

华夏理财龙盈固收周期270天理财产品A款

2023年第1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 01 月 01 日至 2023 年 3 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财龙盈固收周期 270 天理财产品 A 款
理财产品代码	201216700601
产品登记编码	Z7003921000663
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	118.02%
产品起始日期	2020-09-24
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)	期间累计净 值增长率
2023-03-31	1.0755	1,018,181,497.69	1.0755	1,095,049,828.84	1.05%
2022-12-31	1.0643	2,192,462,239.95	1.0643	2,333,395,508.36	

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	1.47%	14.74%
2	同业存单	0.00%	0.55%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	10.35%	65.32%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	2.86%	16.86%
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%	2.53%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	85.33%	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	190,453,566.76	14.74%
2	21 徐州矿务 MTN001	债券	103,009,675.34	7.97%
3	16 武汉地铁 MTN001	权益类投资	31,325,725.57	2.42%
4	20 碧地 02	债券	21,252,021.86	1.64%
5	21 远洋控股 PPN001	债券	16,579,050.05	1.28%
6	方正富邦鑫益一年定期开放混合 A	公募基金	16,434,943.79	1.27%
7	22 金牛象屿 ABN001 优先	债券	16,144,967.89	1.25%
8	民生优 1	权益类投资	15,143,338.92	1.17%
9	21 拱墅 03	债券	14,870,132.90	1.15%
10	20 仪征 02	债券	11,201,604.95	0.87%

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	112305034.IB	23 建设银行 CD034	18,428.33
中国建设银行股份有限公司	112305035.IB	23 建设银行 CD035	18,428.29

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）
英大基金管理有限公司	650952 OTC	英大基金-华英稳健3号集合资产管理计划	买入	30,000,000.00
英大基金管理有限公司	650953 OTC	英大基金-华英稳健4号集合资产管理计划	买入	70,000,000.00
英大基金管理有限公司	ydhywj01 OTC	英大基金-华英稳健1号集合资产管理计划	买入	55,000,000.00
中诚信托有限责任公司	ZC19KZ OTC	中诚信托嘉信配置1号集合资金信托计划	买入	39,830,470.00
中诚信托有限责任公司	ZC1A3M OTC	中诚信托汇鑫16号集合资金信托计划	买入	53,200,000.00

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

本产品每日开放，本报告期内赎回顺利。截至本报告日，产品持有 14%以上的现金等高流动性资产，能够满足每日赎回的需要，流动性风险可控。

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

截至本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优。根据公司内部理财风险资产分类的认定，持仓中 PR01 优（169741.SH）、20 远资 01（175093.SH）和 PR 龙债 02（代码 166599.SH）的资产风险认定从正常类划分为关注类，该券在产品持仓中占比分别不高于 0.98%、0.27%和 0.06%，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

本产品持有 16%以上的权益类资产，主要为优先股和永续债，以及少量的权益类公募基金，存在一定的市场风险，估值净价可能随市场波动。

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	10257000000848060

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。