

华夏理财龙盈 ESG 固定收益类 G 款 4 号一 年定开理财产品

2021 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：2021 年 10 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财龙盈 ESG 固定收益类 G 款 4 号一年定开理财产品
理财产品代码	1912121000403
产品登记编码	Z7003921000499
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(稳健型)
杠杆水平	106.55%
产品起始日期	2019-07-23
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
2021-12-31	1.1172	1,061,599,710.68	1.1172	1,186,022,883.66	1.43%
2021-09-30	1.1015	1,061,599,710.68	1.1015	1,169,355,034.43	

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	0.50%	0.60%
2	同业存单	0.00%	1.24%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.38%
4	债券	11.90%	53.42%
5	非标准化债权类资产	45.07%	42.32%
6	权益类投资	0.00%	0.62%
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%	0.41%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	42.53%	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	科学城(广州)投资集团 2021 第一期 债权融资计划	非标准化债权类 资产	404,487,671.23	32.01%
2	潞安化工集团 2021 第二期债权融资 计划	非标准化债权类 资产	130,320,904.11	10.31%
3	19 农发 07	债券	61,097,672.88	4.83%
4	20 荆门城建 PPN001	债券	41,428,280.55	3.28%
5	17 新郑投资 PPN001	债券	38,722,916.66	3.06%
6	19 民生银行永续债	债券	11,961,267.08	0.95%
7	R007	拆放同业及债券 买入返售	10,516,408.43	0.83%
8	现金及活期存款	现金及银行存款	7,636,258.21	0.60%
9	R001	拆放同业及债券 买入返售	6,985,529.82	0.55%
10	平银优 01	权益类投资	5,536,787.84	0.44%

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	科学城(广州)投资集团有限公司	科学城(广州)投资集团 2021 第一期债权融资计划	北金所债权融资计划	6.5	187	正常
2	潞安化工集团有限公司	潞安化工集团 2021 第二期债权融资计划	北金所债权融资计划	6.9	171	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	032191340.IB	21 东龙控股 PPN002	303,481.80
华夏银行股份有限公司	032191368.IB	21 青岛财富 PPN001	187,645.83
华夏银行股份有限公司	082101495.IB	21 湖北文旅 ABN001 优 先	500,813.52

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

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外部评级未出现下调，展望稳定，债券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

无股票持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

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	10257000000805671

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。