

龙盈固定收益类专属3号三个月定开理财产品

品

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 | 龙盈固定收益类专属3号三个月定开理财产品 |
| 理财产品代码 | 208212400301 |
| 产品登记编码 | C1030420003022 |
| 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 | 117.18% |
| 产品起始日期 | 2020-08-06 |
| 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 | 1.0497 | 546,985,748.58 | 1.0497 | 574,188,066.01 | 1.00% |
| 2021-06-30 | 1.0393 | 964,459,629.70 | 1.0393 | 1,002,352,445.62 | |

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 | 1.88% | 1.72% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 5.30% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 0.00% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 92.58% |
| 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% | 0.40% |
| 12 | 私募基金 | 0.00% | 0.00% |
| 13 | 资产管理产品 | 98.12% | 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 | 11,582,984.31 | 1.72% |
| 2 | 20 交通银行二级 | 债券 | 6,737,532.11 | 1.00% |
| 3 | 19 中国银行二级 03 | 债券 | 5,811,490.37 | 0.86% |
| 4 | 21 中国银行 CD020 | 同业存单 | 4,772,314.11 | 0.71% |
| 5 | 20 中交投资 ABN001 优先 | 债券 | 4,599,252.47 | 0.68% |
| 6 | 21 广州银行二级 | 债券 | 4,522,758.55 | 0.67% |
| 7 | 21 国开 01 | 债券 | 4,488,398.29 | 0.67% |
| 8 | 19 进出 03 | 债券 | 4,437,695.83 | 0.66% |
| 9 | 17 进出 04 | 债券 | 4,318,971.14 | 0.64% |
| 10 | 19 启东 03 | 债券 | 4,295,408.72 | 0.64% |

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 | 012103425.IB | 21 云南世博 SCP002 | 520,616.53 |
| 华夏银行股份有限公司 | 032100868.IB | 21 吴兴城投 PPN002 | 111,194.32 |

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

本产品系固定收益类产品，即以债券等固定收益类资产为底仓，适度配置其它资产，提高投资组合收益。本产品主要投向资产管理计划，根据市场情况和资产管理计划表现，动态调整相关资产比例，平衡产品收益和流动性。穿透资管计划，本产品投资的资产管理计划底层债券资产，AA+以上评级债券占比较高，债券标的主要为城投类债券和国有企业债券。本产品系定期开放产品，根据开放期市场情况及产品申赎特点，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，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

截止本报告日，本产品无股票持仓。

5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

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 | 10257000000842658 |

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。