

华夏理财龙盈 ESG 混合 G 款 9 号两年定开 理财产品

2022 年半年度报告

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 6 月 30 日

第一章 基本信息

| | |
|---------|-------------------------------|
| 产品名称 | 华夏理财龙盈 ESG 混合 G 款 9 号两年定开理财产品 |
| 理财产品代码 | 208282100416 |
| 产品登记编码 | Z7003921000505 |
| 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 级（中等风险） |
| 杠杆水平 | 103.25% |
| 产品起始日期 | 2020-11-19 |
| 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2022-06-30 | 1.0374 | 72,582,000.00 | 1.0374 | 75,294,037.90 | -2.51% |
| 2021-12-31 | 1.0641 | 72,582,000.00 | 1.0641 | 77,237,647.03 | |

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值*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 | 3.05% | 8.33% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.04% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.00% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 9.50% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 40.02% | 38.78% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 2.41% |
| 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 | 4.89% | 40.95% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 52.04% | 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 | 重庆市江津区华信资产经营(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 | 30,151,101.37 | 38.78% |
| 2 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 6,473,132.77 | 8.33% |
| 3 | 富国泓利纯债 A | 公募基金 | 1,536,398.34 | 1.98% |
| 4 | 汇添富成长领先混合 C | 公募基金 | 1,129,393.35 | 1.45% |
| 5 | 中泰星元价值优选 C | 公募基金 | 1,119,500.30 | 1.44% |
| 6 | 鹏华丰享 | 公募基金 | 1,109,501.52 | 1.43% |
| 7 | 景顺长城景颐双利 A | 公募基金 | 1,016,698.77 | 1.31% |
| 8 | 交银施罗德恒益灵活配置混合 C | 公募基金 | 1,016,029.38 | 1.31% |
| 9 | 永赢稳益债券 | 公募基金 | 978,758.85 | 1.26% |
| 10 | 富国产业债 A | 公募基金 | 957,379.66 | 1.23% |

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 | 重庆市江津区华信资产经营(集团)有限公司 | 重庆市江津区华信资产经营(集团)有限公司2020年度第一期债权融资计划 | 债权融资计划 | 5.60 | 118 | 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，相应配置货币类、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，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

上半年，国内经济在内部需求较弱及外部冲击影响下，增长压力较大，货币政策维持宽松，宏观环境整体对债市有利，而且在“资产荒”逻辑下，短久期资产受到大量资金青睐，利率下行较快，尽管6月份上海复产复工后，经济整体呈现复苏，但恢复速度缓慢，利率有缓慢回升。整体看，持仓债券价格上涨。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

一季度，赛道板块出现较大幅度回调，在3月份风险事件频发，权益市场出现一波急跌，在金稳委发声后市场有所恢复，4月底双创指数快速下跌，稳增长板块也出现补跌，市场情绪宣泄式大幅下挫之后，高层发声维稳市场，政治局会议对市场关切问题进行回应，夯实了政策底，5月和6月经济稳增长政策频出，国常会等对稳经济保就业喊话，市场信心逐步恢复，外部扰动弱化，市场情绪回暖，成长板块反弹上涨。本产品持有的权益仓位相对保守，价格波动对组合净值波动率的影响保持在可控范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|-------------------|
| 1 | 托管账户 | 10257000000849154 |

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。