

# 东莞银行玉兰理财莞利宝日日开 5 号净值型理财产品

## 2024 年第四季度暨年度投资管理报告

报告日：2024 年 12 月 31 日

东莞银行玉兰理财莞利宝日日开 5 号净值型理财产品于 2023 年 11 月 09 日成立，于 2023 年 11 月 09 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	东莞银行玉兰理财莞利宝日日开 5 号净值型理财产品
产品类型	非保本浮动收益
风险评级	R1
全国银行业理财信息 登记系统登记编码	C1083123000105
东莞银行销售编码	RRK05A/RRK05B
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	广州农村商业银行股份有限公司

### 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
20241231	1.027174	1.027174	2,978,107,999.88	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
现金及银行存款	272,666,919.56	9.15%
拆放同业及债券买 入返售	795,362,863.72	26.70%
债券	255,974,379.04	8.59%
公募基金	350,104,585.95	11.75%
资产管理产品	1,304,523,599.05	43.80%
合计	2,978,632,347.32	100.00%

穿透后资产分类表

资产类型	资产规模	资产占比
现金及银行存款	285,906,729.22	9.60%
拆放同业及债券买 入返售	795,362,863.72	26.70%
债券	1,547,191,993.54	51.94%
公募基金	350,111,732.67	11.75%
合计	2,978,632,347.32	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	资产管理产品	粤财信托·安享稳益 11 号集合资金 信托计划	765,650,635.65	25.70%
2	拆放同业及债券买 入返售	R007	584,265,207.72	19.62%
3	现金及银行存款	现金及活期存款	272,666,919.56	9.15%
4	资产管理产品	粤财信托·安享稳益 4 号集合资金信 托计划	213,849,640.06	7.18%
5	拆放同业及债券买 入返售	R014	187,095,946.16	6.28%
6	资产管理产品	粤财信托·安享稳益 12 号集合资金 信托计划	120,056,920.94	4.03%
7	资产管理产品	创金合信恒乐 12 号集合资产管理计 划	104,259,596.39	3.50%
8	公募基金	鹏华金元宝货币	100,035,571.20	3.36%
9	公募基金	国投瑞银钱多宝货币 A	100,034,656.93	3.36%
10	公募基金	创金合信货币 A	100,034,357.82	3.36%

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	东莞市水务集团有限公司	148909	24 东水 Y1	4,795.74

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

2025 年 02 月 28 日