

华夏理财龙盈混合 G 款 6 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 6 号一年半定开偏债理财产品
理财产品代码	208282100505
产品登记编码	Z7003921000572
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	127.79%
产品起始日期	2020-06-16
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	1.0662	459,960,554.15	1.0662	490,397,459.39	-1.30%
2022-09-30	1.0802	462,737,817.62	1.0802	499,827,362.63	

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	4.35%	3.98%
2	同业存单	0.00%	1.53%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.35%
4	债券	0.00%	79.90%
5	非标准化债权类资产	5.30%	4.15%
6	权益类投资	0.00%	0.00%
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%	8.10%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	90.35%	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	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	26,002,600.00	4.15%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	24,925,559.15	3.98%
3	19 平安银行二级	债券	21,179,468.26	3.38%
4	16 黔高速	债券	20,470,305.05	3.27%
5	19 交通银行二级 01	债券	18,236,915.72	2.91%
6	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	14,720,838.56	2.35%
7	21 凤凰 01	债券	13,074,688.01	2.09%
8	21 凤凰 02	债券	13,014,789.38	2.08%
9	21 广物 01	债券	12,585,659.26	2.01%
10	21 郑州经开 MTN001	债券	12,509,467.69	2.00%

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	131	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）
-	-	-	-

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）
中诚信托有 限责任公司	ZCXTJX03 OTC	中诚信托嘉信配置3 号集合资金信托计 划	买入	70,000,000.00

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

本产品报告期内未开放，且持有 5%以上的高流动性资产，能够满足临时赎回的需要，流动性风险较低。

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

本产品持有不超过 80%债券资产，久期在 1-2 年，信用等级较高，采用市值法估值，具有一定的价格波动风险。四季度债券市场剧烈调整，拖累产品净值表现。债券回调源于纾解房地产信用风险的各项政策陆续出台，对“新冠”疫情的防控也有所放松，过去三年拖累经济景气度的两大因素均有实质性好转。同时，经过近两年的债券牛市，市场收益率已处于历史绝对低位，各期限品种信用利差也大幅压缩。而自 10 月份开始资金市场中枢缓慢抬升，使得债券市场“杠杆-套息”的盈利模式逐渐被打破。此外，债券收益率快速回升，叠加各类资管机构赎回潮，造成了本次债券市场调整。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品未直接持有股票，持有 8%左右风格均衡的公募基金参与权益市场投资。四季度权益市场迎来较大幅度的上涨，对组合收益有正向贡献。一方面，市场经历前期较大幅度下跌，估值处于较低水平；另一方面，防疫、地产等政策的显著转向，叠加年底重要会议定调，提振了市场信心。

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	10257000000839350

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。