

长城理财之月享利 28 天开放式净值型理财产品
2024 年第一季度报告

产品管理人：长城华西银行股份有限公司

产品托管人：南京银行股份有限公司

一、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 09 月 17 日 |
| 报告期末理财产品份额总额 | 2,319,395,856.31 |
| 报告期 | 2024/1/1-2024/3/31 |

二、产品收益表现

| 项目 | 2024-01-01 至 2024-03-31 |
|--------------|-------------------------|
| 期末理财产品资产净值 | 2657544228.15 |
| 期末理财产品份额净值 | 1.14579 |
| 期末理财产品份额累计净值 | 1.14579 |

三、期末投资组合情况

（一）期末理财产品资产组合情况

单位：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 | 2,131,480,349.83 | 77.60% | 1,824,471,305.16 | 64.21% |
| | 其中：债券 | 1,046,632,067.31 | 38.11% | 1,824,471,305.16 | 64.21% |
| | 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 | 1,084,848,282.52 | 39.50% | - | 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% | 2,601,817.76 | 0.09% |
| | 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 | 471,977,460.75 | 17.18% | 807,644,276.52 | 28.42% |
| 7 | 银行存款和结算备 付金合计 | 143,133,246.43 | 5.21% | 206,915,277.46 | 7.28% |
| 8 | 同业借款 | | 0.00% | | 0.00% |
| | 合计 | 2,746,591,057.01 | 100.00% | 2,841,632,676.90 | 100.00% |

(二) 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 | 现金及银行存款 | 5.53% |
| | 同业存单 | 30.41% |
| | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% |
| | 标准化债权资产 | 64.05% |
| | 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 | 3.13% |
| | 信托保障基金 | 0.83% |
| | 拆放同业及债券买入返售 | 5.25% |
| | 标准化债权资产 | 90.78% |
| | 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 | 1.82% |
| | 信托保障基金 | 0.97% |
| | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% |
| | 标准化债权资产 | 97.21% |
| | 合计 | 100.00% |

(三) 报告期末占理财产品资产净值比例大小排序的前十项资产投资明细

| 序号 | 资产名称 | 资产余额(元) | 占比 |
|----|----------------------|------------------|--------|
| 1 | 创金合信汇盈 172 号集合资产管理计划 | 1,009,265,174.46 | 37.98% |
| 2 | 21 绵科 03 | 120,200,205.20 | 4.52% |
| 3 | 23 阳安债 | 107,520,505.48 | 4.05% |
| 4 | 21 龙阳天府 PPN001 | 106,975,108.20 | 4.03% |

| | | | |
|----|---------------|---------------|-------|
| 5 | 23 工商银行 CD066 | 98,629,804.92 | 3.71% |
| 6 | 23 工商银行 CD069 | 98,442,772.68 | 3.70% |
| 7 | 24 光大银行 CD019 | 98,139,269.40 | 3.69% |
| 8 | 24 农业银行 CD051 | 97,860,101.37 | 3.68% |
| 9 | 24 峨眉 01 | 91,988,616.57 | 3.46% |
| 10 | 22 金鼎 01 | 83,636,673.98 | 3.15% |

注：前十项资产明细仅包含证券投资、场外投资，不包含银行存款、存出保证金、清算备付金等资产。

四、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 | 2,725,737,033.25 |
| 报告期期间理财产品总申购份额 | 1,201,848,177.63 |
| 减：报告期期间理财产品总赎回份额 | 1,608,189,354.57 |
| 报告期期末理财产品份额总额 | 2,319,395,856.31 |

五、产品整体运作情况

自本产品成立起至本报告日，产品管理人恪尽职守、勤勉尽责、谨慎管理，忠实履行有关法律、行政法规和相关文件的规定。

截至本报告日，全部项目均能正常付息，各项投资资产正常运营，产品流动性良好，风险可控。

本产品自成立至本报告日，没有发生涉诉及诉讼等损害投资者利益的情形。

六、投资组合流动性分析

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到期、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。

长城华西银行股份有限公司

2024年04月18日