

# 华夏理财龙盈固定收益类专属 11 号三个月 定开理财产品

## 2023 年年度报告

### 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、天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）对本理财产品的财务报表进行了审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。
- 3、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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 11 号三个月定开理财产品
理财产品代码	208212401101
产品登记编码	Z7003921000429
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	113.77%
产品起始日期	2020-10-15
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)	期间净值增 长率
2023-12-31	1.1042	82,255,481.31	1.1042	90,824,415.25	3.59%
2022-12-31	1.0659	206,307,841.84	1.0659	219,895,617.10	

注：期间净值增长率=（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	0.02%	6.46%
2	同业存单	0.00%	2.92%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	84.49%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	2.32%
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%	3.80%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.98%	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 (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	6,676,624.44	6.46%
2	23 中铝国工 MTN002	债券	2,853,603.18	2.76%
3	易方达恒久 1 年定期债券 A	公募基金	2,591,626.47	2.51%
4	长银优 1	权益类投资	2,399,328.10	2.32%
5	21 豫保 Y1	债券	1,732,914.96	1.68%
6	20 栾川铝业 MTN001	债券	1,462,930.30	1.42%
7	21 中证融担 PPN001	债券	1,391,381.51	1.35%
8	23 兴业银行 CD234	同业存单	1,319,565.74	1.28%
9	21 首创 C1	债券	1,315,644.07	1.27%
10	易方达年年恒实纯债一年定开债券 发起式 A	公募基金	1,282,125.96	1.24%

### 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）
国网国际融资租赁有限公司	012383614	23 国网租赁 SCP006	334,838.02
国网国际融资租赁有限公司	102280312	22 国网租赁 MTN001	81,816.45
鲁能集团有限公司	136692	16 鲁能 02	70,895.58
兴业银行股份有限公司	222380003	23 兴业银行绿债 01	1,255,976.03
驿停车（北京）投资管理有限公司	143235	23 驿停 01	85,177.70
中国建设银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	449,751.93

#### 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）
招商证券股份有限公司	032380258	23 常德城投 PPN004	303,390.35

#### 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

本产品报告期内无流动性风险事件发生，整体流动性风险水平可控。

### 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

本产品持仓信用风险水平相对较低，价格波动可控。截止本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优，担持仓中部分资产主体信用评级和展望有所调整。其中，H20 远资 1（175093.SH）发行人远洋资本有限公司 2023 年 4 月主体信用评级被中诚信国际信用评级有限责任公司由 AA+调低至 AA，评级展望调整为负面。以上债券在产品持仓中合计占比不高于 0.05%，对产品净值影响较小。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品投资的权益资产价格波动对组合净值波动的影响保持在可控范围内。

#### 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	10257000000844305

## 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。

## 第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品在投资运作过程中存在违反法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。