

长沙银行金芙蓉长盈 9 个月周期滚动式净值型理财产品
(2021130) 2024 年第一季度报告

产品管理人：长沙银行股份有限公司

产品托管人：兴业银行股份有限公司长沙分行

§1 重要提示

1. 理财产品管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
2. 理财产品管理人承诺以诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用理财产品资产，但不保证理财产品本金和收益。
3. 本报告所引用的业绩表现仅代表过往业绩表现，过往的业绩表现亦不作为日后投资回报的预示，长沙银行不承诺也不保证任何投资回报。
4. 理财产品托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5. 本报告期自 2024 年 01 月 01 至 2024 年 03 月 31 日止。

§2 产品基本情况

产品名称	长沙银行金芙蓉长盈 9 个月周期滚动式净值型理财产品
产品代码	2021130
登记编码	C1086221000141
理财币种	人民币
产品类型	固定收益类开放式净值型
发行方式	公募
产品管理人	长沙银行股份有限公司
产品托管人	兴业银行股份有限公司长沙分行
产品成立日	2021 年 09 月 22 日
风险等级	中低风险
业绩比较基准	3.85%
报告期末的产品份额总额(份)	4,734,292,580.26
报告期末杠杆水平	109.78%

注：报告期末杠杆水平=报告期末理财产品总资产/净资产

§3 产品规模及收益情况

截至 2024 年 03 月 31 日，长沙银行金芙蓉长盈 9 个月周期滚动式净值型理财产品的产品份额总额为 4,734,292,580.26 份，产品份额净值为 1.1035 元，产品份额累计净值为 1.1035 元，产品资产净值为 5,224,387,799.05 元。截至 2024

年03月29日,长沙银行金芙蓉长盈9个月周期滚动式净值型理财产品的产品份额总额为4,734,292,580.26份,产品份额净值为1.1034元,产品份额累计净值为1.1034元,产品资产净值为5,223,878,807.01元。

产品的收益率表现如下:

阶段	年化收益率
过去一个月	1.6%
过去三个月	3.37%
近半年	3.51%
近1年	4.29%
近3年	-
近5年	-
成立以来	4.1%

§4 产品组合情况及流动性分析

4.1 报告期末投资组合资产配置情况

投资方式	资产种类	市值余额(元)	占产品总资产比例(%)
直接投资	现金及银行存款	3,690,808.58	0.06%
	债券	4,090,608,996.42	71.32%
	同业存单	227,255,075.17	3.96%
	公募基金	531,585,134.09	9.27%
	其他	4,839,315.07	0.08%
	小计	4,857,979,329.33	84.70%
间接投资	资产管理产品	877,421,218.91	15.30%
	小计	877,421,218.91	15.30%
总计		5,735,400,548.24	100%

注:资产分类遵照中债资产负债要素表分类标准进行。

4.1.1 报告期末本产品投资的资产管理产品底层资产信息

序号	资产种类	市值余额(元)	占产品总资产比例(%)
1	现金及银行存款	1,033,908.29	0.02%
2	债券	375,356,769.86	6.54%
3	同业存单	8,155,112.92	0.14%
4	公募基金	6,657,259.58	0.12%
5	拆放同业及买入返售	485,898,504.22	8.47%
6	其他	319,664.04	0.01%
合计		877,421,218.91	15.30%

注:1.资产分类遵照中债资产负债要素表分类标准进行。2.本表统计的资产管理产品不包括公开募集证券投资基金。若投资多个资产管理产品,则合并计算底层资产信息。3.投资比例为资产管理计划底层各类资产占本理财产品总资产比例。

4.2 投资组合流动性分析

截至 2024 年 03 月 31 日，本产品持有的现金或到期日在一年以内的国债、中央银行票据和政策性金融债券市值余额占净值比为 5.32%；直接或间接持有的非标准化债权资产市值余额占净值比为 0.00%，非标准债权类资产（如有）的终止日均在产品到期日或最近开放日之前。本产品通过合理安排投资品种和期限结构、限制资产持仓集中度、监控组合资金头寸等方式管理产品的流动性风险，确保资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配。本理财产品将严格遵守相关法律法规和产品合同，密切跟踪经济基本面、政策面、资金面等情形，做好产品的流动性管理。本报告期内，本产品未发生流动性风险。

4.3 报告期末本产品投资的前十项资产情况如下：

序号	资产名称	市值余额(元)	占产品净值比例(%)
1	创金合信恒利 51 号集合资产管理计划	777,351,726.21	14.88%
2	鹏华稳利短债 A	121,597,707.70	2.33%
3	创金合信长策 2 号集合资产管理计划	100,069,492.70	1.92%
4	21 天易 MTN001	84,883,086.34	1.62%
5	20 邵阳城投 PPN003	83,436,623.83	1.60%
6	24 张家经投 CP001	75,004,610.96	1.44%
7	21 齐鲁银行永续债	68,555,751.45	1.31%
8	19 城陵矶 MTN001	61,743,187.84	1.18%
9	21 进出 13	60,992,979.34	1.17%
10	21 北京银行永续债 02	52,138,299.18	1.00%

4.4 报告期末产品持有的非标准化债权类资产情况如下：

本产品未持有非标准化债权类资产，不适用。

4.5 理财产品报告期内参与关联方情况

4.5.1 理财产品在报告期内投资关联方发行的证券的情况

报告期内未发生投资关联方发行的证券的情况，不适用。

4.5.2 理财产品在报告期内投资关联方承销的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券简称	交易金额(单位:元)
中信银行股份有限公司	012384494	23 徐州交通 SCP004	30,042,346.39
	012480309	24 绍兴交投 SCP001	20,013,966.12
	10248	24 苏州高	19,978,682.62

	0536	新 MTN001	
兴业银行股份有限公司	10248 0160	24 株洲城 建 MTN001	10,000,855.19
	10248 0474	24 宜春发 展 MTN001	20,001,579.23
招商银行股份有限公司	21280 38	21 农业银 行永续债 01	31,130,673.70
	21200 89	21 北京银 行永续债 01	10,594,998.20
	10210 1895	21 深圳特 发 MTN001	40,778,764.59
	09228 0105	22 南京银 行永续债 01	20,655,818.58
	09228 0105	22 南京银 行永续债 01	20,666,338.03
	21200 89	21 北京银 行永续债 01	10,600,591.97
招商银行股份有限公司,兴业银行股份有限公司	10248 0948	24 瀚 蓝 MTN002	9,970,965.75
长沙银行股份有限公司	01248 0057	24 潇湘源 SCP001	10,000,150.00
	04248 0140	24 张家经 投 CP001	75,000,150.00
长沙银行股份有限公司,兴业银行股份有限公司,中 信银行股份有限公司	23021 0	23 国 开 10	10,496,376.07
长沙银行股份有限公司,兴业银行股份有限公司,中 信银行股份有限公司	23021 0	23 国 开 10	20,929,062.30
长沙银行股份有限公司,兴业银行股份有限公司,中 信银行股份有限公司	23021 0	23 国 开 10	10,542,609.51

4.5.3 理财产品在报告期内与关联方作为对手进行的交易的情况

报告期内未发生与关联方作为对手进行的交易的情况，不适用。

4.5.4 理财产品在报告期内其他关联交易的情况

报告期内未发生其他关联交易的情况，不适用。

4.5.5 理财产品在报告期内向关联方支付的费用情况

关联方名称	费用类型	应支付金额（单位：元）
长沙银行股份有限公司	管理费	5,553,182.92
兴业银行股份有限公司	托管费	111,063.65
长沙银行股份有限公司	销售服务费	3,331,909.78

§5 托管人报告

本报告期内，兴业银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对本产品的托管过程中，严格遵守了《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《商业银行理财业务监督管理办法》《商业银行理财子公司管理办法》等相关法律法规、托管协议的规定，依法安全保管了本产品的全部资产，对本产品的投资运作进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，没有从事任何损害产品份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了托管人应尽的义务。

本托管人复核了本产品报告中的“产品份额总额、产品份额净值、产品份额累计净值、产品资产净值及报告期内向关联方支付的费用”等内容。经复核，本产品报告中披露的上述理财产品财务数据核对一致。

长沙银行

2024年04月11日