

龙盈固定收益类 G 款 55 号三个月定开理财产品

2021 年第 1 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、华夏银行股份有限公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏银行股份有限公司

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 3 月 31 日

第一章 基本信息

| | |
|---------|---------------------------|
| 产品名称 | 龙盈固定收益类 G 款 55 号三个月定开理财产品 |
| 理财产品代码 | 208212100324 |
| 产品登记编码 | C1030420002261 |
| 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(稳健型) |
| 杠杆水平上限 | 140% |
| 产品起始日期 | 2020-05-21 |
| 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 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2021-03-31 | 1.0333 | 1,071,192,622.32 | 1.0333 | 1,106,895,033.13 | 0.90% |
| 2020-12-31 | 1.0241 | 1,455,791,060.19 | 1.0241 | 1,490,912,163.29 | |

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 | 3.31% | 4.50% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 9.65% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.00% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 82.93% |
| 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 | 3.37% | 2.92% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 93.32% | 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 | 现金及银行存款 | 现金及银行存款 | 57,537,465.79 | 4.50% |
| 2 | 国投瑞银优化增强 AB | 公募基金 | 37,338,201.80 | 2.92% |
| 3 | 19 民生银行永续债 | 债券 | 21,030,561.45 | 1.64% |
| 4 | 17 进出 04 | 债券 | 16,021,200.63 | 1.25% |
| 5 | 20 浦发银行永续债 | 债券 | 14,328,273.82 | 1.12% |
| 6 | 21 国开 01 | 债券 | 14,043,766.16 | 1.10% |
| 7 | 19 广发银行永续债 | 债券 | 13,559,334.97 | 1.06% |
| 8 | 16 漯河 02 | 债券 | 11,476,893.57 | 0.90% |
| 9 | 16 吉安城建 PPN001 | 债券 | 10,080,019.59 | 0.79% |
| 10 | 19 威中城 | 债券 | 9,856,087.10 | 0.77% |

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 | 948,758.80 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012100328.IB | 21 津城建 SCP005 | 417,178.94 |
| 华夏银行股份有限公司 | 012101232.IB | 21 津城建 SCP011 | 1,132,647.31 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100209.IB | 21 珠海港 PPN001 | 204,229.17 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100305.IB | 21 滨江城建 PPN001 | 1,576,489.10 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100388.IB | 21 济宁城投 PPN002 | 121,721.97 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100325.IB | 21 嘉善经开 MTN001 | 302,948.88 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100350.IB | 21 盐城城资 MTN001 | 231,368.99 |
| 华夏银行股份有限公司 | 2120015.IB | 21 青岛银行二级 | 4,806,778.57 |

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 | 10257000000837772 |

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。