

华夏理财龙盈 ESG 混合 GS 款 5 号两年封闭 偏股理财产品

2021 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、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 01 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 ESG 混合 GS 款 5 号两年封闭偏股理财产品
理财产品代码	208285600406
产品登记编码	Z7003921A000057
产品募集方式	私募
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 级（中等风险）
杠杆水平	100.04%
产品起始日期	2020-07-24
产品终止日期	2022-07-20

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	1.1416	79,730,000.00	1.1416	91,021,501.40	3.60%
2020-12-31	1.1019	79,730,000.00	1.1019	87,857,844.85	

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	0.69%	3.07%
2	同业存单	0.00%	1.38%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.93%
4	债券	0.00%	10.04%
5	非标准化债权类资产	44.04%	44.03%
6	权益类投资	0.00%	0.00%
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%	40.56%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	55.27%	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	潞安化工集团 2021 第二期债权融资计划	非标准化债权类资产	40,090,739.73	44.03%
2	现金及活期存款	现金及银行存款	2,793,126.20	3.07%
3	富国信用债债券 A	公募基金	2,014,874.36	2.21%
4	富国泓利纯债债券型发起式 A	公募基金	1,803,675.37	1.98%
5	富国天利增长债券	公募基金	1,223,634.37	1.34%
6	富国产业债债券 A	公募基金	874,104.38	0.96%
7	环球 02A1	债券	714,525.25	0.78%
8	21 厦门银行 CD255	同业存单	695,548.54	0.76%
9	21 苏美达 MTN001	债券	643,856.98	0.71%
10	招商瑞丰灵活配置混合型发起式	公募基金	639,959.56	0.70%

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	潞安化工集团有限公司	潞安化工集团2021 第二期债权融资计划	债权融资计划	6.90	171	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	012104128.IB	21 陕西交通 SCP002	14,297.45

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

产品组合留有充足头寸应对流动性需求。投资标的方面，以高市值、高票息投资标的为主，做到可及时卖出变现，产品为两年封闭式产品，运作期间无申赎操作，流动性风险较小。

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，流动性相对宽松，债券走出震荡上行行情，为产品净值提供正贡献。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

7月份前，产品权益敞口维持在30%附近，持仓板块成长类为主，8月份后，逐步减仓实际敞口至10%以内，持仓板块相对分散，主要为打新基金及混合偏债型基金，风险分散，价格波动较小。

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	10257000000841927

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。