

龙盈固定收益类中证 500 结构性理财产品 1 号

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	龙盈固定收益类中证 500 结构性理财产品 1 号
理财产品代码	201215410001
产品登记编码	C1030420003418
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式
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	200%
产品起始日期	2020-11-20
产品终止日期	2021-05-24

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	1.0128	365,119,000.00	1.0128	369,778,433.65	0.92%
2020-12-31	1.0036	365,119,000.00	1.0036	366,448,013.37	

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	0.01%	1.46%
2	同业存单	0.00%	20.22%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	0.00%	77.24%
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	0.62%	0.55%
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%	0.54%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	99.37%	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	15 农发 04	债券	7,012,704.61	1.65%
2	现金及银行存款	现金及银行存款	6,185,264.71	1.46%
3	20 光大银行 CD190	同业存单	5,006,650.46	1.18%
4	20 平安银行 CD202	同业存单	5,006,650.46	1.18%
5	20 晋电 02	债券	4,236,175.69	1.00%
6	21 平安银行 CD093	同业存单	4,095,173.16	0.96%
7	21 江苏银行 CD038	同业存单	3,932,496.60	0.93%
8	21 交通银行 CD062	同业存单	3,853,454.32	0.91%
9	20 土地 01	债券	3,414,767.81	0.80%
10	21 光大银行 CD060	同业存单	3,276,709.90	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	012101232.IB	21 津城建 SCP011	172,912.45

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

产品对各类资产风险收益特征进行比较的基础上,合理配置货币类、债券类资产,通过额度控制、事前预测及高流动性资产控制流动性风险。当前组合高流动性资产占比达 10%以上,可应对较大程度的流动性冲击。

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

本产品持有债券未出现信用评级下调及违约等信用风险事件,成立以来债券收益率震荡上行,但整体波动率仍处在合理区间范围内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

无。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

本产品衍生品投资通过收益互换方式持有,并不动用产品本金,衍生品价格波动对组合净值波动率的影响保持在可控范围内。

第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10257000000852203

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。