

# 华夏理财龙盈 ESG 固定收益类 11 号一年定 开理财产品

## 2023 年半年度报告

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、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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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    | 132.21%                       |
| 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<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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2023-06-30 | 1.0679      | 24,894,750.77  | 1.0679      | 26,583,938.67  | 0.80%         |
| 2022-12-31 | 1.0594      | 118,169,661.21 | 1.0594      | 125,186,700.89 |               |

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       | 5.46%     | 4.34%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.85%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 72.48%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 17.12%    |
| 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%     | 5.21%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 94.54%    | 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；“权益类投资”类别中包含永续债和优先股。

### 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  | 民生优 1           | 权益类投资   | 1,937,561.85 | 5.51%       |
| 2  | 存款及清算款等现金类资产    | 现金及银行存款 | 1,526,868.66 | 4.34%       |
| 3  | 19 农业银行永续债 01   | 权益类投资   | 1,262,728.54 | 3.59%       |
| 4  | 21 拱墅 03        | 债券      | 976,079.02   | 2.78%       |
| 5  | 19 广发银行永续债      | 权益类投资   | 859,782.03   | 2.45%       |
| 6  | 21 渤海银行二级       | 债券      | 749,906.66   | 2.13%       |
| 7  | 20 曲文投 MTN001   | 债券      | 565,211.55   | 1.61%       |
| 8  | 21 栖建 01        | 债券      | 562,311.64   | 1.60%       |
| 9  | 20 甬开 01        | 债券      | 506,173.39   | 1.44%       |
| 10 | 易方达恒久 1 年定期债券 A | 公募基金    | 490,092.81   | 1.39%       |

### 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 | 投资规模（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 | 投资规模（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 | 投资规模（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

本产品报告期内顺利应对开放赎回，流动性资产符合比例要求。

### 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总体资质较优。根据公司理财资产风险分类的要求，持仓中 PR 龙债 02（代码 166599.SH）的资产风险分类为关注类，该券在产品持仓中占比不高于 0.3%，对产品净值影响较小。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品持有的权益类资产均为永续债和优先股，风险可控，二季度价格震荡上行，对组合有正收益贡献。

#### 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 | 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，未发现本产品存在违反相关法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。