

华夏理财龙盈固定收益类专属 11 号三个月 定开理财产品

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专属 11 号三个月定开理财产品 |
| 理财产品代码 | 208212401101 |
| 产品登记编码 | Z7003921000429 |
| 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 | 144.24% |
| 产品起始日期 | 2020-10-15 |
| 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 | 1.0659 | 206,307,841.84 | 1.0659 | 219,895,617.10 | -1.14% |
| 2022-09-30 | 1.0782 | 208,959,306.43 | 1.0782 | 225,303,071.23 | |

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 | 0.07% | 0.32% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.45% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.18% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 98.13% |
| 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% | 0.92% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 99.93% | 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 | 20 奉投 01 | 债券 | 3,604,884.77 | 1.14% |
| 2 | 20 常新 01 | 债券 | 2,965,880.02 | 0.94% |
| 3 | GC 天成 01 | 债券 | 2,963,625.34 | 0.93% |
| 4 | 20 襄置 01 | 债券 | 2,952,093.16 | 0.93% |
| 5 | 20 四水 G1 | 债券 | 2,936,011.63 | 0.93% |
| 6 | 20 陕建控股 PPN001 | 债券 | 2,935,587.36 | 0.93% |
| 7 | 招商添安 1 年定开债 | 公募基金 | 2,910,262.05 | 0.92% |
| 8 | 22 赣能源 PPN001 | 债券 | 2,397,084.43 | 0.76% |
| 9 | 20 兴信 02 | 债券 | 2,197,123.33 | 0.69% |
| 10 | 20 南沙 01 | 债券 | 2,183,155.31 | 0.69% |

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） |
|-------|------|------|---------|
| - | - | - | - |

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 | 102282472.IB | 22 胶州湾 MTN002 | 555,109.26 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102282474.IB | 22 株国投 MTN002 | 314,121.56 |
| 华夏银行股份有限公司 | 2220071.IB | 22 苏州银行小微债 | 623,210.26 |

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） |
|-------|------|------|------|---------|
| - | - | - | - | - |

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

报告期内无流动性风险事件发生。

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，价格波动可控。

5.2.2 产品股票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 | 10257000000844305 |

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。