

# 华夏理财龙盈 ESG 混合 G 款 12 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 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    | 110.48%                        |
| 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 |
|------------|-------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 2022-12-31 | 1.0010      | 7,856,678.83  | 1.0010      | 7,864,911.97  | -1.38%        |
| 2022-09-30 | 1.0150      | 63,456,000.00 | 1.0150      | 64,406,929.03 |               |

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       | 8.57%     | 8.17%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 2.51%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 12.52%    |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 75.68%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 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%     | 1.11%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 91.43%    | 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  | 债券买入返售         | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 1,088,178.36 | 12.52%      |
| 2  | 存款及清算款等现金类资产   | 现金及银行存款         | 710,197.54   | 8.17%       |
| 3  | 21 深航空 MTN001  | 债券              | 209,996.96   | 2.42%       |
| 4  | 21 拱墅 03       | 债券              | 200,684.08   | 2.31%       |
| 5  | 19 赣城投         | 债券              | 169,918.86   | 1.96%       |
| 6  | 22 住开 01       | 债券              | 161,348.28   | 1.86%       |
| 7  | 21 动投 01       | 债券              | 159,144.51   | 1.83%       |
| 8  | 20 桂资 01       | 债券              | 159,107.40   | 1.83%       |
| 9  | 22 济南高新 SCP005 | 债券              | 158,729.42   | 1.83%       |
| 10 | 21 安邦债         | 债券              | 140,472.10   | 1.62%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(天) | 风险状况 |
|----|------|------|------|------------|-------------|------|
| -  | -    | -    | -    | -          | -           | -    |

### 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 | 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。