

长城理财之至臻系列新春专属封闭式理财产品 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：招商银行股份有限公司

一、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 2024-01-01 起至 2024-3-31 止。

二、产品概况

产品名称	长城理财之至臻系列新春专属封闭式理财产品
产品代码	DYSR-JZX2024-002
产品登记编码	C1079424A000002
产品成立日	2024 年 03 月 01 日
报告期末产品份额总额	164,430,000.00
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

三、产品净值表现

产品净值表现	报告期
1. 期末产品资产净值	164,774,330.89
2. 期末产品份额净值	1.00209
3. 期末产品份额累计净值	1.00209

四、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	160,298,098.21	97.23%	147,030,744.67	88.30%

	其中：债券		0.00%	147,030,744.67	88.30%
	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	160,298,098.21	97.23%		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%	8,509,848.59	5.11%
	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		0.00%		0.00%
7	银行存款和结算备付金合计	4,560,409.14	2.77%	10,979,099.08	6.59%
8	同业借款		0.00%	-	0.00%
	合计	164,858,507.35	100.00%	166,519,692.34	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 (%)
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%

(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	华润信托·恒嘉2号集合资金信托计划	160,298,098.21	97.28%

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。

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