

华夏理财龙盈固定收益类专属7号理财产品

2024年第2季度报告

重要信息提示：

- 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。
- 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：2024年4月1日至2024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专属7号理财产品 |
| 理财产品代码 | 208212400701 |
| A 份额销售代码 | 208212400701 |
| Z 份额销售代码 | 208212400701Z |
| 产品登记编码 | Z7003921000425 |
| 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 | 102.40% |
| 产品起始日期 | 2020-09-04 |
| 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

2.1 净值和存续规模

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) |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|
| 2024-06-30 | 1.1442 | 1,904,285,922.90 | 1.1442 | 2,178,860,282.31 |

Z 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) |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|
| 2024-06-30 | 1.0232 | 688,400,548.53 | 1.0232 | 704,398,528.94 |

2.2 净值增长率

A 份额：

| | 起始和截止时间 | 净值增长率 |
|-------|-----------------------|--------|
| 报告期间 | 2024年3月31日-2024年6月30日 | 0.86% |
| 成立以来 | 2020年9月4日-2024年6月30日 | 14.42% |
| 2023年 | 2023年全年 | 2.52% |
| 2022年 | 2022年全年 | 3.91% |
| 2021年 | 2021年全年 | 4.14% |
| 2020年 | 2020年9月4日-2020年12月31日 | 1.47% |

Z 份额：

| | 起始和截止时间 | 净值增长率 |
|-------|-------------------------|-------|
| 报告期间 | 2024年3月31日-2024年6月30日 | 0.93% |
| 成立以来 | 2022年12月22日-2024年6月30日 | 2.32% |
| 2023年 | 2023年全年 | 0.47% |
| 2022年 | 2022年12月22日-2022年12月31日 | 0.07% |

注：净值增长率=(期末累计净值-期初累计净值)/期初份额净值*100%；因投资者赎回可能导致在某个时期部分份额为0，该情形下净值增长率的所属区间不连续；年末份额为0时，该年度净值增长率为空；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，投资须谨慎。

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 | 2.75% | 2.75% |
| 2 | 同业存单 | 30.04% | 30.04% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 10.16% | 10.16% |
| 4 | 债券 | 48.92% | 48.92% |
| 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 | 8.13% | 8.13% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 0.00% | 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 | 债券买入返售 | 拆放同业及债券 买入返售 | 300,064,109.59 | 10.16% |
| 2 | 中银纯债债券 D | 公募基金 | 100,954,041.70 | 3.42% |
| 3 | 24 兴业银行 CD046 | 同业存单 | 98,740,049.18 | 3.34% |
| 4 | 24 光大银行 CD099 | 同业存单 | 98,724,955.47 | 3.34% |
| 5 | 24 浦发银行 CD100 | 同业存单 | 98,624,069.32 | 3.34% |
| 6 | 24 农业银行 CD047 | 同业存单 | 98,619,416.99 | 3.34% |
| 7 | 24 中信银行 CD115 | 同业存单 | 98,613,016.99 | 3.34% |
| 8 | 24 平安银行 CD061 | 同业存单 | 98,467,784.93 | 3.34% |
| 9 | 24 兴业银行 CD112 | 同业存单 | 98,430,699.73 | 3.33% |
| 10 | 24 兴业银行 CD114 | 同业存单 | 98,425,527.67 | 3.33% |

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） |
|------------|-----------|---------------|---------------|
| 平安银行股份有限公司 | 112411061 | 24 平安银行 CD061 | 98,030,342.19 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410046 | 24 兴业银行 CD046 | 98,715,412.30 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410112 | 24 兴业银行 CD112 | 97,997,144.11 |
| 兴业银行股份有限公司 | 112410114 | 24 兴业银行 CD114 | 98,393,411.51 |

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。本产品系每日开放产品，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

截止本报告日，产品投资的债券资产价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益类资产持仓。

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 | 10257000000843027 |

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。