

# 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（002 号）

## 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    | 华夏理财龙盈固定收益类一年定期开放式净值型理财产品（002号） |
| 理财产品代码  | 1810621000303                   |
| 产品登记编码  | Z7003921000531                  |
| 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    | 113.93%                         |
| 产品起始日期  | 2018-09-20                      |
| 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2022-09-30 | 1.2011      | 321,900,073.63 | 1.2011      | 386,622,565.47 | 0.65%         |
| 2022-06-30 | 1.1933      | 629,840,407.77 | 1.1933      | 751,615,003.32 |               |

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       | 4.74%     | 5.01%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 1.13%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.23%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 87.34%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 1.13%     |
| 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%     | 5.16%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 95.26%    | 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  | 现金及银行存款       | 现金及银行存款 | 22,057,199.58 | 5.01%       |
| 2  | 19 万盛 01      | 债券      | 5,695,115.86  | 1.29%       |
| 3  | 19 柳投资        | 债券      | 4,989,415.70  | 1.13%       |
| 4  | 20 海盐 01      | 债券      | 4,970,838.47  | 1.13%       |
| 5  | 19 渝枢 03      | 债券      | 4,565,197.29  | 1.04%       |
| 6  | 19 民生银行永续债    | 债券      | 4,412,463.15  | 1.00%       |
| 7  | 民生优 1         | 权益类投资   | 4,051,718.29  | 0.92%       |
| 8  | 22 欣荣 1 优先    | 债券      | 3,819,588.77  | 0.87%       |
| 9  | 20 新庐 01      | 债券      | 3,111,098.93  | 0.71%       |
| 10 | 19 农业银行永续债 01 | 债券      | 2,891,503.44  | 0.66%       |

### 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 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002 | 82,490.15  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281669.IB | 22 武汉生态 MTN001 | 72,585.19  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281789.IB | 22 武汉生态 MTN002 | 128,948.16 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281971.IB | 22 桂铁投 MTN005  | 307,265.60 |

#### 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<br>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<br>划 | 买入   | 50,000,000.00 |
| 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   | 78,000,000.00 |

#### 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 | 10257000000777288 |

## **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。