

# 华夏理财龙盈固定收益类纯债型理财产品 1 号

## 2023 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：2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 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     | 111.03%                |
| 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<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 |
|------------|-------------|-------------------|-------------|-------------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.1686      | 7,906,474,871.50  | 1.1686      | 9,239,123,842.24  | 0.58%         |
| 2023-06-30 | 1.1619      | 10,206,403,487.54 | 1.1619      | 11,858,852,643.43 |               |

### M 份额：

| 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0271      | 221,280,068.50 | 1.0271      | 227,269,776.55 | 0.58%         |
| 2023-06-30 | 1.0212      | 498,789,935.77 | 1.0212      | 509,378,914.20 |               |

### Y 份额：

| 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 |
|------------|-------------|------------|-------------|------------|---------------|
| 2023-09-30 | 1.0200      | 467,751.34 | 1.0200      | 477,128.61 | 0.62%         |
| 2023-06-30 | 1.0137      | 540,505.58 | 1.0137      | 547,915.42 |               |

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值\*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       | 1.34%     | 40.34%    |
| 2  | 同业存单          | 3.13%     | 3.07%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.50%     |
| 4  | 债券            | 22.73%    | 51.32%    |
| 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          | 4.16%     | 4.77%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 68.64%    | 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<br>(元)      | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------------|---------|------------------|-------------|
| 1  | 存款及清算款等现金类资产         | 现金及银行存款 | 2,636,921,954.91 | 25.09%      |
| 2  | 农行天津滨海分行 20230906/12 | 现金及银行存款 | 435,838,053.02   | 4.15%       |
| 3  | 农行北京门头沟支行 20230908/8 | 现金及银行存款 | 290,513,531.97   | 2.76%       |
| 4  | 20 光穗鲲鹏 ABN001 优先    | 债券      | 260,992,065.16   | 2.48%       |
| 5  | 21 光穗铜冠 ABN001 优先    | 债券      | 182,104,662.00   | 1.73%       |
| 6  | 富国稳健增强 C             | 公募基金    | 149,093,082.15   | 1.42%       |
| 7  | 19 江东控股 MTN001       | 债券      | 112,028,647.05   | 1.07%       |
| 8  | 21 金茂投资 MTN001       | 债券      | 107,197,147.38   | 1.02%       |
| 9  | 21 西海发展 PPN001       | 债券      | 102,860,380.87   | 0.98%       |
| 10 | 23 桂投资 CP002         | 债券      | 101,442,571.04   | 0.97%       |

### 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          | 投资规模（元）        |
|--------------|--------------|---------------|----------------|
| 平安银行股份有限公司   | 112311045.IB | 23 平安银行 CD045 | 49,212,512.57  |
| 平安银行股份有限公司   | 112311113.IB | 23 平安银行 CD113 | 49,004,226.09  |
| 兴业银行股份有限公司   | 112310043.IB | 23 兴业银行 CD043 | 29,625,204.82  |
| 兴业银行股份有限公司   | 112310204.IB | 23 兴业银行 CD204 | 98,113,409.29  |
| 兴业银行股份有限公司   | 112310225.IB | 23 兴业银行 CD225 | 196,687,037.82 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112305036.IB | 23 建设银行 CD036 | 49,455,193.44  |
| 中国建设银行股份有限公司 | 112305088.IB | 23 建设银行 CD088 | 98,234,419.13  |

#### 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） |
|-------|------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -    | -       |

## 第四章 收益分配情况

| 除权日期 | 每万份理财份额分红数（元） |
|------|---------------|
| -    | -             |

## 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。价格波动在正常范围之内。

#### 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。