

银河安益 9 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

本集合计划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责任。

本集合计划托管人兴业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 07 月 18 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。

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 2022 年 03 月 02 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 04 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	银河安益 9 个月持有混合（FOF）
基金主代码	970138
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日
报告期末基金份额总额	50,021,200.54 份
投资目标	本计划主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，寻求资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置 本计划主要基于特定的风险收益目标来进行战略资产配置，首先根据产品定位确定投资组合的长期风险收益目标，其次根据各类资产的回报潜力和波动属性确定中枢配置比例，并在管理过程中保持相对稳定以匹配特定风险偏好的投资者需求。 此外，本计划的投资过程中，管理人将根据对宏观经济、货币金融环境、资产风险溢价、行业景气变化等动态分析，跟踪影响各类资产表现的各种因素变化，

	在一定范围内调整各类资产的战术配置比例。 2、证券投资基金投资策略 本计划证券投资基金投资基于管理人的基金投研决策体系，在充分研究的基础上，对备选基金进行绩效评估，选择合适的基金构建组合，并持续优化。基金研究包括定量、定性评估，其中定量评估又分为基于净值和持仓的分析、净值分析进一步细分为收益、风险、风险调整收益分析等。 其他投资策略还包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资基金策略。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*30%	
风险收益特征	本集合计划为混合型基金中基金集合资产管理计划，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划、债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、股票型基金中基金。	
基金管理人	银河金汇证券资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	银河安益 9 个月持有混合（FOF）A	银河安益 9 个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	970138	970139
报告期末下属分级基金的份额总额	47,329,692.77 份	2,691,507.77 份

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。银河安益 9 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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 1 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[2022]69 号文准予变更。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）	
	银河安益 9 个月持有混合（FOF）A	银河安益 9 个月持有混合（FOF）C
1. 本期已实现收益	-46,128.19	-3,269.73
2. 本期利润	296,119.17	14,680.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0086	0.0082
4. 期末基金资产净值	54,433,699.54	3,093,641.82
5. 期末基金份额净值	1.1501	1.1494

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 2022 年 03 月 02 日生效,主要财务指标的实际计算期间为 2022 年 04 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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

银河安益 9 个月持有混合（FOF）A

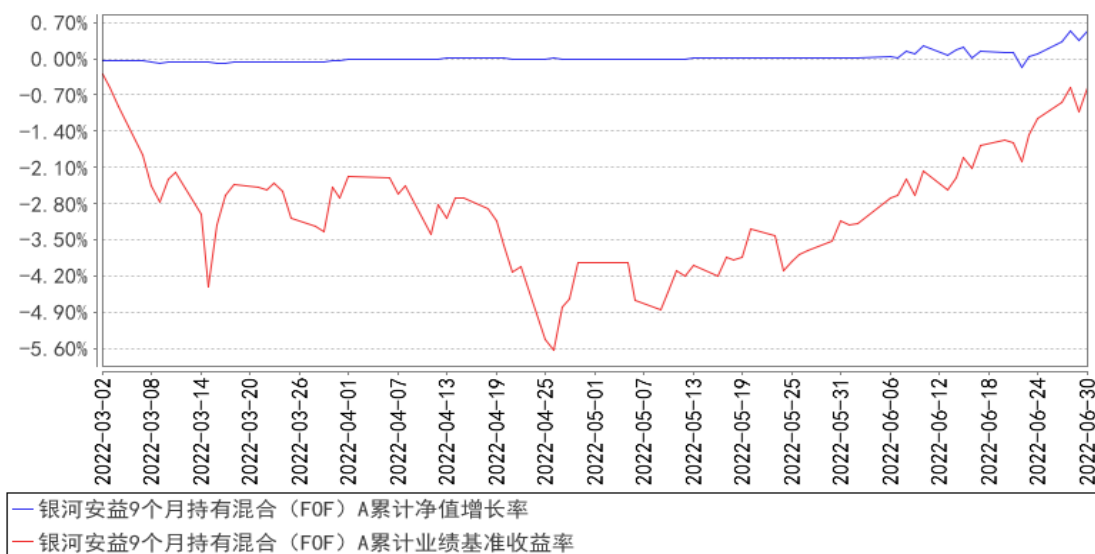
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.56%	0.08%	2.17%	0.43%	-1.61%	-0.35%
自基金合同 生效起至今	0.53%	0.07%	-0.57%	0.48%	1.10%	-0.41%

银河安益 9 个月持有混合（FOF）C

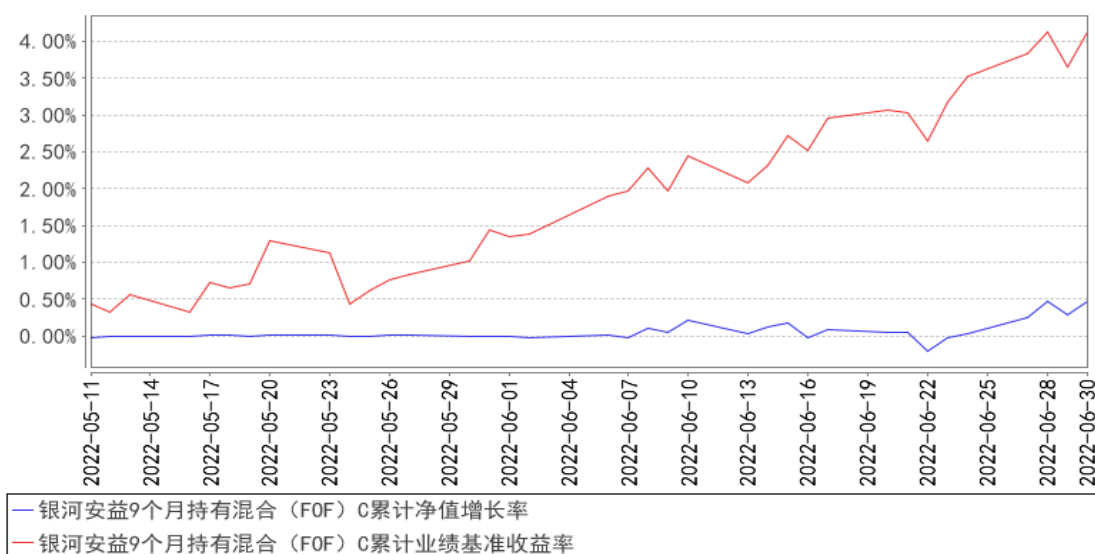
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	0.47%	0.11%	4.13%	0.31%	-3.66%	-0.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

银河安益9个月持有混合（FOF）A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



银河安益9个月持有混合（FOF）C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



- 注：1. 本集合计划于 2022 年 03 月 02 日生效，截至本报告期末本集合计划处于建仓期内；
2. 按集合计划合同和招募说明书的约定，自集合计划合同生效之日起六个月内使集合计划的投资组合比例符合本集合计划合同的有关约定；
3. 本集合计划自银河安心收益 1 号集合资产管理计划变更生效后，新增 C 类份额，C 类份额自 2022 年 05 月 11 日起存续。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
王跃文	本集合计划投资经理	2022 年 3 月 2 日	-	22 年	王跃文，毕业于北京化工大学，深耕 FOF 投资十余年，管理过多种不同风格、不同风险收益特征的产品。1993 年任中国国际期货有限公司基金部投资经理，2000 年任国信证券资产管理部交易室主任，2005 年任国都证券资产管理部理财投研部总经理，2011 年任中国银河证券股份有限公司资产管理部投资主办人，2014 年任银河金汇证券资产管理有限公司多策略投资部总经理。现任银河金汇 FOF 投研团队负责人、银河金汇公募投资一部总经理。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

无。

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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年以来，资本市场波动剧烈。开年以来受到俄乌冲突、疫情反复等多重影响，二级市场出现大幅回撤，4 月份以来，各主要指数企稳反弹，尤其是以新能源汽车为代表的成长行业，很多都创出新高，而价值股表现相对落后。

3 月以来，本集合计划参公改造，6 月初开始建仓基金组合。本集合计划管理人以多元化、有逻辑、低相关的思路构建组合，逐渐增加权益资产比例，整体配置结构偏稳健。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银河安益 9 个月持有混合（FOF）A 的份额净值为 1.1501 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 0.56%，同期业绩比较基准收益率为 2.17%，截至本报告期末银河安益 9 个月持有混合（FOF）C 的份额净值为 1.1494 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 0.47%，同期业绩比较基准收益率为 4.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本集合计划出现连续 20 个工作日以上（2022 年 04 月 01 日-2022 年 05 月 20 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，本集合计划于 2022 年 03 月 02 日-2022 年 05 月 08 日期间一直处于封闭改造状态，自 2022 年 05 月 09 日起开放申购业务，2022 年 05 月 20 日集合计划份额持有人数量超过 200 人，并于 05 月 25 日集合计划资产净值高于 5000 万元。自 2022 年 05 月 25 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	35,328,772.71	60.09
3	固定收益投资	5,870,616.94	9.98
	其中：债券	5,870,616.94	9.98
	资产支持证券	-	-
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	6,205,753.65	10.55
8	其他资产	11,390,442.32	19.37
9	合计	58,795,585.62	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

本集合计划本报告期末无股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末无股票投资。

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)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,544,663.29	6.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,050,997.26	3.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	274,956.39	0.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,870,616.94	10.20

5.5 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)	占基金资产净值比例 (%)
1	175427	20 远东 10	20,000	2,050,997.26	3.57
2	019658	21 国债 10	10,000	1,019,049.32	1.77
3	019664	21 国债 16	10,000	1,016,462.19	1.77
4	019666	22 国债 01	10,000	1,011,223.29	1.76
5	019547	16 国债 19	5,000	497,928.49	0.87

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本集合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。

5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	11,390,442.32
7	其他	-
8	合计	11,390,442.32

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)	占基金资产净值比例 (%)
1	113037	紫银转债	155,825.75	0.27
2	110059	浦发转债	106,000.96	0.18
3	123107	温氏转债	13,129.68	0.02

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	003030	安信新目标混合 A	契约型开放式	3,444,260.71	5,075,118.16	8.82	否
2	001136	易方达裕如混合	契约型开放式	3,884,226.88	5,065,031.85	8.80	否
3	002009	中欧瑾通灵活配置混合 A	契约型开放式	3,582,998.85	5,062,419.08	8.80	否
4	001710	安信新趋势混合 A	契约型开放式	4,358,326.07	5,060,016.57	8.80	否

5	001746	易方达瑞富混合 E	契约型开放式	3,897,116.13	5,038,971.16	8.76	否
6	002015	南方荣光灵活配置混合 A	契约型开放式	3,321,594.68	5,025,572.75	8.74	否
7	006551	中庚价值领航	契约型开放式	2,033,188.27	5,001,643.14	8.69	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 4 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	6,000.00	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	549.62	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	15,800.01	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	2,679.65	-

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本集合计划所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银河安益 9 个月持有混合（FOF）A	银河安益 9 个月持有混合（FOF）C
报告期期初基金份额总额	22,697,478.84	-
报告期期间基金总申购份额	26,736,680.09	2,691,507.77
减：报告期期间基金总赎回份额	2,104,466.16	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	47,329,692.77	2,691,507.77

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本集合计划本报告期无管理人运用自有资金投资本集合计划的情况。

8.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本集合计划本报告期无管理人运用自有资金投资本集合计划的情况。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 (%)
机构	1	2022.05.20-2022.06.30		-17,478,587.66		-17,478,587.66	34.94

产品特有风险

本集合计划由于存在上述单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况，存在以下特有风险：

- 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；
- 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；
- 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；
- 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划管理人于 2022 年 4 月 14 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 2022 年 4 月 12 日起，郭卿代任公司总经理；于 2022 年 5 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 2022 年 5 月 12 日起，叶胜利不再担任首席风险官；于 2022 年 6 月 30 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 2022 年 6 月 28 日起，聂润成代任首席风险官。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准银河安心收益 1 号集合资产管理合同变更的文件；
- 2、《银河安益 9 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《银河安益 9 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划托管协议》；

- 4、《银河安益 9 个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内在规定信息披露媒体上公开披露的各项公告。

10.2 存放地点

管理人处。

10.3 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 7 月 20 日