

华夏理财龙盈固定收益类G款5号一年定开 权益增强理财产品

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	华夏理财龙盈固定收益类 G 款 5 号一年定开权益增强理财产品
理财产品代码	1912121000501
产品登记编码	Z7003921000592
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	108.68%
产品起始日期	2019-06-18
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	1.1793	560,143,283.80	1.1793	660,577,682.93	1.45%
2022-03-31	1.1624	345,516,900.29	1.1624	401,633,592.58	

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	3.59%	3.78%
2	同业存单	0.00%	2.55%
3	拆放同业及债券买入返售	15.13%	13.97%
4	债券（含永续债）	0.00%	44.16%
5	非标准化债权类资产	30.28%	27.89%
6	权益类投资	0.00%	1.43%
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	3.03%	6.22%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	47.97%	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	中国平煤神马能源化工集团有限公司 2022 年第二期债权融资计划	非标准化债权类 资产	200,238,630.14	27.89%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	100,277,515.11	13.97%
3	现金及银行存款	现金及银行存款	27,107,806.17	3.78%
4	华富天益 B	公募基金	20,030,485.80	2.79%
5	光大优 3	权益类投资	10,261,951.10	1.43%
6	21 天成租赁 GN001	债券	8,991,849.20	1.25%
7	20 中交四局 MTN002	债券	6,530,677.24	0.91%
8	22 农业银行永续债 01	债券	6,354,238.77	0.89%
9	22 河南路桥 CP001(乡村振兴)	债券	5,300,935.61	0.74%
10	20 江苏银行永续债	债券	4,962,577.57	0.69%

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	中国平煤神马能源化工集团有限公司	中国平煤神马能源化工集团有限公司 2022 年第二期债权融资计划	债权融资计划	5.70	354	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	102280856.IB	22 知识城 MTN003	112,714.62
华夏银行股份有限公司	102281125.IB	22 豫铁投 MTN001	104,579.28
华夏银行股份有限公司	22CFZR0531	中国平煤神马能源化工集团有限责任公司 2022 年度第二期债权融资计划	200,000,000.00

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

本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,按照产品说明书约定确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例,并随着风险收益特征的相对变化及时调整。此外,本产品通过事前预测及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。

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

本产品按照产品说明书约定的范围进行投资,并根据市场行情,调整各类资产的占比。结合产品所投资公募基金的持仓情况,产品固定收益类资产占比超过80%,且受益于A股市场二季度的整体反弹,产品运作管理期间净值波动幅度较小。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品二季度因A股市场反弹,为投资者提供了较为稳健的投资回报。本产品严格按照产品说明书约定进行资产配置,价格波动幅度较小。

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	10257000000803345

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。