

华夏理财龙盈 ESG 固定收益类 11 号一年定 开理财产品

2022 年年度报告

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、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本理财产品的财务报表进行了审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。
- 3、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 01 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 11 号一年定开理财产品
理财产品代码	218212101101
产品登记编码	Z7003921000564
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	131.74%
产品起始日期	2021-01-19
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	1.0594	118,169,661.21	1.0594	125,186,700.89	1.68%
2021-12-31	1.0419	346,911,000.00	1.0419	361,462,855.34	

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	12.97%	10.17%
2	同业存单	0.00%	1.43%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.01%
4	债券	0.00%	86.02%
5	非标准化债权类资产	0.00%	0.00%
6	权益类投资	0.00%	0.47%
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%	1.89%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	87.03%	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	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	16,775,850.30	10.17%
2	20 财达 C1	债券	1,434,360.20	0.87%
3	22 国海 02	债券	1,381,414.96	0.84%
4	19 首旅 MTN002B	债券	1,221,756.95	0.74%
5	20 民生银行二级	债券	1,093,805.05	0.66%
6	19 盐城城南 MTN001	债券	1,042,292.49	0.63%
7	22 海恒 K2	债券	1,012,823.63	0.61%
8	22 中海企业 MTN004	债券	1,008,765.61	0.61%
9	20 泰州城投 PPN001	债券	983,207.01	0.60%
10	易方达恒久 1 年定期债券 A	公募基金	900,001.11	0.55%

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
-	-	-	-	-	-	-

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）
鲁能集团有限公司	22 鲁能 02	137819.SH	23,325.30

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	012283126.IB	22 新疆金投 SCP002	47,329.93
华夏银行股份有限公司	032280323.IB	22 新疆兵团 PPN001	121,290.78
华夏银行股份有限公司	102281263.IB	22 即墨城投 MTN001	244,226.98
华夏银行股份有限公司	102281527.IB	22 长发集团 MTN002	33,131.20
华夏银行股份有限公司	102281789.IB	22 武汉生态 MTN002	143,984.61
华夏银行股份有限公司	102281971.IB	22 桂铁投 MTN005	88,205.10
华夏银行股份有限公司	102282474.IB	22 株国投 MTN002	53,956.66

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）
中诚信托有 限责任公司	ZC19HA OTC	中诚信托嘉信 11 号 集合资金信托计划	买入	3,000,000.00

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

产品在报告期内顺利开放，满足赎回要求。截至本报告日，产品持有 10% 以上的现金资产，且处于封闭期内，可以应对一定程度的临时赎回，流动性风险较低。

5.2 投资组合投资风险

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总体资质较优，但持仓中受市场原因部分资产主体评级有所调整。其中，长集转债（128105.SZ）发行人广东长青(集团)股份有限公司主体评级 2022 年 5 月被中诚信国际信用评级有限责任公司由 AA 下调至 AA-。

5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，产品持有少量的权益类资产，主要为永续债、优先股及权益类公募基金，其估值会随着市场波动，对产品净值产生一定影响。

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	10257000000856648

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。

第八章 托管人报告

本报告期内，华夏银行股份有限公司在对本理财产品的托管过程中，按照相关法律法规的规定和合同的约定，勤勉尽责地履行了托管人职责，未发现本产品
在投资运作过程中存在违反法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。