

华夏理财龙盈混合 G 款 4 号一年半定开偏债 理财产品

2022 年第 2 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 04 月 01 日至 2022 年 6 月 30 日

第一章 基本信息

| | |
|---------|-----------------------------|
| 产品名称 | 华夏理财龙盈混合 G 款 4 号一年半定开偏债理财产品 |
| 理财产品代码 | 208282100503 |
| 产品登记编码 | Z7003921000667 |
| 产品募集方式 | 公募 |
| 产品运作模式 | 开放式 |
| 产品投资性质 | 混合类 |
| 投资及收益币种 | 人民币 |
| 产品风险评级 | PR3 级（中等风险） |
| 杠杆水平 | 108.41% |
| 产品起始日期 | 2020-06-03 |
| 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-06-30 | 1.0795 | 335,236,749.54 | 1.0795 | 361,901,708.01 | 1.26% |
| 2022-03-31 | 1.0661 | 335,236,749.54 | 1.0661 | 357,402,104.09 | |

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*100%

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 | 2.34% | 5.56% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 3.10% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.09% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 40.80% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 36.88% | 34.03% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 0.97% |
| 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 | 5.93% | 15.45% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 54.86% | 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 | 北京市通州区国有资本运营有限公司 2022 年度第一期债权融资计划 | 非标准化债权类 资产 | 101,467,534.25 | 25.86% |
| 2 | 济南章丘控股集团有限公司理财投融资项目(渤海金雀 97)0511 | 非标准化债权类 资产 | 23,040,058.33 | 5.87% |
| 3 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 21,802,717.58 | 5.56% |
| 4 | 长兴港通建设开发有限公司 2022 年度第一期债权融资计划 | 非标准化债权类 资产 | 9,015,361.64 | 2.30% |
| 5 | 21 郑州银行永续债 | 债券 | 3,780,668.17 | 0.96% |
| 6 | 21 江南农商永续债 | 债券 | 3,714,890.20 | 0.95% |
| 7 | 21 厦门国际银行永续债 01 | 债券 | 3,570,689.70 | 0.91% |
| 8 | 21 天恒置业 MTN003 | 债券 | 2,961,942.84 | 0.75% |
| 9 | 博时黄金 ETF 联接 A | 公募基金 | 2,950,123.60 | 0.75% |
| 10 | 21 铁沪 Y2 | 债券 | 2,906,064.30 | 0.74% |

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 | 济南章丘控股集团有限公司 | 济南章丘控股集团有限公司理财投融资项目(渤海金雀97)0511 | 信托贷款 | 5.70 | 315 | 正常 |
| 2 | 长兴港通建设开发有限公司 | 长兴港通建设开发有限公司2022年度第一期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.50 | 298 | 正常 |
| 3 | 北京市通州区国有资本运营有限公司 | 北京市通州区国有资本运营有限公司2022年度第一期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.40 | 281 | 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 | 012281379.IB | 22 盐城国投 SCP001 | 44,137.38 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281597.IB | 22 长虹电子 SCP002 | 30,746.98 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281600.IB | 22 盐城国投 SCP002 | 400,042.06 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280966.IB | 22 国惠投资 MTN001A | 86,197.57 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281333.IB | 22 京电子城 MTN002 | 48,498.63 |
| 华夏银行股份有限公司 | 22CFZR0351 | 北京市通州区国有资本运营有限公司 2022 年度第一期债权融资计划 | 100,000,000.00 |

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

2022 年股票市场波动较大，二季度市场先跌后涨，走出 V 型反转。本产品 在期初仓位保持中性偏谨慎，在底部进行了加仓，反弹过程中逐步进行再平衡，持仓风格保持均衡。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|-------------------|
| 1 | 托管账户 | 10257000000838878 |

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。