

东莞银行玉兰理财价值精选策略 5 号封闭式净值型理财产品 2024 年第三季度投资管理报告

报告日：2024 年 09 月 30 日

东莞银行玉兰理财价值精选策略 5 号封闭式净值型理财产品于 2024 年 03 月 05 日成立, 于 2024 年 03 月 05 日正式开始投资运作, 目前投资运作正常。

一、产品情况

产品名称	东莞银行玉兰理财价值精选策略 5 号封闭式净值型理财产品
产品类型	非保本浮动收益
风险评级	R2
全国银行业理财信息 登记系统登记编码	C1083123000140
东莞银行销售编码	JX0005
业绩基准	详见官网公告
管理人	东莞银行股份有限公司
托管人	中信银行股份有限公司

二、产品运行情况

产品报告日收益表现

日期	产品净值	产品累计 净值	产品资产净值	杠杆 水平
20240930	1.0220	1.0220	33,925,508.89	1.00

三、产品资产组合情况

穿透前资产分类表

资产类型	资产规模	资产占比
现金及活期存款	42,873.24	0.13%
集合资产管理计划	18,559,999.34	54.67%
同业借款	15,345,083.33	45.20%
合计	33,947,955.91	100.00%

穿透后资产分类表

资产类型	资产规模	资产占比
现金及活期存款	436,641.32	1.29%
公募基金	709,904.26	2.09%
同业存单	4,232,971.46	12.47%
债券类资产	13,223,355.54	38.95%
同业借款	15,345,083.33	45.20%
合计	33,947,955.91	100.00%

四、前十大资产持仓

序号	资产类型	资产明细	资产估值	占比
1	集合资产管理产品	华润信托·惠祥 2 号集合资金信托计划	16,216,264.09	47.77%
2	同业借款	皖江金融租赁股份有限公司同业借款 20240313001	15,345,083.33	45.20%
3	集合资产管理产品	粤财信托安享稳益 2 号集合资金信托计划	2,343,735.25	6.90%
4	现金及活期存款	现金及活期存款	42,873.24	0.13%

五、报告期内关联交易发生情况

报告期内投资关联方发行的证券情况

序号	关联方名称	资产代码	资产名称	买入规模（元）
1	-	-	-	-

报告期内投资关联方承销的证券情况

序号	关联方名称	资产代码	资产名称	买入规模（元）
1	-	-	-	-

报告期内其他重大关联交易

序号	关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	交易金额（元）
1	-	-	-	-	-

六、产品整体情况

截至本报告日，所有投资资产正常运营，未发现有异常情况或不利情况。

七、投资组合的流动性分析

投资组合的流动性风险是指本产品资金不足履行与负债相关义务的风险。流动性风险主要来自于本产品资产如市场不活跃，可能带来资产变现困难或资产在市场出现剧烈波动的情况下不能以合理价格变现的风险。

特此公告

东莞银行股份有限公司

2024年10月15日