

华夏理财龙盈固定收益类纯债型理财产品 1 号

2023 年第 2 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：2023 年 4 月 1 日至 2023 年 6 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纯债型理财产品 1 号
理财产品代码	1912121000101
A 份额销售代码	1912121000101
M 份额销售代码	19121210001M
Y 份额销售代码	19121210001Y
产品登记编码	Z7003921000629
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	109.71%
产品起始日期	2019-03-06
产品终止日期	无特定存续期限

注：由于子份额可能存在募集金额或存续金额为 0，导致无持有人的情形，本报告仅列示报告期末存续金额不为 0 的相关子份额信息。

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
2023-06-30	1.1619	10,206,403,487.54	1.1619	11,858,852,643.43	0.85%
2023-03-31	1.1521	8,449,331,278.69	1.1521	9,734,197,966.22	

M 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
2023-06-30	1.0212	498,789,935.77	1.0212	509,378,914.20	0.85%
2023-03-31	1.0126	188,655,018.37	1.0126	191,031,914.92	

Y 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
2023-06-30	1.0137	540,505.58	1.0137	547,915.42	0.91%
2023-03-31	1.0046	188,486.66	1.0046	189,361.35	

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	2.84%	36.10%
2	同业存单	2.36%	2.93%
3	拆放同业及债券买入返售	4.59%	5.87%
4	债券	27.61%	54.00%
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	0.82%	1.09%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	61.78%	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；“权益类投资”类别中包含永续债和优先股。

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	1,127,637,883.32	8.31%
2	建行重庆渝北支行 20230621-20 亿	现金及银行存款	929,718,494.11	6.85%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	796,809,147.50	5.87%
4	农行顺德乐从支行 230614/9 亿	现金及银行存款	418,559,085.46	3.08%
5	农行顺德乐从支行 230614/8 亿	现金及银行存款	372,052,520.43	2.74%
6	20 光穗鲲鹏 ABN001 优先	债券	274,361,156.75	2.02%
7	21 光穗铜冠 ABN001 优先	债券	192,600,396.57	1.42%
8	19 江东控股 MTN001	债券	116,164,347.26	0.86%
9	工商银行盐城分行 20230630/2.5 亿	现金及银行存款	116,113,222.58	0.86%
10	工商银行盐城分行 20230630/2.5 亿	现金及银行存款	116,113,222.58	0.86%

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	投资规模（元）
兴业银行股份有限公司	222380003.IB	23 兴业银行绿债 01	5,218,680.24
平安银行股份有限公司	112311049.IB	23 平安银行 CD049	98,151,523.50
兴业银行股份有限公司	112310026.IB	23 兴业银行 CD026	98,653,414.29
中国建设银行股份有限公司	2128025.IB	21 建设银行二级 01	41,451,543.56

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	投资规模（元）
-	-	-	-

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	投资规模（元）
中诚信托有限责任公司	ZC19KY OTC	中诚信托汇鑫 11 号集合资金信托计划	买入	40,000,000.00
中国人保资产管理有限公司	BZ22043 OTC	中国人保资产中短期配置 12 号资产管理产品	买入	370,000,000.00

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，提前储备流动性资金；二是根据当前市场收益率情况及对未来市场趋势的研判，合理制定组合加权久期，防范流动性风险；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

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。根据公司理财资产风险分类的要求，持仓中 20 时代 12（代码 167463.SH）、20 时代 10（代码 167340.SH）的资产风险分类为关注类，该券在产品持仓中占比分别不高于 0.1%和 0.05%，对产品净值影响较小。

截至本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优，但持仓中部分资产主体信用评级有所调整。其中，20 时代 10（167340.SH）发行人广州市时代控股集团有限公司 2023 年 6 月主体信用评级被上海新世纪资信评估投资服务有限公司由 AA+调低为 AA-。

截至本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优，但持仓中部分资产信用评级展望有所调整。其中，20 时代 12（167463.SH）发行人广州市时代控股集团

有限公司 2023 年 6 月主体信用评级被上海新世纪资信评估投资服务有限公司由 AA+调低为 AA-。

5.2.2 产品权益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	10257000000772542

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。