

华夏理财龙盈固定收益类半年定期开放式 净值型理财产品(006号)

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半年定期开放式净值型理财产品(006号) |
| 理财产品代码 | 1910621000202 |
| 产品登记编码 | Z7003921000431 |
| 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 | 107.55% |
| 产品起始日期 | 2019-03-26 |
| 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 | 1.1391 | 568,362,056.46 | 1.1391 | 647,419,371.17 | 0.71% |
| 2021-12-31 | 1.1311 | 931,505,583.44 | 1.1311 | 1,053,665,581.82 | |

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 | 18.14% | 45.89% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 2.75% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.52% |
| 4 | 债券 | 2.72% | 49.81% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 0.39% |
| 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 | 0.00% | 0.63% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 79.14% | 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 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 319,522,954.00 | 45.89% |
| 2 | 20 柳工 MTN001 | 债券 | 15,596,966.10 | 2.24% |
| 3 | 买入返售金融资产 | 拆放同业及债券 买入返售 | 3,636,053.42 | 0.52% |
| 4 | 19 启东 03 | 债券 | 3,615,203.96 | 0.52% |
| 5 | 21 广州银行二级 | 债券 | 3,285,357.71 | 0.47% |
| 6 | 20 衡阳城投 PPN003 | 债券 | 3,001,861.51 | 0.43% |
| 7 | 19 中国银行二级 03 | 债券 | 2,485,288.98 | 0.36% |
| 8 | 15 农发 12 | 债券 | 2,480,733.95 | 0.36% |
| 9 | 19 航控 05 | 债券 | 2,372,967.53 | 0.34% |
| 10 | 21 杭州银行 CD224 | 同业存单 | 2,268,829.49 | 0.33% |

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 |
|----|------|------|------|------------|-------------|------|
| - | - | - | - | - | - | - |

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 | 012105549.IB | 21 伊利实业 SCP034 | 18,994.04 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280061.IB | 22 湘高速 MTN001 | 325,004.75 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280116.IB | 22 新郑投资 MTN001 | 44,695.15 |

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,当前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

本产品持有债券未出现信用评级下调及违约等信用风险事件,一季度债券收益率先下后上整体呈震荡态势,但整体波动率仍处在合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的股票仓位相对保守,价格波动对组合净值波动率的影响保持在可控范围内。

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 | 10257000000798083 |

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。