

锦州银行锦鲤鸿运周到 001 期开放式理财产品 2023 年上半年报告暨第二季度报告

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：2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日

一、理财产品基本情况

产品名称	锦州银行锦鲤鸿运周到 001 期开放式
理财产品代码	JLHYDSZD07D001A
产品登记编码	C1081421000197
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	614,745,962.25
报告期末杠杆水平	106.99%
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	3.10%

二、净值、存续规模及收益表现

理财产品总份额	614,745,962.25
估值日期	2023-06-30
理财产品份额净值	1.0572
理财产品累计净值	1.0572
理财产品资产净值	649,906,069.90
成立以来年化收益率	3.37%

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	-	0.82%
同业存单	-	17.25%
拆放同业及债券买入返售	-	0.18%
债券	-	81.75%
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%	100.00%

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 16	220216.IB	3,808.80	5.86%
2	19 徽商银行永续债	1920076.IB	2,451.27	3.77%
3	20 邮储银行永续债	2028006.IB	2,137.26	3.29%
4	23 建设银行 CD035	112305035.IB	2,065.43	3.18%
5	23 交通银行 CD136	112306136.IB	2,054.27	3.16%
6	23 农业银行 CD093	112303093.IB	2,052.74	3.16%
7	22 光大环境 GN001(碳中和债)	132280033.IB	1,900.63	2.92%
8	20 盐城高新 MTN002	102001872.IB	1,758.80	2.71%
9	21 周口城投 PPN002	032180050.IB	1,517.97	2.34%
10	19 鹰投 02	162753.SH	1,514.11	2.33%

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	锦州银行锦鲤鸿运周到 001 期开放式理财产品
账号	124904440710339
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。