

# 华夏理财龙盈固定收益类纯债型理财产品 1 号

## 2023 年第 1 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 3 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纯债型理财产品 1 号 |
| 理财产品代码   | 1912121000101          |
| A 份额销售代码 | 1912121000101          |
| M 份额销售代码 | 19121210001M           |
| Y 份额销售代码 | 19121210001Y           |
| 产品登记编码   | Z7003921000629         |
| 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     | 107.28%                |
| 产品起始日期   | 2019-03-06             |
| 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

### A 份额：

| 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 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2023-03-31 | 1.1521      | 8,449,331,278.69 | 1.1521      | 9,734,197,966.22 | 1.03%         |
| 2022-12-31 | 1.1404      | 5,639,144,897.99 | 1.1404      | 6,430,978,962.62 |               |

### M 份额：

| 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-03-31 | 1.0126      | 188,655,018.37 | 1.0126      | 191,031,914.92 | 1.02%         |
| 2022-12-31 | 1.0024      | 313,505,674.48 | 1.0024      | 314,244,523.37 |               |

### Y 份额：

| 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 |
|------------|-------------|------------|-------------|------------|---------------|
| 2023-03-31 | 1.0046      | 188,486.66 | 1.0046      | 189,361.35 | 1.07%         |
| 2022-12-31 | 0.9940      | 113,645.84 | 0.9940      | 112,960.28 |               |

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       | 2.39%     | 30.50%    |
| 2  | 同业存单          | 3.20%     | 5.12%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.91%     | 1.27%     |
| 4  | 债券            | 16.24%    | 62.53%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 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%     | 0.58%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 77.27%    | 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；“权益类投资”类别中包含永续债和优先股。

### 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         | 2,264,295,474.38 | 21.27%      |
| 2  | 21 光穗铜冠 ABN001 优先           | 债券              | 194,943,686.68   | 1.83%       |
| 3  | 20 光穗鲲鹏 ABN001 优先           | 债券              | 162,424,860.60   | 1.53%       |
| 4  | 债券买入返售                      | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 135,068,177.40   | 1.27%       |
| 5  | 农行台州温岭支行 20(20220610)       | 现金及银行存款         | 119,716,029.36   | 1.12%       |
| 6  | 工行中山银苑支行 9.9(20220728)      | 现金及银行存款         | 118,033,449.81   | 1.11%       |
| 7  | 农业银行逸景翠园支行 20<br>(20230324) | 现金及银行存款         | 116,823,872.55   | 1.10%       |
| 8  | 21 西海发展 PPN001              | 债券              | 100,787,080.87   | 0.95%       |
| 9  | 22 光大银行 CD112               | 同业存单            | 99,680,404.11    | 0.94%       |
| 10 | 22 建设银行 CD163               | 同业存单            | 98,653,628.77    | 0.93%       |

### 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          | 投资规模（元）       |
|------------|--------------|---------------|---------------|
| 鲁能集团有限公司   | 136692.SH    | 16 鲁能 02      | 22,342,607.23 |
| 平安银行股份有限公司 | 112311041.IB | 23 平安银行 CD041 | 13,334,892.52 |

#### 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 | 投资规模（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 | 投资规模（元）        |
|--------------|-----------------|--------------------------|------|----------------|
| 英大保险资产管理有限公司 | 601082 OTC      | 英大资产-聚鑫 11 号<br>保险资管产品   | 买入   | 653,400,000.00 |
| 英大保险资产管理有限公司 | YDDC01<br>OTC   | 英大资产-聚鑫 8 号<br>保险资管产品    | 买入   | 100,650,000.00 |
| 英大保险资产管理有限公司 | YD-HLYJ<br>OTC  | 英大资产活利壹玖<br>资产管理产品       | 买入   | 20,000,000.00  |
| 英大基金管理有限公司   | 650956 OTC      | 英大基金-华英稳健<br>5 号集合资产管理计划 | 买入   | 140,000,000.00 |
| 英大基金管理有限公司   | ydhywj01<br>OTC | 英大基金-华英稳健<br>1 号集合资产管理计划 | 买入   | 124,000,000.00 |
| 中诚信托有限责任公司   | ZC19HA OTC      | 中诚信托嘉信 11 号<br>集合资金信托计划  | 买入   | 100,000,000.00 |
| 中国人保资产管理有限公司 | BZ22043<br>OTC  | 中国人保资产中短期配置 12 号资产管理产品   | 买入   | 100,000,000.00 |

|              |               |                    |    |               |
|--------------|---------------|--------------------|----|---------------|
| 中国人保资产管理有限公司 | RBWY03<br>OTC | 中国人保资产稳盈专享3号资产管理产品 | 买入 | 30,000,000.00 |
|--------------|---------------|--------------------|----|---------------|

#### 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

本产品在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，提前储备流动性资金；二是根据当前市场收益率情况及对未来市场趋势的研判，合理制定组合加权久期，防范流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出、基金赎回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。根据公司理财资产风险分类的要求，持仓中 20 时代 12（代码 167463.SH）、20 时代 10（代码 167340.SH）的资产风险分类为关注类，该券在产品持仓中占比分别不高于 0.1%和 0.05%，对产品净值影响较小。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

#### 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 | 10257000000772542 |

## **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。