

华夏理财龙盈固定收益类 G 款 5 号一年定开 权益增强理财产品

2023 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：2023 年 10 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 G 款 5 号一年定开权益增强理财产品
理财产品代码	1912121000501
产品登记编码	Z7003921000592
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	117.27%
产品起始日期	2019-06-18
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
2023-12-31	1.2365	426,309,963.50	1.2365	527,148,518.28	1.03%
2023-09-30	1.2239	426,309,963.50	1.2239	521,754,987.25	

注：期间累计净值增长率=（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	5.58%	5.84%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.80%
4	债券	0.00%	70.36%
5	非标准化债权类资产	26.64%	22.73%
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%	0.28%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	67.78%	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	渤海信托.北塘湾(天津)科技发展有限公司理财融资项目(第一期).2023 盈夏 9 号.固收 G 款 5 号	非标准化债权类资产	50,106,125.00	8.11%
2	中诚信托.消费授信付款资产(蚂蚁“花呗”)承接池信托(第二期).永成 601 号.债权 120 号.G 款 8 号.G 款 5 号.G 款 15 号	非标准化债权类资产	40,343,555.56	6.53%
3	山东信托.湖北宏泰集团.融华 12 号.第一期.固收 G5	非标准化债权类资产	40,026,905.89	6.48%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	36,080,805.27	5.84%
5	21 华租 03	债券	11,029,572.45	1.78%
6	渤海信托.天津市政投资有限公司(第 3 期).2023 盈夏 5 号.G 款 5 号	非标准化债权类资产	10,020,994.44	1.62%
7	23 京住总 MTN003	债券	9,948,490.33	1.61%
8	22 新兴 01	债券	9,679,600.85	1.57%
9	22 海旅 01	债券	9,533,394.55	1.54%
10	20 桂交 01	债券	9,530,681.00	1.54%

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
1	北塘湾(天津)科技发展有限公司	渤海信托.北塘湾(天津)科技发展有限公司理财融资项目(第一期).2023 盈夏 9 号.固收 G 款 5 号	信托贷款	5.3100	168	正常
2	非特定消费信贷客户	中诚信托.消费授信付款资产(蚂蚁“花呗”)承接池信托(第二期).永成 601 号.债权 120 号.G 款 8 号.G 款 5 号.G 款 15 号	信托贷款	4.4000	115	正常
3	湖北宏泰集团有限公司	山东信托.湖北宏泰集团.融华 12 号.第一期.固收 G5	信托贷款	4.4923	167	正常
4	天津市政投资有限公司	渤海信托.天津市政投资有限公司(第 3 期).2023 盈夏 5 号.G 款 5 号	信托贷款	4.5800	169	正常

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）
-	-	-	-

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）
中诚信托有 限责任公司	fb20231026B	中诚信托-永成 601 号集合资金信托计 划	理财买入	40,000,000.00

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

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，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	10257000000803345

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。