

龙盈固定收益类纯债型理财产品 1 号

2021 年半年度报告

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、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 6 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	龙盈固定收益类纯债型理财产品 1 号
理财产品代码	1912121000101
产品登记编码	C1030419002057
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	106.11%
产品起始日期	2019-03-06
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
2021-06-30	1.0994	3,180,264,082.93	1.0994	3,496,246,533.33	1.79%
2020-12-31	1.0801	1,094,095,290.91	1.0801	1,181,713,292.28	

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	0.96%	1.04%
2	同业存单	1.33%	1.43%
3	拆放同业及债券买入返售	3.52%	3.50%
4	债券	22.92%	94.03%
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%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	71.27%	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	19 鲁能源 MTN001	债券	285,981,947.95	7.71%
2	21 皋发 D1	债券	203,814,566.44	5.49%
3	21 襄阳 01	债券	202,571,841.47	5.46%
4	21 凤雏大桥 ABN001 优先	债券	169,779,244.50	4.58%
5	20 晋建优	债券	151,914,086.76	4.09%
6	1 日回购	拆放同业及债券 买入返售	130,011,397.26	3.50%
7	19 武经 03	债券	123,115,250.59	3.32%
8	21 常德经建 SCP001	债券	112,006,047.40	3.02%
9	21 西海发展 PPN001	债券	101,235,893.93	2.73%
10	21 飞驰鸢都 ABN001 优先	债券	101,141,538.89	2.73%

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	012100328.IB	21 津城建 SCP005	295,632.13
华夏银行股份有限公司	012101232.IB	21 津城建 SCP011	280,914.71
华夏银行股份有限公司	012101859.IB	21 津城建 SCP017	180,701.82
华夏银行股份有限公司	012101861.IB	21 晋能煤业 SCP003	180,701.82
华夏银行股份有限公司	012102045.IB	21 椒江社发 SCP001	10,059,003.60
华夏银行股份有限公司	012102073.IB	21 桂铁投 SCP004	1,676,500.60
华夏银行股份有限公司	012102171.IB	21 栖霞建设 SCP003	9,391,658.53
华夏银行股份有限公司	032100043.IB	21 富阳开发 PPN001	70,000,000.00
华夏银行股份有限公司	032100209.IB	21 珠海港 PPN001	144,726.16
华夏银行股份有限公司	032100305.IB	21 滨江城建 PPN001	946,554.46
华夏银行股份有限公司	032100388.IB	21 济宁城投 PPN002	86,257.77
华夏银行股份有限公司	032100425.IB	21 华远陆港 PPN002	229,898.51
华夏银行股份有限公司	032100527.IB	21 诚通建投 PPN001	138,400.47
华夏银行股份有限公司	032100554.IB	21 漕湖产业 PPN001	138,400.47
华夏银行股份有限公司	032100639.IB	21 缙云资产 PPN001	891,248.08
华夏银行股份有限公司	032100704.IB	21 济宁城投 PPN004	9,100.65
华夏银行股份有限公司	032100710.IB	21 珠海港 PPN003	30,335.50
华夏银行股份有限公司	102100325.IB	21 嘉善经开 MTN001	189,169.52
华夏银行股份有限公司	102100350.IB	21 盐城城资 MTN001	163,958.68
华夏银行股份有限公司	102100759.IB	21 洋浦开发 MTN001	188,652.48
华夏银行股份有限公司	102100889.IB	21 空港兴城 MTN001	232,270.61
华夏银行股份有限公司	102101024.IB	21 中山城建 MTN001	22,028.69
华夏银行股份有限公司	2120015.IB	21 青岛银行二级	4,762,843.24
华夏银行股份有限公司	4012100594.IB	21 常德经建 SCP001	111,000,000.00

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

今年以来利率债的供给一直低于预期，因此今年市场流动性宽裕，因此二季度债券市场收益率出现一波较为明显的下行，尤其是信用债，当前的信用利差进一步压缩，整体来说二季度债券市场有一波较为明显的上涨。展望下半年的市场，利率债供给预计将较上半年有明显的增加，对市场流动性有较为明显的收缩，叠加目前信用利差水平非常低，我们对下半年的市场相对谨慎，如果利率进一步下行，我们将适当降低组合的久期；另外，权益市场方面，我们预计整体市场出现大幅上涨的概率不大，但是预期上市公司整体半年报都有较好的表现，部分景气度高并且有较好持续性的行业活跃度将会比较高，有较好的表现，因此展望上半年，我们认为结构性行情将继续演绎，关注新能源、半导体、化工等高景气度行业。

5.1 投资组合流动性风险分析

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出、基金赎回等方式优化组合的流动性管理。

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。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

无。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000772542

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相关法律法规的规定和合同的约定、损害投资者利益的行为。