

龙盈固定收益类专属 11 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	龙盈固定收益类专属 11 号三个月定开理财产品
理财产品代码	208212401101
产品登记编码	C1030420003042
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	2020-10-15
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	1.0167	1,465,352,683.24	1.0167	1,489,826,668.71	0.59%
2020-12-31	1.0107	2,537,840,000.00	1.0107	2,564,959,316.12	

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	6.46%	8.85%
2	同业存单	6.29%	9.82%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.03%
4	债券	3.91%	74.08%
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	3.18%	7.22%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	80.17%	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	147,017,088.20	8.85%
2	20 徽商银行 CD146	同业存单	97,952,121.37	5.90%
3	16 环太湖 MTN001	债券	30,667,676.30	1.85%
4	21 长兴建投 SCP001	债券	30,249,686.30	1.82%
5	天弘永利债券 B	公募基金	29,374,551.82	1.77%
6	16 吉安城建 PPN001	债券	25,645,707.78	1.54%
7	国投瑞银优化增强 AB	公募基金	20,165,658.34	1.21%
8	19 吉林高速 MTN002	债券	13,711,092.32	0.83%
9	20 富阳 01	债券	12,027,901.22	0.72%
10	19 民生银行永续债	债券	11,389,699.84	0.69%

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	031663015	16 吉安城建 PPN001	25,645,707.78
华夏银行股份有限公司	012100328.IB	21 津城建 SCP005	3,240,740.51
华夏银行股份有限公司	012101232.IB	21 津城建 SCP011	180,353.92
华夏银行股份有限公司	032100209.IB	21 珠海港 PPN001	1,815,208.76
华夏银行股份有限公司	032100305.IB	21 滨江城建 PPN001	342,366.89
华夏银行股份有限公司	032100388.IB	21 济宁城投 PPN002	152,192.50
华夏银行股份有限公司	102100325.IB	21 嘉善经开 MTN001	611,329.85
华夏银行股份有限公司	102100350.IB	21 盐城城资 MTN001	1,928,441.94
华夏银行股份有限公司	2120015.IB	21 青岛银行二级	1,748,480.34

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

本产品以债券等固收类资产为主要投资标的，追求稳健回报，同时适度配置其他固收增强类资产，为组合谋求超额收益。本产品固收部分主要投向资管计划以及债券，同时根据市场行情变化，动态调整相关资产的比例，平衡产品投资收益以及流动性。穿透资管计划，本产品投资的资管计划底层债券资产以 AA 以上评级债券为主，品种上以城投债以及国有企业债券为主。本产品系定期开放产品，将根据开放期市场情况以及申赎特点，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，评级展望稳定，债券价格波动处于合理的市场波动区间。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

截止本报告日，产品投资的权益类资产受市场波动影响，出现一定回调，产品严格按照产品说明书约定，灵活进行了仓位调整，产品净值波动低。

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	1025700000844305

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。