

华夏理财龙盈混合 G 款 31 号一年半封闭多 策略理财产品

2021 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：2021 年 10 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

第一章 基本信息

| | |
|---------|-------------------------------|
| 产品名称 | 华夏理财龙盈混合 G 款 31 号一年半封闭多策略理财产品 |
| 理财产品代码 | 208285100527 |
| 产品登记编码 | Z7003921000682 |
| 产品募集方式 | 公募 |
| 产品运作模式 | 封闭式 |
| 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(平衡型) |
| 杠杆水平 | 104.54% |
| 产品起始日期 | 2020-09-24 |
| 产品终止日期 | 2022-03-28 |

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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2021-12-31 | 1.0785 | 689,857,000.00 | 1.0785 | 743,996,598.24 | 1.27% |
| 2021-09-30 | 1.0650 | 690,057,000.00 | 1.0650 | 734,894,085.83 | |

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 | 0.18% | 2.76% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.49% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 15.55% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 67.80% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 5.40% |
| 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% | 8.00% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 99.82% | 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 | R007 | 拆放同业及债券 买入返售 | 48,227,483.14 | 6.20% |
| 2 | R001 | 拆放同业及债券 买入返售 | 32,531,104.26 | 4.18% |
| 3 | GC007 | 拆放同业及债券 买入返售 | 31,949,773.05 | 4.11% |
| 4 | 现金及活期存款 | 现金及银行存款 | 21,497,110.27 | 2.76% |
| 5 | 21 航租 Y1 | 债券 | 14,465,325.19 | 1.86% |
| 6 | 上银优 1 | 权益类投资 | 11,806,903.15 | 1.52% |
| 7 | 21 江北建投 MTN001 | 债券 | 9,610,003.12 | 1.24% |
| 8 | 杭银优 1 | 权益类投资 | 9,453,740.58 | 1.22% |
| 9 | 21 徐州新盛 MTN002 | 债券 | 9,327,692.00 | 1.20% |
| 10 | 20 赣版 01 | 债券 | 9,079,257.95 | 1.17% |

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） |
|-------|------|------|---------|
| - | - | - | - |

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 | 012103847.IB | 21 云能投 SCP012 | 408,734.91 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012104128.IB | 21 陕西交通 SCP002 | 123,726.44 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032191368.IB | 21 青岛财富 PPN001 | 983,706.85 |

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） |
|-------|------|------|------|---------|
| - | - | - | - | - |

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

本产品对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、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,当前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

本产品持有债券未出现信用评级下调及违约等信用风险事件,四季度债券收益率窄幅震荡略有下行,但整体波动率仍处在合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有的股票仓位相对保守,价格波动对组合净值波动率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 | 10257000000847102 |

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。