

龙盈 ESG 混合 G 款 8 号两年定开理财产品

2021 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、华夏银行股份有限公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏银行股份有限公司

产品托管人：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2021 年 07 月 01 日至 2021 年 9 月 30 日

第一章 基本信息

| | |
|---------|---------------------------|
| 产品名称 | 龙盈 ESG 混合 G 款 8 号两年定开理财产品 |
| 理财产品代码 | 208282100415 |
| 产品登记编码 | C1030420003182 |
| 产品募集方式 | 公募 |
| 产品运作模式 | 开放式 |
| 产品投资性质 | 混合类 |
| 投资及收益币种 | 人民币 |
| 产品风险评级 | PR3(平衡型) |
| 杠杆水平 | 100.09% |
| 产品起始日期 | 2020-11-06 |
| 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2021-09-30 | 1.0480 | 92,472,000.00 | 1.0480 | 96,910,879.41 | 0.31% |
| 2021-06-30 | 1.0448 | 92,472,000.00 | 1.0448 | 96,618,249.13 | |

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 | 1.58% | 3.76% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.00% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.68% |
| 4 | 债券 | 3.18% | 3.18% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 38.40% | 38.38% |
| 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% | 54.00% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 56.84% | 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 (元) | 占总资产 的比例 |
|----|-----------------------------------|---------------|---------------|-------------|
| 1 | 赣州城市开发投资集团有限责任公司 2020 年度第二期债权融资计划 | 非标准化债权类 资产 | 37,231,919.64 | 38.38% |
| 2 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 3,649,567.46 | 3.76% |
| 3 | 17 国开 06 | 债券 | 3,080,246.63 | 3.18% |
| 4 | 富国信用债债券 A | 公募基金 | 2,942,309.95 | 3.03% |
| 5 | 富国泓利纯债债券型发起式 A | 公募基金 | 2,244,193.39 | 2.31% |
| 6 | 富国天利增长债券 | 公募基金 | 2,043,253.12 | 2.11% |
| 7 | 富国量化对冲策略三个月持有期混合 C | 公募基金 | 1,605,084.86 | 1.65% |
| 8 | 景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合 | 公募基金 | 1,594,585.59 | 1.64% |
| 9 | 广发睿享稳健增利混合 C | 公募基金 | 1,592,689.04 | 1.64% |
| 10 | 中欧明睿新常态混合 A | 公募基金 | 1,419,281.94 | 1.46% |

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 | 赣州城市开发投资集团有限责任公司 | 赣州城市开发投资集团有限责任公司 2020 年度第二期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.32 | 384 | 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 | 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） |
|-------|------|------|---------|
| - | - | - | - |

3.4.3 报告期内其他重大关联交易

| 关联方名称 | 资产代码 | 资产名称 | 交易类型 | 交易金额（元） |
|-------|------|------|------|---------|
| - | - | - | - | - |

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

本产品为定开型产品，在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，相应配置货币类、债券类、权益类资产，通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险，产品持有的现金等高流动性资产比例符合要求，组合流动性风险可控。

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

本产品持有债券未出现信用评级下调及违约等信用风险事件，三季度在超预期降准下，流动性相对宽松，债券走出震荡上行行情，为产品净值提供正贡献，临近9月末，随通胀的抬升债券收益率有上行压力，波动加大。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品权益敞口三季度维持在18%中枢，大盘指数在9月上半月反弹后由于经济数据走弱，“拉闸限电”等调控以及个别信用风险事件的影响，9月下半月市场出现回跌，板块轮动加速，持仓波动较大。

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 | 10257000000849143 |

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。