

华夏理财龙盈固收周期360天理财产品A款

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	华夏理财龙盈固收周期 360 天理财产品 A 款
理财产品代码	201216800707
产品登记编码	Z7003921000664
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	109.85%
产品起始日期	2020-12-04
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	1.0777	20,166,395,120.17	1.0777	21,734,092,076.60	0.58%
2022-06-30	1.0715	21,975,754,291.53	1.0715	23,547,353,012.26	

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	1.14%	2.17%
2	同业存单	0.00%	10.50%
3	拆放同业及债券买入返售	2.53%	2.76%
4	债券	6.73%	66.85%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	2.47%
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	15.74%	15.26%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	73.86%	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	19 民生银行永续债	债券	749,966,051.00	3.14%
2	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	658,289,575.84	2.76%
3	19 广发银行永续债	债券	637,105,763.41	2.67%
4	易方达稳健收益 B	公募基金	635,786,466.28	2.66%
5	现金及银行存款	现金及银行存款	475,295,750.06	1.99%
6	19 平安银行二级	债券	401,048,849.16	1.68%
7	平银优 01	权益类投资	349,361,641.47	1.46%
8	20 浦发银行永续债	债券	335,690,352.17	1.41%
9	泰康稳健增利 A	公募基金	307,103,424.82	1.29%
10	富国稳健增强 AB	公募基金	297,774,290.50	1.25%

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	2,830,042.99
华夏银行股份有限公司	042280372.IB	22 武清国资 CP004	3,142,605.10
华夏银行股份有限公司	092280061.IB	22 长沙农商行二级资本 债 01	931,524.96
华夏银行股份有限公司	102281527.IB	22 长发集团 MTN002	447,712.15
华夏银行股份有限公司	102281789.IB	22 武汉生态 MTN002	1,023,515.12
华夏银行股份有限公司	102281971.IB	22 桂铁投 MTN005	2,368,520.75

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 理有限公司	650953 OTC	英大基金-华英稳健 4号集合资产管理计 划	买入	361,000,000.00

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

在央行持续呵护下，银行体系流动性保持合理充裕，资金价格维持在低位水平，总体而言，稳健的货币政策引导并稳定市场预期，为债券投资营造适宜货币金融环境。本产品在日常投资管理中灵活运用各类交易工具，维持了较为充裕的流动性，同时也注意保持投资品变现能力，预防市场极端情况对产品流动性的冲击。

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

截至本报告日，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	10257000000848424

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。