

华夏理财龙盈固收 G 款 11 号三个月定开纯 债型理财产品

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 | 华夏理财龙盈固收 G 款 11 号三个月定开纯债型理财产品 |
| 理财产品代码 | 1912121000303 |
| 产品登记编码 | Z7003921000405 |
| 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 | 119.89% |
| 产品起始日期 | 2019-08-08 |
| 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 | 1.1065 | 713,424,702.01 | 1.1065 | 789,398,599.27 | 3.75% |
| 2020-12-31 | 1.0665 | 912,854,110.58 | 1.0665 | 973,575,805.34 | |

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 | 0.50% | 0.57% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 4.49% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 2.59% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 91.47% |
| 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% | 0.89% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 99.50% | 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 | R007 | 拆放同业及债券 买入返售 | 13,460,854.86 | 1.42% |
| 2 | 17 进出 04 | 债券 | 11,667,516.48 | 1.23% |
| 3 | 19 兴港 02 | 债券 | 10,000,320.04 | 1.06% |
| 4 | R001 | 拆放同业及债券 买入返售 | 9,998,845.54 | 1.06% |
| 5 | 20 南京银行二级 01 | 债券 | 9,429,517.24 | 1.00% |
| 6 | 19 威中城 | 债券 | 8,396,333.76 | 0.89% |
| 7 | 21 华租 03 | 债券 | 8,224,399.09 | 0.87% |
| 8 | 21 付息国债 09 | 债券 | 8,148,887.61 | 0.86% |
| 9 | 19 即墨 01 | 债券 | 7,813,605.83 | 0.83% |
| 10 | 20 桂金 01 | 债券 | 7,467,617.86 | 0.79% |

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 | 1,904,831.61 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012101232.IB | 21 津城建 SCP011 | 582,008.70 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100305.IB | 21 滨江城建 PPN001 | 1,577,748.28 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100388.IB | 21 济宁城投 PPN002 | 344,423.50 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100325.IB | 21 嘉善经开 MTN001 | 426,091.51 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100350.IB | 21 盐城城资 MTN001 | 654,679.82 |
| 华夏银行股份有限公司 | 2120015.IB | 21 青岛银行二级 | 6,057,812.12 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012101394.IB | 21 铜陵建投 SCP002 | 733,322.31 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100425.IB | 21 华远陆港 PPN002 | 483,820.61 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100633.IB | 21 襄阳高新 PPN002 | 1,198,696.68 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100710.IB | 21 珠海港 PPN003 | 820,312.41 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100555.IB | 21 日照城投 MTN001 | 271,424.13 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100752.IB | 21 芜湖宜居 MTN002 | 788,735.39 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100759.IB | 21 洋浦开发 MTN001 | 314,452.20 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100846.IB | 21 振业集团 MTN001 | 471,519.37 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100889.IB | 21 空港兴城 MTN001 | 387,156.33 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101026.IB | 21 六安城投 MTN002 | 212,705.45 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102101130.IB | 21 绵阳交通 MTN001 | 2,103,864.15 |
| 华夏银行股份有限公司 | 2120015.IB | 21 青岛银行二级 | 3,089,450.94 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103425.IB | 21 云南世博 SCP002 | 840,324.95 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100868.IB | 21 吴兴城投 PPN002 | 256,450.53 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103760.IB | 21 京电子城 SCP004 | 1,231,889.02 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012103847.IB | 21 云能投 SCP012 | 420,593.51 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032191340.IB | 21 东龙控股 PPN002 | 512,246.42 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102102094.IB | 21 嘉善经开 MTN002 | 695,979.07 |

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 | ydhywj01 | 英大基金-华英稳健1号集合资产管理计划 | 买入 | 650,000,000.00 |
| 英大基金管理有限公司 | ydhywj02 | 英大基金-华英稳健2号集合资产管理计划 | 买入 | 100,000,000.00 |

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 | 10257000000806039 |

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。