

龙盈固定收益类 TS 款 64 号理财产品

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 TS 款 64 号理财产品 |
| 理财产品代码 | 201645500160 |
| 产品登记编码 | C1030421A000009 |
| 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 | 100.04% |
| 产品起始日期 | 2021-02-09 |
| 产品终止日期 | 2022-02-09 |

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 | 1.0313 | 2,000,000,000.00 | 1.0313 | 2,062,590,394.64 | 1.42% |
| 2021-06-30 | 1.0169 | 2,000,000,000.00 | 1.0169 | 2,033,700,446.00 | |

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 | 0.26% | 0.30% |
| 2 | 同业存单 | 0.00% | 0.00% |
| 3 | 拆放同业及债券买入返售 | 0.00% | 1.61% |
| 4 | 债券 | 0.00% | 98.09% |
| 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 | 99.74% | 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 金水 02 | 债券 | 95,083,393.46 | 4.61% |
| 2 | 20 兴港 01 | 债券 | 92,402,763.02 | 4.48% |
| 3 | 19 青财 01 | 债券 | 63,136,894.58 | 3.06% |
| 4 | 19 高控 01 | 债券 | 62,664,255.80 | 3.04% |
| 5 | 20 市北 01 | 债券 | 58,266,368.64 | 2.82% |
| 6 | 20 鑫诚债 | 债券 | 54,696,672.32 | 2.65% |
| 7 | G20 长交 1 | 债券 | 53,181,833.01 | 2.58% |
| 8 | 19 绵阳投资 PPN001 | 债券 | 47,140,493.56 | 2.28% |
| 9 | 21 绍城 01 | 债券 | 44,140,049.48 | 2.14% |
| 10 | 19 昆交 03 | 债券 | 42,511,500.86 | 2.06% |

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） |
|-------|------|------|---------|
| - | - | - | - |

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

本产品为封闭式产品，报告期内无流动性风险事件发生，产品持仓非公开品种比例较高，但整体流动性风险水平可控。

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

本产品主要配置货币市场工具、利率债、同业存单和国企、央企城投债，信用风险水平相对较低，报告期内持仓信用债无信用风险事件发生。产品组合久期控制在 2 以内，价格波动水平较低，整体可控。

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 | 10257000000859128 |

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。