

华夏理财龙盈固收周期 90 天理财产品 A 款

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 | 华夏理财龙盈固收周期 90 天理财产品 A 款 |
| 理财产品代码 | 201216700301 |
| A 份额销售代码 | 201216700301 |
| S 份额销售代码 | 201216700301S |
| 产品登记编码 | Z7003921000665 |
| 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 | 134.56% |
| 产品起始日期 | 2020-09-24 |
| 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

A 份额：

| 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 | 1.0722 | 10,416,485,477.81 | 1.0722 | 11,168,455,475.11 | -1.42% |
| 2022-09-30 | 1.0876 | 17,507,601,904.32 | 1.0876 | 19,040,786,667.40 | |

S 份额：

| 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 | 0.9876 | 393,488,787.64 | 0.9876 | 388,613,168.00 | -1.38% |
| 2022-09-30 | 1.0014 | 455,881,898.91 | 1.0014 | 456,519,751.85 | |

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 | 4.30% | 10.02% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.25% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 5.69% | 4.71% |
| 4 | 债券 | 34.72% | 83.07% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 0.90% |
| 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 | 0.62% | 1.05% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 54.66% | 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 | 存款及清算款等现金类资产 | 现金及银行存款 | 1,558,661,637.66 | 10.02% |
| 2 | 债券买入返售 | 拆放同业及债券 买入返售 | 733,045,571.56 | 4.71% |
| 3 | 21 光穗铜冠 ABN001 优先 | 债券 | 400,548,259.97 | 2.58% |
| 4 | 20 民生银行二级 | 债券 | 379,554,568.21 | 2.44% |
| 5 | 20 长城人寿 01 | 债券 | 206,234,756.16 | 1.33% |
| 6 | 22 民生银行永续债 01 | 债券 | 187,937,926.03 | 1.21% |
| 7 | 22 淮安交通 MTN001 | 债券 | 173,987,913.70 | 1.12% |
| 8 | 20 巩义国资 PPN001 | 债券 | 168,444,555.42 | 1.08% |
| 9 | 20 晋交投 MTN002 | 债券 | 164,918,492.05 | 1.06% |
| 10 | 22 中色 MTN001 | 债券 | 156,790,614.79 | 1.01% |

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 | 102282373.IB | 22 鹤壁投资 MTN003 | 1,872,405.16 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102282474.IB | 22 株国投 MTN002 | 3,560,909.77 |

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） |
|----------------|------------|-------------------------|------|---------------|
| 中诚信托有 限责任公司 | ZC19HA OTC | 中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划 | 买入 | 12,300,000.00 |

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、基金赎回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

回顾四季度，10月坚持“动态清零”和降准置换MLF预期下，收益率有所下行，但11月随着地产政策和防控政策的边际放松，市场对经济修复预期加强叠加理财赎回负反馈，债券大幅调整，一直到12月中旬债市企稳反弹。展望2023年，经济复苏政策持续发力，内需改善与基建制造投资托底，助力经济增长，若经济复苏超预期利率中枢可能会有上行压力。操作上，鉴于产品特性，维持久期杠杆较低水平，增加低波资产配置。

5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，产品持仓的债券价格波动处于市场合理区间范围。

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 | 10257000000848059 |

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。