

龙盈 3 号开放式净值型理财产品

2021 年第 2 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 04 月 01 日至 2021 年 6 月 30 日

第一章 基本信息

产品名称	龙盈3号开放式净值型理财产品
理财产品代码	1610621000101
产品登记编码	C1030416002501
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(稳健型)
杠杆水平	122.87%
产品起始日期	2016-11-16
产品终止日期	2029-12-31

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
2021-06-30	1.2448	2,173,125,060.64	1.2448	2,705,039,172.48	0.98%
2021-03-31	1.2327	1,772,546,301.72	1.2327	2,184,975,638.22	

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	0.35%	0.36%
2	同业存单	21.43%	21.43%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.05%
4	债券	52.49%	78.16%
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	25.73%	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	19 中国银行二级 01	债券	269,124,247.23	8.10%
2	20 民生银行 CD357	同业存单	199,333,391.23	6.00%
3	17 金坛交通债 01	债券	163,196,835.89	4.91%
4	16 浏阳城建债	债券	138,391,271.23	4.16%
5	19 国泰租赁 PPN001	债券	105,694,110.96	3.18%
6	21 长兴建投 SCP001	债券	101,947,647.95	3.07%
7	21 交通银行 CD062	同业存单	98,083,254.25	2.95%
8	21 中信银行 CD050	同业存单	98,057,789.59	2.95%
9	21 兴业银行 CD121	同业存单	98,014,757.81	2.95%
10	21 中国银行 CD020	同业存单	98,005,556.71	2.95%

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	012102045.IB	21 椒江社发 SCP001	10,187,012.14
华夏银行股份有限公司	012102073.IB	21 桂铁投 SCP004	1,697,835.36
华夏银行股份有限公司	012102171.IB	21 栖霞建设 SCP003	9,511,174.60

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

今年以来利率债的供给一直低于预期，因此今年市场流动性宽裕，因此二季度债券市场收益率出现一波较为明显的下行，尤其是信用债，当前的信用利差进一步压缩，整体来说二季度债券市场有一波较为明显的上涨。展望下半年的市场，利率债供给预计将较上半年有明显的增加，对市场流动性有较为明显的收缩，叠加目前信用利差水平非常低，我们对下半年的市场相对谨慎，如果利率进一步下行，我们将适当降低组合的久期；另外，权益市场方面，我们预计整体市场出现大幅上涨的概率不大，但是预期上市公司整体半年报都有较好的表现，部分景气度高并且有较好持续性的行业活跃度将会比较高，有较好的表现，因此展望上半年，我们认为结构性行情将继续演绎，关注新能源、半导体、化工等高景气度行业。

5.1 投资组合流动性风险分析

流动性风险控制方面，本产品在对各类资产风险收益特征进行比较的基础上，确定投资组合在各类别资产间的投资分配比例，并随着风险收益特征的相对变化及时调整；此外，本产品通过额度控制、事前预测、募集资金及变现高流动性资产的方式应对流动性风险。具体包括：一是跟踪资金申购赎回情况，提前备付流动资金；二是根据产品的期限，合理制定组合加权久期，预防流动性风险；三是择机通过债券正回购、债券卖出、基金赎回等方式优化组合的流动性管理。

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

截至本报告日，产品投资的债券资产外部评级未出现下调，展望稳定，债券价格波动处于市场合理区间范围

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	10257000000698884

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。