

华夏理财龙盈 ESG 混合 G 款 2 号两年定开 理财产品

2022 年第 3 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 07 月 01 日至 2022 年 09 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 2 号两年定开理财产品
理财产品代码	208282100409
产品登记编码	Z7003921000567
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	109.17%
产品起始日期	2020-09-01
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
2022-09-30	1.0423	38,226,186.55	1.0423	39,843,575.71	0.24%
2022-06-30	1.0398	466,974,000.00	1.0398	485,569,414.40	

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	0.00%	0.23%
2	同业存单	0.00%	0.70%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.48%
4	债券	0.00%	56.03%
5	非标准化债权类资产	42.69%	39.13%
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%	3.43%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	57.30%	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	亳州文化旅游控股集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	非标准化债权类 资产	17,019,841.10	39.13%
2	21 郑州银行永续债	债券	469,430.79	1.08%
3	21 江南农商永续债	债券	460,945.63	1.06%
4	21 厦门国际银行永续债 01	债券	435,045.29	1.00%
5	21 铁沪 Y2	债券	361,292.57	0.83%
6	22 扬子国资 MTN001	债券	359,065.19	0.83%
7	21 三局 Y1	债券	358,460.37	0.82%
8	21 川能 Y1	债券	274,774.76	0.63%
9	21 铁隧 Y1	债券	269,011.91	0.62%
10	22 飞驰强链 ABN001 优先	债券	268,171.47	0.62%

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	亳州文化旅游控股集团有限公司	亳州文化旅游控股集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	债权融资计划	5.40	441	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）
北京科技园建设（集团）股份有限公司	032200226.IB	22 京科技园 PPN001A	481,439.98
鲁能集团有限公司	137819.SH	22 鲁能 02	27,281.16

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	042280372.IB	22 武清国资 CP004	561,549.25
华夏银行股份有限公司	fb20220914B	亳州文化旅游控股集团有限公司 2022 年度第一期债权融资计划	17,000,000.00

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

本产品持有的债券及债券型基金总体信用风险可控。三季度，经济基本面修复仍然面临众多挑战，货币政策维持宽松态势，并在 8 月中旬下调 OMO 利率，推动十年国债收益率下行。但随着降息带来的做多情绪逐步弱化，叠加稳增长政策加码，9 月初以来债市以回调为主。总体来讲，本季度市场利率走势呈先下后上的形态。信用债方面，违约依然集中在民营房地产主体，违约率处于近两年高位。报告期内，产品持仓债券整体上涨。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品未直接持有股票，主要通过权益或混合类公募基金参与权益市场的投资。三季度，海内外不确定性交织共振，海外方面，美国通胀率超预期，联储加息态度强硬，人民币汇率承压；国内方面，疫情呈现多点散发式布局，打乱经济修复节奏，7 月份房地产市场发生“断供”风波，地产下行压力凸显。在此背景下，权益市场呈现震荡下行走势，且回调幅度较大。本产品对持仓结构进行了调整，择机降低权益仓位，控制产品净值回撤幅度。

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	10257000000844940

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。