

长城理财之至臻系列新春专属封闭式理财产品 2024 年第三季度报告

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

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 |
| 产品到期日 | 2026 年 03 月 10 日 |
| 产品运作方式 | 封闭式净值型 |
| 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 |

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） | 168,382,626.90 |
| 2. 期末产品份额净值（元） | 1.02404 |
| 3. 期末产品份额累计净值（元） | 1.02404 |

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 | 10,240,649.59 | 6.04 | 127,114,334.02 | 74.29 |
| | 其中：债券 | 10,240,649.59 | 6.04 | 121,685,529.12 | 71.12 |

| | | | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|----------------|--------|
| | 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 | 5,428,804.90 | 3.17 |
| | 同业借款 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 4 | 资产管理计划 | 120,521,233.92 | 71.07 | - | 0.00 |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | 0.00 | - | 0.00 |
| 6 | 买入返售金融资产 | 36,010,034.50 | 21.23 | 36,010,034.50 | 21.05 |
| | 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 | 2,820,538.40 | 1.66 | 7,970,315.64 | 4.66 |
| | 合计 | 169,592,456.41 | 100.00 | 171,094,684.16 | 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 | 华润信托·恒嘉2号集合资金信托计划 | 120,521,233.92 | 71.58 |
| 2 | G22眉山1 | 10,240,649.59 | 6.08 |

注：本表格列示穿透前投资规模占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（%） |
|-------------------|--------------|-------------|
| 华润信托·恒嘉2号集合资金信托计划 | 权益投资 | 0.00 |
| | 基金投资 | 0.00 |
| | 固定收益投资 | 95.78 |
| | 金融衍生品投资 | 0.00 |
| | 买入返售金融资产 | 0.00 |
| | 同业存单 | 0.00 |
| | 银行存款和结算备付金合计 | 4.22 |
| | 合计 | 100.00 |

四、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。

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。

长城华西银行股份有限公司

2024年10月17日