

# 华夏理财龙盈 ESG 混合 GS 款 2 号两年封闭 偏股理财产品

## 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 混合 GS 款 2 号两年封闭偏股理财产品
理财产品代码	208285600403
产品登记编码	Z7003921A000054
产品募集方式	私募
产品运作模式	封闭式
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	107.77%
产品起始日期	2020-06-24
产品终止日期	2022-06-22

## 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	1.0739	13,620,000.00	1.0739	14,626,814.27	0.46%
2021-09-30	1.0690	13,620,000.00	1.0690	14,559,154.06	

## 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	3.53%	4.54%
2	同业存单	0.00%	3.49%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.21%
4	债券	0.00%	49.30%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	19.97%
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%	21.48%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	96.47%	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	英大现金宝货币	公募基金	1,085,328.52	6.89%
2	光大优 3	权益类投资	790,131.06	5.01%
3	现金及活期存款	现金及银行存款	715,830.74	4.54%
4	上银优 1	权益类投资	712,868.74	4.52%
5	长银优 1	权益类投资	546,558.65	3.47%
6	杭银优 1	权益类投资	434,236.90	2.75%
7	21 中铁建 MTN001	债券	429,171.21	2.72%
8	工行优 1	权益类投资	376,589.71	2.39%
9	贵银优 1	权益类投资	286,726.08	1.82%
10	20 电投 Y9	债券	286,635.82	1.82%

### 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
-	-	-	-	-	-	-

### 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	012104128.IB	21 陕西交通 SCP002	8,196.96

#### 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

产品权益投资比例维持在合理区间，灵活调整，留有充足头寸应对流动性需求。产品为两年封闭式产品，运作期间无申赎操作，流动性风险较小。

### 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

产品持有约 50%的永续债仓位，并且在 10 月底永续债利差空间走阔后加仓，随着二次降准落地，永续债利差走窄，价格上升，对产品提供正贡献。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

产品权益敞口 2%，主要是通过投资公募基金参与，持仓比例较小，波动较小。

#### 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	10257000000840128

## 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。