

# 龙盈 ESG 混合 G 款 12 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 12 号两年定开理财产品
理财产品代码	208282100419
产品登记编码	C1030420003186
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	100.20%
产品起始日期	2020-12-22
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	1.0511	63,456,000.00	1.0511	66,700,671.55	0.55%
2021-06-30	1.0454	63,456,000.00	1.0454	66,340,069.49	

## 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	2.04%	9.78%
2	同业存单	0.00%	0.05%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.58%
4	债券	0.00%	25.33%
5	非标准化债权类资产	30.00%	29.99%
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%	34.27%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	67.96%	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	潞安化工集团 2021 第一期债券融资计划	非标准化债权类资产	20,041,589.04	29.99%
2	现金及银行存款	现金及银行存款	6,536,603.79	9.78%
3	20 民生银行二级	债券	1,214,169.48	1.82%
4	富国量化对冲策略三个月持有期混合 C	公募基金	866,986.42	1.30%
5	景顺长城量化对冲策略三个月定期开放混合	公募基金	861,315.24	1.29%
6	广发睿享稳健增利混合 C	公募基金	860,290.82	1.29%
7	中欧明睿新常态混合 A	公募基金	700,239.25	1.05%
8	新华增盈回报债券	公募基金	577,969.95	0.86%
9	恒越核心精选混合	公募基金	555,546.16	0.83%
10	华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合	公募基金	514,290.79	0.77%

### 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	潞安化工集团有限公司	潞安化工集团2021 第一期债券融资计划	债券融资计划	6.9	315	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）
华夏银行股份有限公司	012103176.IB	21 新疆金投 SCP001	400,289.69
华夏银行股份有限公司	042100354.IB	21 郑州路桥 CP001	154,760.69
华夏银行股份有限公司	042100420.IB	21 海安动迁 CP001	65,734.19

#### 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	10257000000849187

## 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。