

华夏理财龙盈固定收益类 ESG 理念理财产品 02 号

2022 年第 1 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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 3 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	华夏理财龙盈固定收益类 ESG 理念理财产品 02 号
理财产品代码	1910621000305
产品登记编码	Z7003921000557
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 级（中低风险）
杠杆水平	116.10%
产品起始日期	2019-05-21
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
2022-03-31	1.1336	1,310,727,371.72	1.1336	1,485,789,378.20	0.55%
2021-12-31	1.1274	1,310,727,371.72	1.1274	1,477,653,542.12	

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	0.58%	13.02%
2	同业存单	0.00%	2.48%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.47%
4	债券	5.54%	62.26%
5	非标准化债权类资产	18.21%	15.69%
6	权益类投资	0.00%	0.70%
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%	5.39%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	75.67%	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 第三期债券融资 计划	非标准化债权类 资产	170,403,109.59	9.88%
2	晋能控股煤业集团有限公司 2021 年 度第四期债权融资计划	非标准化债权类 资产	100,233,698.63	5.81%
3	19 进出 06	债券	72,098,200.14	4.18%
4	新华工行遵义定存 (2022) 1 号	现金及银行存款	34,511,283.07	2.00%
5	新华交行定存(2021)3 号	现金及银行存款	23,852,123.32	1.38%
6	新华广州定存(2021)2 号	现金及银行存款	23,763,852.17	1.38%
7	新华农行存单(2020)4 号	现金及银行存款	23,012,381.14	1.33%
8	新华重庆协存(2021)1 号	现金及银行存款	22,951,929.89	1.33%
9	新华农行存单(2020)6 号	现金及银行存款	22,925,400.92	1.33%
10	现金及银行存款	现金及银行存款	15,574,554.89	0.90%

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	晋能控股煤业集团有限公司	晋能控股煤业集团有限公司2021年度第四期债权融资计划	债权融资计划	6.50	30	正常
2	潞安化工集团有限公司	潞安化工集团2021第三期债权融资计划	债权融资计划	6.30	42	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	032280174.IB	22 中山火炬 PPN001	280,159.20
华夏银行股份有限公司	032280323.IB	22 新疆兵团 PPN001	855,039.52
华夏银行股份有限公司	102280116.IB	22 新郑投资 MTN001	457,912.46

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

截至本报告日，产品投资的权益资产无负面信息，展望稳定，权益资产价格波动处于市场合理区间范围内。

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	10257000000801881

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。