

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 4 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 10 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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	120.13%
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
2022-12-31	1.0707	335,236,749.54	1.0707	358,947,716.78	-0.71%
2022-09-30	1.0784	335,236,749.54	1.0784	361,519,106.65	

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	0.66%	1.04%
2	同业存单	0.00%	1.43%
3	拆放同业及债券买入返售	2.23%	2.40%
4	债券	0.00%	58.11%
5	非标准化债权类资产	37.10%	30.90%
6	权益类投资	0.00%	0.34%
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	5.58%	5.78%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	54.44%	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	101,222,328.76	23.47%
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	22,998,658.33	5.33%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	10,351,128.78	2.40%
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	9,001,417.81	2.09%
5	21 江南农商永续债	债券	8,834,481.95	2.05%
6	21 郑州银行永续债	债券	8,519,345.46	1.98%
7	21 厦门国际银行永续债 01	债券	7,904,872.51	1.83%
8	22 扬子国资 MTN001	债券	6,971,163.41	1.62%
9	21 铁沪 Y2	债券	6,827,570.66	1.58%
10	21 川能 Y1	债券	5,391,562.48	1.25%

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	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	97	正常
2	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	131	正常
3	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	114	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	102282474.IB	22 株国投 MTN002	78,813.61

3.4.3 报告期内其他关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	交易金额（元）
英大基金管 理有限公司	000912 OTC	英大现金宝 A	买入	9,000,000.00

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。

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评级稳定，债券价格自 11 月份起出现较大波动，产品净值受到影响。下一步拟逐步优化组合结构，将产品的久期、杠杆控制在更优状态。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

产品股票部分主要通过公募基金投资。四季度股票市场收涨，逐步走出底部区域。本产品在组合角度注重风格均衡，仓位把握稳健，在 10 月份进一步降低了仓位，11-12 月逐步增加了仓位配置，部分对冲了债券价格的波动。未来拟进一步根据市场情况动态调整。

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	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。