

# 华夏理财龙盈固定收益类半年定期开放式 净值型理财产品(003 号)

## 2021 年第 4 季度报告

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、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 10 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半年定期开放式净值型理财产品(003号)
理财产品代码	1810621000204
产品登记编码	Z7003921000579
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(稳健型)
杠杆水平	104.29%
产品起始日期	2018-11-15
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	1.1563	1,046,449,622.52	1.1563	1,210,010,534.62	0.73%
2021-09-30	1.1479	1,281,847,875.87	1.1479	1,471,389,257.69	

## 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	2.86%	2.83%
2	同业存单	0.00%	1.19%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	3.97%
4	债券	26.24%	56.10%
5	非标准化债权类资产	37.23%	35.72%
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%	0.18%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	33.67%	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	民生金融租赁同业借款 169 天	非标准化债权类 资产	450,767,500.00	35.72%
2	19 涪陵交通 PPN001	债券	106,710,400.53	8.46%
3	19 天易 PPN001	债券	105,957,828.77	8.40%
4	19 新海连 PPN002	债券	105,833,441.68	8.39%
5	现金及活期存款	现金及银行存款	35,738,826.76	2.83%
6	R007	拆放同业及债券 买入返售	32,579,831.81	2.58%
7	R001	拆放同业及债券 买入返售	16,862,200.27	1.34%
8	19 农发 03	债券	6,772,336.14	0.54%
9	19 农发 07	债券	5,433,396.13	0.43%
10	21 国开 11	债券	4,231,311.46	0.34%

### 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	民生金融租赁股份有限公司 同业借款 169 天	同业借款	4.60%	133 天	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）
-	-	-	-

#### 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	012103760.IB	21 京电子城 SCP004	1,464,446.67
华夏银行股份有限公司	012103847.IB	21 云能投 SCP012	499,993.71
华夏银行股份有限公司	032191340.IB	21 东龙控股 PPN002	340,864.47
华夏银行股份有限公司	102102094.IB	21 嘉善经开 MTN002	827,366.93

#### 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

截至本报告日，产品投资的债券资产总体资质较优，但持仓中部分资产受市场原因评级展望有所调整。产品持仓 PR01 优（169741.SH）发行人上海世茂股份有限公司 2021 年评级展望被联合资信评估股份有限公司调整为“负面”。

#### 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	10257000000788870

## 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。