

# 龙盈固定收益类专属 12 号半年定开理财产品

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 12 号半年定开理财产品 |
| 理财产品代码  | 208212401201           |
| 产品登记编码  | C1030420003043         |
| 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  | 2020-10-22             |
| 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<br>(元) | 份额总数(份)          | 累计净值<br>(元) | 资产净值(元)          | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|------------------|-------------|------------------|---------------|
| 2021-03-31 | 1.0169      | 2,473,950,000.00 | 1.0169      | 2,515,792,942.38 | 1.03%         |
| 2020-12-31 | 1.0065      | 2,473,950,000.00 | 1.0065      | 2,490,059,337.70 |               |

## 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       | 2.28%     | 3.87%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 12.33%    |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.01%     |
| 4  | 债券            | 0.63%     | 81.67%    |
| 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          | 1.16%     | 2.12%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 95.93%    | 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<br>(元)    | 占总资产<br>的比例 |
|----|----------------|---------|----------------|-------------|
| 1  | 现金及银行存款        | 现金及银行存款 | 113,293,349.15 | 3.87%       |
| 2  | 19 民生银行永续债     | 债券      | 94,444,570.63  | 3.23%       |
| 3  | 19 广发银行永续债     | 债券      | 40,083,225.79  | 1.37%       |
| 4  | 诺安优化收益         | 公募基金    | 29,260,780.28  | 1.00%       |
| 5  | 20 浦发银行永续债     | 债券      | 29,096,891.45  | 0.99%       |
| 6  | 21 国开 01       | 债券      | 27,619,083.01  | 0.94%       |
| 7  | 15 农发 04       | 债券      | 17,726,977.87  | 0.61%       |
| 8  | 15 长沙经开 PPN001 | 债券      | 17,048,677.37  | 0.58%       |
| 9  | 19 平安银行二级      | 债券      | 16,660,607.74  | 0.57%       |
| 10 | 17 江北国资 MTN002 | 债券      | 15,893,601.16  | 0.54%       |

### 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<br>(%) | 剩余期限<br>(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 | 946,987.34    |
| 华夏银行股份有限公司 | 012100328.IB | 21 津城建 SCP005  | 4,174,864.32  |
| 华夏银行股份有限公司 | 012101232.IB | 21 津城建 SCP011  | 1,206,696.17  |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100043.IB | 21 富阳开发 PPN001 | 638,590.81    |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100209.IB | 21 珠海港 PPN001  | 3,314,457.45  |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100305.IB | 21 滨江城建 PPN001 | 3,728,185.22  |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100388.IB | 21 济宁城投 PPN002 | 1,200,849.55  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100325.IB | 21 嘉善经开 MTN001 | 1,315,721.85  |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100350.IB | 21 盐城城资 MTN001 | 2,610,404.46  |
| 华夏银行股份有限公司 | 2120015.IB   | 21 青岛银行二级      | 15,104,418.27 |

#### 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 | 1025700000844316 |

## 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。