

# 长城理财之双季盈182天开放式净值型理财产品 2023年年报

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：浦发银行股份有限公司

## 一、理财产品基本情况

项目	信息
理财产品名称	长城理财之双季盈182天开放式净值型理财产品
理财产品编码	C1079421000017
理财产品代码	JX06-JZXKH-182D
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	浦发银行股份有限公司
理财产品运作方式	开放式净值型
理财产品成立日期	2021年07月29日
报告期末理财产品份额总额	2,674,534,338.51
风险收益特征	非保本浮动收益

## 二、理财产品净值表现

阶段	净值增长率(%)
当年	4.84
自理财产品合同生效起至今	10.92

注：净值增长率 = (期末累计净值-期初累计净值) / 期初累计净值

当年净值增长率 = (本年度末累计净值-上年度末累计净值) / 上年度末累计净值

## 三、主要财务指标

期间数据和指标	2023年
本期已实现收益	33,115,804.73
期末可供分配利润	206,252,279.82
期末理财产品资产净值	2,966,603,821.56
期末理财产品份额净值	1.10920
期末理财产品累计份额净值	1.10920

## 四、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	穿透前		穿透后	
		金额	占比	金额	占比
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	-	0.00%	-	0.00%
3	固定收益投资	2,884,746,976.01	94.28%	2,482,327,174.15	81.07%
	其中：债券	1,766,588,218.11	57.73%	2,482,327,174.15	81.07%
	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%
	SPV投资	1,118,158,757.90	36.54%	-	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	50,041,152.28	1.64%	236,044,075.82	7.71%
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00%	-	0.00%
6	同业存单	49,159,081.15	1.61%	141,234,416.28	4.61%
7	银行存款和结算备付金合计	75,947,628.96	2.48%	202,280,400.86	6.61%
8	同业借款	-	0.00%	-	0.00%
	合计	3,059,894,838.40	100.00%	3,061,886,067.12	100.00%

## (二) 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	资产名称	金额	占理财资产净值比例 (%)
1	创金合信汇盈172号集合资产管理计划	460,420,065.99	15.52%
2	外贸信托汇聚鑫享1号集合资金信托计划	351,762,847.08	11.86%
3	华润信托·恒嘉2号集合资金信托计划	305,975,844.83	10.31%

4	22兴旅01	187,732,870.00	6.33%
5	20邛崃债01	112,962,038.74	3.81%
6	19瑞丽仁隆债	100,717,311.48	3.40%
7	23阳安债	100,065,753.42	3.37%
8	20泸州银行二级02	91,097,930.66	3.07%
9	22金鼎01	90,719,167.81	3.06%
10	23金鼎产融MTN002	76,261,255.33	2.57%

### (三) 报告期末持仓资产管理计划底层资产投资类别及比例

资管产品名称	投资范围	占其总资产的比例 (%)
创金合信汇盈172号集合资产管理计划	现金及银行存款	1.22%
	同业存单	19.98%
	拆放同业及债券买入返售	13.49%
	债券	65.31%
	合计	100.00%
华润信托·恒嘉2号集合资金信托计划	现金及银行存款	11.77%
	信托保障基金	0.77%
	拆放同业及债券买入返售	11.56%
	债券	75.91%
	合计	100.00%
外贸信托汇聚鑫享1号集合资金信托计划	现金及银行存款	5.53%
	信托保障基金	0.35%
	拆放同业及债券买入返售	42.51%
	债券	51.61%

	合计	100.00%
--	----	---------

## 五、 理财产品份额变动情况

报告期期初理财产品份额总额	3,006,075,288.63
报告期期间理财产品总申购份额	2,706,292,762.10
减：报告期期间理财产品总赎回份额	3,037,833,712.22
报告期期末理财产品份额总额	2,674,534,338.51

## 六、 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。

## 七、 托管人报告

# “长城理财之双季盈 182 天开放式净值型理财产品” 托管人报告

长城华西银行股份有限公司：

根据贵行与我行于 2021 年 6 月 30 日签署的编号为【CCHXPF-20210518001】的《银行理财产品托管协议》（以下简称“本托管协议”），为保障“本托管协议”资产的安全、维护投资人的合法权益，我行本着笃守诚信、勤勉尽责、严格自律、创造卓越的工作精神，对“本托管协议”投资组合进行了托管，并严格按照人民银行、银保监会有关要求，以专业经营的方式认真履行了我行作为托管人的义务。现将 2023 年年度的资产托管情况报告如下：

## 一、 主要持仓

期初托管的资产总额（单位：元）	3,192,689,523.71
年末资产总额（单位：元）	3,059,894,838.40
年末持有证券数量（单位：份）	1,079,979,634.77

## 二、 报告期间保管资金运用情况

“本托管协议”管理人能够按照托管协议规定的方向进行投资运作。

上述“本托管协议”2023 年年度保管运作情况，特此报告。

上海浦东发展银行资产托管部托管运营中心

2024 年 01 月 10 日



长城华西银行股份有限公司

2024年3月12日