

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%	22.29%
5	非标准化债权类资产	43.46%	38.73%
6	权益类投资	0.00%	28.01%
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	权益类投资	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	权益类投资	566,684.10	0.94%
10	20 招金 Y1	权益类投资	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）
中诚信托有 限责任公司	fb20221108B	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)	买入	12,000,000.00

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

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

本产品持有的权益仓位价格波动对组合净值波动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	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。