

龙盈 ESG 固定收益类 G 款 11 号 1045 天 封闭式理财产品 2020 年第一季度运行报告

1、重要信息提示			
无。			
2、理财产品概况			
产品名称	龙盈 ESG 固定收益类 G 款 11 号 1045 天封闭式理财产品		
产品登记编码	C1030419009951		
销售币种	人民币		
产品风险评级	PR2 级（稳健型）		
收益类型	非保本浮动收益、净值型		
产品成立日	2019 年 11 月 12 日		
产品到期日	2022 年 9 月 22 日，理财产品正常到期，如理财产品因故提前或延迟到期的，则到期日以华夏银行发布的公告为准。		
产品托管人	华夏银行		
报告期末理财产品份额	149,940,000 份		
3、报告期理财产品净值表现			
起始日净值 (2019 年 12 月 31 日)	结束日净值 (2020 年 3 月 31 日)	报告期实现收益率（年化）	
1.0051	1.0247	7.82%	
4、理财产品持仓情况			
序号	资产种类	资产占比 (%)	
1	货币市场类	直接	0.07
		间接	3.89
2	债券市场类	直接	-
		间接	96.04
合计		100.00	100.00
5、投资前十名资产具体情况			
序号	资产名称	规模（亿元）	占比 (%)
1	创金合信华晟 11 号 单一资产管理计划	1.54	99.93
2	银行存款	0.001	0.07
6、投资组合的流动性风险分析			
<p>2020 年一季度，我国债券市场继续稳步发展，为疫情防控和经济社会发展提供了有力支持。据初步统计，一季度债券市场共发行债券 12 万亿元，同比增长 14%；余额为 103 万亿元，较上年末增长 4%，市场规模位居全球第二。其中，公司信用类债券发行和净融资规模同比明显增加，民营企业债券融资情况进一步改善。2020 年一季度，公司信用类债券共发行 3 万亿元，同比增长 35%；净融资规模超 1.7 万亿元，同比多增 8000 多亿元；发行量与净融资规模均处于历史同期高位。与此同时，一季度民营企业发债约 2100 亿元，同比增长 50%；净融资规模约 930 亿元，创近三年来新高。</p> <p>资产配置上，本产品按照产品说明书约定的范围进行投资，并根据市场行情，调整</p>			

各类资产的占比。回顾 2020 年第一季度的产品管理工作，组合维持信用债的票息策略，跟随市场热点精选个券、积极操作，获得较好的投资回报，保障了产品净值的平稳增长。未来，本产品将按照产品说明书约定，进行有效资产配置。

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。

7、报告期内投资关联方发行的证券的情况

无。

8、报告期内投资关联方承销的证券的情况

无。