

# 龙盈 ESG 固定收益类 G 款 1 号 734 天封闭式理财产品 2019 年第四季度 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 1 号 734 天封闭式理财产品                         |               |               |
| 产品登记编码                     | C1030419005133  |               |               |
| 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 7 月 2 日  |               |               |
| 产品到期日                      | 2021 年 7 月 5 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                 | 750,100,000.00 份  |               |               |
| 3、报告期理财产品净值表现              |   |               |               |
| 起始日净值<br>(2019 年 9 月 30 日) | 结束日净值<br>(2019 年 12 月 31 日)                               | 报告期实现收益率（年化）  |               |
| 1.0079                     | 1.0221  | 5.59%         |               |
| 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            | 0.32          |
|                            |   | 间接            | 0.25          |
| 2                          | 债券市场类   | 直接            | -             |
|                            |   | 间接            | 99.43         |
| 合计                         |   | <b>100.00</b> | <b>100.00</b> |
| 5、投资前十项资产具体情况              |   |               |               |
| 序号                         | 资产名称  | 规模（亿元）        | 占比 (%)        |
| 1                          | 创金合信华晟 1 号单一资产管理计划  | 7.66          | 99.68         |
| 2                          | 银行存款  | 0.02          | 0.32          |
| 6、投资组合的流动性风险分析             |   |               |               |

四季度债券收益率先下后上，长端利率基本走平。10月猪价快速上涨引发通胀担忧，同时公布的9月经济和金融数据好于预期，债市出现调整；11月央行预期外下调MLF/OMO利率，同时PMI、社融和经济数据多数低于预期，叠加中美贸易谈判出现反复，收益率高位回落；12月跨年资金面保持宽松，同时定开型摊余成本法债基大规模发行，配置需求旺盛，虽然通胀、金融数据等基本面对债市偏不利，但债市长端收益率维持震荡，中短端收益率明显下行。

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，调整各类资产的占比。回顾三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。