

# 华夏理财龙盈固定收益类专属6号半年定开 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    | 华夏理财龙盈固定收益类专属 6 号半年定开理财产品 |
| 理财产品代码  | 208212400601              |
| 产品登记编码  | Z7003921000421            |
| 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    | 134.12%                   |
| 产品起始日期  | 2020-08-27                |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)       | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)       | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-12-31 | 1.0913      | 487,130,536.44 | 1.0913      | 531,617,102.27 | -0.19%        |
| 2022-09-30 | 1.0934      | 487,130,536.44 | 1.0934      | 532,623,892.19 |               |

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       | 4.48%     | 4.20%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.66%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.13%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 92.46%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 1.31%     |
| 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%     | 1.23%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 95.52%    | 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------|---------|---------------|-------------|
| 1  | 存款及清算款等现金类资产   | 现金及银行存款 | 29,977,142.84 | 4.20%       |
| 2  | 20 碧地 02       | 债券      | 7,234,877.11  | 1.01%       |
| 3  | 21 远洋控股 PPN001 | 债券      | 6,336,762.08  | 0.89%       |
| 4  | 19 民生银行永续债     | 债券      | 5,324,322.69  | 0.75%       |
| 5  | 民生优 1          | 权益类投资   | 4,696,198.91  | 0.66%       |
| 6  | 光大优 3          | 权益类投资   | 4,630,174.64  | 0.65%       |
| 7  | 21 天成租赁 GN001  | 债券      | 4,599,212.12  | 0.65%       |
| 8  | 22 国海 02       | 债券      | 4,178,491.40  | 0.59%       |
| 9  | PR01 优         | 债券      | 4,072,940.13  | 0.57%       |
| 10 | 21 远洋控股 PPN002 | 债券      | 4,030,130.79  | 0.57%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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 | 102282474.IB | 22 株国投 MTN002 | 281,229.86 |

#### 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<br>限责任公司 | ZC19HA OTC | 中诚信托嘉信 11 号<br>集合资金信托计划 | 买入   | 6,000,000.00 |

## 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 | 10257000000843016 |

## **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。