

龙盈固定收益类 G 款 2 号 711 天封闭式理财 产品 2020 年四季度运行报告

一、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。			
3、本报告期自 2020 年 10 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。			
二、理财产品概况			
产品名称	龙盈固定收益类 G 款 2 号 711 天封闭式理财产品		
产品代码	1912151000102		
理财信息系统登记编码	C1030419005135		
产品运作模式	封闭式		
产品投资类型	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	200%		
产品成立日	2019 年 06 月 24 日		
产品到期日	2021 年 06 月 04 日		
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		
三、报告期最后一个市场交易日净值表现			
单位净值	1.0823	累计单位净值	1.0823
资产净值	541,167,275.35 元	产品份额	500,000,000.00 份
四、报告期理财产品收益表现			
起始日净值 (2020 年 09 月 30 日)	结束日净值 (2020 年 12 月 31 日)	报告期实现收益率(年化)	
1.0708	1.0823	4.26%	
五、理财产品投资组合情况			
序号	资产种类	直接投资资产占比 (%)	间接投资资产占比 (%)
1	货币市场类	1.91%	0.72%
2	债券市场类	33.17%	64.20%
3	非标债权类	-	-
4	权益类	-	-
5	其它类	-	-
合计		100.00	
注：由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。			
六、理财产品前十项资产投资情况			
序号	资产名称	规模(元)	占比 (%)
1	华夏资本-龙盈固收 G 款 2 号单一资产管理	278,866,800.00	51.29%

	计划		
2	诺德农行量化对冲1号	70,187,269.38	12.91%
3	16冀交投MTN001	51,486,534.07	9.47%
4	16津保投MTN001	51,470,083.16	9.47%
5	16衡阳城投MTN001	51,464,876.28	9.47%
6	16六安城投MTN002	25,930,706.94	4.77%
7	银行存款	10,399,864.43	1.91%
8	北信瑞丰宜投宝A	3,900,647.06	0.72%
9			
10			

七、投资组合的流动性风险及投资风险分析

随着二季度和三季度连续两个季度的下跌，债券市场经历了较为充分的调整。11月份永煤事件之后，银行存单利率持续大幅上行，央行超市场预期的投放流动性稳定市场，使得利率在永煤事件之后到达了短期的高点，债券市场迎来了一波反弹。展望明年一季度，社融数据已经见顶并会持续回落，经济数据处于一、二月份的真空期，经济基本面对市场的利空因素逐渐钝化，叠加春节前后市场流动性预计会持续宽松的态势，明年一季度债券市场的反弹料将延续，我们会择机进行积极的操作。同时，权益市场在一季度也处于偏利好的时间窗口，顺周期类行业的转债可能有投资机会，另外还需要关注军工、汽车及半导体等版块。

（一）产品的流动性风险情况

本产品为封闭期产品，在投资上采用持有到期策略，流动性风险可控。

（二）产品的投资风险情况

1.产品债券持仓风险及价格波动情况

本产品为封闭期产品，债券持有至到期为主。持仓风险及价格变动风险可控。

2.产品股票持仓风险及价格波动情况

无股票持仓。

3.产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无衍生品持仓。

八、报告期内投资关联方发行的证券的情况

无。

九、报告期内投资关联方承销的证券的情况

无。

十、报告期内其他重大关联交易

无。

十一、报告期末非标准化债权类资产投资情况

无。

十二、报告期末信贷资产受（收）益权投资情况

无。

十三、利润分配情况

本报告期末进行利润分配。

十四、影响投资者决策的其他重要信息

无。