
长城理财之日日鑫净值型理财产品

2022年第一季度报告

2022年03月31日

理财产品管理人:长城华西银行股份有限公司

理财产品托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年04月26日

§ 1 理财产品概况

理财产品简称	长城理财之日日鑫净值型理财产品
理财产品登记编码	C1079421000016
理财产品运作方式	开放式净值型
理财产品合同生效日	2021年08月03日
报告期末理财产品份额总额	1,547,785,351.85份
理财产品管理人	长城华西银行股份有限公司
理财产品托管人	招商银行股份有限公司

§ 2 主要财务指标和理财净值表现

2.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年01月01日 - 2022年03月31日）
1. 本期利润	15,543,212.51
2. 期末理财资产净值	1,547,785,351.85
3. 期末份额净值	1.0000
4. 期末份额累计净值	1.0000

2.2 理财产品七日年化收益率变动情况



§ 3 投资组合报告

3.1 报告期末理财资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占理财总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,687,326,151.52	91.15
	其中：债券	779,412,321.36	42.11
	同业存单	907,913,830.16	49.05
	资产支持证券	—	0.00
2	现金及现金等价物	163,763,914.93	8.85
3	应收利息	—	0.00
4	间接投资	—	0.00
	其中：债券及资产支持证券	—	0.00
	非标准化债权资产	—	0.00
	其他资产	—	0.00
	资产合计	1,851,090,066.45	100.00

3.2 报告期末按摊余成本/公允价值占理财产品资产净值比例大小排名的前十名 资产投资明细

序号	资产代码	资产名称	资产类别	金额（元）	占理财产品资产净值比例（%）
1	210211	21国开11	债券	162,075,523.98	10.47
2	1920022	19吉林银行小微债01	债券	114,038,782.05	7.37
3	101900611	19沪港务MTN002	债券	103,128,505.78	6.66
4	112106155	21交通银行CD155	债券	99,624,775.20	6.44
5	112182654	21桂林银行CD164	债券	69,510,694.90	4.49
6	112115338	21民生银行CD338	债券	68,857,507.13	4.45
7	162115	19川纾01	债券	51,883,954.14	3.35
8	196996	21凉山D3	债券	51,706,081.00	3.34
9	101800130	18川高速MTN001	债券	51,413,328.89	3.32
10	101900881	19中电投MTN012A	债券	51,292,334.14	3.31

3.3 “影子定价”与“摊余成本法”确定的理财资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	8
报告期内偏离度的最高值	0.2860%
报告期内偏离度的最低值	0.1458%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2053%

§ 4 开放式理财份额变动

单位：份

报告期期初理财份额总额	1,942,867,351.85
报告期期间理财总申购份额	3,808,316,000.00
报告期期间理财总赎回份额	4,203,398,000.00
报告期期末理财份额总额	1,547,785,351.85

§ 5 流动性风险分析

本理财产品资金主要投资于存单、货币市场工具、债券及资产支持证券，所投资品种可在交易所市场或银行间市场交易，变现能力强。

存单、货币市场工具、现金等高流动性资产占产品资产净值的比例约为69.24%，产品整体流动性风险可控。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

《长城理财之日日鑫净值型理财产品 2022 年第一季度报告》正文

6.2 存放地点

四川省成都市高新区天府二街 333 号

6.3 查阅方式

<https://www.gwbank.com.cn>

长城华西银行股份有限公司

2022年3月31日