

吉林银行吉利财富吉稳系列B款2023年第12期

2024年度第一季度运行报告

尊敬的客户：

现将我行吉林银行吉利财富吉稳系列B款2023年第12期2024年度第一季度运行情况公布如下：

一、产品基本信息

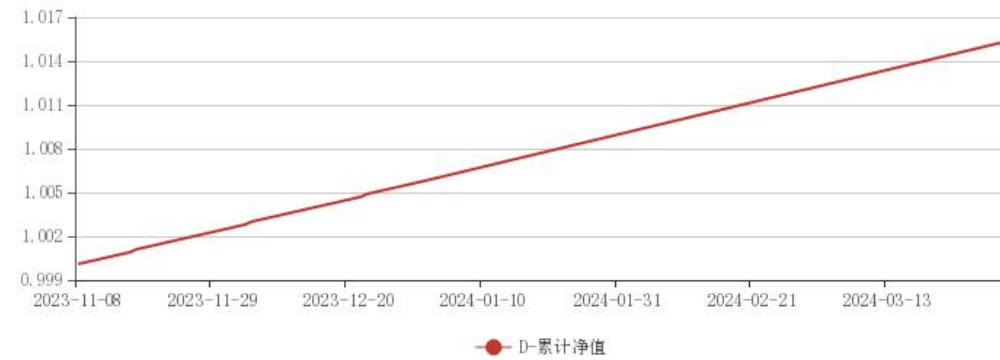
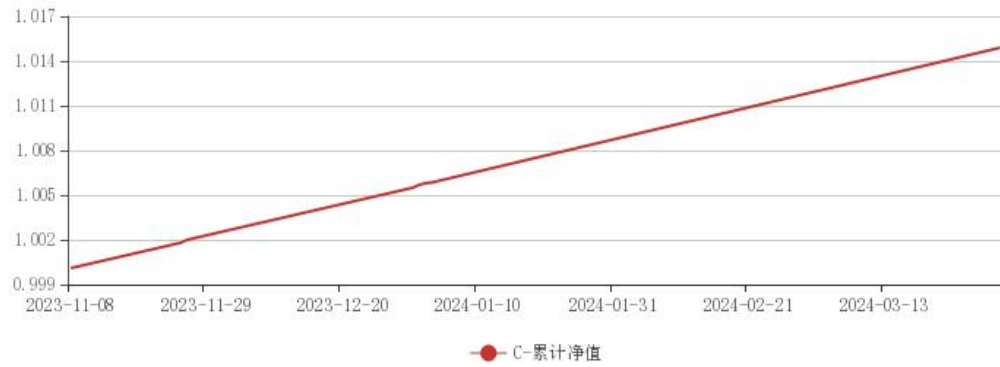
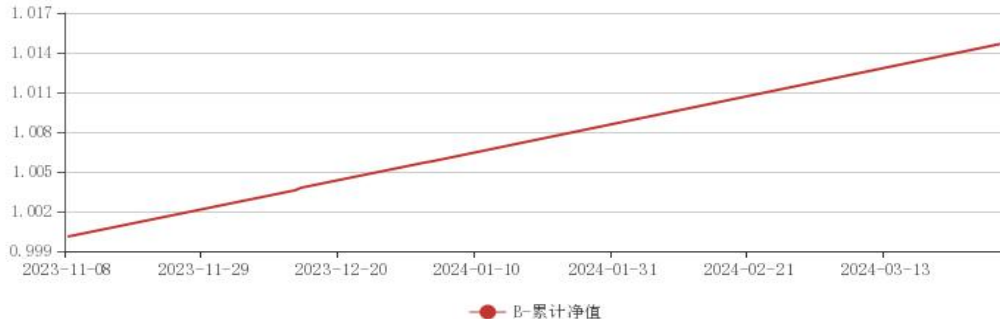
产品名称	吉林银行吉利财富吉稳系列B款2023年第12期
产品代码	CGB2023012
产品登记编码	C1086723000078
成立日	2023年11月08日
到期日	2024年12月11日
期限（天）	399
业绩比较基准	A类份额：3.65%（年化）； B类份额：3.70%（年化）； C类份额：3.75%（年化）； D类份额：3.85%（年化）； 本产品为净值型产品，其业绩表现将随市场波动，具有不确定性。业绩比较基准是管理人按照产品说明书的投资范围要求，考虑当前市场环境和资产储备情况，根据同类产品历史平均业绩及相应预投资资产市场收益水平，进行静态测算和情景分析综合预估得出。 业绩比较基准不是预期收益率，不代表理财产品的未来表现和实际收益，不构成对委托财产收益的任何暗示或保证，不构成对理财产品的任何收益承诺，投资须谨慎。 该业绩比较基准已经扣除各项费用。
产品类型	固定收益类
产品风险等级	三级（中）
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式净值型
产品托管人	南京银行股份有限公司
产品管理人	吉林银行股份有限公司
杠杆率	100.00%

销售手续费费率	A类份额：0.30%（年）； B类份额：0.24%（年）； C类份额：0.20%（年）； D类份额：0.10%（年）；
投资管理费率	A类份额：0.30%（年）； B类份额：0.30%（年）； C类份额：0.30%（年）； D类份额：0.30%（年）；
托管费率	A类份额：0.01%（年）； B类份额：0.01%（年）； C类份额：0.01%（年）； D类份额：0.01%（年）；

二、产品存续规模、净值及收益表现

产品代码	存续规模	份额净值	份额累计净值	资产净值	期间累计净值增长率
CGB2023012_A	23,679.50万元	1.01450004	1.01450004	24,022.85万元	0.90%
CGB2023012_B	15,000.00万元	1.01469902	1.01469902	15,220.49万元	0.90%
CGB2023012_C	15,000.00万元	1.01489756	1.01489756	15,223.46万元	0.91%
CGB2023012_D	21,154.00万元	1.01529409	1.01529409	21,477.53万元	0.94%





三、期末产品资产持仓情况

序号	资产类别	穿透前占总资产比例	穿透后占总资产比例
1	现金及银行存款	1.99%	2.00%
2	同业存单	0.00%	0.35%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.37%
4	债券	89.64%	95.31%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.00%
7	金融衍生品	0.00%	0.00%

8	待客境外理财投资 QDII	0.00%	0.00%
9	商品类资产	0.00%	0.00%
10	另类资产	0.00%	0.00%
11	公募基金	1.95%	1.96%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	6.42%	0.00%
14	委外投资-协议方式	0.00%	0.00%
15	合计	100.00%	100.00%

注：由于计算中四舍五入的原因，占总资产的比例可能存在尾差。

四、期末前十项资产明细

序号	资产名称	投资金额（元）	投资占比
1	广西北部湾银行股份有限公司2023年无固定期限资本债券	63,280,620.00	8.33%
2	长春润德投资集团有限公司2020年度第二期债券融资工具	52,707,800.00	6.94%
3	中国农业发展银行2023年第二十期金融债券	51,497,750.00	6.78%
4	河南航空港投资集团有限公司2023年度第十一期定向债务融资工具（可持续挂钩）	50,993,700.00	6.71%
5	中信期货-粤湾4号集合资产管理计划	50,060,000.00	6.59%
6	天津泰达投资控股有限公司2024年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）	50,018,550.00	6.59%
7	长春市城市发展投资控股(集团)有限公司2022年非公开发行公司债券（第三期）	46,509,975.00	6.12%
8	2021年第九期中国铁路建设债券（10年期）	42,334,760.00	5.57%
9	2022年吉林省长春市轨道交通集团有限公司绿色债券（第一期）	41,054,880.00	5.41%
10	2020年天津农村商业银行股份有限公司二级资本债券	40,885,120.00	5.38%

五、投资组合风险分析

（一）流动性风险分析

本理财产品投资策略以稳健型资产配置为主，管理人合理安排资产配置结构，主要投资于货币市场工具、金融债、高信用级别的信用类债券等金融工具，保持一定比例的高流动性资产。资产与产品最大限度匹配，适度增加杠杆比例，保证产品流动性合理充裕。报告期内，本产品未发生流动性风险。

(二) 投资风险情况分析

1. 产品债券持仓风险及价格波动情况

报告期内，本产品所投资债券资产的市场价格波动处于合理区间范围内。

2. 产品权益类资产持仓风险及价格波动情况

报告期内，本产品合理控制权益仓位，权益类资产的市场价格波动处于合理区间范围内。

六、投资账户信息

序号	账户类型	账户编号	账户名称	开户单位
1	0501080000001390	托管账户	南京银行北京分行 吉林银行吉利财富 吉稳系列B款2023 年第12期	南京银行北京分行

七、投资非标准化债权类资产清单

项目名称	融资客户名称	剩余融资期限(年)	年化收益率(%)	交易结构	风险状况
-	-	-	-	-	-

八、产品整体运作情况

资产配置上，以债券为代表的固定收益类资产占据绝对主导地位，资产管理产品类资产占比适中，同时兼顾配置了公募基金、现金、买入返售及同业存单等资产，力争在产品运行中实现风险的有效分散，并扩充收益来源的多元化。

本产品自成立至本报告日，产品管理人严格遵守有关法律、行政法规和相关文件的规定，审慎管理。截至本报告日，所投资资产运营正常，未发现异常情况或损害投资者利益的情况。

特此公告。

