

长城理财之日日鑫净值型理财产品

2021年年度报告

2021年12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

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	开放式净值型产品
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	1,942,867,351.85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（2021年08月03日 - 2021年12月31日）
1. 本期利润	12,033,638.89
2. 期末理财资产净值	1,942,867,351.85
3. 期末份额净值	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	1,893,552,896.16	90.82
	其中：债券	1,063,908,260.96	51.03
	同业存单	829,644,635.20	39.79
	资产支持证券	—	0.00
2	现金及现金等价物	163,299,825.55	7.83
3	应收利息	28,132,219.89	1.35
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	2,084,984,941.60	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	159,706,763.34	8.22
2	112182654	21桂林银行CD164	债券	118,188,194.21	6.08
3	1920022	19吉林银行小微债01	债券	110,068,963.52	5.67
4	101900611	19沪港务MTN002	债券	99,861,726.42	5.14
5	112183543	21广西北部湾银行CD201	债券	64,524,990.69	3.32

6	101800130	18川高速MTN001	债券	51,316,090.58	2.64
7	162115	19川纾01	债券	50,037,463.05	2.58
8	155548	19电气01	债券	50,024,152.01	2.57
9	196996	21凉山D3	债券	50,000,040.46	2.57
10	012102693	21甘国投SCP003	债券	49,994,315.21	2.57

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2008%
报告期内偏离度的最低值	-0.0517%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0912%

4 开放式理财份额变动

单位：份

报告期期初理财份额总额	615,000.00
报告期期间理财总申购份额	4,825,969,884.52
报告期期间理财总赎回份额	2,883,717,532.67
报告期期末理财份额总额	1,942,867,351.85

5 前十大投资明细

序号	投资者类别	持有份额（份）	份额占比
1	个人	30,000,000.00	1.54%
2	机构	30,000,000.00	1.54%
3	机构	30,000,000.00	1.54%
4	机构	30,000,000.00	1.54%
5	机构	30,000,000.00	1.54%
6	机构	26,300,000.00	1.35%
7	机构	25,000,000.00	1.29%
8	机构	25,000,000.00	1.29%
9	机构	25,000,000.00	1.29%
10	机构	20,000,000.00	1.03%
合计		271,300,000.00	13.96%

6 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51.11%，产品整体流动性风险可控。

7 托管人报告

一、理财产品托管情况

（一）托管产品基本情况

在本报告期内，招商银行成都分行托管长城理财之日日鑫净值型理财产品的基本情况：

产品全称： 长城理财之日日鑫净值型理财产品	成立日期： 2021年8月3日
--------------------------	--------------------

（二）履职情况

1. 托管资产托管

托管资产独立于招商银行的自有资产及其托管的其他资产，不同投资账户之间的托管资产之间互相独立。

我行按照监管相关规定，完整保存与托管资产有关的会计档案、与托管资产有关的投资记录、指令和合同等。

2. 会计核算和估值

我行与长城华西银行股份有限公司按照《长城理财之日日鑫净值型理财产品托管合同》约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和托管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值。

3. 定期核对有关数据

我行根据托管协议约定与长城华西银行股份有限公司定期进行账务核对。

4. 投资监督

招商银行根据法规、托管协议以及双方约定的投资监督条款，对长城华西银行股份有限公司的长城理财之日日鑫净值型理财产品的投资行为进行监督。

二、托管人声明

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在对长城理财之日日鑫净值型理财产品托管的过程中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全托管托管资产。

8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

《长城理财之日日鑫净值型理财产品 2021 年年度报告》正文

8.2 存放地点

四川省成都市高新区天府二街 333 号

8.3 查阅方式

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

长城华西银行股份有限公司

2021年12月31日