

华夏理财龙盈混合 G 款 93 号一年封闭理财产品

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、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本理财产品的财务报表进行了审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。
- 3、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 05 月 24 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 93 号一年封闭理财产品 |
| 理财产品代码 | 218285100589 |
| 产品登记编码 | Z7003921000717 |
| 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 级（中等风险） |
| 杠杆水平 | 107.43% |
| 产品起始日期 | 2021-05-24 |
| 产品终止日期 | 2022-05-24 |

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 | 1.0331 | 786,349,000.00 | 1.0331 | 812,358,921.82 | 3.31% |
| 2021-05-24 | 1.0000 | - | 1.0000 | - | |

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 | 3.41% | 4.61% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.14% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.43% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 42.11% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 29.59% | 27.56% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 9.01% |
| 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% | 16.16% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 67.00% | 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 | 晋能控股煤业集团有限公司 2021 年 度第四期债权融资计划 | 非标准化债权类 资产 | 150,320,547.95 | 17.22% |
| 2 | 晋能控股煤业集团有限公司 2021 年 度第五期债权融资计划 | 非标准化债权类 资产 | 90,192,328.77 | 10.33% |
| 3 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 40,192,708.64 | 4.61% |
| 4 | 上银优 1 | 权益类投资 | 25,827,077.58 | 2.96% |
| 5 | 英大现金宝货币 | 公募基金 | 23,793,371.21 | 2.73% |
| 6 | 光大优 3 | 权益类投资 | 15,217,461.01 | 1.74% |
| 7 | 长银优 1 | 权益类投资 | 10,526,399.17 | 1.21% |
| 8 | 20 光穗首创 ABN001 优先 | 债券 | 10,064,204.40 | 1.15% |
| 9 | 20 易睿平安 ABN001 优先 | 债券 | 9,982,049.84 | 1.14% |
| 10 | 20 天成租赁 GN003 | 债券 | 8,418,349.45 | 0.96% |

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 | 晋能控股煤业集团有限公司 | 晋能控股煤业集团有限公司2021年度第四期债权融资计划 | 债权融资计划 | 6.50 | 120 | 正常 |
| 2 | 晋能控股煤业集团有限公司 | 晋能控股煤业集团有限公司2021年度第五期债权融资计划 | 债权融资计划 | 6.50 | 123 | 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） |
|--------------|--------------|----------------|--------------|
| 国网国际融资租赁有限公司 | 188183.SH | 21 网租 01 | 1,442,412.94 |
| 山东电工电气集团有限公司 | 012101965.IB | 21 山东电工 SCP001 | 3,658,325.80 |

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 | 012102016.IB | 21 电工电气集团 SCP001 | 3,658,325.80 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012102171.IB | 21 栖霞建设 SCP003 | 1,306,075.05 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012102274.IB | 21 高速地产 SCP008 | 863,686.92 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100639.IB | 21 缙云资产 PPN001 | 1,036,424.30 |
| 华夏银行股份有限公司 | 082100570.IB | 21 赢盛云瑞 ABN001 优先 | 356,045.77 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101121.IB | 21 首农食品 MTN001 | 764,248.16 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101226.IB | 21 义乌国资 MTN004 | 2,450,153.76 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103176.IB | 21 新疆金投 SCP001 | 290,613.66 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100868.IB | 21 吴兴城投 PPN002 | 57,069.13 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042100354.IB | 21 郑州路桥 CP001 | 112,357.55 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042100420.IB | 21 海安动迁 CP001 | 47,723.57 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032191368.IB | 21 青岛财富 PPN001 | 1,792,091.66 |

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,成立以来债券收益率震荡上行,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 | 10257000000863815 |

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法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。