

华夏理财龙盈混合 G 款 100 号一年半封闭理 财产品

2022 年第 3 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 07 月 01 日至 2022 年 09 月 30 日

第一章 基本信息

| | |
|---------|-----------------------------|
| 产品名称 | 华夏理财龙盈混合 G 款 100 号一年半封闭理财产品 |
| 理财产品代码 | 218285100596 |
| 产品登记编码 | Z7003921000721 |
| 产品募集方式 | 公募 |
| 产品运作模式 | 封闭式 |
| 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 | 111.38% |
| 产品起始日期 | 2021-05-14 |
| 产品终止日期 | 2022-11-15 |

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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|------------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.0563 | 950,249,000.00 | 1.0563 | 1,003,715,491.63 | 0.67% |
| 2022-06-30 | 1.0493 | 950,249,000.00 | 1.0493 | 997,121,533.81 | |

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 | 0.74% | 1.36% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.53% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 1.20% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 86.89% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 5.66% |
| 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 | 4.84% | 4.35% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 94.43% | 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 | 19 西投 01 | 债券 | 95,323,062.66 | 8.53% |
| 2 | 22 上饶国资专项债 01 | 债券 | 62,765,966.69 | 5.61% |
| 3 | 22 章丘债 | 债券 | 58,660,880.29 | 5.25% |
| 4 | 22 常齐债 | 债券 | 39,083,988.95 | 3.50% |
| 5 | 22 冶投 01 | 债券 | 39,075,304.49 | 3.50% |
| 6 | 22 平投 02 | 债券 | 38,818,064.99 | 3.47% |
| 7 | 21 和县债 | 债券 | 19,998,476.26 | 1.79% |
| 8 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 15,244,486.80 | 1.36% |
| 9 | 债券买入返售 | 拆放同业及债券 买入返售 | 13,457,923.18 | 1.20% |
| 10 | 21 汇微 01 | 债券 | 12,958,138.23 | 1.16% |

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 |
|----|------|------|------|------------|-------------|------|
| - | - | - | - | - | - | - |

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） |
|-----------------------|--------------|-----------------|------------|
| 北京科技园建设（集团） 股份有限公司 | 032200226.IB | 22 京科技园 PPN001A | 636,642.96 |

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 | 012283126.IB | 22 新疆金投 SCP002 | 710,901.68 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042280372.IB | 22 武清国资 CP004 | 688,456.11 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002 | 22,629.30 |

3.4.3 报告期内其他重大关联交易

| 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 | 650956 OTC | 英大基金-华英稳健 5号集合资产管理计 划 | 买入 | 1,570,000,000.00 |

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

本产品对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类、权益类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险,当前组合流动性风险可控。

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

本产品持有债券未出现信用违约等信用风险事件,三季度债券收益率整体呈下行态势,有一定的资本利得收益,整体波动率在合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的股票仓位相对稳健,价格波动对组合净值波动率的影响保持在可控范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|-------------------|
| 1 | 托管账户 | 10257000000862970 |

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。