

# 华夏理财龙盈固定收益类 G 款 27 号一年半 定期开放式纯债理财产品

## 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 27 号一年半定期开放式纯债理财产品 |
| 理财产品代码  | 1912121000304                      |
| 产品登记编码  | Z7003921000570                     |
| 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    | 125.76%                            |
| 产品起始日期  | 2019-11-15                         |
| 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2023-12-31 | 1.1905      | 36,013,533.67 | 1.1905      | 42,872,878.48 | 1.12%         |
| 2023-09-30 | 1.1773      | 36,013,533.67 | 1.1773      | 42,398,847.33 |               |

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       | 0.85%     | 0.82%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 99.18%    |
| 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%     | 0.00%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.15%    | 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<br>(元)  | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------|------|--------------|-------------|
| 1  | 23 金阳投资 PPN001 | 债券   | 3,082,694.58 | 5.72%       |
| 2  | 23 洛阳城乡 PPN001 | 债券   | 3,073,448.11 | 5.70%       |
| 3  | 20 常投 01       | 债券   | 3,068,651.62 | 5.69%       |
| 4  | 23 常德城投 PPN004 | 债券   | 3,027,565.33 | 5.62%       |
| 5  | 22 六安城投 PPN001 | 债券   | 3,023,934.38 | 5.61%       |
| 6  | G20 长交 1       | 债券   | 2,808,003.14 | 5.21%       |
| 7  | 22 南部新城 MTN001 | 债券   | 2,431,765.42 | 4.51%       |
| 8  | 22 济宁高新 MTN001 | 债券   | 2,426,006.58 | 4.50%       |
| 9  | 23 建发 01       | 债券   | 1,831,074.63 | 3.40%       |
| 10 | 22 宿州城投 PPN001 | 债券   | 1,821,144.36 | 3.38%       |

### 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 | 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） |
|-------|------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -    | -       |

## 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

流动性风险控制方面，本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，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出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

截至本报告日，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 | 10257000000821706 |

## 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。