

渤海理财财收有略系列固定收益类九个月封闭式理财产品 2026 年 5 号

2026 年第二季度报告

渤海理财有限责任公司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。理财产品管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产，但不保证产品一定盈利。产品过往业绩并不代表其未来表现。理财非存款，投资需谨慎。

产品管理人：渤海理财有限责任公司

产品托管人：兴业银行股份有限公司

报 告 期：2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	渤海理财财收有略系列固定收益类九个月封闭式理财产品 2026 年 5 号
产品代码	CSFB9M26005
登记编码	Z7008426000033 (可在中国理财网 www.chinawealth.com.cn 查询产品信息)
募集方式	公募
运作模式	封闭式净值型
投资性质	固定收益类
风险等级	二级(中低) (该等级为理财产品发行机构评定结果)
产品起始日期	2026-01-29
产品终止日期	2026-11-19

第二章 净值、存续规模及收益表现

2.1 报告期内产品净值情况

销售代码	时点指标：报告期末				区间指标：报告期间	
	日期	份额净值	累计净值	资产净值 (元)		年化 收益 率
CSFB9M26005 A	2026-06-30	1.012409	1.012409	13,540,225 .46	近三个月	3.62%
CSFB9M26005 B	2026-06-30	1.011988	1.011988	147,638,39 4.99	近三个月	3.52%
CSFB9M26005 C	2026-06-30	1.011568	1.011568	2,536,049. 63	近三个月	3.42%
CSFB9M26005 D	2026-06-30	1.011568	1.011568	2,603,775. 34	近三个月	3.42%
CSFB9M26005 E	2026-06-30	1.012409	1.012409	414,068,52 9.75	近三个月	3.62%

注：成立不足一个月，不展示年化收益率。

2.2 报告期内产品收益分配情况

销售代码	收益分配 基准日	权益 登记日	除息日	红利 发放日	每份额现金分红 (元)
—	—	—	—	—	—

第三章 管理人报告

3.1 报告期内产品投资策略

利用定性分析和定量分析方法，通过对相关金融资产的合理配置，在尽可能保障本金安全和流动性的前提下，追求相对稳定合理的投资回报。

3.2 产品未来表现展望

通过对国内外宏观经济形势、金融市场运行情况综合分析，在严格控制风险的前提下，主动构建及调整投资组合，力争获取超额收益。

3.3 报告期内产品运作合规守信情况

渤海理财有限责任公司声明：

作为理财产品管理人，在报告期内产品运作严格遵守《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《商业银行理财业务监督管理办法》等法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则，在认真控制产品投资风险的基础上，为产品持有人谋求最大利益。

第四章 资产持仓

4.1 期末产品资产持仓情况

序号	资产类别	穿透前占总资产比例	穿透后占总资产比例
1	现金及银行存款	0.12%	12.35%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.92%
4	债券	0.00%	83.49%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类资产	0.00%	0.00%
7	金融衍生品	0.00%	0.00%
8	境外资产	0.00%	1.25%
9	商品类资产	0.00%	0.00%
10	另类资产	0.00%	0.00%
11	公募基金	0.00%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.88%	0.00%
14	委外投资——协议方式	0.00%	0.00%
15	其他资产	0.00%	0.00%

注：上表数据因计算结果四舍五入保留两位小数，可能存在尾差。

本产品截至报告期末的穿透后杠杆率为 100.6448%。

4.2 期末产品持有的前十项资产（穿透后）

序号	资产名称	资产类别	资产代码	持有金额（元）	占总资产的比例
1	重庆经开区投资集团有限公司 2025 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)	债券	258569. SH	29,416,044.36	5.04%
2	现金及活期存款	现金及银行存款	CASH	20,285,158.47	3.47%
3	R001	拆放同业及债券买入返售	S20240603WJ11-20260630-361	17,041,046.01	2.92%
4	泰安泰山城乡建设发展有限公司 2025 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)	债券	280042. SH	16,842,425.64	2.88%
5	洛阳城市发展投资集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第二期)(品种二)	债券	256571. SH	16,616,315.62	2.84%
6	赣州建控投资控股集团有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第	债券	254708. SH	16,569,273.53	2.84%

	一期) (品种二)				
7	山东公用控股有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券 (第二期) 品种一	债券	254907. SH	16,455,895.6 1	2.82%
8	延安城市建设投资(集团)有限责任公司 2025 年面向专业投资者非公开发行公司债券 (第一期) (品种一)	债券	258813. SH	16,299,382.4 9	2.79%
9	邳州市建设投资集团有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具	债券	032480671. IB	16,269,814.4 6	2.79%
10	淮北市建投控股集团有限公司 2024 年度第三期定向债务融资工具	债券	032480926. IB	13,216,574.2 5	2.26%

4.3 报告期末持有非标准化债权类资产情况

序号	融资客户	项目情况	投资本金 (元)	剩余融 资期限 (天)	到期收 益分配	交易结构	风险 情况
1	-	-	-	-	-	-	-

4.4 报告期内关联交易情况

4.4.1 产品持有关联方发行或承销的证券

序号	证券代码	证券简称	交易种类	买入金额（元）	关联方名称
1	-	-	-	-	-

4.4.2 其他关联交易

序号	资产代码	资产名称	交易种类	交易金额（元）	关联方名称
1	HTYTJX21-2 0260415-11 1	渣打银行 结构性存 款	存款	6,937,920.94	渣打银行(中国) 有限公司

4.4.3 向关联方支付的费用

序号	交易种类	交易金额（元）	关联方名称
1	托管费	29,116.07	兴业银行股份有限公司
2	销售服务费	14,315.75	渤海银行股份有限公司
3	销售服务费	88,369.66	兴业银行股份有限公司

第五章 风险分析

5.1 理财投资组合流动性风险分析

为保障投资组合的变现能力与产品到期安排相匹配，本理财产品管理人严格遵守相关法律法规及产品销售协议，通过合理安排投资品种和期限结构、控制资产持仓集中度等措施，对理财投资组合的流动性进行管控，降低产品流动性风险。

报告期内，本产品未发生重大流动性风险事件，流动性风险总体可控。

5.2 理财投资组合其他风险分析

为保障投资组合风险可控，本理财产品管理人严格遵守相关法律法规及产品销售协议，针对信用风险、市场风险等相关风险建立完善的风控机制，在投资运作过程中综合采用多种措施，降低产品相关风险。

报告期内，本产品未发生重大信用风险、市场风险等事件，相关风险总体可控。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户名称	账户号码	开户单位
1	资金托管账户	渤海理财有限责 任公司财收九个 月 26 年 5 号	35698010010341 8471	兴业银行股份有 限公司

第七章 理财投资合作机构信息

序号	投资合作机构名称
1	中国对外经济贸易信托有限公司
2	华泰证券(上海)资产管理有限公司

注：上表数据为报告期末日终的存量情况。

第八章 影响投资者决策的其他重要信息

无其他影响投资者决策的其他重要信息。