

# 银河金汇量选科创领航 FOF 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：北京银行股份有限公司深圳分行

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：   | 银河金汇量选科创领航 FOF 集合资产管理计划 |
| 资产管理计划成立时间： | 2025-01-22              |
| 管理人：        | 银河金汇证券资产管理有限公司          |
| 托管人：        | 北京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) | 13,262,197.01 |
| 本期利润(元)   | 2,805,278.80  |
| 份额净值(元)   | 1.6051        |
| 份额累计净值(元) | 1.6051        |

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       | 11,929,532.13 | 89.42      |
| 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     | 1,412,047.24  | 10.58      |
| 8  | 其他资产     | 26.72         | 0.00       |
| 9  | 资产合计     | 13,341,606.09 | 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(%) |
|--------|----------------|------------|--------------|----------------|
| 511880 | 银华交易型货币 A      | 13,500.00  | 1,357,546.50 | 10.24          |
| 515000 | 科技 ETF         | 435,700.00 | 745,918.40   | 5.62           |
| 159516 | 半导体设备          | 337,900.00 | 667,352.50   | 5.03           |
| 588020 | 易方达上证科创板成长 ETF | 171,600.00 | 616,558.80   | 4.65           |
| 512480 | 国联安中证全指半导体 ETF | 192,300.00 | 577,861.50   | 4.36           |

(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 100.60%

(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

徐杰，北京大学理学学士、经济学硕士，中国注册会计师（非执业）。现任 FOF 投资经理。曾就职于普华永道中天会计师事务所、中国银河证券股份有限公司。2014 年加入银河金汇证券资产管理有限公司，历任基金研究员和 FOF 投资经理。

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

### 一、市场回顾

本季度，A 股分化极大，通信、电子等 AI 板块相关股票大涨，而其他股票大多是先涨而后大跌，分界线是 5 月 13 日，为特朗普访华首日。美股、日本、韩国等 AI 产业占比高的市场，都比较强势，而港股、欧股等 AI 占比低的市场，走势偏弱。美国 10 年国债利率震荡走高，季末收在 4.46%左右的高位。国际金价震荡下跌。

### 二、策略思路

管理人的基金选择上，主要来自量化选基金策略。报告期内，基本维持中等

偏高仓位，中间有动态调整。结构上主要分 3 大类，科创策略、中低波策略和 ETF 趋势策略，科创策略加中低波策略为底仓，ETF 趋势策略为辅助。

关于本计划的主要配置思路依然未变，分两个层次进行配置：

#### 1、大类资产配置

管理人综合考虑资产性价比、宏观和政策环境、市场走势以及本产品风险承受能力，考虑各大类资产的配置安排。权益类资产为主，阶段性配置了部分的转债 ETF，主要是在市场趋势强劲时增加风险暴露。

#### 2、基金选择和配置

基金是本计划主要投资工具。管理人主要通过定量和定性分析工具，考察基金的历史业绩表现和回撤控制能力、基金经理的投资框架、基金经理投资风格与市场的适配性等。本计划持仓基金主要根据量化模型筛选，持仓数量较多，较为分散。

#### 三、策略回顾和展望

本季度策略整体表现符合预期。主要收益来自科创策略和 ETF 策略。

自 2024 年下半年首次尝试量化选基策略以来，管理人经过 2 年多升级迭代选，并结合实盘，不断优化操作方法。策略效果在今年以来得到较好的展现，各产品均获得了不错的收益。

经过 2 季度科技股大涨，短期市场可能需要震荡整固。但宏观流动性依然充沛，投资者情绪较高，部分行业盈利强劲，市场会持续提供多种投资机会。管理人会积极跟踪市场变化，继续优化策略，提升产品业绩，力争为客户提供更好持有体验。

#### (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【1.0】%。 |
| 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【0.01】%。 |
| 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 | <p>本计划业绩报酬计提基准为 8.0%/年，管理人对超过业绩报酬计提基准 8.0% 的超额部分提取 20%作为管理人业绩报酬。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 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 8.0\%</math> 0 0</p> <p><math>R &gt; 8.0\%</math> 20% <math>E = (R - 8.0\%) \times 20\% \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</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|  |                           |
|--|---------------------------|
|  | 最近可支付日支付。注册登记数据以管理人提供的为准。 |
|--|---------------------------|

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