

龙盈天天理财 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	龙盈天天理财 1 号
理财产品代码	1910621000601
产品登记编码	C1030419001278
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	PR1 级(谨慎型)
杠杆水平上限	140%
产品起始日期	2019-01-30
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	1.0827	60,791,551,252.72	1.0827	65,817,217,541.56	0.86%
2020-12-31	1.0735	54,663,028,865.23	1.0735	58,679,634,900.91	

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	0.23%	0.76%
2	同业存单	11.00%	11.74%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.00%
4	债券	36.07%	87.50%
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	52.70%	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	17 民生银行二级 01	债券	1,561,483,871.06	1.77%
2	15 长沙经开 PPN001	债券	988,188,636.50	1.12%
3	17 中国银行二级 02	债券	929,829,560.44	1.06%
4	17 民生银行二级 02	债券	825,001,323.05	0.94%
5	16 北京农商二级	债券	809,483,633.61	0.92%
6	16 陕高速 PPN002	债券	806,473,154.77	0.92%
7	17 东莞农商二级	债券	736,288,855.16	0.84%
8	现金及银行存款	现金及银行存款	669,028,625.08	0.76%
9	19 信投 03	债券	634,651,003.26	0.72%
10	19 陕煤化 MTN001	债券	623,704,358.98	0.71%

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	012100316.IB	21 云能投 SCP001	100,000,000.00
华夏银行股份有限公司	012100688.IB	21 京电子城 SCP001	40,000,000.00
华夏银行股份有限公司	012100710.IB	21 中国医疗 SCP001	380,000,000.00
华夏银行股份有限公司	012101232.IB	21 津城建 SCP011	20,000,000.00

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

本产品为现金管理类理财产品，在保证安全性、流动性的前提下，力争产品收益的稳定增长。

2021年1季度，货币政策保持连续性、稳定性、可持续性，总体以稳健中性为主，尽管1月末曾出现“压力测试”情形，但后续央行在公开市场进行稳定操作，持续释放平稳预期，资金价格总体平稳，维持了较好的货币与流动性环境。

5.1 投资组合流动性风险分析

在产品的日常管理中，持有一定现金及银行存款，1年以内国债、政策性金融债资产以满足流动性监管要求（净资产5%），另一方面，产品资产端配置的债券以银行存单、中高等级信用债为主，具有较好的可质押性、流动性特征，可通过杠杆融资等方式以满足产品赎回资金的需要（本报告期末，可质押资产占比进一步提升，超过85%）。此外，在月末、季末等关键时点，产品将预留出一定的杠杆空间以确保产品无流动性风险。

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

本产品所持有的债券以中高等级为主，其中，AA+（含）以上级别债券占比达到90%以上，其中，AAA级债券占比超70%，而AA级债券延续以短期限为主，持仓债券总体资质较优。在债券配置过程中，严格按照我司内部集中度及限额管理相关要求，单只债券占比较低，起到风险分散作用。

本产品采用的是“摊余成本法”估值方式，即相较于“市价法”估值的产品而言，每日净值增长不受债券价格波动的直接影响。

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	10257000000792343

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。