

华夏理财龙盈固定收益类 G 款 21 号一年定 开科创打新 FOF 型理财产品

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 21 号一年定开科创打新 FOF 型理财产品
理财产品代码	1912121000502
产品登记编码	Z7003921000593
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	117.81%
产品起始日期	2019-09-25
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 (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
2022-12-31	1.1775	243,780,500.92	1.1775	287,046,894.15	-0.70%
2022-09-30	1.1858	246,899,451.37	1.1858	292,761,949.34	

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	1.88%	4.27%
2	同业存单	0.00%	1.02%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	2.05%
4	债券	0.00%	71.40%
5	非标准化债权类资产	17.34%	14.72%
6	权益类投资	0.00%	3.54%
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%	3.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	80.79%	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	百瑞信托.镇江风旅(百瑞富诚 935 号)到期 0922	非标准化债权类 资产	49,786,036.39	14.72%
2	19 民生银行永续债	债券	12,926,176.13	3.82%
3	19 广发银行永续债	债券	7,491,161.02	2.22%
4	平银优 01	权益类投资	7,473,494.75	2.21%
5	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	6,920,767.54	2.05%
6	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	6,698,919.31	1.98%
7	21 荆门城建 MTN001	债券	4,946,707.61	1.46%
8	22 新兴 01	债券	4,743,285.49	1.40%
9	22 海旅 01	债券	4,625,353.66	1.37%
10	20 海盐 01	债券	4,394,585.29	1.30%

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	镇江市风景旅游发展有限责任公司	百瑞信托·镇江风旅(百瑞富诚935号)到期0922	信托贷款	5.30	265	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）
-	-	-	-

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	650959 OTC	英大基金-华英价值2号集合资产管理计划	买入	2,000,000.00
英大基金管理有限公司	650960 OTC	英大基金-华英价值3号集合资产管理计划	买入	400,000.00

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。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

截止本报告日，产品投资的债券资产信用展望稳定，债券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

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	10257000000814143

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。