

华夏理财龙盈固定收益类专属 12 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 12 号半年定开理财产品
理财产品代码	208212401201
产品登记编码	Z7003921000424
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	110.80%
产品起始日期	2020-10-22
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
2022-09-30	1.0833	311,544,503.64	1.0833	337,482,474.67	0.88%
2022-06-30	1.0738	311,544,503.64	1.0738	334,522,649.60	

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	2.88%	2.72%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	29.63%	26.93%
4	债券	0.00%	70.22%
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%	0.13%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	67.49%	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	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	100,706,919.10	26.93%
2	现金及银行存款	现金及银行存款	10,152,846.48	2.72%
3	20 中交投资 ABN001 优先	债券	8,054,735.40	2.15%
4	20 农发 02	债券	5,052,439.71	1.35%
5	21 宣城国资 PPN001	债券	4,408,468.54	1.18%
6	20 光德鲲鹏 ABN001 优先	债券	4,310,020.78	1.15%
7	21 徐州高新 PPN001	债券	3,519,217.67	0.94%
8	20 电建 01	债券	3,518,967.01	0.94%
9	21 常德城投 PPN002	债券	3,516,040.21	0.94%
10	20 电建 A	债券	3,504,483.43	0.94%

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	012283126.IB	22 新疆金投 SCP002	79,374.42
华夏银行股份有限公司	102281527.IB	22 长发集团 MTN002	62,088.64

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）
-	-	-	-	-

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	10257000000844316

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。