

“2024 港湾财富 77 期-B”产品半年度运行公告

单位：元

1、理财产品概况

| | |
|-----------|-------------------------------|
| 报告日 | 2024 年 06 月 30 日 |
| 产品名称 | 2024 港湾财富 77 期-B |
| 产品代码 | 2024GW077B |
| 产品登记编码 | C1080324000112 |
| 币种 | 人民币 |
| 产品发行日 | 2024 年 03 月 26 日 |
| 产品到期日 | 2026 年 03 月 19 日 |
| 募集方式 | 公募 |
| 理财产品存续份额 | 35,816,000.00 |
| 理财产品资产净值 | 36,219,038.69 |
| 单位净值 | 1.011253 |
| 累计净值 | 1.011253 |
| 业绩比较基准 | 3.45%-4.05% |
| 客户端对应单位净值 | 1.011253 |
| 产品类型 | 固定收益类 |
| 产品流动性 | 报告期内，本理财产品投资运作正常，投资组合流动性风险可控。 |
| 理财产品托管人 | 招商银行股份有限公司天津分行 |
| 投资账户信息 | 账户名称：天津银行-港湾财富封闭净值型系列理财产品 |
| | 账号：00000032339 |
| | 开户行：中央结算公司 |
| | 账户名称：天津银行-港湾财富封闭净值型系列理财产品 |
| | 账号：B2179901 |
| | 开户行：银行间市场清算所 |

2、投资组合报告

2.1 投资组合基本情况

| | |
|------|---------|
| 杠杆水平 | 100.21% |
|------|---------|

2.2 资产配置情况

| 序号 | 资产种类 | 占投资组合总资产比例 |
|----|------|------------|
|----|------|------------|

| | | 直接投资 | 间接投资 |
|---|------------------|--------|--------|
| 1 | 现金、银行存款、货币市场工具类 | 41.97% | 45.90% |
| 2 | 债券、ABS 等标准化固定收益类 | 48.39% | 52.04% |
| 3 | 非标准化债权类 | 0.00% | 0.00% |
| 4 | 权益类 | 0.00% | 0.00% |
| 5 | 公募基金 | 0.00% | 2.06% |
| 6 | 资产管理计划 | 9.64% | 0.00% |
| 7 | 其他类 | 0.00% | 0.00% |

2.3 非标准化债权资产明细

| 序号 | 融资客户 | 项目名称 | 剩余融资期限 (天) | 交易结构 | 收益率 | 风险状况 |
|----|------|------|---------------|------|-----|------|
| - | - | - | - | - | - | - |

2.4 占产品资产净值前十大投资资产明细

| 序号 | 代码 | 资产名称 | 规模 | 占投资组合的比例 |
|----|-----------|-------------------|--------------|----------|
| 1 | 112406018 | 24 交通银行 CD018 | 4,997,361.57 | 9.59% |
| 2 | 112304020 | 23 中国银行 CD020 | 4,996,057.12 | 9.59% |
| 3 | 112421021 | 24 渤海银行 CD021 | 4,994,762.64 | 9.58% |
| 4 | 102382517 | 23 津渤海 MTN004 | 4,469,626.23 | 8.58% |
| 5 | 177311 | 20 津建 03 | 4,287,013.70 | 8.23% |
| 6 | 032281065 | 22 国金租赁 PPN001 | 4,166,524.59 | 7.99% |
| 7 | 1928021 | 19 农业银行永续债 01 | 4,165,145.21 | 7.99% |
| 8 | 2128024 | 21 中国银行 02 | 4,109,478.36 | 7.89% |
| 9 | 240672 | 山招 YK03 | 4,074,094.25 | 7.82% |
| 10 | - | 渤海汇金海纳天汇集资 管计划 | 4,033,856.90 | 7.74% |

备注：上述披露信息为该产品报告日日终的投资情况，该数据仅供参考，实际投资比例以银行投资运作情况为准。本报告中资产配置及投资明细数据为 2024 港湾财富 77 期-A，2024 港湾财富 77 期-B，2024 港湾财富 77 期-C 社保工会双卡专属的合计数据。