

# 东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划

## 2026 年第二季度管理报告

管理人：东方财富证券股份有限公司

托管人：上海银行股份有限公司

2026 年 07 月

## 一、重要提示

资管计划管理人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。

资管计划托管人已复核本报告中的财务指标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。

资管计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资管计划资产，但不保证资管计划一定盈利，也不保证最低收益。

资管计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本资管计划的风险揭示书。

本报告仅供报告期末持有本计划份额的投资者查阅，未经许可，不得传播和转发，也不得对本报告进行任何形式的复制或修改。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

## 二、资产管理计划概况

（一）名称：东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”、“资管计划”）

（二）产品类型：固定收益类

（三）产品成立日：2025-07-21

（四）存续期限：10[年]

（五）管理人：东方财富证券股份有限公司

（六）托管人：上海银行股份有限公司

## 三、管理人履职报告

### （一）投资经理简介（截至本报告期末）

鲍兵，男，复旦大学管理学院金融工程硕士。曾任兴业国际信托有限公司资产管理部投资经理、东亚前海证券有限责任公司资产管理部投资经理。2023 年 2 月加入东方财富证券资产管理总部，现任东方财富证券资产管理总部投资经理。

杜喻言，男，美国波士顿大学金融数学硕士，CPA、CFA 三级。曾任东亚前海证券有限责任公司资产管理部交易员、固收研究员。现任东方财富证券资产管

理总部投资经理。

赵超，男，美国旧金山大学金融分析硕士。曾任渤海银行资金运营中心债券交易员、组合投资经理，有丰富债券交易、债券研究、债券和基金投资经验，。现任东方财富证券资产管理总部投资经理。

## （二）投资经理工作报告

2026 年第二季度债券市场整体运行平稳偏强，行情主要受到资金价格低位运行、宏观数据结构性偏弱等因素驱动，长短端收益率总体震荡下行。其中，10 年期国债在 1.7%-1.8% 区间附近震荡，整体呈现下行态势。信用债方面，整体收益率与国债收益率波动趋同、震荡下行，且低等级、长久期信用债收益率下行幅度更为显著。信用利差方面，各等级信用利差延续收窄态势，但结构分化明显，1 年期高等级利差小幅走阔，3 年期和 5 年期各等级利差继续收窄，中低等级利差收窄幅度整体高于高等级。

产品操作层面，基本上保持了产品的大类资产的比例中枢未作较大调整，阶段性进行了信用债的波段操作。实际运作结果来看，产品整体运行平稳，净值有所增长。

往后看，基本面方面，当前实体经济内部分化，制造业 PMI 等景气度指数连续多月在荣枯线附近，高科技创新型等新动能板块与出口外需板块增长强劲，但内需方面尚未边际扭转，整体中短期宏观基本面对于债市的利空较为有限。货币政策方面，央行或仍维持稳健宽松的政策立场，只是降息空间或相对受限，可能仍倾向于通过结构性货币政策工具精准滴灌实体经济。因此，利率整体预计呈现窄幅震荡走势，特别是 10 年以内曲线的国债品种，预计上下空间较小。30 年及其他更长久期国债可作为波动操作的品种，在市场情绪较为极端时进行反向操作，以此争取快速获得资本利得。

信用债方面，当前化债背景下，债券供给存在一定限制，管理人操作将会更加审慎，预计以优质信用主体为配置主要方面，同时辅以波段操作，保持中性久期。

## （三）管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，本计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等

有关法律法规、中国证监会和《东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划资产管理合同》的规定，本着诚实守信、审慎尽责、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，在严格控制风险的基础上，为本计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本计划运作整体合法合规，没有损害份额持有人利益。本计划的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的规定。

#### **（四）管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

##### **1、公平交易制度和控制方法**

本计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》以及有关法律法规的规定，建立了公平交易制度及异常交易监控机制，公平对待所管理的不同资产，对投资交易行为进行监控、分析、评估、核查，监督投资交易的过程和结果。

##### **2、公平交易制度的执行情况**

本报告期内，本计划管理人严格执行《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》以及有关法律法规的规定，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待所管理的所有资管计划。

##### **3、异常交易行为的专项说明**

报告期内未发现本计划存在异常交易行为。

#### **四、托管人履职报告**

本报告期内，本托管人在东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划托管协议》（如有）和其他有关规定，不存在损害投资者利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人按照国家有关规定、《东方财富证券双周添利 2 号集

合资产管理计划资产管理合同》、《东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划托管协议》（如有）和其他有关规定，对受托资产的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有损害投资者利益的行为。

本托管人复核审查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。

### 五、主要财务指标和投资表现情况

| 主要财务指标               | 单位：人民币元        |
|----------------------|----------------|
| 主要财务指标               | 本期间            |
| 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 | 629,662.94     |
| 本期利润                 | 1,021,266.84   |
| 其中：本期公允价值变动损益        | 391,603.90     |
| 加权平均份额本期利润           | 0.0052         |
| 加权平均净值利润率            | 0.5072%        |
| 本期单位净值增长率            | 0.5181%        |
| 期末可分配利润              | 3,499,886.77   |
| 期末可供分配份额利润           | 0.0170         |
| 期末资产净值               | 210,226,170.34 |
| 期末单位资产净值             | 1.021881       |
| 单位累计净值增长率            | 2.1881%        |

注：1、本处“本期公允价值变动损益”已扣除暂估附加税。  
 2、所述业绩指标不包括持有人认购或交易本计划的各项费用，计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

截至 2026 年 6 月 30 日，本计划单位净值为 1.021881 元。

### 六、投资组合报告

| (一) 报告期末资管计划资产组合情况 |        |               | 单位：人民币元        |
|--------------------|--------|---------------|----------------|
| 序号                 | 项目     | 金额            | 占资管计划总资产的比例（%） |
| 1                  | 权益投资   |               |                |
|                    | 其中：股票  |               |                |
| 2                  | 基金     |               |                |
| 3                  | 固定收益投资 | 40,790,890.41 | 19.39          |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券             | 40,790,890.41  | 19.39  |
|   | 资产支持证券            |                |        |
| 4 | 金融衍生品投资           |                |        |
| 5 | 买入返售金融资产          | 102,977,652.35 | 48.96  |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 |                |        |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 5,963,104.06   | 2.83   |
| 7 | 其他资产              | 60,612,265.20  | 28.82  |
| 8 | 合计                | 210,343,912.02 | 100.00 |

注：因四舍五入，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

## （二）运用杠杆情况

本报告期末，本计划资产净值为 210,226,170.34 元，资产总值为 210,343,912.02 元，杠杆比率为 100.06%。

## 七、财务会计报告

### （一）资管计划资产负债表

单位：人民币元

| 资产          | 期末余额           | 上年年末余额        |
|-------------|----------------|---------------|
| <b>资 产：</b> |                |               |
| 货币资金        | 5,963,104.06   | 1,189,837.32  |
| 结算备付金       | 0.00           | 0.00          |
| 存出保证金       | 0.00           | 2,639.64      |
| 衍生金融资产      | 0.00           | 0.00          |
| 应收清算款       | 0.00           | 0.00          |
| 应收利息        | 0.00           | 0.00          |
| 应收股利        | 0.00           | 0.00          |
| 应收申购款       | 0.00           | 0.00          |
| 买入返售金融资产    | 102,977,652.35 | 22,939,292.79 |
| 发放贷款和垫款     |                |               |
| 交易性金融资产     | 101,403,155.61 | 52,163,648.86 |
| 债权投资        | 0.00           | 0.00          |
| 其他债权投资      |                |               |
| 其他权益工具投资    |                |               |
| 长期股权投资      | 0.00           | 0.00          |
| 其他资产        | 0.00           | 0.00          |
|             |                |               |
|             |                |               |
|             |                |               |
|             |                |               |

|      |                |               |
|------|----------------|---------------|
| 资产总计 | 210,343,912.02 | 76,295,418.61 |
|------|----------------|---------------|

资管计划资产负债表（续）

单位：人民币元

| 负债和净资产          | 期末余额                  | 上年年末余额               |
|-----------------|-----------------------|----------------------|
| <b>负 债：</b>     |                       |                      |
| 短期借款            | 0.00                  | 0.00                 |
| 交易性金融负债         | 0.00                  | 0.00                 |
| 衍生金融负债          | 0.00                  | 0.00                 |
| 卖出回购金融资产款       | 0.00                  | 8,804,769.28         |
| 应付管理人报酬         | 100,477.69            | 48,562.12            |
| 应付托管费           | 5,023.92              | 2,428.10             |
| 应付销售服务费         | 0.00                  | 0.00                 |
| 应付投资顾问费         | 0.00                  | 0.00                 |
| 应交税费            | 10,256.31             | 13,702.85            |
| 应付清算款           | 0.00                  | 0.00                 |
| 应付赎回款           | 0.00                  | 0.00                 |
| 应付利息            | 0.00                  | 0.00                 |
| 应付利润            | 0.00                  | 0.00                 |
| 其他负债            | 1,983.76              | 4,000.00             |
| <b>负债合计</b>     | <b>117,741.68</b>     | <b>8,873,462.35</b>  |
| <b>净资产：</b>     |                       |                      |
| 实收资金            | 205,724,734.89        | 66,693,770.26        |
| 其他综合收益          |                       |                      |
| 未分配利润           | 4,501,435.45          | 728,186.00           |
| <b>净资产合计</b>    | <b>210,226,170.34</b> | <b>67,421,956.26</b> |
| <b>负债和净资产总计</b> | <b>210,343,912.02</b> | <b>76,295,418.61</b> |

（二）资管计划经营业绩表

单位：人民币元

| 项目                       | 本期金额                | 上期金额              |
|--------------------------|---------------------|-------------------|
| <b>一、营业总收入</b>           | <b>1,132,165.29</b> | <b>796,758.85</b> |
| 利息收入                     | 422,455.47          | 277,367.41        |
| 投资收益（损失以“-”填列）           | 318,105.92          | 265,716.27        |
| 其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | 0.00                | 0.00              |
| 公允价值变动收益（损失以“-”填列）       | 391,603.90          | 253,675.17        |
| 汇兑损益（损失以“-”填列）           | 0.00                | 0.00              |
| 其他业务收入                   | 0.00                | 0.00              |
| <b>二、营业总支出</b>           | <b>110,898.45</b>   | <b>77,900.70</b>  |
| 管理人报酬                    | 100,526.13          | 65,791.63         |
| 其中：暂估管理人报酬               | 0.00                | 0.00              |
| 托管费                      | 5,023.92            | 3,289.58          |

|                         |                     |                   |
|-------------------------|---------------------|-------------------|
| 销售服务费                   | 0.00                | 0.00              |
| 投资顾问费                   | 0.00                | 0.00              |
| 利息支出                    | 3,252.15            | 6,375.37          |
| 信用减值损失                  | 0.00                | 0.00              |
| 税金及附加                   | 1,098.89            | 1,457.72          |
| 其他费用                    | 997.36              | 986.40            |
| <b>三、利润总额</b>           | <b>1,021,266.84</b> | <b>718,858.15</b> |
| 减：所得税费用                 | -                   | -                 |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列</b> | <b>1,021,266.84</b> | <b>718,858.15</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>    |                     |                   |
| <b>六、综合收益总额</b>         | <b>1,021,266.84</b> | <b>718,858.15</b> |

## 八、投资收益分配情况

本报告期内，未发生投资收益分配情况。

## 九、管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

本报告期内，本计划的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式均按资产管理合同及相关补充文件（如有）的约定执行。

## 十、涉及投资者权益的事项说明

### （一）重大事项

#### 1、投资经理变更情况

本报告期内，本计划发生了投资经理变更。本计划投资经理于 2026 年 4 月 20 日由鲍兵、杜喻言、李娜变更为鲍兵、杜喻言、赵超。

#### 2、重大关联交易情况

本报告期内，未发生重大关联交易。

#### 3、其它涉及投资者权益的重大事项情况

本报告期内，未发生其它涉及投资者权益的重大事项。

### （二）其他事项

## 1、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与情况

截至本报告期末，本计划不存在管理人及管理人子公司自有资金参与的情况。

## 2、证券期货经营机构董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与情况

截至本报告期末，管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的情况如下：

| 类型             | 数量 | 合计持有份额<br>(份) | 占总份额比例 |
|----------------|----|---------------|--------|
| 关联公司           | 0  | 0.00          | 0%     |
| 关联自然人          | 0  | 0.00          | 0%     |
| 同一管理人管理的资产管理计划 | 0  | 0.00          | 0%     |
| 从业人员及其配偶       | 3  | 1,808,694.15  | 0.88%  |

注：如某一关联方为“从业人员及其配偶”且为“关联自然人”，则统一计入“从业人员及其配偶”，不做重复统计。

## 十一、备查文件目录

### （一）备查文件目录

- 1、《东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划说明书》；
- 3、《东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划风险揭示书》；
- 4、《东方财富证券双周添利 2 号集合资产管理计划托管协议》（如有）；
- 5、资管计划管理人业务资格批件、营业执照。

### （二）存放地点

文件存放地点：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

信息披露网址：<http://www.18.cn/>

信息披露电话：95357

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东方财富证券股份有限公司。

东方财富证券股份有限公司

2026 年 07 月