

龙盈固定收益类尊享 37 号封闭式理财产品

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 | 龙盈固定收益类尊享 37 号封闭式理财产品 |
| 理财产品代码 | 218215503702 |
| 产品登记编码 | C1030420A001350 |
| 产品募集方式 | 私募 |
| 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(稳健型) |
| 杠杆水平 | 114.32% |
| 产品起始日期 | 2021-01-20 |
| 产品终止日期 | 2021-12-22 |

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 | 1.0218 | 420,000,000.00 | 1.0218 | 429,162,557.54 | 1.42% |
| 2021-03-31 | 1.0075 | 420,000,000.00 | 1.0075 | 423,166,170.70 | |

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 | 2.09% | 2.49% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 9.91% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.54% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 84.98% |
| 5 | 非标准化债权类资产 | 0.00% | 0.00% |
| 6 | 权益类投资 | 0.00% | 1.94% |
| 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% | 0.15% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 97.91% | 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 | 12,194,874.05 | 2.49% |
| 2 | 19 民生银行永续债 | 债券 | 8,841,217.59 | 1.80% |
| 3 | 17 进出 04 | 债券 | 5,214,767.28 | 1.06% |
| 4 | 21 浦发银行 CD109 | 同业存单 | 4,117,529.81 | 0.84% |
| 5 | 21 光穗广开 ABN001 优先 | 债券 | 3,738,407.76 | 0.76% |
| 6 | 20 恒信 G1 | 债券 | 3,216,011.64 | 0.66% |
| 7 | 20 碧地 02 | 债券 | 2,667,604.51 | 0.54% |
| 8 | 20 远东五 | 债券 | 2,664,356.32 | 0.54% |
| 9 | 21 淮交 01 | 债券 | 2,648,930.59 | 0.54% |
| 10 | 19 铁十六 | 债券 | 2,440,387.73 | 0.50% |

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 | 012101394.IB | 21 铜陵建投 SCP002 | 819,515.03 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100425.IB | 21 华远陆港 PPPN002 | 86,537.10 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100555.IB | 21 日照城投 MTN001 | 303,326.59 |
| 华夏银行股份有限公司 | 102100752.IB | 21 日照城投 MTN001 | 881,441.21 |

| | | | | |
|--|----------------|--------------|--|------------|
| | 公司 | | 1 美 湖 宣 居 M T N 0 0 2 | |
| | 华夏银行股份有限 公司 | 102100846.IB | 2 1 振 业 集 团 M T N 0 0 1 | 526,940.49 |
| | 华夏银行股份有限 公司 | 102101024.IB | 2 1 中 山 城 建 M T N 0 0 1 | 44,070.43 |
| | 华夏银行股份有限 公司 | 102101026.IB | 2 1 | 82,911.74 |

| | | | | |
|--|----------------|--------------|---|------------|
| | | | 六安城投 M T N 0 0 2 | |
| | 华夏银行股份有限 公司 | 102101130.IB | 2 1 附 交 通 M T N 0 0 1 | 820,077.90 |

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，同时精选权益基金，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。本产品系封闭式产品，将根据产品到期时间，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 | 10257000000856525 |

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。