

银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产 管理计划 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：银河金汇证券资产管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本集合计划管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

本集合计划托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 3 月 11 日复核了本报告中的财务指标、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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利。

本集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，本集合计划于 2021 年 9 月 28 日合同变更生效。按照相关法律法规的规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料经审计，中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 9 月 28 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	12
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§ 8 投资组合报告	38

8.1 期末基金资产组合情况	38
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	42
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
8.12 投资组合报告附注	42
§ 9 基金份额持有人信息	43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	43
§ 10 开放式基金份额变动	43
§ 11 重大事件揭示	44
11.1 基金份额持有人大会决议	44
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
11.4 基金投资策略的改变	44
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
11.8 其他重大事件	45
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	46
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	46
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 13 备查文件目录	46
13.1 备查文件目录	46
13.2 存放地点	46
13.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划
基金简称	银河安丰九个月滚动持有混合
基金主代码	970051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 28 日
基金管理人	银河金汇证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,713,918.85 份
基金合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不超过 3 年。

注：本报告所述“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河安心收益 2 号集合资产管理计划变更而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2021]1867 号文准予变更。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资金流动性的基础上，追求集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划的投资将根据对宏观经济、宏观政策走势、行业景气变化及企业经营和财务状况、债券市场走势等动态分析，在限定投资范围内，决定债券类资产、股票类资产和现金类资产的配置比例，并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期对大类资产配置比例进行调整。其他具体投资策略包括：债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略及国债期货投资策略，详见产品合同。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数收益×85%。
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合资产管理计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合资产管理计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河金汇证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	江佳文	石立平
	联系电话	010-89623246	010-63639180
	电子邮箱	jiangjiawen_yhjh@chinastock.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		010-89623098	95595
传真		010-89623270	010-63639132
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A	北京市西城区太平桥大街 25

	栋 201 室（入驻深圳前海商务秘书有限公司）	号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	北京市丰台区西营街 8 号新青海金融大厦 7 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	100073	100033
法定代表人	郭卿	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://yhjh.chinastock.com.cn
基金年度报告备置地点	集合计划管理人和托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	武汉市武昌区东湖路 169 号 2-9 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	354,362.05
本期利润	989,645.07
加权平均基金份额本期利润	0.0171
本期加权平均净值利润率	1.49%
本期基金份额净值增长率	0.97%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	39,199,085.47
期末可供分配基金份额利润	0.3673
期末基金资产净值	122,956,496.74
期末基金份额净值	1.1522
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	0.97%

注：1. 本期已实现收益指本集合计划本期利息收入、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；

2. 上述集合计划业绩指标已扣除了本集合计划的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申赎本集合计划的各项费用，计入认购或申赎本集合计划各项费用后，实际收益水平要低于所列数字；

3. 本集合计划于 2021 年 9 月 28 日生效，主要财务指标的实际计算期间为 2021 年 9 月 28 日（合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

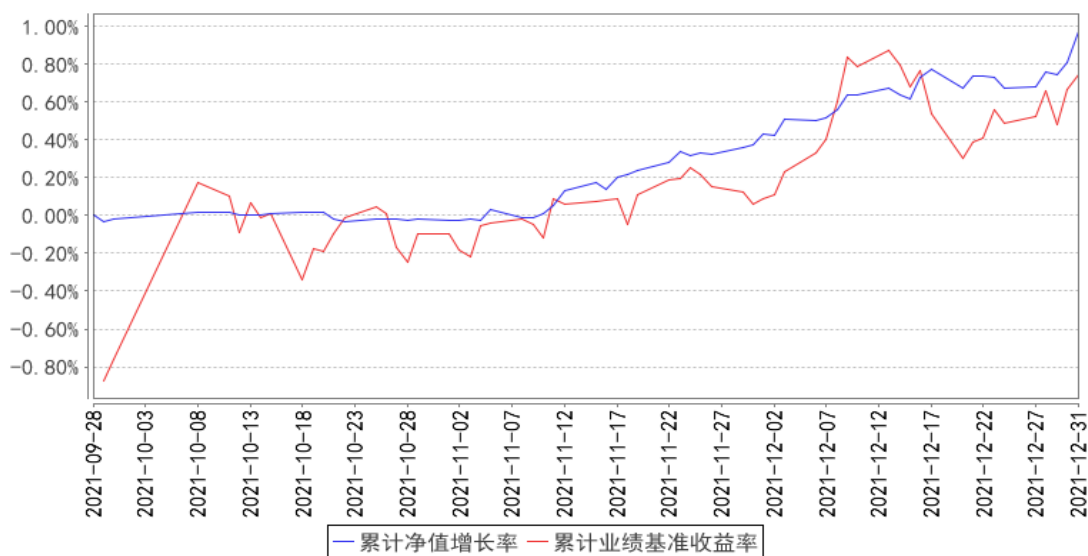
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.99%	0.04%	0.77%	0.12%	0.22%	-0.08%
自基金合同生效起至今	0.97%	0.04%	0.75%	0.12%	0.22%	-0.08%

注：本集合计划于 2021 年 9 月 28 日生效，截至本报告期末本集合计划变更生效未满一年。

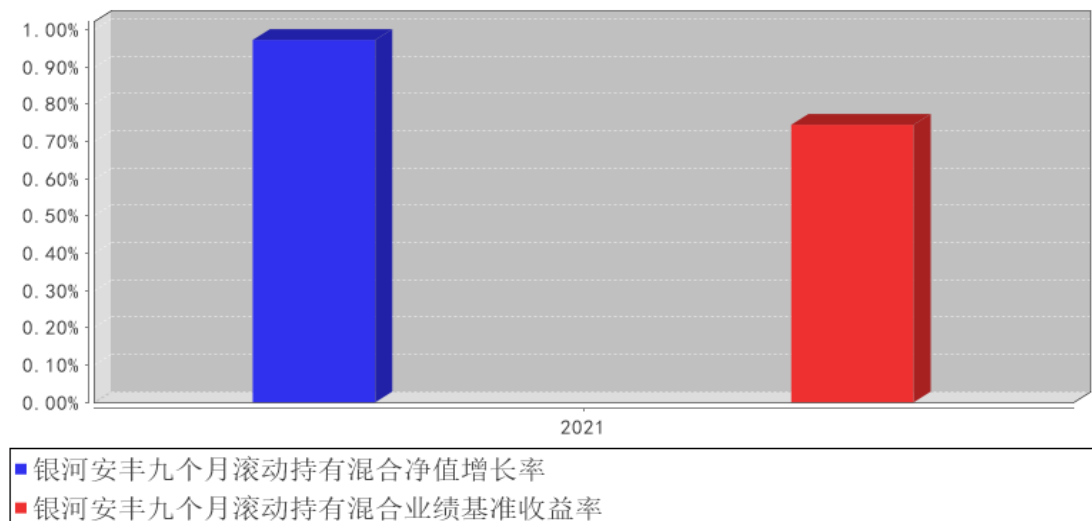
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

银河安丰九个月滚动持有混合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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银河安丰九个月滚动持有混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河金汇证券资产管理有限公司（以下简称“银河金汇资管”或“公司”）是中国银河证券股份有限公司的全资子公司，经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1556 号文批准设立，于 2014 年 4 月 25 日取得企业法人营业执照，注册资本人民币 10 亿元，注册地为深圳前海，经营范围为证券资产管理。

银河金汇证券资产管理有限公司经营证券资产管理业务，对客户受托资产实行统一管理，为客户提供多样化、专业化和个性化的资产管理服务。依托自身的业务发展优势、完善的内控制度、多元化的业务模式以及优秀的业务团队，银河金汇证券资产管理有限公司已与多家银行以及其他相关金融机构建立合作关系。

银河金汇资管根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求，截至 2021 年 12 月 31 日，旗下已有一只大集合产品完成公募化改造，为“银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李石	投资经理	2021 年 9 月 28 日	-	10 年	南开大学数学学士，金融工程硕士，多年证券从业经验。2010 年加入国信证券固定收益部，负责企业债发行、债券研究等工作。2012 年加入华夏基金固定收益部，先后任交易员、研究员、基金经理助理，协助管理多个社保、专户、年金组合。2016 年加入银河金汇证券资产管理有限公司固定收益投资部，主要从事固定收益类产品投资工作，具备证券从业资格和基金从业资格，近 3 年内没有被采取监管措施或处罚。2021 年 9 月起任银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划投资经理。

注：1. 本集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为本集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
李石	公募基金	1	122,956,496.74	2021 年 09 月 28 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	3	267,690,249.18	2021 年 03 月 08 日
	合计	4	390,646,745.92	-

注：其他组合指“银河水星 3 号月月盈集合资产管理计划”、“银河水星 5 号月月盈集合资产管理计划”、“银河优选 3 号集合资产管理计划”，均为按照《证券公司大集合资产管理业务使用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更的大集合产品。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法律法规及本集合计划合同、招募说明书等有关法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，在控制风险的基础上，为本集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害本集合计

划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本集合计划管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源，考察是否存在不公平的因素。本报告期内本集合计划严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年利率呈现下行行情，利率走势主要分为五个阶段：第一阶段（1 月-2 月），永煤事件冲击后的货币宽松到春节期间流动性冲击，债市震荡盘整，债市收益率小幅上行；第二阶段（3 月-6 月），资金面平稳，但 PPI 持续上行，市场对货币政策仍然担忧，债市收益率缓慢下行；第三阶段（7 月-8 月），央行意外降准，市场预期年内会二次降准，债市情绪较好，收益率快速下行；第四阶段（9 月-10 月），专项债发行提速，通胀预期升温，二次降准未兑现，债市收益率上行调整；第五阶段（11 月-12 月），二次降准落地，稳增长信号强烈，市场交易降息预期，债市情绪较好。2021 年，本产品以长端利率债、高等级信用债和可转债为主进行了配置，严格控制信用风险，获取稳健收益。

权益方面，考虑到产品成立初期以及我们对净值稳健增长的追求，我们对权益进行了逐步加仓，但总体保持了偏低的权益仓位。持仓结构方面，产品采取均衡、低估值的配置策略，具体体现在：一是对于新能源、半导体等市场热门赛道，考虑到其处于历史高估值分位，我们暂时未进行配置；二是布局了银行、地产、建筑等具备困境反转逻辑的行业；三是配置了通信、家电等行业景气度正在改善的相对低估值板块；四是配置了军工板块，使组合在整体保守、稳健的前提下具有一定的进攻属性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本集合计划份额净值为 1.1522 元，本报告期集合计划份额净值增长率为

0.97%，业绩比较基准收益率为 0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济：1) 投资，投资是稳增长的重要抓手，房地产政策近期有边际宽松的迹象，但整体趋势应当还是以防控为主，在稳增长的政策目标下，基建投资有望实现快速增长；2) 消费，从社会消费品零售总额的数据来看，消费依然较弱，在疫情完全控制之前，预计消费很难有明显的趋势性增长；3) 出口，2020 年和 2021 年，全球疫情爆发后，中国的动态清零政策优势明显，率先实现了疫情的有效控制，大量的海外制造业订单转移到国内，造成出口的快速增长，展望 2022 年，预计仍然会保持较好增长，但增速大概率会回落。

固收市场：在宽信用宽货币的大环境下，债市目前主要的风险点首先在于“宽信用”的传导和“稳增长”的落实情况，以及外部货币环境的冲击，包括美联储加息及缩表的进展。目前看，经济修复的压力比较大，投资、消费以及出口增速都有一定的限制，货币政策仍以宽松为主，所以 2022 年上半年债市收益率上行风险不大；下半年，随着经济逐步修复，宽信用被证实，CPI 上行，利率将逐步进入中枢抬升的周期。

权益市场：风险偏好或有所下行，一是地产下行拖累经济，虽然政策对地产行业有边际放松，但管控的大方向不会改变，房地产公司的经营目标自“利润最大化”转向“负债最小化”，预计 2022 年地产投资增速会有明显的下滑，房价悲观预期导致财富缩水担忧或将成为市场风险偏好抬升的掣肘；二是出口增速预计将下行，2021 年出口大幅增长，主要由于美联储强刺激下的蓬勃的商品需求以及国内较快恢复后承接了海外大量的转移订单，2022 年，这两个因素都在明显减弱。但也应当看到国内稳增长预期下，货币政策相对宽松，社融数据的逐月改善预示着信用环境的逐步宽松，预计权益市场整体风险偏好不会有明显的下行压力。

行业走势：我们重点看好以下几个行业投资主线：1) 高端制造，科技创新依然是未来时代发展的助推剂，我国正在从低附加值制造逐渐向微笑曲线两端拓展，重点看好受益国产替代和产业发展趋势的航空航天装备制造及材料、工业母机、工业自动化、工业机器人及减速器、控制器等关键零部件、半导体设备及材料、3D 打印设备、激光器、传感器等；2) 新能源，未来能源结构将发生大的转型和重构，双碳投资将贯穿未来 40 年，锂电池技术走向成熟的过程中快速降本增效，带动新能源汽车爆发式增长，固态电池、氢能源、甲醇燃料电池等有望从实验室或试点走向规模化应用，重点看好新能源整车、动力电池、隔膜、铜箔、热管理、电控、光伏电站、光伏 HJT 设备、风电叶片、风电轴承、碳纤维材料、核电关键设备等；3) 新消费，在共同富裕、促进内循环的大背景下，14 亿消费群体，构成规模庞大的内销市场，蕴藏着巨大的消费潜力，消费升级的整体趋势不会改变，高品质、新消费发展潜力巨大，重点看好方向：乳制品、智能家居、代糖、宠

物产业链、茶饮、家居机器人、电子烟、医美等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。合规管理方面，管理人积极跟踪法律法规变化和监管动态更新，及时向业务团队传达最新法律法规和监管政策，认真评估其对业务的影响并明确各项法规、监管要求的落实责任部门，使得管理人的从业人员知法、守法，合法合规展业；管理人不断完善内控制度建设，通过制度和流程明细合规管理要点并细化工作要求，确保在内控有效性的前提下稳健展业；继续开展合规宣导，不断增强管理员工的合规意识，促进合规文化的建设，通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训等各种多样形式，并结合最新的法律法规变化、监管政策更新及行业风险事件，加深员工对法律法规、监管政策及风险的理解，从而使得法律法规、监管政策等合规要点在管理人内部得到切实落实。风险管理方面，管理人严格落实事前严格监督审查、事中严格指标监控、事后及时分析管理的三阶段工作部署，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理和风控指标的强制合规管理，督促投研交易业务的合规开展。监察稽核方面，管理人定期和不定期开展多项内部稽核，对投资决策、投资研究、交易执行、基金销售、信息技术等关键业务和岗位进行监察监督，并关注内部控制的健全性和有效性，及时提出相应的改进性建议，促进管理人业务合规运作、稳健经营。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行集合计划估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25%以上时所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未进行收益分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本集合计划出现连续 20 个工作日（2021 年 09 月 28 日-2021 年 11 月 09 日）集合计划份额持

有人数量不满 200 人且集合计划资产净值低于 5000 万的情形。因改造合同生效后，集合计划于 2021 年 09 月 28 日-2021 年 11 月 07 日期间一直处于封闭状态，2021 年 11 月 08 日恢复开放募集并于 2021 年 11 月 10 日集合计划份额持有人数量超过 200 人且集合计划资产净值高于 5000 万元。自 2021 年 11 月 10 日后，截至报告期末，未出现连续 20 个工作日集合计划份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国光大银行股份有限公司在本集合计划的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、本集合计划合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害集合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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、本集合计划合同、托管协议和其他有关规定，对本集合计划的资产净值计算、费用开支等方面进行了认真的复核，对本集合计划的投资运作方面进行了监督，未发现集合计划管理人有损害集合计划份额持有人利益的行为。报告期内，本集合计划未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	众环审字(2022)0710011 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划全体份额持有人：
审计意见	我们审计了后附的银河金汇证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”）作为集合计划管理人的银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 9 月 28 日（合同变更生效日）至 2021 年 12 月 31 日利润表和所有者权益（集合计

	<p>划净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照财务报表附注二所述编制基础编制,公允反映了银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划于2021年12月31日的财务状况以及2021年9月28日(合同变更生效日)至2021年12月31日经营成果和集合计划净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>集合计划管理人负责按照后附的财务报表附注二所述的编制基础编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,集合计划管理人负责评估银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非集合计划管理人计划清算银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会</p>

	<p>计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对集合计划管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与集合计划管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	毛宝军 张慧
会计师事务所的地址	武汉市武昌区东湖路 169 号 2-9 层
审计报告日期	2022 年 3 月 15 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	459,160.36
结算备付金		1,603,394.25
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	118,523,212.20
其中：股票投资		10,333,092.30
基金投资		-
债券投资		104,188,119.90
资产支持证券投资		4,002,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	600,003.00
应收证券清算款		2,101,414.78
应收利息	7.4.7.5	2,358,906.68
应收股利		-
应收申购款		19,940.18
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		125,666,031.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		2,492,205.85
应付赎回款		-
应付管理人报酬		64,687.86
应付托管费		16,171.99
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	6,990.56
应交税费		54,187.27
应付利息		-423.04
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	75,714.22
负债合计		2,709,534.71
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	83,757,411.27
未分配利润	7.4.7.10	39,199,085.47
所有者权益合计		122,956,496.74
负债和所有者权益总计		125,666,031.45

注：1. 报告期截止日 2021 年 12 月 31 日，本集合计划份额净值 1.1522 元，集合计划份额总额 106713918.85 份；

2. 本集合计划合同变更生效日为 2021 年 9 月 28 日，本财务报表的实际编制期间为 2021 年 9 月 28 日至 2021 年 12 月 31 日，因此无上年度可比期间数据。

7.2 利润表

会计主体：银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 9 月 28 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		1,157,069.53
1. 利息收入		520,029.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,770.48
债券利息收入		422,141.83
资产支持证券利息收入		22,822.01
买入返售金融资产收入		64,295.34
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,756.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,766.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-6,009.90
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	635,283.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
减：二、费用		167,424.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	65,259.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	16,314.84
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,798.67
5. 利息支出		1,090.55
其中：卖出回购金融资产支出		1,090.55
6. 税金及附加		1,344.93
7. 其他费用	7.4.7.20	77,616.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		989,645.07
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		989,645.07

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 9 月 28 日，本财务报表的实际编制期间为 2021 年 9 月 28 日至 2021 年 12 月 31 日，因此无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,568,670.23	5,693,169.18	18,261,839.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	989,645.07	989,645.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	71,188,741.04	32,516,271.22	103,705,012.26
其中：1. 基金申购款	72,104,295.42	32,930,985.42	105,035,280.84
2. 基金赎回款	-915,554.38	-414,714.20	-1,330,268.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	83,757,411.27	39,199,085.47	122,956,496.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

郭卿

牟珊珊

张红雨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河安心收益 2 号集合资产管理计划变更而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2021]1867 号文准予变更，本集合计划托管人为中国光大银行股份有限公司。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企

业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的 0%-30%；投资于同业存单的比例不超过集合计划资产的 20%；投资于可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例不超过集合计划资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数收益率×85%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和集合计划净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本期财务报表的实际编制期间为 2021

年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。

本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

(3) 该金融资产已转移, 虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种, 在估值日有报价的, 除会计准则规定的例外情况外, 应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的, 应对报价进行调整, 确定公允价值。与上述投资品种相同, 但具有不同特征的, 应以相同资产或负债的公允价值为基础, 并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等, 如果该限制是针对资产持有者的, 那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外, 本集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种, 应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时, 应优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件, 使潜在估值调整对前一估值日的本集合计划资产净值的影响在 0.25% 以上的, 应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利, 且该种法定权利现在是可执行的, 同时本集合计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示, 除此以外, 金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示, 不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于本集合计划申购确认日及赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于申购确认日或赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率，在回购期内逐日计提；

(5) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 公允价值变动收益/(损失)系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配；

(2) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；投资者持有的集合计划份额（原份额）所获得的红利再投资份额的运作期起始日和运作期到期日与原份额相同；

(3) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一集合计划份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

无。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 印花税

证券（交易）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

(2) 增值税

参照财政部、税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》：资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。该通知自 2018 年 1 月 1 日起施行，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的

增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得税暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	459,160.36
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	459,160.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,987,078.88	10,333,092.30	346,013.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	63,989,808.12	64,155,919.90
	银行间市场	39,928,365.00	40,032,200.00
	合计	103,918,173.12	104,188,119.90
资产支持证券	4,000,000.00	4,002,000.00	2,000.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	117,905,252.00	118,523,212.20	617,960.20

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	600,003.00	-
银行间市场	-	-
合计	600,003.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本集合计划未持有通过买断式逆回购交易取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	168.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	793.65
应收债券利息	2,335,950.55
应收资产支持证券利息	23,506.85
应收买入返售证券利息	-1,513.19
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	2,358,906.68

7.4.7.6 其他资产

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	5,055.56
银行间市场应付交易费用	1,935.00
合计	6,990.56

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	75,714.22
合计	75,714.22

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	16,014,136.18	12,568,670.23
本期申购	91,866,684.93	72,104,295.42
本期赎回（以“-”号填列）	-1,166,902.26	-915,554.38
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	106,713,918.85	83,757,411.27

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	6,279,058.06	-585,888.88	5,693,169.18
本期利润	354,362.05	635,283.02	989,645.07
本期基金份额交易产生的变动数	35,800,184.85	-3,283,913.63	32,516,271.22
其中：基金申购款	36,257,577.64	-3,326,592.22	32,930,985.42
基金赎回款	-457,392.79	42,678.59	-414,714.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,433,604.96	-3,234,519.49	39,199,085.47

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	活期存款利息收入	
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		4,023.77
其他		-
合计		10,770.48

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	
股票投资收益——赎回差价收入		-

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,173.50

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	616,130.25
减：卖出股票成本总额	608,363.50
买卖股票差价收入	7,766.75

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,009.90
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-6,009.90

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	16,016,881.66
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,606,226.90
减：应收利息总额	416,664.66
买卖债券差价收入	-6,009.90

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本集合计划本报告期无贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本集合计划本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	635,283.02
股票投资	346,013.42
债券投资	287,269.60
资产支持证券投资	2,000.00
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	635,283.02

7.4.7.18 其他收入

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	3,863.67
银行间市场交易费用	1,935.00
合计	5,798.67

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	2,602.00
信息披露费	65,714.22
证券出借违约金	-
账户维护费	9,300.00
合计	77,616.22

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
银河金汇证券资产管理有限公司	基金管理人
中国光大银行股份有限公司	基金托管人
中国银河证券股份有限公司	基金管理人的母公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中国银河证券股份有限公司	11,211,979.38	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
中国银河证券股份有限公司	58,254,904.90	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
中国银河证券股份有限公司	603,900,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中国银河证券股份 有限公司	5,115.56	100.00	5,055.56	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，并已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期

	2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	65,259.25
其中：支付销售机构的客户维护费	19,339.22

注：支付集合计划管理人银河金汇证券资产管理有限公司的管理人报酬按前一日集合计划资产净值×0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划管理费=前一日集合计划资产净值×0.4%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,314.84

注：支付集合计划托管人中国光大银行股份有限公司的托管人报酬按前一日集合计划资产净值×0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×0.1%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 9 月 28 日）持有的基金份额	2,384,838.07
报告期初持有的基金份额	2,384,838.07
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	2,384,838.07

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.23%
-------------------------	-------

注：1. 本集合计划合同生效日为 2021 年 9 月 28 日；

2. 本集合计划管理人运用固有资金投资本集合计划的交易费用按照变更前银河安心收益 2 号集合资产管理计划资产管理合同规定的费率收取。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	459,160.36	6,746.71

注：本集合计划的银行存款由托管人保管，按适用利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末实施利润分配。

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052.SH	兴业转债	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 14 日	新发流通受限	100.00	100.00	1,430	143,000.00	143,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本集合计划无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本集合计划无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本集合计划管理人建立了由风险管理部、审计部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、审计部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划根据合同约定，投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	4,999,000.00
合计	4,999,000.00

注：1、以上列示债券不包括国债、政策性金融债、央行票据。

2、未评级债券为超短期融资券。

3、以上信用评级系根据第三方评估机构的债券评级报告确定。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有短期信用评级的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	69,402,364.40
AAA 以下	20,259,506.10
未评级	-
合计	89,661,870.50

注：1、以上列示债券不包括国债、政策性金融债、央行票据。

2、以上信用评级系根据第三方评估机构的债券评级报告确定。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	4,002,000.00
未评级	-
合计	4,002,000.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有长期信用评级的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

本集合计划的流动性风险主要表现在两方面：一是管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于个股、个券的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将债券、股票买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个股、个券的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售股票、债券。两者均可能使集合计划净值受到不利影响。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

在资产端，本集合计划主要投资于合同约定的具有良好流动性的金融工具。集合计划管理人持续监测本集合计划持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，集合计划管理人持续监测本集合计划开放期内投资者历史申购、投资者类型和结

构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持集合计划资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，集合计划管理人将采用本集合计划合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	459,160.36	-	-	-	459,160.36
结算备付金	1,603,394.25	-	-	-	1,603,394.25
交易性金融资产	47,777,524.20	51,174,966.90	9,237,628.80	10,333,092.30	118,523,212.20
买入返售金融资产	600,003.00	-	-	-	600,003.00
应收利息	-	-	-	2,358,906.68	2,358,906.68
应收申购款	-	-	-	19,940.18	19,940.18
应收证券清算款	-	-	-	2,101,414.78	2,101,414.78
资产总计	50,440,081.81	51,174,966.90	9,237,628.80	14,813,353.94	125,666,031.45
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	64,687.86	64,687.86
应付托管费	-	-	-	16,171.99	16,171.99
应付证券清算款	-	-	-	2,492,205.85	2,492,205.85
应付交易费用	-	-	-	6,990.56	6,990.56
应付利息	-	-	-	-423.04	-423.04
应交税费	-	-	-	54,187.27	54,187.27
其他负债	-	-	-	75,714.22	75,714.22
负债总计	-	-	-	2,709,534.71	2,709,534.71
利率敏感度缺口	50,440,081.81	51,174,966.90	9,237,628.80	12,103,819.23	122,956,496.74

注：表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-443,791.53
	市场利率下降 25 个基点	452,545.20

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的债券等资产损失的可能性。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本集合计划管理人对本集合计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	10,333,092.30	8.40
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	104,188,119.90	84.74
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	114,521,212.20	93.14

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准下降 5%	-341,962.76
	业绩比较基准上升 5%	341,962.76

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 11,099,636.30 元，属于第二层次的余额为人民币 107,423,575.90 元，无划分为第三层次的金融工具。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,333,092.30	8.22
	其中：股票	10,333,092.30	8.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	108,190,119.90	86.09
	其中：债券	104,188,119.90	82.91
	资产支持证券	4,002,000.00	3.18
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	600,003.00	0.48
	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	2,062,554.61	1.64
8	其他各项资产	4,480,261.64	3.57
9	合计	125,666,031.45	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	574,946.00	0.47
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,721,950.30	5.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,184,001.00	0.96
F	批发和零售业	-	-
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	1,761,299.00	1.43
K	房地产业	90,896.00	0.07
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	10,333,092.30	8.40

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	33,700	1,128,950.00	0.92
2	603516	淳中科技	45,660	925,984.80	0.75
3	603100	川仪股份	40,400	854,864.00	0.70
4	601390	中国中铁	89,800	519,942.00	0.42
5	601668	中国建筑	103,500	517,500.00	0.42
6	000725	京东方 A	97,600	492,880.00	0.40
7	300374	中铁装配	31,400	421,388.00	0.34
8	002876	三利谱	5,700	356,136.00	0.29
9	603868	飞科电器	7,525	326,735.50	0.27
10	300193	佳士科技	23,700	302,175.00	0.25
11	002041	登海种业	11,200	288,848.00	0.23
12	000998	隆平高科	12,300	286,098.00	0.23
13	002045	国光电器	17,000	255,000.00	0.21
14	000547	航天发展	12,500	208,750.00	0.17
15	002851	麦格米特	6,400	204,928.00	0.17
16	601166	兴业银行	10,500	199,920.00	0.16
17	601939	建设银行	33,000	193,380.00	0.16
18	601288	农业银行	65,200	191,688.00	0.16
19	601398	工商银行	41,200	190,756.00	0.16
20	601988	中国银行	62,200	189,710.00	0.15
21	600036	招商银行	3,800	185,098.00	0.15
22	000001	平安银行	10,800	177,984.00	0.14
23	600926	杭州银行	13,600	174,352.00	0.14

24	300503	昊志机电	13,200	169,752.00	0.14
25	002180	纳思达	3,300	157,608.00	0.13
26	600372	中航电子	6,700	150,013.00	0.12
27	601611	中国核建	14,700	146,559.00	0.12
28	601211	国泰君安	7,400	132,386.00	0.11
29	601318	中国平安	2,500	126,025.00	0.10
30	605336	帅丰电器	3,100	105,710.00	0.09
31	603187	海容冷链	2,200	104,390.00	0.08
32	000333	美的集团	1,400	103,334.00	0.08
33	600761	安徽合力	7,500	93,825.00	0.08
34	000002	万科A	4,600	90,896.00	0.07
35	000738	航发控制	2,800	84,784.00	0.07
36	002414	高德红外	3,500	84,735.00	0.07
37	600760	中航沈飞	1,000	68,040.00	0.06
38	002049	紫光国微	300	67,500.00	0.05
39	002191	劲嘉股份	3,600	54,468.00	0.04

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	1,102,237.00	0.92
2	603516	淳中科技	928,379.00	0.75
3	603100	川仪股份	775,493.00	0.70
4	000547	航天发展	693,763.00	0.42
5	601390	中国中铁	495,613.00	0.42
6	601668	中国建筑	495,463.00	0.40
7	000725	京东方A	492,198.00	0.34
8	300374	中铁装配	386,019.00	0.29
9	002876	三利谱	323,427.00	0.27
10	300193	佳士科技	307,820.00	0.25
11	603868	飞科电器	304,463.00	0.23
12	002041	登海种业	291,631.00	0.23
13	000998	隆平高科	289,525.38	0.21
14	002045	国光电器	221,510.00	0.17
15	002851	麦格米特	201,008.00	0.17
16	300503	昊志机电	192,912.00	0.16
17	601939	建设银行	191,070.00	0.16
18	601288	农业银行	191,036.00	0.16
19	601988	中国银行	190,954.00	0.16
20	601166	兴业银行	190,890.00	0.15

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000547	航天发展	484,942.00	0.39
2	002690	美亚光电	76,540.00	0.06
3	002191	劲嘉股份	55,055.00	0.04

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,595,442.38
卖出股票收入（成交）总额	616,537.00

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,527,249.40	7.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	53,719,126.50	43.69
5	企业短期融资券	4,999,000.00	4.07
6	中期票据	35,033,200.00	28.49
7	可转债（可交换债）	909,544.00	0.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	104,188,119.90	84.74

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	149730	21 广金 07	100,000	10,040,000.00	8.17
2	101901746	19 鄂联投 MTN003	80,000	8,079,200.00	6.57
3	122723	12 石油 05	70,000	7,028,700.00	5.72
4	136980	17 申证 01	60,000	6,012,000.00	4.89
5	101900115	19 上饶城投 MTN001	60,000	6,003,600.00	4.88

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	193885	招融 4 优	40,000	4,002,000.00	3.25

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本集合计划投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票中，没有投资超出集合计划合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,101,414.78
3	应收股利	-

4	应收利息	2,358,906.68
5	应收申购款	19,940.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	-	-
9	其他	-
10	合计	4,480,261.64

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132009	17 中油 EB	344,784.00	0.28
2	132016	19 东创 EB	305,940.00	0.25
3	110073	国投转债	115,820.00	0.09

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
615	173,518.57	5,348,951.89	5.01	101,364,966.96	94.99

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	43,979.33	0.04

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 9 月 28 日） 基金份额总额	16,014,136.18
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	91,866,684.93
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	1,166,902.26
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	106,713,918.85

注：银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由银河安心收益 2 号集合资产管理计划变更而来，管理人对于银河安心收益 2 号集合资产管理计划产品份额于 2021 年 9 月 27 日安排强制退出，具体内容可在管理人网站查阅《关于银河安心收益 2 号集合资产管理计划产品份额安排强制退出的公告》，此次强制退出于 2021 年 9 月 28 日（本集合计划生效日）确认，因此有份额减少。本报告期 2021 年 9 月 28 日至 2021 年 12 月 31 日未开放赎回，本集合计划赎回起始日为 2022 年 6 月 28 日。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本集合计划管理人、本集合计划财产、本集合计划托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本集合计划未改聘会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划管理人、托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国银河证券股份有限公司	2	11,211,979.38	100.00%	1,299.25	100.00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	58,254,904.90	100.00%	603,900,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划资产管理合同	中国证监会规定报刊及网站	2021年9月28日
2	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2021年9月28日
3	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划招募说明书	中国证监会规定报刊及网站	2021年9月28日
4	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及网站	2021年9月28日
5	关于银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年9月28日
6	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划开放日常申购、赎回的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年11月4日
7	银河金汇证券资产管理有限公司关于旗下集合计划增加代销机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年11月4日
8	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021年12月27日
9	银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2021年12月27日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
个人	1	20211109-20211109		- 6,990,422.24		6,990,422.24	6.55
产品特有风险							
<p>本集合计划由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,存在以下特有风险:</p> <p>1、持有集合计划份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的集合计划份额净值波动风险;</p> <p>2、持有集合计划份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的流动性风险;</p> <p>3、持有集合计划份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险;</p> <p>4、持有集合计划份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的集合计划资产净值持续低于 5000 万元的风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准银河安心收益 2 号集合资产管理合同变更的文件;
- 2、《银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》;
- 3、《银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划托管协议》;
- 4、法律意见书;
- 5、管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、托管人业务资格批件、营业执照;
- 7、《银河安丰九个月滚动持有混合型集合资产管理计划招募说明书》;
- 8、报告期内在规定信息披露媒体上公开披露的各项公告以及中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

管理人、托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可在本集合计划管理人的网站进行查阅，网址为 <http://yhjh.chinastock.com.cn>。

银河金汇证券资产管理有限公司

2022 年 3 月 30 日