

龙盈 ESG 混合 G 款 1 号两年定开理财产品

2020 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、华夏银行股份有限公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏银行股份有限公司

产品托管人：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2020 年 08 月 11 日至 2020 年 12 月 31 日

第一章 基本信息

产品名称	龙盈 ESG 混合 G 款 1 号两年定开理财产品
理财产品代码	208282100408
产品登记编码	C1030420003071
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)
杠杆水平上限	140%
产品起始日期	2020-08-11
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
2020-12-31	1.0292	536,079,000.00	1.0292	551,705,748.76	2.92%
2020-08-11	1.0000	-	-	-	

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	0.90%	6.50%
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	6.51%	6.50%
5	非标准化债权类资产	37.98%	37.97%
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%	49.02%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	54.61%	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	西安高新控股有限公司 2020 年度第七期债权融资计划	非标准化债权类资产	209,162,644.34	37.20%
2	现金及银行存款	现金及银行存款	36,569,622.46	6.50%
3	18 进出 13	债券	26,471,110.74	4.71%
4	上投摩根安隆回报混合 A	公募基金	20,306,449.38	3.61%
5	南方交元债券	公募基金	17,744,330.84	3.16%
6	博时富瑞纯债债券	公募基金	17,720,525.77	3.15%
7	汇添富价值精选混合 A	公募基金	15,693,190.74	2.79%
8	圆信永丰优加生活股票	公募基金	14,571,954.67	2.59%
9	鹏华品牌传承混合	公募基金	12,475,195.31	2.22%
10	易方达安源中短债 A	公募基金	11,173,986.01	1.99%

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	西安高新控股有限公司	西安高新控股有限公司 2020 年度第七期债权融资计划	北金所债权融资计划	5.51%	571	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	北金所债权融资计划	5.51%	578	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)
-	-	-	-

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

本产品为两年定开型产品，其直接持有的现金或到期日一年以内的国债、央行票据和政策性金融债合计 7.41%，符合监管不低于 5% 的要求，而且产品在下一个开放日前封闭运作，流动性风险较低。

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

本产品自成立以来直接持仓的债券均为利率债，信用风险较小，价格波动小；产品通过资管计划持有的债券型公募基金在四季度受信用风险事件影响出现一定波动，但市场充足的流动性使得其估值得到支撑，为产品提供稳定的收益。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

2020 年，股票市场演绎了流动性宽松下的结构性牛市行情。本产品通过资管计划持有混合型及股票型公募基金参与权益市场投资，风险相对分散，而且产品立足于稳健的投资策略，权益仓位维持在 25% 以内，价格波动及回撤情况控制在合理区间内。

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	10257000000844292

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，未发现本产品存在违反相关法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。