

# 华夏理财龙盈 ESG 混合 G 款 12 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 12 号两年定开理财产品 |
| 理财产品代码  | 208282100419                   |
| 产品登记编码  | Z7003921000569                 |
| 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    | 105.42%                        |
| 产品起始日期  | 2020-12-22                     |
| 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<br>(元) | 份额总数 (份)      | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)      | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2022-06-30 | 1.0333      | 63,456,000.00 | 1.0333      | 65,570,295.37 | -3.24%        |
| 2021-12-31 | 1.0679      | 63,456,000.00 | 1.0679      | 67,766,565.67 |               |

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       | 3.19%     | 8.60%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.32%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.13%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 16.92%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 30.58%    | 29.02%    |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 1.12%     |
| 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          | 5.16%     | 43.90%    |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 61.08%    | 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。

### 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|-----------------------|-----------|---------------|-------------|
| 1  | 潞安化工集团 2021 第一期债权融资计划 | 非标准化债权类资产 | 20,059,589.04 | 29.02%      |
| 2  | 现金及银行存款               | 现金及银行存款   | 5,941,438.64  | 8.60%       |
| 3  | 富国泓利纯债 A              | 公募基金      | 1,302,548.21  | 1.88%       |
| 4  | 景顺长城景颐双利 A            | 公募基金      | 1,016,698.77  | 1.47%       |
| 5  | 交银施罗德恒益灵活配置混合 C       | 公募基金      | 1,016,029.38  | 1.47%       |
| 6  | 永赢稳益债券                | 公募基金      | 829,785.18    | 1.20%       |
| 7  | 富国产业债 A               | 公募基金      | 811,660.05    | 1.17%       |
| 8  | 富国天利增长债券              | 公募基金      | 789,483.20    | 1.14%       |
| 9  | 汇添富成长领先混合 C           | 公募基金      | 695,377.05    | 1.01%       |
| 10 | 安信永鑫增强债券 C            | 公募基金      | 693,106.06    | 1.00%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(天) | 风险状况 |
|----|------------|------------------------------|------------|------------|-------------|------|
| 1  | 潞安化工集团有限公司 | 潞安化工集团<br>2021 第一期债权<br>融资计划 | 债权融资<br>计划 | 6.90       | 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 | 012281379.IB | 22 盐城国投 SCP001  | 1,518.56  |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281597.IB | 22 长虹电子 SCP002  | 1,057.86  |
| 华夏银行股份有限公司 | 012281600.IB | 22 盐城国投 SCP002  | 3,324.69  |
| 华夏银行股份有限公司 | 032280058.IB | 22 杭州农副 PPN001  | 4,170.22  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280061.IB | 22 湘高速 MTN001   | 10,425.55 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280104.IB | 22 宜春创业 MTN001  | 1,878.67  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280116.IB | 22 新郑投资 MTN001  | 1,445.97  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280560.IB | 22 郑州地产 MTN001  | 3,243.73  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280606.IB | 22 京国资 MTN001   | 1,617.48  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102280966.IB | 22 国惠投资 MTN001A | 2,965.65  |

#### 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且外部冲击影响下，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 | 10257000000849187 |

## 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。