

东莞银行玉兰理财莞利宝现金 1 号开放式净值型产品

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现金 1 号开放式净值型产品于 2019 年 03 月 15 日成立，于 2019 年 03 月 15 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	玉兰理财莞利宝现金 1 号开放式 净值型产品
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	C1083119000010
东莞银行销售编码	GXJ001/GXJ002/GXJ003/GXJ0 04
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	招商银行股份有限公司

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	1.169515	1.169515	893,136,888.93	1.09

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	103,546,213.31	10.63%
同业存单	179,716,888.96	18.44%
拆放同业及债券买 入返售	162,522,068.40	16.68%
债券	528,605,901.54	54.25%
合计	974,391,072.21	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	103,546,213.31	10.63%
同业存单	179,716,888.96	18.44%
拆放同业及债券买 入返售	162,522,068.40	16.68%
债券	528,605,901.54	54.25%
合计	974,391,072.21	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	拆放同业及债券买 入返售	R007	120,009,724.25	12.32%
2	现金及银行存款	现金及活期存款	103,546,213.31	10.63%
3	债券	24 广州发展 SCP001	70,868,231.38	7.27%
4	债券	22 城投公路 MTN001	61,653,766.56	6.33%
5	债券	20 锡交通 PPN001	52,053,449.74	5.34%
6	债券	22 绍兴交投 PPN001	51,632,658.45	5.30%
7	债券	20 国开 03	51,592,332.00	5.29%
8	债券	24 浙国贸 SCP001	50,409,678.25	5.17%
9	债券	24 南通沿海 SCP011	50,134,924.45	5.15%
10	债券	24 大横琴 SCP006	50,106,123.57	5.14%

五、产品前十大投资者情况

排名	客户号	客户类别	持有份额	总份额	占比
1	2019061700204318	机构	52,332,053.00	763,681,151.03	6.78%
2	5001106931	机构	38,720,678.98	763,681,151.03	5.01%
3	2023121101735866	机构	25,831,583.93	763,681,151.03	3.34%
4	2019041700193907	机构	8,880,286.21	763,681,151.03	1.15%
5	2021092900918235	机构	8,720,083.57	763,681,151.03	1.13%
6	2022062901132387	机构	8,551,006.33	763,681,151.03	1.11%
7	2022122801297735	机构	7,838,412.52	763,681,151.03	1.01%
8	2016091900046567	机构	7,756,725.92	763,681,151.03	1.00%
9	2015101900018023	机构	7,743,672.92	763,681,151.03	1.00%
10	2015081900011391	机构	7,685,455.28	763,681,151.03	1.00%

单一投资者持有产品份额达到或者超过该产品总份额 20%的情况：

客户号	客户类别	持有份额	总份额	占比	持有份额变化情况
-	-	-	-	-	-

六、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	-	-	-	-	-

七、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。

八、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