

# 华夏理财龙盈固定收益类纯债型理财产品 1 号

## 2024 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：2024 年 7 月 1 日至 2024 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	104.13%
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

### 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)
2024-09-30	1.1963	4,854,877,716.61	1.1963	5,807,907,910.71

#### 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)
2024-09-30	1.0516	75,621,852.11	1.0516	79,520,824.56

#### 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)
2024-09-30	1.0466	58,405.83	1.0466	61,124.92

### 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6月30日-2024年9月30日	0.35%
成立以来	2019年3月6日-2024年9月30日	19.63%
2023年	2023年全年	3.17%
2022年	2022年全年	1.83%
2021年	2021年全年	3.68%
2020年	2020年全年	4.07%
2019年	2019年3月6日-2019年12月31日	3.79%

#### M 份额：

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年6月30日-2024年9月30日	0.36%

成立以来	2022年6月9日-2024年9月30日	5.16%
2023年	2023年全年	3.16%
2022年	2022年6月9日-2022年12月31日	0.24%

**Y 份额：**

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年6月30日-2024年9月30日	0.42%
成立以来	2022年8月19日-2024年9月30日	4.66%
2023年	2023年全年	3.38%
2022年	2022年8月19日-2022年12月31日	-0.60%

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	0.11%	34.53%
2	同业存单	4.84%	5.24%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.64%
4	债券	36.69%	51.30%
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	7.23%	7.30%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	51.12%	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	401,541,744.27	6.55%
2	24 连云城建 CP002	债券	181,031,131.23	2.95%
3	建行溧阳嘉丰支行 20231215	现金及银行存款	174,724,590.53	2.85%
4	20 平安人寿	债券	112,690,714.52	1.84%
5	24 供销 MTN001	债券	110,022,174.79	1.79%
6	20 中邮人寿 02	债券	105,708,418.03	1.72%
7	21 宏泰国资 MTN001	债券	101,796,830.14	1.66%
8	汇添富添添乐双盈债券 A	公募基金	101,755,228.77	1.66%
9	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	100,437,109.26	1.64%
10	财通多利债券 C	公募基金	99,945,533.77	1.63%

### 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）
中国建设银行股份有限 公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	1,580,150.57

#### 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	262766	5 美好 1B	333,706.75
招商证券股份有限公司	263089	5 美意 1A	2,311,677.48
招商证券股份有限公司	263090	5 美意 1B	624,152.92

#### 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	ZXD32Z2023 11010022356	中诚信托-汇鑫 21 号 集合资金信托计划	买入	91,000,000.00



#### 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

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

截止本报告日,产品持仓债券价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 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。