

# 渤海理财财收有略系列固定收益类六个月封闭式理财产品 2026 年 29 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六个月封闭式理财产品<br>2026 年 29 号                                                              |
| 产品代码   | CSFB6M26029                                                                                           |
| 登记编码   | Z7008426000194<br>(可在中国理财网 <a href="http://www.chinawealth.com.cn">www.chinawealth.com.cn</a> 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)<br>(该等级为理财产品发行机构评定结果)                                                                          |
| 产品起始日期 | 2026-03-26                                                                                            |
| 产品终止日期 | 2026-10-14                                                                                            |

## 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<br>(元)        |           | 年化<br>收益<br>率 |
| CSFB6M26029<br>A | 2026-06-30 | 1.008529 | 1.008529 | 41,418,523<br>.88  | 近三个月      | 3.20%         |
| CSFB6M26029<br>B | 2026-06-30 | 1.008927 | 1.008927 | 8,918,419.<br>14   | 近三个月      | 3.35%         |
| CSFB6M26029<br>C | 2026-06-30 | 1.009060 | 1.009060 | 275,450,67<br>4.07 | 近三个月      | 3.41%         |
| CSFB6M26029<br>D | 2026-06-30 | 1.009193 | 1.009193 | 178,770,92<br>9.56 | 近三个月      | 3.46%         |
| CSFB6M26029<br>E | 2026-06-30 | 1.009060 | 1.009060 | 14,341,208<br>.61  | 近三个月      | 3.41%         |
| CSFB6M26029<br>F | 2026-06-30 | 1.008794 | 1.008794 | 169,958,25<br>3.68 | 近三个月      | 3.30%         |

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<br>基准日 | 权益<br>登记日 | 除息日 | 红利<br>发放日 | 每份额现金分红<br>(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，在严格控制信用风险和流动性风险的前提下，追求稳定合理的回报。产品运作方面，注重建仓高评级债券提升组合流动性，平衡收益与波动。

### 3.2 产品未来表现展望

通过对国内外宏观经济形势进行综合评估、以票息和杠杆策略为主，积极平衡流动性与收益性，择机把握债市调整形成的波段操作机会，获取资本利得、控制风险敞口，努力为客户提供稳健的产品收益。

### 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     | 0.00%     | 3.00%     |
| 2  | 同业存单        | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00%     | 2.01%     |
| 4  | 债券          | 0.00%     | 93.33%    |
| 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%     | 0.00%     |
| 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%     | 1.66%     |
| 12 | 私募基金        | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品      | 100.00%   | 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 134.5921%。

#### 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  | 现金及活期存款                                        | 现金及银行存款 | CASH         | 27,786,835.85 | 3.00%   |
| 2  | 衡阳市城市建设投资有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第三期)      | 债券      | 256909.SH    | 19,687,416.37 | 2.12%   |
| 3  | 四川龙阳天府新区建设投资有限公司 2024 年度第一期定向债务融资工具            | 债券      | 032480319.IB | 18,991,612.66 | 2.05%   |
| 4  | 福建省九仙产业投资发展集团有限公司 2025 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)  | 债券      | 258584.SH    | 18,175,993.79 | 1.96%   |
| 5  | 怀化市城市建设投资有限公司 2024 年面向专业投资者非公开发行公司债券(第一期)(品种二) | 债券      | 256586.SH    | 15,019,509.77 | 1.62%   |
| 6  | 株洲高科集团有限公司 2026 年度第一期定                         | 债券      | 032680172.IB | 14,491,189.94 | 1.56%   |

|    |                                                     |    |               |                   |       |
|----|-----------------------------------------------------|----|---------------|-------------------|-------|
|    | 向债务融资工具                                             |    |               |                   |       |
| 7  | 株洲市云龙发展投资控股集团有限公司 2025 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第二期) (品种一) | 债券 | 243722. SH    | 13,821,861.2<br>2 | 1.49% |
| 8  | 潜江市城市建设投资开发有限公司 2025 年度第一期定向债务融资工具                  | 债券 | 032580552. IB | 13,255,592.8<br>6 | 1.43% |
| 9  | 庐江县潜城城市运营管理有限公司 2025 年面向专业投资者非公开发行公司债券 (第一期)        | 债券 | 134705. SZ    | 13,100,755.5<br>2 | 1.41% |
| 10 | 江西省湖口县石钟投资开发有限公司 2026 年面向专业投资者非公开发行公司债券 (第一期)       | 债券 | 281586. SH    | 13,088,543.7<br>5 | 1.41% |

#### 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<br>(元) | 剩余融<br>资期限<br>(天) | 到期收<br>益分配 | 交易结构 | 风险<br>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  | 102681519.I<br>B | 26 津渤海<br>MTN008 | 发行   | 11,857,791.57 | 天津渤海国有资产<br>经营管理有限<br>公司 |

##### 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<br>（元） | 关联方名称 |
|----|------|------|------|-------------|-------|
| 1  | -    | -    | -    | -           | -     |

##### 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   | 32,315.31 | 兴业银行股份有限公司 |
| 2  | 销售服务费 | 58,561.28 | 渤海银行股份有限公司 |
| 3  | 销售服务费 | 52,682.68 | 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循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循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<br>任公司财收六个<br>月 26 年 29 号 | 44127010010137<br>3407 | 兴业银行股份有<br>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  | 西部信托有限公司      |
| 2  | 湖南省财信信托有限责任公司 |
| 3  | 广东粤财信托有限公司    |

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。