

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 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 级（中低风险）
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	3.99%
2020-12-31	1.1266	703,457,892.89	1.1266	792,521,262.64	

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	民生金融租赁借款合同二期 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）
山东电工电气集团有限 公司	012101965.IB	21 山东电工 SCP001	1,557,964.39

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	012101232.IB	21 津城建 SCP011	43,829.97
华夏银行股份有限公司	012101966.IB	21 电工电气集团 SCP001	1,557,964.39
华夏银行股份有限公司	102101226.IB	21 义乌国资 MTN004	652,696.24
华夏银行股份有限公司	042100420.IB	21 海安动迁 CP001	72,923.18
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

本产品为定开型产品，在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，产品持有的现金等高流动性资产比例符合要求，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

2021年流动性相对宽松，债券价格走出震荡上行行情，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

组合采用精选打新收益高、底仓选股超额能力强的打新基金策略。2021年打新收益仍维持较高水平，底仓部分成长板块占比较高，在高景气赛道行情占优情况下，均对产品提供正贡献。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000814143

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。