

华夏理财龙盈混合 G 款 98 号一年半封闭理 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 04 月 16 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 98 号一年半封闭理财产品 |
| 理财产品代码 | 218285100594 |
| 产品登记编码 | Z7003921000719 |
| 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 | 110.78% |
| 产品起始日期 | 2021-04-16 |
| 产品终止日期 | 2022-10-18 |

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 | 1.0300 | 715,776,000.00 | 1.0300 | 737,277,060.32 | 3.00% |
| 2021-04-16 | 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 | 1.78% | 3.20% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 3.24% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 1.46% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 51.44% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 2.74% | 2.48% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 3.02% |
| 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 | 10.09% | 35.15% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 85.38% | 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 | 英大现金宝货币 | 公募基金 | 71,442,987.22 | 8.75% |
| 2 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 26,159,306.83 | 3.20% |
| 3 | 南方双元 A | 公募基金 | 20,275,271.68 | 2.48% |
| 4 | 科学城(广州)投资集团 2021 第二期 债权融资计划 | 非标准化债权类 资产 | 20,224,383.56 | 2.48% |
| 5 | 易方达瑞程 A | 公募基金 | 19,905,037.59 | 2.44% |
| 6 | 易方达科融 | 公募基金 | 19,840,446.51 | 2.43% |
| 7 | 申万菱信新经济 | 公募基金 | 14,445,572.36 | 1.77% |
| 8 | 21 付息国债 05 | 债券 | 13,478,129.23 | 1.65% |
| 9 | 诺安优化收益债券 | 公募基金 | 10,510,671.64 | 1.29% |
| 10 | 19 平安银行二级 | 债券 | 8,679,265.70 | 1.06% |

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 | 科学城(广州)投资集团有限公司 | 科学城(广州)投资集团 2021 第二期债权融资计划 | 债权融资计划 | 6.50 | 211 | 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 | 8,952,112.86 |

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 | 012101861.IB | 21 晋能煤业 SCP003 | 10,614,763.73 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012102171.IB | 21 栖霞建设 SCP003 | 180,786.13 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100509.IB | 21 甘公投 PPN001 | 1,254,264.83 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100527.IB | 21 诚通建投 PPN001 | 5,646,499.26 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100633.IB | 21 襄阳高新 PPN002 | 6,758,458.82 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100639.IB | 21 缙云资产 PPN001 | 7,572,253.66 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100704.IB | 21 济宁城投 PPN004 | 1,247,337.91 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042100171.IB | 21 甘交建 CP001(乡村振兴) | 22,825,987.71 |
| 华夏银行股份有限公司 | 082100570.IB | 21 赢盛云瑞 ABN001 优先 | 238,709.29 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100774.IB | 21 衢州交投 MTN001 | 115,258.17 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100844.IB | 21 保利久联 MTN001 | 16,234,747.06 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100914.IB | 21 临汾投资 MTN002 | 1,153,095.19 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100968.IB | 21 世园投资 MTN001 | 444,033.36 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101121.IB | 21 首农食品 MTN001 | 512,386.74 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101226.IB | 21 义乌国资 MTN004 | 1,642,694.57 |
| 华夏银行股份有限公司 | 132100044.IB | 21 川能投 GN001(权益出资) | 1,802,644.31 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103176.IB | 21 新疆金投 SCP001 | 7,908,698.47 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100868.IB | 21 吴兴城投 PPN002 | 1,553,067.16 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042100354.IB | 21 郑州路桥 CP001 | 3,057,674.55 |
| 华夏银行股份有限公司 | 042100420.IB | 21 海安动迁 CP001 | 1,224,510.58 |

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

本产品报告期内没有开放，同时配置了 10%以上的现金及流动性资产，能够满足临时赎回的要求，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

本产品持有非标准化债权资产，估值稳定；持有高信用评级债券，估值和信用风险较低，价格随着市场变化小幅波动。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

本产品持有 35%左右的公募基金，估值随市场变化而变化，对产品净值产生一定的影响。

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 | 10257000000861885 |

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。