

华夏理财龙盈固定收益类一年定期开放式 净值型理财产品（003 号）

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	华夏理财龙盈固定收益类一年定期开放式净值型理财产品（003号）
理财产品代码	1810621000304
产品登记编码	Z7003921000584
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	113.63%
产品起始日期	2018-10-18
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
2022-12-31	1.1912	328,436,452.69	1.1912	391,231,382.99	-0.81%
2022-09-30	1.2009	750,373,324.04	1.2009	901,134,873.05	

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	0.42%	0.75%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.51%
4	债券	14.21%	61.83%
5	非标准化债权类资产	40.70%	35.84%
6	权益类投资	0.00%	0.60%
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%	0.47%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	44.67%	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	山东信托.洛阳国晟 1017 到期(融华 1 号)	非标准化债权类资产	94,654,833.33	21.29%
2	粤财信托.南京江宁滨江物流有限公司理财融资项目 1018 到期(瑞丰 35 号)	非标准化债权类资产	64,662,739.92	14.55%
3	20 天津经开 MTN003	债券	30,154,451.40	6.78%
4	20 巩义国资 PPN001	债券	25,918,275.30	5.83%
5	21 首创 C1	债券	4,421,070.71	0.99%
6	22 南京奥体 MTN001	债券	3,931,824.98	0.88%
7	21 随州城建 MTN001	债券	3,778,664.58	0.85%
8	21 南平高速 MTN001	债券	3,767,713.59	0.85%
9	22 运和 03	债券	3,508,926.95	0.79%
10	19 信投 03	债券	3,424,094.77	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
1	洛阳国晟投资控股集团有限公司	山东信托.洛阳国晟 1017 到期(融华 1 号)	信托贷款	5.00	290	正常
2	南京江宁滨江物流有限公司	粤财信托.南京江宁滨江物流有限公司理财融资项目 1018 到期(瑞丰 35 号)	信托贷款	4.29	291	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	109,481.58

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	ydhywj01 OTC	英大基金-华英稳健 1 号集合资产管理计 划	买入	30,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	50,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZC19RE OTC	中诚信托嘉信 12 号 集合资金信托计划	买入	20,000,000.00

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

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，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，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

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

截至本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优，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

截至本报告日，产品投资的权益资产价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000786725

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。