

华夏理财龙盈 ESG 固定收益类 1 号一年定 开理财产品

2022 年第 4 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 10 月 01 日至 2022 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 1 号一年定开理财产品
理财产品代码	208212100101
产品登记编码	Z7003921000563
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	129.60%
产品起始日期	2020-10-22
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 (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
2022-12-31	1.0772	158,031,114.71	1.0772	170,233,130.97	-1.92%
2022-09-30	1.0983	270,861,565.85	1.0983	297,477,773.41	

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	1.58%	3.42%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.98%
4	债券	0.00%	86.05%
5	非标准化债权类资产	8.78%	6.77%
6	权益类投资	0.00%	1.82%
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%	0.95%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	89.64%	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	粤财信托.泰州建设投资集团有限公司理财融资项目 1013 到期(瑞丰 37 号)	非标准化债权类资产	14,946,037.63	6.77%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	7,548,032.77	3.42%
3	19 民生银行永续债	债券	2,365,797.63	1.07%
4	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	2,169,488.41	0.98%
5	民生优 1	权益类投资	2,086,698.52	0.95%
6	21 首创 C1	债券	1,983,457.00	0.90%
7	22 南京奥体 MTN001	债券	1,820,079.50	0.82%
8	19 农业银行永续债 01	债券	1,558,559.17	0.71%
9	19 广发银行永续债	债券	1,552,847.27	0.70%
10	19 信投 03	债券	1,507,187.36	0.68%

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	泰州建设投资集团有限公司	粤财信托.泰州建设投资集团有限公司理财融资项目 1013 到期(瑞丰 37 号)	信托贷款	4.92	286	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	102282474.IB	22 株国投 MTN002	86,395.92

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	交易金额（元）
英大基金管 理有限公司	ydhywj01 OTC	英大基金-华英稳健 1 号集合资产管理计 划	买入	10,000,000.00

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

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出等方式优化组合的流动性管理。

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价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，产品投资的权益资产价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000849686

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。