

锦州银行锦鲤鸿运速达 001 期开放式理财产品 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：招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	锦州银行锦鲤鸿运速达 001 期开放式
理财产品代码	JLHYDSSD01D001A
产品登记编码	C1081421000196
产品托管机构	招商银行股份有限公司
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式净值型
产品投资性质	固定收益类
产品存续份额	509,897,462.47
报告期末杠杆水平	108.10%
产品期限	1911 天
风险级别	R2（中低风险）
产品起始日期	2021 年 10 月 20 日
产品终止日期	2027 年 01 月 13 日
业绩比较基准	2.00%

二、净值、存续规模及收益表现

理财产品总份额	509,897,462.47
估值日期	2024-09-30
理财产品份额净值	1.0892
理财产品累计净值	1.0892
理财产品资产净值	555,388,789.68
成立以来年化收益率	3.02%

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	-	1.26%
同业存单	-	41.71%
拆放同业及债券买入返售	-	34.53%
债券	-	22.50%
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%	-
委托投资——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 国开 02	220202.IB	4,507.11	8.12%
2	19 徽商银行永续债	1920076.IB	3,728.21	6.71%
3	24 中国银行 CD003	112404003.IB	3,133.95	5.64%
4	24 兴业银行 CD057	112410057.IB	3,124.35	5.63%
5	24 北京银行 CD048	112412048.IB	3,120.69	5.62%
6	24 南京银行 CD083	112497217.IB	3,120.16	5.62%
7	24 浦发银行 CD156	112409156.IB	3,116.75	5.61%
8	24 浦发银行 CD154	112409154.IB	3,114.91	5.61%
9	24 建设银行 CD165	112405165.IB	3,112.34	5.60%
10	24 农业银行 CD198	112403198.IB	3,102.41	5.59%

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	锦州银行锦鲤鸿运速达 001 期开放式理财产品
账号	124904440710538
开户行	招商银行股份有限公司沈阳分行营业部

七、产品组合流动性风险分析

本产品为定期开放式产品，存续期可以申购及赎回，投资组合流动性管理要求较高。管理人通过动态调整资产组合的流动性，使其与产品申购、赎回安排相匹配，管理人在收到投资者赎回申请后及时进行变现操作。管理期内，管理人维持合理的高流动性资产持有比例（现金、国债、央票、政金债等）和适度的杠杆水平，并有效控制资产的久期结构，保障流动性稳健。