

# 华夏理财龙盈固定收益类尊享 37 号三个月 定开理财产品

## 2022 年第 4 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：2022 年 10 月 01 日至 2022 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尊享 37 号三个月定开理财产品 |
| 理财产品代码  | 208212403702                |
| 产品登记编码  | Z7003921000413              |
| 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    | 119.48%                     |
| 产品起始日期  | 2021-01-07                  |
| 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<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 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2022-12-31 | 1.0738      | 778,527,227.52   | 1.0738      | 835,953,470.47   | -0.22%        |
| 2022-09-30 | 1.0762      | 1,104,029,020.24 | 1.0762      | 1,188,155,495.56 |               |

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       | 14.03%    | 17.77%    |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 6.13%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 75.81%    |
| 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          | 0.00%     | 0.29%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 85.97%    | 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。

### 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 | 177,505,907.34 | 17.77%      |
| 2  | 20 碧地 02       | 债券      | 55,862,972.58  | 5.59%       |
| 3  | 21 远洋控股 PPN001 | 债券      | 48,928,317.75  | 4.90%       |
| 4  | PR01 优         | 债券      | 31,448,570.49  | 3.15%       |
| 5  | 21 远洋控股 PPN002 | 债券      | 31,118,024.86  | 3.12%       |
| 6  | PR 旭辉 1A       | 债券      | 31,089,382.28  | 3.11%       |
| 7  | 20 复星高科 MTN003 | 债券      | 27,739,042.38  | 2.78%       |
| 8  | 20 桂金 01       | 债券      | 18,927,218.71  | 1.90%       |
| 9  | 20 京保险 PPN001  | 债券      | 15,201,101.27  | 1.52%       |
| 10 | 22 中国银行 CD001  | 同业存单    | 13,721,834.04  | 1.37%       |

### 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 | 买入规模（元） |
|-------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -       |

#### 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          | 买入规模（元）    |
|------------|--------------|---------------|------------|
| 华夏银行股份有限公司 | 102282474.IB | 22 株国投 MTN002 | 476,190.04 |

#### 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 | 交易金额（元）        |
|----------------|-----------------|------------------------------|------|----------------|
| 英大基金管理有限公司     | ydhywj02<br>OTC | 英大基金-华英稳健<br>2 号集合资产管理计<br>划 | 买入   | 755,000,000.00 |
| 中诚信托有<br>限责任公司 | ZC19HA OTC      | 中诚信托嘉信 11 号<br>集合资金信托计划      | 买入   | 137,700,000.00 |
| 中诚信托有<br>限责任公司 | ZC19RE OTC      | 中诚信托嘉信 12 号<br>集合资金信托计划      | 买入   | 40,000,000.00  |

## 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。本产品系定期开放产品，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，本产品投资的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

截至本报告日，本产品无权益持仓。

#### 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 | 10257000000849303 |

## **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。