长城理财之季增利98天开放式净值型理财产品

2023年年度报告

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：中国银行股份有限公司

1、理财产品基本情况

项目	信息
理财产品名称	长城理财之季增利98天开放式净值型理财产品
理财产品编码	C1079420000059
理财产品代码	JX06-JZXKH-98D
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	中国银行股份有限公司
理财产品运作方式	开放式净值型
理财产品成立日期	2020年11月27日
报告期末理财产品份额总额	1,070,051,809.51
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（%）
当年	3.86
自理财产品合同生效起至今	13.28

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

当年净值增长率等于（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

3、主要财务指标

单位：人民币元

项目	2023-1-1至2023-12-31
本期已实现收益	18,971,244.79
期末理财产品资产净值	1,212,098,797.74
期末理财产品份额净值	1.13275
期末理财产品累计份额净值	1.13275

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	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	1,044,363,225.62	84.46%	886,115,016.54	71.60%

	其中：债券	614,554,207.16	49.70%	886,115,016.54	71.60%
	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	429,809,018.46	34.76%	-	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%	78,150,377.26	6.31%
	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	98,711,413.39	7.98%	111,055,455.62	8.97%
7	银行存款和结算备付金合计	93,498,884.99	7.56%	162,233,471.70	13.11%
8	同业借款	-	0.00%	-	0.00%
	合计	1,236,573,524.00	100.00%	1,237,554,321.12	100.00%

4.2报告期末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	外贸信托汇聚鑫享1号集合资金信托计划	200,790,666.79	16.57%
2	华润信托·恒嘉2号集合资金信托计划	167,292,323.43	13.80%
3	23浦发银行CD128	98,711,413.39	8.14%
4	银行存款和结算备付金	93,498,884.99	7.71%
5	23金鼎产融MTN002	76,261,255.33	6.29%
6	19眉资01	73,433,233.43	6.06%
7	创金合信汇盈172号集合资产管理计划	61,726,028.24	5.09%
8	21成都经开MTN002	58,632,179.26	4.84%
9	21龙阳天府PPN001	52,915,522.13	4.37%
10	21绵科03	52,630,282.88	4.34%

4.3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%

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	635,686,151.17
报告期期间理财产品总申购份额	1,767,973,627.22
减：报告期期间理财产品总赎回份额	1,333,607,968.88
报告期期末理财产品份额总额	1,070,051,809.51

6、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。

中国银行
BANK OF CHINA

托管业务中心（广东）

长城理财之季增利98天开放式净值型理财产品
2023年年度托管人报告

长城华西银行股份有限公司：

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长城理财之季增利98天开放式净值型理财产品（以下称“本理财产品”）的托管过程中，严格遵守《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《商业银行理财业务监督管理办法》和托管合同等文本的规定，认真履行了应尽的义务，不存在损害理财产品份额持有人利益的行为。

1、根据《商业银行理财业务监督管理办法》，本托管人对报告期内本理财产品的投资运作情况报告进行了复核，复核意见如下：在财务数据方面，相关财务数据经核实无误，托管账户的费用开支方面未发现违反托管合同的情况。

2、2023年，本托管人依据理财相关法律法规规定及托管合同对本理财产品的投资运作进行必要监督，报告期内对于理财产品流动性波动等情况尽职履行理财产品发行人通知及监管报告义务。

中国银行股份有限公司
托管业务中心（广东）
2024年2月27日

长城华西银行股份有限公司

2024年3月12日