

# 华夏理财龙盈固定收益类 G 款 21 号一年定 开科创打新 FOF 型理财产品

## 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	华夏理财龙盈固定收益类 G 款 21 号一年定开科创打新 FOF 型理财产品
理财产品代码	1912121000502
产品登记编码	Z7003921000593
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(稳健型)
杠杆水平	103.67%
产品起始日期	2019-09-25
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
2021-12-31	1.1715	1,024,529,158.20	1.1715	1,200,222,776.25	0.80%
2021-09-30	1.1622	940,835,496.02	1.1622	1,093,484,480.62	

## 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	2.93%	4.00%
2	同业存单	0.00%	1.14%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	1.26%
4	债券	0.00%	20.54%
5	非标准化债权类资产	45.07%	43.49%
6	权益类投资	0.00%	4.45%
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	9.54%	25.13%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	42.46%	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	民生金融租赁同业借款二期 180 天	非标准化债权类 资产	541,161,000.00	43.49%
2	现金及活期存款	现金及银行存款	49,709,736.48	4.00%
3	鹏扬汇利 C	公募基金	46,934,615.01	3.77%
4	华宝添益货币 A	公募基金	33,501,148.12	2.69%
5	保证金	公募基金	33,485,748.41	2.69%
6	易方达裕祥回报	公募基金	22,447,194.23	1.80%
7	华夏睿磐泰兴	公募基金	20,132,175.79	1.62%
8	R007	拆放同业及债券 买入返售	13,299,656.53	1.07%
9	中欧价值智选回报 C	公募基金	11,349,173.62	0.91%
10	银华交易型货币 A	公募基金	10,702,038.35	0.86%

### 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	民生金融租赁股份有限公司	民生金融租赁 同业借款二期 180天	同业借款	4.60	172	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）
华夏银行股份有限公司	032191340.IB	21 东龙控股 PPN002	137,737.20
华夏银行股份有限公司	032191368.IB	21 青岛财富 PPN001	145,247.32
华夏银行股份有限公司	082101495.IB	21 湖北文旅 ABN001 优先	251,401.03

#### 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

产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,按照产品说明书约定确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例,并随着风险收益特征的相对变化及时调整;此外,本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。

### 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

本产品按照产品说明书约定的范围进行投资,并根据市场行情,调整各类资产的占比。结合产品所投资公募基金的持仓情况,由于产品债券固定收益类资产配置占比超过 80%,产品运作管理期间净值波动幅度较小。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品精选打新主题公募基金,成功把握政策红利,四季度在面临新股频繁破发、申购收益下降的情况下依然为投资者提供了较好的投资回报。本产品严格按照产品说明书约定进行资产配置,价格波动幅度较小。

#### 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	1025700000814143

## 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。