

龙盈固定收益类一年定期开放式净值型理财产品（003号）

2021年第3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07月01日至2021年9月30日

第一章 基本信息

| | |
|---------|-----------------------------|
| 产品名称 | 龙盈固定收益类一年定期开放式净值型理财产品（003号） |
| 理财产品代码 | 1810621000304 |
| 产品登记编码 | C1030418012855 |
| 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 | 105.38% |
| 产品起始日期 | 2018-10-18 |
| 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 |
|------------|-------------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 2021-09-30 | 1.1494 | 780,609,323.51 | 1.1494 | 897,198,807.04 | 1.10% |
| 2021-06-30 | 1.1369 | 782,962,689.22 | 1.1369 | 890,117,658.24 | |

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 | 0.52% | 0.89% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.81% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 3.61% |
| 4 | 债券 | 10.34% | 93.96% |
| 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% | 0.74% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 89.14% | 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 | 21 光大嘉宝 PPN001 | 债券 | 72,520,767.12 | 7.67% |
| 2 | 20 九江置地 PPN001 | 债券 | 20,339,726.03 | 2.15% |
| 3 | 21 国开 11 | 债券 | 16,487,518.50 | 1.74% |
| 4 | 20 赣版 01 | 债券 | 16,460,805.77 | 1.74% |
| 5 | R007 | 拆放同业及债券 买入返售 | 16,248,906.32 | 1.72% |
| 6 | 19 江东控股 MTN001 | 债券 | 13,402,943.51 | 1.42% |
| 7 | 19 农发 03 | 债券 | 12,853,583.07 | 1.36% |
| 8 | R008 | 拆放同业及债券 买入返售 | 11,396,469.05 | 1.21% |
| 9 | 19 农发 07 | 债券 | 10,829,669.12 | 1.15% |
| 10 | 19 北汽 06 | 债券 | 9,564,525.09 | 1.01% |

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 | 032100868.IB | 21 吴兴城投 PPN002 | 241,456.94 |

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

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内。

5.2.2 产品股票持仓风险及价格波动情况

无股票持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

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 | 10257000000786725 |

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。