

“龙银理财睿骐理财产品” 2024 年第 1 季度运行报告

一、产品基本信息

| | |
|-----------------|----------------|
| 产品名称 | 龙银理财睿骐理财产品 |
| 产品编码 | RQ2023001 |
| 全国银行业理财信息登记系统编码 | C1128823000217 |
| 成立日 | 2023年11月01日 |
| 产品投资性质 | 固定收益类 |
| 产品运作方式 | 开放式净值型 |

二、产品表现

(一) 产品存续规模 (份额) : 1,999,857,992.12

(二) 期末资产净值 (元) : 1,999,938,890.83

(三) 产品收益表现:

| | |
|---------|----------|
| 份额单位净值 | 份额累计净值 |
| 1.00004 | 1.012453 |

三、产品投资资产种类及比例:

| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占产品总资产的比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1 | 固定收益投资 | 1,836,263,367.30 | 90.71 |
| | 其中: 债券 | 349,367,105.35 | 17.26 |
| | 非标资产 | 1,428,601,489.91 | 70.57 |
| | 资产支持证券 | 58,294,772.04 | 2.88 |
| 2 | 权益投资 | 49,587,394.82 | 2.45 |
| | 其中: 基金 | 49,587,394.82 | 2.45 |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 136679263.2 | 6.75 |
| | 其中: 买断式回购 | - | - |
| 5 | 银行存款合计 | 1,797,958.15 | 0.09 |
| 6 | 其他资产 | - | - |
| 7 | 合计 | 2,024,327,983.47 | 100 |

由于四舍五入的原因分项之和与合计项之间可能存在尾差。

四、前十项持仓资产明细

| 序号 | 资产名称 | 资产规模(元) | 占产品资产净值比例 (%) |
|----|----------------|----------------|---------------|
| 1 | 交银国信汇利 247 号 | 890,236,156.97 | 44.51 |
| 2 | 交银国信蓝色港湾 | 519,052,265.13 | 25.95 |
| 3 | 上交所协议式回购 R007 | 41,336,364.62 | 2.07 |
| 4 | 荟享 101A | 40,482,641.10 | 2.02 |
| 5 | 深交所协议式回购 R-007 | 40,023,780.82 | 2.00 |
| 6 | 上交所协议式回购 R014 | 32,289,609.16 | 1.61 |
| 7 | 23 瀚瑞投资 PPN003 | 31,320,654.59 | 1.57 |
| 8 | 21 进出 13 | 30,496,489.67 | 1.52 |
| 9 | 23 农发清发 02 | 30,214,264.93 | 1.51 |
| 10 | 创金合信睿存 2 号 | 24,557,771.77 | 1.23 |

由于四舍五入的原因分项之和与合计项之间可能存在尾差。

五、报告期末投资组合流动性风险分析

流动性风险是指因市场内部和外部的原因造成理财产品所持金融工具变现的难易程度,如果持有资产不能迅速变成现金,或者变现时对理财产品净值产生冲击成本,都会影响资产运作和收益水平。尤其是在资产委托人进行大额退出申请时,如果资产管理计划变现能力差,可能会产生资产管理计划财产调整的困难 导致流动性风险,从而影响理财产品收益。

龙江银行股份有限公司

2024 年 3 月 31 日