

# 华夏理财龙盈 ESG 混合 G 款 2 号两年定开 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 混合 G 款 2 号两年定开理财产品
理财产品代码	208282100409
产品登记编码	Z7003921000567
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	100.23%
产品起始日期	2020-09-01
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	1.0698	466,974,000.00	1.0698	499,562,015.67	1.50%
2021-09-30	1.0540	466,974,000.00	1.0540	492,195,894.20	

## 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	0.26%	2.96%
2	同业存单	0.00%	0.28%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.34%
4	债券	4.03%	5.75%
5	非标准化债权类资产	37.77%	37.75%
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	0.80%	52.92%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	57.14%	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	阜阳市建设投资控股集团有限公司 2020 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类 资产	186,902,965.75	37.33%
2	21 国开 11	债券	20,159,657.26	4.03%
3	现金及活期存款	现金及银行存款	14,822,730.33	2.96%
4	富国信用债债券 A	公募基金	12,109,436.08	2.42%
5	富国泓利纯债债券型发起式 A	公募基金	9,299,036.50	1.86%
6	广发睿享稳健增利混合 C	公募基金	6,993,409.11	1.40%
7	富国天利增长债券	公募基金	6,308,574.61	1.26%
8	广发可转债债券 E	公募基金	6,073,635.42	1.21%
9	华夏短债债券 A	公募基金	5,039,063.84	1.01%
10	华安安康灵活配置混合 C	公募基金	4,798,421.87	0.96%

### 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	阜阳市建设投资控股集团有限公司	阜阳市建设投资控股集团有限公司 2020 年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.58	188	正常
2	柳州市投资控股有限公司	柳州市投资控股有限公司 2020 年第二期债权融资计划	债权融资计划	5.7	213	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	012104128.IB	21 陕西交通 SCP002	20,597.07

#### 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，合理配置货币类、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

本产品主要通过持有债券型基金，其底层未出现信用风险事件，在二次降准，流动性相对宽松环境下，债券走出震荡上行行情，为产品净值提供正贡献。在经济基本面仍较弱情况下，债券价格无大幅下跌风险，波动较小。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品权益敞口四季度维持在 16% 中枢，其中电气设备、电子等成长板块占比相对较高，在其高景气赛道占优行情下，产品净值上行幅度大，在 12 月中旬后，成长板块开始回调，产品持仓净值波动较大。

#### 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	10257000000844940

## 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。