

长城理财之季增利98天开放式净值型理财产品

2023年第三季度报告

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（如有）	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	983,124,940.66
业绩比较基准（如有）	3.2%-3.8%
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	0.95	--	--
自理财产品合同生效起至今	12.23	--	--

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-上季度末累计净值）/上季度末累计净值

3、主要财务指标

单位：人民币元

项目	2023-7-1至2023-9-30
本期已实现收益	8,134,278.98
本期利润	9,918,568.17
期末理财产品资产净值	1,103,338,787.43
期末理财产品份额净值	1.12228
期末理财产品累计净值	1.12228

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	0.00	0.00

3	固定收益投资	607,903,934.15	54.22
	其中：债券	607,903,934.15	54.22
	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	275,175,261.22	24.54
	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	12,434,007.46	1.11
8	其他各项资产	225,745,272.75	20.13
	合计	1,121,258,475.58	100.00

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	0.00
2	央行票据	0	0.00
3	金融债券	50,705,700.82	4.52
	其中：政策性金融债	50,705,700.82	4.52
4	企业债券	469,824,306.72	41.90
5	企业短期融资券	30,158,734.59	2.69
6	中期票据	57,215,192.02	5.10
7	可转债（可交换债）	0	0.00
8	同业存单	0	0.00
9	私募债	0	0.00
10	公司债	0	0.00
11	其他	0	0.00
12	合计	607,903,934.15	54.21

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	1AAVG6	华润信托·恒嘉2号集合资金信托计划	163,610,175.00	164,979,377.84	14.95

2	151632	19眉资01	700,000.00	70,952,840.00	6.43
3	1CJHX7	创金合信汇盈172号集合资产管理计划	55,499,036.36	60,765,894.91	5.51
4	102101805	21成都经开MTN002	550,000.00	57,016,080.00	5.17
5	032100550	21龙阳天府PPN001	500,000.00	50,590,750.00	4.59
6	114985	21绵科03	500,000.00	50,516,400.00	4.58
7	230201	23国开01	500,000.00	50,010,250.00	4.53
8	150906	18兴阳01	430,000.00	43,192,081.00	3.91
9	184310	22绵经01	400,000.00	40,693,400.00	3.69
10	196535	21绵金01	400,000.00	40,374,160.00	3.66

4.4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	占总资产的比例（%）
创金合信汇盈172号集合资产管理计划	存放同业	0.18%
	固定收益类资产	99.82%
华润信托·恒嘉2号集合资金信托计划	存放同业	3.52%
	固定收益类资产	96.48%

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	872,313,639.47
报告期期间理财产品总申购份额	469,732,148.93
减：报告期期间理财产品总赎回份额	358,920,847.74
报告期期末理财产品份额总额	983,124,940.66

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。

长城华西银行股份有限公司
2023年10月13日