

# 华夏理财龙盈固定收益类专属 10 号半年定 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专属 10 号半年定开理财产品 |
| 理财产品代码  | 208212401001               |
| 产品登记编码  | Z7003921000520             |
| 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    | 113.90%                    |
| 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

| 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 | 1.0880      | 334,944,203.17 | 1.0880      | 364,432,862.01 | 0.53%         |
| 2022-06-30 | 1.0823      | 359,246,990.69 | 1.0823      | 388,828,090.65 |               |

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       | 1.41%     | 1.37%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.86%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.23%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 95.29%    |
| 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%     | 2.24%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 98.59%    | 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  | 22 济南轨交 MTN001        | 债券      | 7,468,476.48 | 1.80%       |
| 2  | 22 国开 02              | 债券      | 5,852,921.08 | 1.41%       |
| 3  | 现金及银行存款               | 现金及银行存款 | 5,700,746.35 | 1.37%       |
| 4  | 20 国开 08              | 债券      | 5,480,328.76 | 1.32%       |
| 5  | 21 京城投 MTN002         | 债券      | 5,463,956.07 | 1.32%       |
| 6  | 22 佛燃能源 MTN002        | 债券      | 5,409,094.47 | 1.30%       |
| 7  | 22 龙岩汇金 MTN002        | 债券      | 4,042,237.02 | 0.97%       |
| 8  | 20 中交投资 ABN001 优先     | 债券      | 3,531,968.10 | 0.85%       |
| 9  | 22 付息国债 19            | 债券      | 3,386,610.18 | 0.82%       |
| 10 | 22 湖州城投 MTN004(可持续挂钩) | 债券      | 2,873,420.05 | 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<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 | 87,624.00 |

#### 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 | ydhywj02<br>OTC | 英大基金-华英稳健<br>2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

截至本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优，但持仓中部分资产受市场原因评级展望有所调整。产品持仓 16 阿勒泰（1680035.IB）发行人阿勒泰地区国有资产投资经营有限公司 2022 年 7 月评级展望被联合资信评估股份有限公司调整为“负面”，2022 年 9 月评级展望被上海新世纪资信评估投资服务有限公司调整为“负面”。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益持仓。

#### 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 | 10257000000843061 |

## **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。