

专项计划名称：杭钢温州水务污水处理收费收益权绿色资产支持专项计划
证券代码：189264、189265、189266、189267、189268、189269、189270、189271、
189272、189273、189274、189275、189276
证券简称：G 杭钢 S01、G 杭钢 S02、G 杭钢 S03、G 杭钢 S04、G 杭钢 S05、G 杭
钢 S06、G 杭钢 S07、G 杭钢 S08、G 杭钢 S09、G 杭钢 S10、G 杭钢 S11、G 杭钢
S12、G 杭钢 S 次

长城证券资产管理有限公司关于杭钢温州水务污水处理收
费收益权绿色资产支持专项计划
2026 年第 2 期(总第 20 期)收益分配的报告

本公司保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，
并对其内容的真实性、准确性和完整性承担相应的法律责任。

一、 资产支持证券基本情况

杭钢温州水务污水处理收费收益权绿色资产支持专项计划于
2021 年 4 月 30 日由长城证券股份有限公司设立并开始运作。本专项
计划设置优先级资产支持证券和次级资产支持证券两种资产支持证
券，其中优先级资产支持证券共分为 12 个品种，分别为：“G 杭钢 S01”、
“G 杭钢 S02”、“G 杭钢 S03”、“G 杭钢 S04”、“G 杭钢 S05”、“G 杭钢
S06”、“G 杭钢 S07”、“G 杭钢 S08”、“G 杭钢 S09”、“G 杭钢 S10”、“G
杭钢 S11”、“G 杭钢 S12”。截至目前，本次发行的资产支持证券各类
别情况如下表所示：

证券代 码	证券简 称	按面值分 期偿还后 的简称	起息日	到期日	收益分配 方式	信用评 级	年化收 益率	发行金 额(亿 元)	未偿本 金余额 (亿元)
----------	----------	---------------------	-----	-----	------------	----------	-----------	------------------	--------------------

189264	G 杭钢 S01	-	2021/4/30	2022/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	3.20%	0.15	0.00
189265	G 杭钢 S02	-	2021/4/30	2023/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	3.70%	0.26	0.00
189266	G 杭钢 S03	-	2021/4/30	2024/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	3.74%	0.33	0.00
189267	G 杭钢 S04	-	2021/4/30	2025/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.62%	0.35	0.00
189268	G 杭钢 S05	PR 杭钢 05	2021/4/30	2026/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.78%	0.39	0.09999 6
189269	G 杭钢 S06	-	2021/4/30	2027/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.98%	0.41	0.41
189270	G 杭钢 S07	-	2021/4/30	2028/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.98%	0.43	0.43
189271	G 杭钢 S08	-	2021/4/30	2029/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.98%	0.45	0.45
189272	G 杭钢 S09	-	2021/4/30	2030/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.98%	0.47	0.47
189273	G 杭钢 S10	-	2021/4/30	2031/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.98%	0.49	0.49
189274	G 杭钢 S11	-	2021/4/30	2032/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.98%	0.53	0.53
189275	G 杭钢 S12	-	2021/4/30	2033/4/30	按计划还 本、按季 付息	AAAsf	2.98%	0.54	0.54
189276	G 杭钢 S次	-	2021/4/30	2033/4/30	每一兑付 日优先级 资产支持 证券本金 和预期收 益全部偿 付完毕 后, 剩余	-	-	0.26	0.26

2025/ 4/30	-	-	-	25.71%	-	-	-	-	-	-	-	-
2025/ 7/30	-	-	-	-	20.51%	-	-	-	-	-	-	-
2025/ 10/30	-	-	-	-	28.21%	-	-	-	-	-	-	-
2026/ 1/30	-	-	-	-	25.64%	-	-	-	-	-	-	-
2026/ 4/30	-	-	-	-	25.64 %	-	-	-	-	-	-	-
2026/ 7/30	-	-	-	-	-	21.95%	-	-	-	-	-	-
2026/ 10/30	-	-	-	-	-	26.83%	-	-	-	-	-	-
2027/ 1/30	-	-	-	-	-	24.39%	-	-	-	-	-	-
2027/ 4/30	-	-	-	-	-	26.83%	-	-	-	-	-	-
2027/ 7/30	-	-	-	-	-	-	20.93%	-	-	-	-	-
2027/ 10/30	-	-	-	-	-	-	27.91%	-	-	-	-	-
2028/ 1/30	-	-	-	-	-	-	25.58%	-	-	-	-	-
2028/ 4/30	-	-	-	-	-	-	25.58%	-	-	-	-	-

4/30												
2028/ 7/30	-	-	-	-	-	-	-	22.22%	-	-	-	-
2028/ 10/30	-	-	-	-	-	-	-	26.67%	-	-	-	-
2029/ 1/30	-	-	-	-	-	-	-	24.44%	-	-	-	-
2029/ 4/30	-	-	-	-	-	-	-	26.67%	-	-	-	-
2029/ 7/30	-	-	-	-	-	-	-	-	21.28%	-	-	-
2029/ 10/30	-	-	-	-	-	-	-	-	27.66%	-	-	-
2030/ 1/30	-	-	-	-	-	-	-	-	25.53%	-	-	-
2030/ 4/30	-	-	-	-	-	-	-	-	25.53%	-	-	-
2030/ 7/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	22.45%	-	-
2030/ 10/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	26.53%	-	-
2031/ 1/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24.49%	-	-
2031/ 4/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	26.53%	-	-

2031/ 7/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	22.64%	-
2031/ 10/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	26.42%	-
2032/ 1/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24.52%	-
2032/ 4/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	26.42%	-
2032/ 7/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24.07%
2032/ 10/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	25.93%
2033/ 1/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24.07%
2033/ 4/30	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	25.93%
合计	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%

注：兑付日为预计兑付日，如遇法定节假日或交易所休市，则兑付顺延至下一交易日，具体安排详见管理人收益分配报告。

三、本次收益分配方案

本资产支持专项计划将于收益分配日 2026 年 4 月 30 日（T 日）将实际分配的资金划付至资产支持证券持有人的资金账户（如遇法定节假日或休息日顺延至其后的第 1 个交易日）。债权登记日 2026 年 4 月 29 日（T-1 日）在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（以下简称“中证登上海公司”）本专项计划持有人名册上登记的资产支

持证券持有人可获得相应的收益分配款项。

本次资产支持证券本金和收益的分配安排如下：

证券代码	证券简称	收益分配类型	分配本金(元/份)	分配收益(元/份)	持有人份额(份)	分配资金合计(元)	剩余本金面值(元)	剩余本金余额(元)
189268	G 杭钢 S05	到期兑付	25.64	0.1757	390,000	10,068,123.00	0.00	0.00
189269	G 杭钢 S06	付息	0.00	0.7347	410,000	301,227.00	100.00	41,000,000.00
189270	G 杭钢 S07	付息	0.00	0.7347	430,000	315,921.00	100.00	43,000,000.00
189271	G 杭钢 S08	付息	0.00	0.7347	450,000	330,615.00	100.00	45,000,000.00
189272	G 杭钢 S09	付息	0.00	0.7347	470,000	345,309.00	100.00	47,000,000.00
189273	G 杭钢 S10	付息	0.00	0.7347	490,000	360,003.00	100.00	49,000,000.00
189274	G 杭钢 S11	付息	0.00	0.7347	530,000	389,391.00	100.00	53,000,000.00
189275	G 杭钢 S12	付息	0.00	0.7347	540,000	396,738.00	100.00	54,000,000.00
189276	G 杭钢 S次	付息	0.00	22.5503	260,000	5,863,078.00	100.00	26,000,000.00

【G 杭钢 S05、189268】本次分配完成后，本金兑付完毕并终止挂牌转让，摘牌日为 2026 年 4 月 30 日（如遇法定节假日或休息日顺延至其后的第 1 个交易日）。

四、收益分配方式

资产支持证券进行收益分配的，应当由托管人根据管理人发出的分配指令，将本次分配资金划至中证登上海公司，并由中证登上海公司支付至资产支持证券持有人的资金账户，或托管人根据管理人发出的分配指令，将本次分配资金直接支付至资产支持证券持有人的资金账户。

五、关于专项计划资产支持证券利息所得税的征收

资产支持证券利息所得税的征收事宜敬请持有人参考中证登上海公司相关业务规则与通知。

六、管理人联系方式

长城证券资产管理有限公司

地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 11 层

电话：0755-83516086

传真：0755-83553470

特此公告

长城证券资产管理有限公司

2026 年 4 月 20 日

