

# 长城理财之月享利28天开放式净值型理财产品

## 2021年年度报告

### 一、 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       | JX06-JZXKH-28D        |
| 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               |
| 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 | 4, 537, 154, 614. 39  |
| 业绩比较基准（如有）   | 4. 30%                |
| 风险收益特征       | 非保本浮动收益               |

### 二、 主要财务指标及净值表现

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 期间数据和指标    | 2021年             |
| 本期已实现收益    | 137, 450, 253. 34 |
| 本期利润       | 165, 220, 002. 59 |
| 期末数据和指标    | 2021年末            |
| 期末可供分配利润   | 227, 678, 826. 19 |
| 期末理财产品资产净值 | 4793004763. 09    |
| 期末理财产品份额净值 | 1. 05639          |

### 三、 期末投资组合情况

#### （一）期末理财产品资产组合情况

| 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, 617, 343, 702. 98 | 33. 25         |
| 3  | 固定收益投资 | 3, 046, 772, 231. 43 | 62. 63         |
|    | 其中：债券  | 3, 046, 772, 231. 43 | 62. 63         |

|   |                       |                  |      |
|---|-----------------------|------------------|------|
|   | 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<br>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          | 200,499,245.00   | 4.12 |
| 8 | 其他各项资产                | 20,060.92        | 0.00 |
|   | 合计                    | 4,864,635,240.33 |      |

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、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

## （二）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）          | 占理财产品资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|----------------|
| 1  | 国家债券      | 0.00             | 0.00           |
| 2  | 央行票据      | 0.00             | 0.00           |
| 3  | 金融债券      | 299,401,525.34   | 6.25           |
|    | 其中：政策性金融债 | 248,535,825.34   | 5.19           |
| 4  | 企业债券      | 759,098,182.31   | 15.84          |
| 5  | 企业短期融资券   | 0.00             | 0.00           |
| 6  | 中期票据      | 153,191,584.11   | 3.20           |
| 7  | 可转债（可交换债） | 0.00             | 0.00           |
| 8  | 同业存单      | 413,319,142.88   | 8.62           |
| 9  | 其他        | 1,421,761,796.79 | 29.66          |
| 10 | 合计        | 3,046,772,231.43 | 63.57          |

## （三）报告期末按公允价值计量排名前十的资产

| 序号 | 资产代码            | 资产名称                  | 数量（张）       | 公允价值（元）        |
|----|-----------------|-----------------------|-------------|----------------|
| 1  | 3M2200<br>OTC   | 创金合信汇盈172号集合资产管理计划    | 847,555,481 | 848,826,813.94 |
| 2  | HA0177<br>OTC   | 华安财保资管安华优选28号固定收益集合产品 | 708,242,052 | 755,623,444.94 |
| 3  | 166726 SH       | 20简工01                | 1,720,000   | 178,122,283.45 |
| 4  | 167987 SH       | 20广鑫01                | 1,390,000   | 144,762,688.66 |
| 5  | 114985 SZ       | 21绵科03                | 1,300,000   | 135,551,735.48 |
| 6  | 150844 SH       | 18沪工02                | 1,200,000   | 116,858,812.61 |
| 7  | 114704 SZ       | 20什邡01                | 1,100,000   | 115,229,088.08 |
| 8  | 145373 SH       | 17鸿业01                | 1,050,000   | 112,010,559.45 |
| 9  | 032100550<br>IB | 21龙阳天府PPN001          | 1,000,000   | 105,342,502.74 |
| 10 | 2080067<br>IB   | 20邛崃债01               | 900,000     | 95,550,239.59  |

#### 四、 理财产品份额变动情况

|                  |                   |
|------------------|-------------------|
| 报告期期初理财产品份额总额    | 2,156,286,886.21  |
| 报告期期间理财产品总申购份额   | 12,561,884,240.05 |
| 减：报告期期间理财产品总赎回份额 | 10,181,016,511.87 |
| 报告期期末理财产品份额总额    | 4,537,154,614.39  |

#### 五、 流动性风险分析

本理财产品管理人通过合理安排产品的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，确保本产品资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配。报告期内，本产品未发生重大流动性风险事件。

#### 六、 托管人年度报告

##### 1. 报告期内托管人合规守信情况声明

在托管“长城理财之月享利28天开放式净值型理财产品”的过程中，本产品托管人南京银行股份有限公司严格遵守《商业银行理财业务监督管理办法》等相关法律法规、理财产品说明书、理财产品托管协议的约定，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害产品份额持有人利益的行为。

2. 托管人对报告期内投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人对“长城理财之月享利28天开放式净值型理财产品”的投资运作进行了必要的监督，对产品资产净值计算、产品费用开支、利润分配等方面进行了认真地复核，经过复核，本理财产品报告中披露的理财产品财务数据核对一致，未发现产品管理人存在损害产品份额持有人利益的行为。

长城华西银行股份有限公司

2022年2月28日