

银河安丰集合资产管理计划 2026 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：中国光大银行股份有限公司北京分行

报告期间：2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日

一、基本信息

资产管理计划名称：	银河安丰集合资产管理计划
资产管理计划成立时间：	2025-03-26
管理人：	银河金汇证券资产管理有限公司
托管人：	中国光大银行股份有限公司北京分行

二、资产管理计划投资表现

	本期末
期末资产净值(元)	890,006.53
本期利润(元)	15,601.12
份额净值(元)	1.3252
份额累计净值(元)	1.3252

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	26,947.00	2.97
	其中：股票	26,947.00	2.97
2	固定收益投资	102,611.89	11.29
3	基金	389,636.10	42.87
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	381,544.32	41.98
8	其他资产	8,090.46	0.89
9	资产合计	908,829.77	100.00

(二) 委托资产投资前十名股票（按市值）明细

代码	名称	持仓数量(股)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
601319	中国人保	1,000.00	6,760.00	0.76
601336	新华保险	100.00	5,966.00	0.67
603993	洛阳钼业	300.00	5,265.00	0.59
600111	北方稀土	100.00	4,805.00	0.54
002472	双环传动	100.00	4,151.00	0.47

(三) 委托资产投资前五名债券（按市值）明细

代码	名称	持仓数量(张)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
113052	兴业转债	200	23,017.21	2.59
113049	长汽转债	200	21,423.81	2.41
127108	太能转债	100	12,461.81	1.40
127045	牧原转债	100	11,736.10	1.32

113042	上银转债	100	11,552.35	1.30
--------	------	-----	-----------	------

(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(%)
511220	海富通上证可质押城投债 ETF	10,000.00	103,750.00	11.66
511380	博时中证可转债及可交换债券 ETF	6,500.00	90,701.00	10.19
511180	海富通上证投资级可转债 ETF	2,000.00	25,296.00	2.84
159949	华安创业板 50ETF	9,000.00	18,792.00	2.11
588000	华夏上证科创板 50ETF	8,000.00	18,752.00	2.11

(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 102.11%

(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

张嘉瑶先生，中国人民大学经济统计学硕士研究生。2010 年加入银河证券资产管理总部，分别任研究员，投资助理，投资经理。主要负责固收、固收+类产品的投资管理工作。已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

蔡昭先生，武汉大学金融工程硕士。2012 年加入北京农村商业银行，从事银行授信等相关工作。2015 年加入联合信用评级有限公司，从事债券信用分析及评级工作。2017 年加入银河金汇证券资产管理有限公司，从事投资管理工作。已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

(二)投资策略回顾与展望

宏观经济方面，当前国内宏观弱复苏延续、结构分化：制造业景气边际放缓，

非制造业回暖重返扩张但需求动能仍弱；生产端保持韧性、装备与高技术制造领跑，外需与科技链条支撑强劲；但内需修复缓慢，房地产与民间投资偏弱；出口在 AI 与新能源驱动下维持高增，但地缘与关税不确定性增加波动风险；通胀端 CPI，CPI 略有走弱，PPI 环比转负，物价改善斜率放缓；财政端一般公共预算收入继续修复，政府性基金偏弱、支出结构更倾向民生与科技，基建相关支出与专项债发行节奏阶段性放缓；信贷需求延续弱势；货币政策延续适度宽松、结构性工具为主，资金面偏松、利率低位震荡。

资本市场方面，二季度债券收益率整体窄幅波动，资金面和基本面对债市有较强支撑。整体资金面平稳宽松，但资金面对当前利率影响有限，债市缺乏破局点，无明显做多做空信号指引。权益市场呈现明显 K 型分化，AI 硬件相关板块持续上涨，其他板块承压，大盘指数呈现宽幅震荡态势，小微盘指数承压。

随着二季度经济数据公布，而且 7 月下旬存在政治局会议预期扰动，8-9 月存在政府债供给扰动，三季度债券市场可能需要适当谨慎，重点关注波段性交易机会。

权益市场方面，AI 相关产业链全球市场出现回调，国内也呈现抱团松动迹象，仓位上需要适度进行行业再均衡，上半年深度回调的价值、中游制造、消费、小微盘下半年可能出现阶段性机会，值得关注。

(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

本计划托管人-中国光大银行在托管银河安丰集合资产管理计划的过程中，严格遵守各项法律法规，对该产品管理人-银河金汇证券资产管理有限公司本季度计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害计划份额持有人利益的行为。

管理人所编制的本季度报告的财务数据是真实、准确的。

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	本计划在投资者分红、退出或者计划终止时提取业绩报酬，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。管理人有权根据市场情况调低业绩报酬收取比例或调高业绩报酬计提基准，并及时通过公告形式向投资者披露，无需另行征询投资者的意见；但若调高业绩报酬收取比例或调低业绩报酬计提基准，应按照资产管理合同的约定履行合同变更程序后再予以调整。 业绩报酬计提基准仅供投资者参考，不构成管理人保证受托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺，不构成管理人的投资业绩预测，不构成预期收益率。
------	---

计提方式	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。 具体计算方法如下： R 为该笔份额持有期间的年化收益率； A 为该笔份额业绩报酬计提日集合计划的单位累计净值； 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； 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； 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； E=该笔份额业绩报酬； K=业绩报酬计提日该笔份额数； 年化收益率 $R = (A - C) / C' \times 365 / D \times 100\%$； 业绩报酬计提标准为： 年化收益率 提取比例 业绩报酬公式 $R \leq 6\% \quad 0 \quad 0$ $R > 6\% \quad 20\% \quad E = (R - 6\%) \times 20\% \times C' \times K \times (D \div 365)$ 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。
支付方式	业绩报酬的计算，由管理人负责，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 个工作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。

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

2026 年 07 月 31 日