

华夏理财龙盈固收周期360天理财产品A款

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 | 华夏理财龙盈固收周期 360 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码 | 201216800707 |
| 产品登记编码 | Z7003921000664 |
| 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 | 114.03% |
| 产品起始日期 | 2020-12-04 |
| 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 | 1.0715 | 21,975,754,291.53 | 1.0715 | 23,547,353,012.26 | 1.29% |
| 2022-03-31 | 1.0579 | 22,174,576,500.59 | 1.0579 | 23,458,444,672.94 | |

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 | 0.43% | 1.01% |
| 2 | 同业存单 | 0.42% | 7.50% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.34% |
| 4 | 债券 | 7.44% | 75.28% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 1.91% |
| 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 | 14.59% | 13.96% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 77.12% | 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 | 易方达稳健收益 B | 公募基金 | 641,919,902.92 | 2.39% |
| 2 | 19 民生银行永续债 | 债券 | 547,034,229.45 | 2.04% |
| 3 | 19 广发银行永续债 | 债券 | 431,952,692.61 | 1.61% |
| 4 | 平银优 01 | 权益类投资 | 366,932,104.44 | 1.37% |
| 5 | 富国信用增强债券 A/B | 公募基金 | 313,519,880.11 | 1.17% |
| 6 | 泰康稳健增利 A | 公募基金 | 304,946,604.21 | 1.14% |
| 7 | 22 光穗建发 ABN002 优先 | 债券 | 294,912,631.72 | 1.10% |
| 8 | 19 平安银行二级 | 债券 | 255,125,558.00 | 0.95% |
| 9 | 22 中国信达债 01 | 债券 | 206,022,405.48 | 0.77% |
| 10 | 20 浦发银行永续债 | 债券 | 205,556,247.36 | 0.77% |

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 | 012281379.IB | 22 盐城国投 SCP001 | 11,293,582.30 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281485.IB | 22 三一重工 SCP003 | 1,211,543.74 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281597.IB | 22 长虹电子 SCP002 | 11,711,730.89 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281600.IB | 22 盐城国投 SCP002 | 21,784,672.30 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281870.IB | 22 江北建投 SCP003 | 23,806,040.30 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032280609.IB | 22 赣能源 PPN001 | 8,790,322.84 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280856.IB | 22 知识城 MTN003 | 1,010,920.73 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281125.IB | 22 豫铁投 MTN001 | 937,956.06 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281263.IB | 22 即墨城投 MTN001 | 1,328,129.47 |

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） |
|------------------|----------------|-----------------------------|------|----------------|
| 英大保险资产管理有 限公司 | YD-HLYJ OTC | 英大资产活利壹玖 资产管理产品 | 买入 | 30,000,000.00 |
| 英大基金管 理有限公司 | 650953 OTC | 英大基金-华英稳健 4号集合资产管理计 划 | 买入 | 735,000,000.00 |

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

本产品为周期型产品，产品持有现金及剩余期限一年内的利率债比例不低于5%，同时持有较高比例的高流动性资产，报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控。

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

本产品主要配置货币市场工具、利率债、同业存单和国企、央企城投债，信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生。产品组合久期控制在3以内，价格波动水平较低，整体可控。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的权益仓位相对保守，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 | 10257000000848424 |

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。