

# 华夏理财龙盈固定收益类尊享5号三个月定 开理财产品

## 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    | 华夏理财龙盈固定收益类尊享 5 号三个月定开理财产品 |
| 理财产品代码  | 208212400502               |
| 产品登记编码  | Z7003921000574             |
| 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    | 108.40%                    |
| 产品起始日期  | 2020-08-13                 |
| 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 | 1.0943      | 1,289,354,481.95 | 1.0943      | 1,410,905,169.75 | 0.75%         |
| 2022-06-30 | 1.0862      | 993,940,551.54   | 1.0862      | 1,079,591,014.06 |               |

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       | 0.55%     | 0.73%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 6.32%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.12%     |
| 4  | 债券            | 13.82%    | 88.38%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 1.16%     |
| 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          | 3.55%     | 3.28%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 82.08%    | 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  | 18 国开 11     | 债券   | 71,462,626.03 | 4.67%       |
| 2  | 21 渤海银行二级    | 债券   | 63,100,538.90 | 4.13%       |
| 3  | 22 津城建 CP012 | 债券   | 50,570,606.85 | 3.31%       |
| 4  | 广发景明中短债 A    | 公募基金 | 50,155,405.22 | 3.28%       |
| 5  | G20 长交 1     | 债券   | 22,317,719.18 | 1.46%       |
| 6  | 19 民生银行永续债   | 债券   | 22,152,519.85 | 1.45%       |
| 7  | 19 绵纾 02     | 债券   | 21,951,878.52 | 1.44%       |
| 8  | 19 广发银行永续债   | 债券   | 19,671,390.25 | 1.29%       |
| 9  | G21 惠投 1     | 债券   | 15,406,704.16 | 1.01%       |
| 10 | 20 国兴 01     | 债券   | 15,341,335.34 | 1.00%       |

### 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）   |
|----------|-----------|----------|-----------|
| 鲁能集团有限公司 | 137819.SH | 22 鲁能 02 | 23,236.33 |

#### 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       | 558,585.07   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032280716.IB | 22 连云城建 PPN004       | 167,256.45   |
| 华夏银行股份有限公司 | 092280061.IB | 22 长沙农商行二级资本<br>债 01 | 2,050,583.30 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281527.IB | 22 长发集团 MTN002       | 525,774.98   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281864.IB | 22 豫投资 MTN002        | 238,937.79   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102281971.IB | 22 桂铁投 MTN005        | 1,221,651.70 |

#### 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 | 650953 OTC | 英大基金-华英稳健<br>4号集合资产管理计<br>划 | 买入   | 100,000,000.00 |

## 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

本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

### 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

本产品主要配置货币市场工具、利率债、同业存单和国企、央企城投债，信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生。产品组合久期控制在3以内，价格波动水平较低，整体可控。

#### 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。

## 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号              |
|----|------|-------------------|
| 1  | 托管账户 | 10257000000843163 |

## **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。