管理人按投资者每笔认购/参与份额分别计算年化收益率并按照业绩报酬计提办法计提业绩报酬。</p> <p>具体计算方法如下：</p> <p>R 为该笔份额持有期间的年化收益率；</p> <p>A 为该笔份额业绩报酬计提日集合计划的单位累计净值；</p> <p>C 为该笔份额上一业绩报酬计提日（若该笔份额无上一业绩报酬计提日的，则为集合计划成立日或投资者该笔份额参与日）集合计划的单位累计净值；</p> <p>C' 为该笔份额上一业绩报酬计提日（若该笔份额无上一业绩报酬计提日的，则为集合计划成立日或投资者该笔份额参与日）集合计划的单位净值；</p> <p>D 为该笔份额上一业绩报酬计提日（若该笔份额无上一业绩报酬计提日的，则为集合计划成立日或投资者该笔份额参与确认日（含）至本笔份额退出确认日（不含）之间的天数；</p> <p>E=该笔份额业绩报酬；</p> <p>K=业绩报酬计提日该笔份额数；</p> <p>年化收益率 <math>R = (A - C) / C' \times 365 / D \times 100\%</math>；</p> <p>业绩报酬计提标准为：</p>

	<p>年化收益率 提取比例 业绩报酬公式</p> <p><math>R \leq 10\% \quad 0 \quad 0</math></p> <p><math>R &gt; 10\% \quad 10\% \quad E = (R-10\%) \times 10\% \times C' \times K \times (D \div 365)</math></p> <p>管理人计提业绩报酬为计提日各笔业绩报酬之和，如管理人已经提取业绩报酬，即使投资者退出本计划时净值有所下跌，则该部分已提取业绩报酬亦不退还投资者。</p>
支付方式	<p>业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于 5 个交易日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，业绩报酬收款账户同管理费收款账户，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。由于涉及份额注册登记，管理人负责计算业绩报酬，托管人不复核，仅负责按照管理人出具的划款指令进行划款并配合进行账务处理。</p>

## 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

无。

### (三) 报告期内其他事项说明

无。

## 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

2025 年 07 月 31 日