

# 华夏理财龙盈固定收益类纯债型理财产品 2 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纯债型理财产品 2 号
理财产品代码	1912121000102
产品登记编码	Z7003921000511
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	106.25%
产品起始日期	2019-03-27
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	1.1350	2,139,806,599.15	1.1350	2,428,633,931.18	1.30%
2021-09-30	1.1204	1,826,178,404.14	1.1204	2,046,119,881.27	

## 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	67.33%	63.80%
2	同业存单	0.00%	1.93%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.89%	33.76%
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%	0.52%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	31.78%	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	现金及活期存款	现金及银行存款	1,646,156,693.02	63.80%
2	18 济宁城投 MTN001	债券	21,645,472.33	0.84%
3	20 晋电 02	债券	12,350,731.71	0.48%
4	19 兴港 02	债券	11,705,753.26	0.45%
5	21 中国银行 CD020	同业存单	7,315,574.11	0.28%
6	20 承控 01	债券	7,309,069.79	0.28%
7	20 中交投资 ABN001 优先	债券	6,878,819.17	0.27%
8	19 进出 03	债券	6,798,714.70	0.26%
9	G19 绿洲 1	债券	6,604,760.72	0.26%
10	17 进出 04	债券	6,055,374.82	0.23%

### 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	012103760.IB	21 京电子城 SCP004	1,267,788.92
华夏银行股份有限公司	012103847.IB	21 云能投 SCP012	432,850.51
华夏银行股份有限公司	032191340.IB	21 东龙控股 PPN002	2,842,585.59
华夏银行股份有限公司	102102094.IB	21 嘉善经开 MTN002	716,261.40

#### 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	10257000000798072

## 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。