

# 华夏理财龙盈固定收益类专属5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专属5号三个月定开理财产品 |
| 理财产品代码  | 208212400501             |
| 产品登记编码  | Z7003921000426           |
| 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    | 114.29%                  |
| 产品起始日期  | 2020-08-20               |
| 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<br>(元) | 份额总数(份)          | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)          | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2021-12-31 | 1.0583      | 669,087,681.43   | 1.0583      | 708,096,176.51   | 4.16%         |
| 2020-12-31 | 1.0160      | 3,003,822,157.24 | 1.0160      | 3,051,866,295.56 |               |

## 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       | 1.32%     | 1.32%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 6.11%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 4.55%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 87.46%    |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 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%     | 0.57%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 98.68%    | 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<br>(元)   | 占总资产<br>的比例 |
|----|-------------------|-----------------|---------------|-------------|
| 1  | R007              | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 20,242,847.04 | 2.50%       |
| 2  | R001              | 拆放同业及债券<br>买入返售 | 15,036,571.08 | 1.86%       |
| 3  | 现金及活期存款           | 现金及银行存款         | 10,644,203.96 | 1.32%       |
| 4  | 21 中国银行 CD020     | 同业存单            | 8,343,977.16  | 1.03%       |
| 5  | 20 中交投资 ABN001 优先 | 债券              | 7,845,824.43  | 0.97%       |
| 6  | 19 进出 03          | 债券              | 7,754,459.10  | 0.96%       |
| 7  | 21 国开 01          | 债券              | 6,862,313.51  | 0.85%       |
| 8  | 21 浦发银行 CD106     | 同业存单            | 6,678,044.52  | 0.83%       |
| 9  | 20 易睿平安 ABN001 优先 | 债券              | 5,703,447.86  | 0.70%       |
| 10 | 21 华发 01          | 债券              | 5,265,244.98  | 0.65%       |

### 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 | 012100303.IB | 21 邯郸城投 SCP001 | 1,890,815.88 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012101232.IB | 21 津城建 SCP011  | 562,845.04   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100043.IB | 21 富阳开发 PPN001 | 445,523.86   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100209.IB | 21 珠海港 PPN001  | 704,822.55   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100305.IB | 21 滨江城建 PPN001 | 1,547,517.41 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100388.IB | 21 济宁城投 PPN002 | 413,019.52   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100325.IB | 21 嘉善经开 MTN001 | 459,442.95   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100350.IB | 21 盐城城资 MTN001 | 785,067.06   |
| 华夏银行股份有限公司 | 2120015.IB   | 21 青岛银行二级      | 6,363,040.36 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012101859.IB | 21 津城建 SCP017  | 140,766.29   |
| 华夏银行股份有限公司 | 012101861.IB | 21 晋能煤业 SCP003 | 140,766.29   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100425.IB | 21 华远陆港 PPN002 | 512,258.54   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100527.IB | 21 诚通建投 PPN001 | 226,270.27   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100554.IB | 21 漕湖产业 PPN001 | 226,270.27   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100633.IB | 21 襄阳高新 PPN002 | 945,942.54   |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100710.IB | 21 珠海港 PPN003  | 647,343.42   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100759.IB | 21 洋浦开发 MTN001 | 308,427.05   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100889.IB | 21 空港兴城 MTN001 | 379,738.12   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101024.IB | 21 中山城建 MTN001 | 105,836.15   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101026.IB | 21 六安城投 MTN002 | 186,946.12   |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101130.IB | 21 绵阳交通 MTN001 | 1,849,079.25 |
| 华夏银行股份有限公司 | 2120015.IB   | 21 青岛银行二级      | 2,438,017.16 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103425.IB | 21 云南世博 SCP002 | 839,320.48   |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103760.IB | 21 京电子城 SCP004 | 1,230,416.49 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103847.IB | 21 云能投 SCP012  | 420,090.76   |

|            |              |                |              |
|------------|--------------|----------------|--------------|
| 华夏银行股份有限公司 | 032191340.IB | 21 东龙控股 PPN002 | 1,023,092.58 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102102094.IB | 21 嘉善经开 MTN002 | 695,147.13   |

### 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）        |
|------------|----------|-----------------------------|------|----------------|
| 英大基金管理有限公司 | ydhywj02 | 英大基金-华英稳健<br>2号集合资产管理计<br>划 | 买入   | 150,000,000.00 |



#### 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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，做好流动性管理。

### 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

截止本报告日，产品投资的债券资产外部评级未出现下调，展望稳定，债券价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，本产品无股票持仓。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

截止本报告日，本产品无衍生品持仓。

## 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号              |
|----|------|-------------------|
| 1  | 托管账户 | 10257000000843005 |

## 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。