

**长城华西银行股份有限公司长城理财之月享利28天开放式
净值型理财产品**

2022年第二季度报告

2022年06月30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：南京银行托管部

1、理财产品基本情况

| 项目 | 信息 |
|--------------|-----------------------|
| 理财产品名称 | 长城理财之月享利28天开放式净值型理财产品 |
| 理财产品编码 | C1079420000052 |
| 理财产品代码 | JX06JZXKH28D |
| 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(如有) | 南京银行托管部 |
| 投资顾问(如有) | 无 |
| 理财产品运作方式 | 开放式净值型 |
| 理财产品成立日期 | 2020年09月17日 |
| 报告期末理财产品份额总额 | 3,733,051,668.72 |
| 业绩比较基准(如有) | 3.80% |
| 风险收益特征 | 非保本浮动收益 |

2、理财产品净值表现

| 阶段 | 净值增长率(%) | 净值增长率标准差(%) | 业绩比较基准收益率(%) |
|--------------|----------|-------------|--------------|
| 当季 | 1.01 | 0.0008 | 1.07 |
| 自理财产品合同生效起至今 | 7.78 | 0.0017 | 7.68 |

说明：净值增长率等于(期末累计净值-期初累计净值)/期初累计净值

当季净值增长率等于(本季度末累计净值-本季度初累计净值)/本季度初累计净值

3、主要财务指标

单位：人民币元

| | |
|------------|-----------------------|
| 项目 | 2022-04-01至2022-06-30 |
| 本期已实现收益 | 30519716.79 |
| 本期利润 | 44084039.34 |
| 期末理财产品资产净值 | 4023384280.84 |
| 期末理财产品份额净值 | 1.07777 |
| 偏离度 | 0.00% |
| 偏离金额 | 0.00 |

4、投资组合报告

4.1 期末理财产品资产组合情况

单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占理财产品总资产的比例(%) |
|----|----|----|----------------|
|----|----|----|----------------|

| | | | |
|---|-------------------|------------------|-------|
| 1 | 权益投资 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：普通股 | 0.00 | 0.00 |
| | 存托凭证 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 基金投资 | 1,273,062,241.85 | 31.08 |
| 3 | 固定收益投资 | 2,636,873,367.55 | 64.38 |
| | 其中：债券 | 2,636,873,367.55 | 64.38 |
| | 理财直接融资工具 | 0.00 | 0.00 |
| | 非标准债权投资 | 0.00 | 0.00 |
| | 资产支持证券 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 金融衍生品投资 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：远期 | 0.00 | 0.00 |
| | 期货 | 0.00 | 0.00 |
| | 期权 | 0.00 | 0.00 |
| | 权证 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 货币市场工具 | 0.00 | 0.00 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 185,836,676.03 | 4.54 |
| 8 | 其他各项资产 | 169,759.69 | 0.00 |
| | 合计 | 4,095,942,045.12 | |
| | 合计 | 4,095,942,045.12 | |

注：其他各项资产：主要包括银行存款和结算备付金应收利息、其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、信托计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

4.2报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 (元) | 占理财产品净值比例 (%) |
|----|------------|------------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 央行票据 | 0.00 | 0.00 |
| 3 | 金融债券 | 278,782,474.79 | 6.93 |
| | 其中：政策性金融债 | 175,054,408.35 | 4.35 |
| 4 | 企业债券 | 790,342,546.38 | 19.64 |
| 5 | 企业短期融资券 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 中期票据 | 99,032,141.10 | 2.46 |
| 7 | 可转债 (可交换债) | 0.00 | 0.00 |
| 8 | 同业存单 | 345,542,980.23 | 8.59 |
| 9 | 私募债 | 345,542,980.23 | 8.59 |
| 10 | 公司债 | 345,542,980.23 | 8.59 |
| 11 | 其他 | 1,123,173,225.05 | 27.92 |
| 12 | 合计 | 3,327,959,328.01 | 82.72 |

4.3报告期末按公允价值占理财产品资产净值比例大小排序的前十名投资明细

| 序号 | 资产代码 | 资产名称 | 数量 (张) | 公允价值 (元) | 占理财产品净值比例 (%) |
|----|--------------|-----------------------|----------------|----------------|---------------|
| 1 | 3M2200 OTC | 创金合信汇盈172号集合资产管理计划 | 817,993,616.02 | 845,314,602.80 | 21.01 |
| 2 | HA0177 OTC | 华安财保资管安华优选28号固定收益集合产品 | 387,097,386.32 | 413,071,620.94 | 10.27 |
| 3 | 114985 SZ | 21绵科03 | 1,300,000.00 | 131,410,165.21 | 3.27 |
| 4 | 194531 SH | 22兴阳01 | 1,200,000.00 | 120,944,791.24 | 3.01 |
| 5 | 114704 SZ | 20什邡01 | 1,100,000.00 | 112,601,454.79 | 2.80 |
| 6 | 032100550 IB | 21龙阳天府PPN001 | 1,000,000.00 | 102,212,413.70 | 2.54 |
| 7 | 194389 SH | 22兴旅01 | 1,000,000.00 | 101,645,100.00 | 2.53 |
| 8 | 194809 SH | 22峨眉02 | 1,000,000.00 | 100,065,753.42 | 2.49 |
| 9 | 112205009 IB | 22建设银行CD009 | 1,000,000.00 | 98,768,648.77 | 2.45 |
| 10 | 112209035 IB | 22浦发银行CD035 | 1,000,000.00 | 98,640,800.55 | 2.45 |

5、理财产品份额变动情况

单位：份

| | |
|-----------------------------|------------------|
| 报告期期初理财产品份额总额 | 4,051,270,034.63 |
| 报告期期间理财产品总申购份额 | 2,173,197,388.82 |
| 减：报告期期间理财产品总赎回份额 | 2,491,415,754.73 |
| 报告期期间理财产品拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | |
| 报告期期末理财产品份额总额 | 3,733,051,668.72 |

6、流动性风险分析

本理财产品资金主要投资于债券。债券可在交易所市场或银行间交易市场交易，变现能力强。产品整体流动性风险可控。

7、托管人报告

根据南京银行股份有限公司与长城华西银行股份有限公司签署的《长城理财之月享利28天开放式净值型理财产品托管协议》，南京银行对长城理财之月享利28天开放式净值型理财产品项下，托管账户内的现金资产进行了托管。

本报告期内，托管人在对本理财产品项下理财产品资金的托管过程中，严格遵守了法律法规的规定，并按照托管协议勤勉履行了托管人职责，办理托管账户内资金的往来清算业务，并在托管协议约定范围内对本理财产品资金使用进行了监督，没有发生任何损害本理财产品投资人利益的行为。

8、备查文件目录

8.1 备查文件目录

《长城华西银行股份有限公司长城理财之月享利28天开放式净值型理财产品2022年第二季度报告》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

2022年6月30日