

# 华夏理财龙盈 ESG 固定收益类 2 号一年定 开理财产品

## 2023 年年度报告

### 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、天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）对本理财产品的财务报表进行了审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。
- 3、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：2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2 号一年定开理财产品
理财产品代码	208212100201
产品登记编码	Z7003921000562
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	117.72%
产品起始日期	2020-10-29
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)	期间净值增 长率
2023-12-31	1.1164	40,971,822.32	1.1164	45,742,338.61	4.46%
2022-12-31	1.0687	127,563,228.85	1.0687	136,329,878.69	

注：期间净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值\*100%

## 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	4.14%	3.69%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	68.40%
5	非标准化债权类资产	32.78%	27.92%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	63.08%	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；“权益类投资”类别中包含优先股。

### 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	光大信托.乌鲁木齐高新投资发展集团.瑞信 61 号.ESG 固收 2 号	非标准化债权类资产	15,032,455.00	27.92%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,986,541.86	3.69%
3	21 华租 03	债券	1,178,564.61	2.19%
4	23 京住总 MTN003	债券	1,063,045.61	1.97%
5	20 桂交 01	债券	1,018,400.61	1.89%
6	22 淄金 02	债券	718,681.02	1.33%
7	22 绿城地产 MTN005	债券	652,324.10	1.21%
8	21 陕投 01	债券	632,893.95	1.18%
9	20 广投能源 MTN001	债券	609,782.51	1.13%
10	22 周投 01	债券	604,525.17	1.12%

### 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	乌鲁木齐高新投资发展集团有限公司	光大信托.乌鲁木齐高新投资发展集团.瑞信61号.ESG 固收2号	信托贷款	4.5820	295	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	投资规模（元）
中国建设银行股份有限 公司	242380021	23 建行永续债 02	1,246,450.27

#### 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	投资规模（元）
-	-	-	-

#### 3.4.3 报告期内其他关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	投资规模（元）
英大基金管 理有限公司	ydhywj02 OTC	英大基金-华英稳健 2号集合资产管理计 划	买入	40,000,000.00
中诚信托有 限责任公司	ZCXTJX03 OTC	中诚信托嘉信配置3 号集合资金信托计 划	买入	4,000,000.00

## 第四章 收益分配情况

除权日期	每万份理财份额分红数（元）
-	-



## 第五章 风险分析

### 5.1 投资组合流动性风险分析

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

### 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总体资质较优。持仓的 H2 时代 10（167340.SH）发行人广州市时代控股集团有限公司 2023 年 7 月 10 日对该债券兑付时间进行展期。这只债券在产品持仓中占比不高于 0.1%，风险已被市场定价，对产品净值影响较小。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无权益资产持仓。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况



## 第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000850158

## 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。

## 第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品  
在投资运作过程中存在违反法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。