

|                                                    |                                    |            |       |
|----------------------------------------------------|------------------------------------|------------|-------|
| ““巡航财富-优选 FOF 固收增强年年开放净值型”23 期理财产品”产品上半年暨二季度产品运行公告 |                                    |            |       |
| 单位：元                                               |                                    |            |       |
| 1、理财产品概况                                           |                                    |            |       |
| 报告日                                                | 2026 年 06 月 30 日                   |            |       |
| 产品名称                                               | “巡航财富-优选 FOF 固收增强年年开放净值型” 23 期理财产品 |            |       |
| 产品代码                                               | XH12M023                           |            |       |
| 产品登记编码                                             | C1080322000525                     |            |       |
| 币种                                                 | 人民币                                |            |       |
| 产品发行日                                              | 2022 年 12 月 13 日                   |            |       |
| 产品到期日                                              | 2042 年 11 月 18 日                   |            |       |
| 募集方式                                               | 公募                                 |            |       |
| 理财产品存续份额                                           | 36,174,966.60                      |            |       |
| 理财产品资产净值                                           | 36,671,607.62                      |            |       |
| 单位净值                                               | 1.013729                           |            |       |
| 累计净值                                               | 1.105338                           |            |       |
| 业绩比较基准                                             | 2.35%-3.65%                        |            |       |
| 客户端对应单位净值                                          | 1.013610                           |            |       |
| 产品类型                                               | 固定收益类                              |            |       |
| 产品流动性                                              | 报告期内，本理财产品投资运作正常，投资组合流动性风险可控。      |            |       |
| 理财产品托管人                                            | 中国建设银行股份有限公司                       |            |       |
| 投资账户信息                                             | 账户名称：天津银行巡航财富 FOF 固收年年开放 23 期理财托管户 |            |       |
|                                                    | 账号：12050163540000004864            |            |       |
|                                                    | 开户行：中国建设银行股份有限公司天津河西支行             |            |       |
| 2、投资组合报告                                           |                                    |            |       |
| 2.1 投资组合基本情况                                       |                                    |            |       |
| 杠杆水平                                               | 100.39%                            |            |       |
| 2.2 资产配置情况                                         |                                    |            |       |
| 序号                                                 | 资产种类                               | 占投资组合总资产比例 |       |
|                                                    |                                    | 直接投资       | 间接投资  |
| 1                                                  | 现金、银行存款、货币市场工具类                    | 0.09%      | 9.66% |

|   |                  |        |        |
|---|------------------|--------|--------|
| 2 | 债券、ABS 等标准化固定收益类 | 0.00%  | 84.41% |
| 3 | 非标准化债权类          | 0.00%  | 0.00%  |
| 4 | 权益类              | 0.00%  | 0.00%  |
| 5 | 公募基金             | 0.00%  | 5.93%  |
| 6 | 资产管理计划           | 99.91% | 0.00%  |
| 7 | 其他类              | 0.00%  | 0.00%  |

### 2.3 非标准化债权资产明细

| 序号 | 融资客户 | 项目名称 | 剩余融资期限<br>(天) | 交易结构 | 收益率 | 风险状况 |
|----|------|------|---------------|------|-----|------|
| -  | -    | -    | -             | -    | -   | -    |

#### 2.4 占产品资产净值前十大投资资产明细

| 序号 | 代码 | 资产名称                   | 规模            | 占投资组合的比例 |
|----|----|------------------------|---------------|----------|
| 1  | —  | 中信证券星云 81 号集合资产管理计划    | 15,469,359.78 | 42.18%   |
| 2  | —  | 中金金悦 ESG1 号            | 8,461,561.89  | 23.07%   |
| 3  | —  | 华泰 ESG 智富 12 号集合资产管理计划 | 7,354,620.54  | 20.06%   |
| 4  | —  | 华宝证券津华 2 号集合资产管理计划     | 3,679,621.67  | 10.03%   |
| 5  | —  | 中诚信托-嘉信 91 号集合资金信托计划   | 1,817,048.85  | 4.95%    |
| 6  | —  | —                      | —             | —        |
| 7  | —  | —                      | —             | —        |
| 8  | —  | —                      | —             | —        |
| 9  | —  | —                      | —             | —        |
| 10 | —  | —                      | —             | —        |

备注：上述披露信息为该产品报告日日终的投资情况，该数据仅供参考，实际投资比例以银行投资运作情况为准。