

华夏理财龙盈 ESG 混合 G 款 4 号两年定开 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 混合 G 款 4 号两年定开理财产品
理财产品代码	208282100411
产品登记编码	Z7003921000510
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	112.27%
产品起始日期	2020-09-25
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	1.0239	52,178,974.16	1.0239	53,423,613.15	-1.51%
2022-09-30	1.0396	52,178,974.16	1.0396	54,245,008.32	

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	2.85%	2.75%
2	同业存单	0.00%	1.56%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	4.01%
4	债券	0.00%	50.30%
5	非标准化债权类资产	43.46%	38.73%
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	2.69%	2.64%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	50.99%	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	中诚信托.重庆市涪陵实业发展集团有限公司信托贷款 0902 到期(2022 君诚 21 号)	非标准化债权类资产	11,831,440.00	19.73%
2	厦门信托.郑州投控流动资金贷款第二期.917 到期	非标准化债权类资产	9,798,512.83	16.34%
3	债券买入返售	拆放同业及债券 买入返售	2,405,664.87	4.01%
4	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,651,536.25	2.75%
5	收益凭证.国泰君安祥云伍佰柜台定制 2022 第 18 期.ESG 混合 G 款 4 号	非标准化债权类资产	1,601,920.00	2.67%
6	20 江苏银行永续债	债券	740,124.25	1.23%
7	22 湘高速 MTN001	债券	734,672.01	1.22%
8	21 苏州银行 CD464	同业存单	718,785.12	1.20%
9	22 陕投集团 MTN003	债券	566,684.10	0.94%
10	20 招金 Y1	债券	511,179.52	0.85%

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	重庆市涪陵实业发展集团有限公司	中诚信托.重庆市涪陵实业发展集团有限公司信托贷款0902 到期(2022 君诚 21 号)	信托贷款	5.26	611	正常
2	郑州投资控股有限公司	厦门信托.郑州投控流动资金贷款第二期.917 到期	信托贷款	5.40	626	正常
3	国泰君安证券股份有限公司	收益凭证.国泰君安祥云伍佰柜台定制 2022 第 18 期.ESG 混合 G 款 4 号	收益凭证	无固定收益率	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。价格波动方面，进入四季度，债券市场剧烈调整，其原因主要有，纾解房地产信用风险的各项政策陆续出台，对“新冠”疫情的防控也有所放松，过去三年拖累经济景气度的两大因素均有实质性好转。另外，经过近两年的债券牛市，市场收益率已处于历史绝对低位，各期限品种信用利差也大幅压缩，自 10 月份开始资金市场中枢缓慢抬升，使得债券市场“杠杆-套息”的盈利模式逐渐被打破，债券收益率快速回升，叠加各类资管机构赎回潮，造成了本次债券市场调整。

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。进入四季度，权益市场迎来较大幅度的上涨，市场经历前期较大幅度下跌，估值处于较低水平，年底重要会议定调稳增长重新成为各项工作排名首位，凸显稳增长重要性，提振市场信心，四季度市场走出一波快速的估值修复行情。产品持仓权益及混合类基金净值均有修复，对组合收益有正向贡献。

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	10257000000845604

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。