

# 华夏理财龙盈固定收益类 G 款 92 号一年定 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 G 款 92 号一年定开理财产品 |
| 理财产品代码  | 208212100365                 |
| 产品登记编码  | Z7003921000534               |
| 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    | 122.44%                      |
| 产品起始日期  | 2020-11-03                   |
| 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<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 | 1.0743      | 275,763,867.78 | 1.0743      | 296,247,269.23 | -0.72%        |
| 2022-09-30 | 1.0821      | 324,884,247.13 | 1.0821      | 351,563,772.31 |               |

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       | 0.14%     | 0.37%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.59%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 69.71%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 33.77%    | 27.59%    |
| 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          | 1.23%     | 1.73%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 64.86%    | 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  | 温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年度第十期债权融资计划 | 非标准化债权类<br>资产 | 100,083,808.22 | 27.59%      |
| 2  | 21 首创 C1                          | 债券            | 5,644,080.87   | 1.56%       |
| 3  | 22 南京奥体 MTN001                    | 债券            | 5,168,761.19   | 1.43%       |
| 4  | 21 随州城建 MTN001                    | 债券            | 4,530,333.20   | 1.25%       |
| 5  | 21 南平高速 MTN001                    | 债券            | 4,517,203.80   | 1.25%       |
| 6  | 22 运和 03                          | 债券            | 4,206,938.17   | 1.16%       |
| 7  | 19 信投 03                          | 债券            | 3,965,586.96   | 1.09%       |
| 8  | 华夏上证 50ETF 联接 C                   | 公募基金          | 3,637,230.95   | 1.00%       |
| 9  | 20 常德城投 PPN002                    | 债券            | 3,486,526.17   | 0.96%       |
| 10 | 22 欣荣 1 优先                        | 债券            | 2,891,451.00   | 0.80%       |

### 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  | 温州市鹿城区国有控股集团有限公司 | 温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年度第十期债权融资计划 | 债权融资计划 | 4.96   | 299     | 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                     | 158,395.38     |
| 华夏银行股份有限公司 | fb20221108D  | 温州市鹿城区国有控股集团有限公司 2022 年度第十期债权融资计划 | 100,000,000.00 |

#### 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<br>OTC | 英大基金-华英稳健1号集合资产管理计划 | 买入   | 150,000,000.00 |
| 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   | 10,000,000.00  |

## 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**

流动性风险管理方面，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、正逆回购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；三是产品持有一定比例的高流动性资产，赎回期内主要通过正回购操作或卖出部分资产变现，满足产品的流动性需求。

### **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，本产品投资的债券价格波动处于市场合理区间范围内。

#### **5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况**

截止本报告日，本产品无权益持仓。

#### **5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况**

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

## 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号              |
|----|------|-------------------|
| 1  | 托管账户 | 10257000000845207 |

## **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。