

华夏理财龙盈固定收益类 G 款 54 号半年定 开理财产品

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 54 号半年定开理财产品 |
| 理财产品代码 | 208212100323 |
| 产品登记编码 | Z7003921000580 |
| 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 | 109.47% |
| 产品起始日期 | 2020-05-15 |
| 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 | 1.0696 | 298,314,491.76 | 1.0696 | 319,081,272.38 | 0.94% |
| 2021-09-30 | 1.0596 | 292,209,440.48 | 1.0596 | 309,633,399.92 | |

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 | 4.00% | 3.82% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 6.12% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 4.52% |
| 4 | 债券 | 3.28% | 52.78% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 34.52% | 31.55% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 0.52% |
| 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% | 0.69% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 58.20% | 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 171 天 | 非标准化债权类 资产 | 110,209,611.11 | 31.55% |
| 2 | 现金及活期存款 | 现金及银行存款 | 13,354,548.72 | 3.82% |
| 3 | 18 咸宁城投 MTN002 | 债券 | 10,458,827.53 | 2.99% |
| 4 | R007 | 拆放同业及债券 买入返售 | 9,391,404.96 | 2.69% |
| 5 | R001 | 拆放同业及债券 买入返售 | 5,819,566.64 | 1.67% |
| 6 | 15 农发 04 | 债券 | 2,475,058.31 | 0.71% |
| 7 | 19 民生银行永续债 | 债券 | 1,751,371.26 | 0.50% |
| 8 | 21 农发 11 | 债券 | 1,544,491.85 | 0.44% |
| 9 | 19 广发银行永续债 | 债券 | 1,513,180.04 | 0.43% |
| 10 | 20 民生银行二级 | 债券 | 1,512,458.14 | 0.43% |

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 | 民生金融租赁股份有限公司 同业借款 171 天 | 同业借款 | 4.60% | 129 | 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 | 012103760.IB | 21 京电子城 SCP004 | 947,902.45 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103847.IB | 21 云能投 SCP012 | 296,742.64 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103956.IB | 21 南京公路 SCP002 | 21,816.14 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032191340.IB | 21 东龙控股 PPN002 | 20,332.17 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032191368.IB | 21 青岛财富 PPN001 | 91,044.89 |
| 华夏银行股份有限公司 | 082101495.IB | 21 湖北文旅 ABN001 优 先 | 48,220.92 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102102094.IB | 21 嘉善经开 MTN002 | 534,865.40 |

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

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

截止本报告日，产品投资的债券资产外部评级未出现下调，展望稳定，债券价格波动处于市场合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无股票持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号 |
|----|------|-------------------|
| 1 | 托管账户 | 10257000000837943 |

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。