

锦州银行锦鲤鸿福3个月119期封闭式新客及代 发理财产品 2024年第三季度报告

产品管理人：锦州银行股份有限公司

产品托管人：中国工商银行股份有限公司

报 告 期：2024年07月01日-2024年09月30日

一、理财产品基本情况

产品名称	锦州银行锦鲤鸿福3个月119期封闭式新客及代发理财产品
理财产品代码	JLHFDS03MDX119A
产品登记编码	C1081424000190
产品托管机构	中国工商银行股份有限公司
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式净值型
产品投资性质	固定收益类
产品募集规模	2,000.00 万元
报告期末杠杆水平	129.88%
产品期限	98 天
风险级别	R2（中低风险）
产品起始日期	2024 年 08 月 29 日
产品终止日期	2024 年 12 月 05 日
业绩比较基准	2.00%~3.00%

二、净值、存续规模及收益表现

理财产品总份额	20,000,000.00
估值日期	2024-09-30
理财产品份额净值	1.0028
理财产品累计净值	1.0028
理财产品资产净值	20,055,521.95
成立以来年化收益率	3.10%

三、期末产品资产情况

资产类别	穿透前占总资产的比例	穿透后占总资产比例
现金及银行存款	-	0.03%
同业存单	-	4.44%
拆放同业及债券买入返售	-	0.01%
债券	-	95.52%

非标准化债权类资产	-	-
权益类资产	-	-
金融衍生品	-	-
代客境外理财投资 QDII	-	-
商品类资产	-	-
另类资产	-	-
公募基金	-	-
私募基金	-	-
资产管理产品	100.00%	-
委外投资——协议方式	-	-
合计	100.00%	100%

四、期末前十大资产持仓

序号	资产名称	代码	持有金额 (万元)	占净资产的比例
1	22 青岛银行永续债 01	092280017.IB	41.26	2.06%
2	21 中证 Y2	188529.SH	38.91	1.94%
3	21 光证 Y1	188104.SH	38.54	1.92%
4	21 富湾债 01	2180342.IB	34.27	1.71%
5	21 中证 Y1	188455.SH	34.02	1.70%
6	23 鲁黄金 MTN004(科创票据)	102381933.IB	32.59	1.63%
7	21 诸暨停车场债 01	2180292.IB	30.94	1.54%
8	21 温国控债 01	2180041.IB	29.77	1.48%
9	23 中电国际 MTN002	102383058.IB	26.33	1.31%
10	22 青岛银行永续债 02	092280064.IB	26.29	1.31%

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产

五、期末产品持有的非标准化债权类资产

该产品未持有非标准化债权类资产。

六、投资账户信息

户名	工行上海-锦州银行锦鲤鸿福3个月119期封闭式新客及代发
账号	1001252429200419492
开户行	中国工商银行股份有限公司上海市虹口支行

七、产品组合流动性风险分析

本产品为封闭式产品，存续期内无申购赎回，投资组合流动性管理主要体现在资产端久期及组合杠杆主动管理为主。市场方面，金融市场流动性整体宽松，利率持续低位波动，管理人维持适度的杠杆操作并控制产品久期，产品流动性稳健。