

长城理财之至臻系列兔年专属 002 期
封闭式理财产品
2024 年第三季度报告

产品经理人：长城华西银行股份有限公司

产品托管人：招商银行股份有限公司

重要提示

产品管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用产品资产，但不保证产品一定盈利。产品的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本产品的销售文件。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起 至 2024 年 9 月 30 日止。

一、产品概况

| | |
|------------|----------------------------|
| 产品名称 | 长城理财之至臻系列兔年专属 002 期封闭式理财产品 |
| 产品代码 | DYSR-JZX2023-002 |
| 产品登记编码 | C1079423A000002 |
| 产品成立日 | 2023 年 02 月 03 日 |
| 产品到期日 | 2025 年 02 月 07 日 |
| 产品运作方式 | 封闭式净值型 |
| 报告期末产品份额总额 | 76,500,000.00 |
| 产品管理人 | 长城华西银行股份有限公司 |
| 产品托管人 | 招商银行股份有限公司 |

二、产品收益表现

| 产品净值表现 | 报告期 |
|------------------|----------------------------------|
| | 2024 年 7 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日 |
| 1. 期末产品资产净值（元） | 82,001,448.48 |
| 2. 期末产品份额净值（元） | 1.07191 |
| 3. 期末产品份额累计净值（元） | 1.07191 |

三、投资组合情况

3.1 期末资产组合情况

| 序号 | 项目 | 穿透前 | | 穿透后 | |
|----|--------|---------------|-------|---------------|-------|
| | | 金额（元） | 占比（%） | 金额（元） | 占比（%） |
| 1 | 权益投资 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 2 | 基金投资 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 3 | 固定收益投资 | 82,327,349.37 | 99.18 | 82,327,349.37 | 99.18 |
| | 其中：债券 | 82,327,349.37 | 99.18 | 82,327,349.37 | 99.18 |

| | | | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|---------------|--------|
| | 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 |
| | 同业借款 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 4 | 资产管理计划 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 7 | 同业存单 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 8 | 银行存款和结算备付金合计 | 681,503.89 | 0.82 | 681,503.89 | 0.82 |
| | 合计 | 83,008,853.26 | 100.00 | 83,008,853.26 | 100.00 |

注：本表采用四舍五入计数法展示两位小数，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

3.2 报告期末占资产净值比例大小排序的前十项资产明细

| 序号 | 资产名称 | 资产余额(元) | 资产占比(%) |
|----|--------------|---------------|---------|
| 1 | 19兴蜀投资PPN001 | 82,327,349.37 | 100.40 |

注：本表格列示穿透前投资规模占比比较高的前十项资产，不含现金及活期存款、买入返售金融资产。

3.3 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(%) |
|--------|------|-------------|
| - | - | - |

四、产品整体运作情况

自本产品成立至本报告日，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。

五、投资组合的流动性分析

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产品赎回需求的匹配。报告期内，本产品未发生重大流动性风险事件。

2024年10月17日