

华夏理财龙盈固定收益类 G 款 21 号一年定 开科创打新 FOF 型理财产品

2022 年第 1 季度报告

重要信息提示：

- 1、理财非存款，产品有风险，投资须谨慎。理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益。
- 2、华夏理财有限责任公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏理财有限责任公司

产品托管人：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 3 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财龙盈固定收益类 G 款 21 号一年定开科创打新 FOF 型理财产品
理财产品代码	1912121000502
产品登记编码	Z7003921000593
产品募集方式	公募
产品运作模式	开放式
产品投资性质	固定收益类
投资及收益币种	人民币
产品风险评级	PR2 级（中低风险）
杠杆水平	103.74%
产品起始日期	2019-09-25
产品终止日期	无特定存续期限

第二章 净值、存续规模及收益表现

估值日期	份额净值 (元)	份额总数 (份)	累计净值 (元)	资产净值 (元)	期间累计净 值增长率
2022-03-31	1.1495	1,024,529,158.20	1.1495	1,177,732,928.20	-1.88%
2021-12-31	1.1715	1,024,529,158.20	1.1715	1,200,222,776.25	

第三章 资产持仓

3.1 期末产品资产持仓情况

序号	资产类别	穿透前占总资产比例	穿透后占总资产比例
1	现金及银行存款	0.63%	4.86%
2	同业存单	0.00%	0.68%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.21%
4	债券	0.00%	22.96%
5	非标准化债权类资产	45.92%	44.28%
6	权益类投资	0.00%	3.05%
7	金融衍生品	0.00%	0.00%
8	代客境外理财投资 QDII	0.00%	0.00%
9	商品类资产	0.00%	0.00%
10	另类资产	0.00%	0.00%
11	公募基金	18.43%	23.96%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	35.02%	0.00%
14	委外投资——协议方式	0.00%	0.00%

注：由于计算中四舍五入的原因，占总资产的比例可能存在尾差。

3.2 期末产品持有的前十项资产

序号	资产名称	资产类别	持有金额 (元)	占总资产 的比例
1	民生金融租赁借款合同二期 180 天	非标准化债权类 资产	541,029,000.00	44.28%
2	现金及银行存款	现金及银行存款	59,327,197.00	4.86%
3	鹏扬汇利 C	公募基金	50,747,248.82	4.15%
4	中银稳健添利 C	公募基金	40,522,941.02	3.32%
5	交银施罗德恒益灵活配置混合 C	公募基金	22,753,886.48	1.86%
6	安信稳健增利 C	公募基金	21,950,299.53	1.80%
7	华夏睿磐泰兴混合	公募基金	19,739,822.56	1.62%
8	国投瑞银瑞利	公募基金	16,866,730.88	1.38%
9	交银趋势优先 C	公募基金	10,174,216.18	0.83%
10	华泰柏瑞富利 C	公募基金	9,145,371.36	0.75%

3.3 期末产品持有的非标准化债权类资产

序号	融资客户	项目名称	交易结构	收益率(%)	剩余期限(天)	风险状况
1	民生金融租赁股份有限公司	民生金融租赁借款合同二期 180天	同业借款	4.60	82	正常

3.4 报告期内关联交易情况

3.4.1 报告期内投资关联方发行的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券名称	买入规模（元）
-	-	-	-

3.4.2 报告期内投资关联方承销的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券名称	买入规模（元）
华夏银行股份有限公司	032280323.IB	22 新疆兵团 PPN001	122,398.46
华夏银行股份有限公司	102280116.IB	22 新郑投资 MTN001	35,978.97
华夏银行股份有限公司	102280693.IB	22 临平城建 MTN001	372,194.44

3.4.3 报告期内其他重大关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	交易金额（元）
-	-	-	-	-

第四章 收益分配情况

除权日期	每万份份额分红	每万份现金分红
-	-	-

第五章 风险分析

5.1 投资组合流动性风险分析

本产品为定开型产品，在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类、权益类资产，通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险，产品持有的现金等高流动性资产比例符合要求，组合流动性风险可控。

5.2 投资组合投资风险分析

5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，产品投资的债券资产外部评级未出现下调，展望稳定，债券价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

组合采用精选超额收益能力强的公募基金策略。2022 年股票市场波动较大，基金重仓股持续下跌，本产品在市场下跌中做了如下调整，一是增加了价值型风格基金占比，二是降低了持仓偏核心白马的基金占比。未来，本产品将按照产品说明书约定，为客户贡献权益市场收益。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000814143

第七章 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。