

华夏理财龙盈固定收益类 G 款 72 号三个月 定开理财产品

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 72 号三个月定开理财产品 |
| 理财产品代码 | 208212100345 |
| 产品登记编码 | Z7003921000521 |
| 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 | 114.37% |
| 产品起始日期 | 2020-07-22 |
| 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 | 1.0630 | 1,060,178,420.48 | 1.0630 | 1,126,931,102.02 | 4.31% |
| 2020-12-31 | 1.0191 | 831,101,811.25 | 1.0191 | 846,978,767.92 | |

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 | 0.33% | 0.48% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 1.97% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.56% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 95.01% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 0.44% |
| 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% | 1.53% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 99.67% | 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 | 21 广州银行二级 | 债券 | 11,121,660.62 | 0.86% |
| 2 | 20 晋电 02 | 债券 | 11,093,736.33 | 0.86% |
| 3 | 19 兴港 02 | 债券 | 10,886,147.96 | 0.84% |
| 4 | 19 启东 03 | 债券 | 10,371,514.02 | 0.80% |
| 5 | 19 中国银行二级 03 | 债券 | 9,774,339.38 | 0.76% |
| 6 | 19 民生银行永续债 | 债券 | 8,707,409.44 | 0.68% |
| 7 | 19 农发 07 | 债券 | 8,627,814.78 | 0.67% |
| 8 | 20 衡阳城投 PPN003 | 债券 | 8,433,740.95 | 0.65% |
| 9 | 17 进出 04 | 债券 | 8,314,838.79 | 0.65% |
| 10 | 21 国开 05 | 债券 | 7,836,439.23 | 0.61% |

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 |
|----|------|------|------|------------|-------------|------|
| - | - | - | - | - | - | - |

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 | 012101232.IB | 21 津城建 SCP011 | 194,570.96 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100209.IB | 21 珠海港 PPN001 | 895,356.19 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100305.IB | 21 滨江城建 PPN001 | 1,897,519.80 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100325.IB | 21 嘉善经开 MTN001 | 283,752.17 |
| 华夏银行股份有限公司 | 2120015.IB | 21 青岛银行二级 | 4,964,762.07 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012101712.IB | 21 云南世博 SCP001 | 4,119,155.01 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103425.IB | 21 云南世博 SCP002 | 648,475.47 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100868.IB | 21 吴兴城投 PPN002 | 198,143.31 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103760.IB | 21 京电子城 SCP004 | 582,835.59 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103847.IB | 21 云能投 SCP012 | 397,827.69 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032191340.IB | 21 东龙控股 PPN002 | 432,240.90 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032191368.IB | 21 青岛财富 PPN001 | 136,600.00 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102102094.IB | 21 嘉善经开 MTN002 | 329,284.02 |

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 | 10257000000841632 |

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。