

龙盈 ESG 固定收益类 G 款 2 号一年定开理财产品 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 2 号一年定开理财产品 | | | |
| 产品登记编码 | C1030419005136 | | | |
| 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 6 月 25 日 | | | |
| 产品到期日 | 无固定期限，本产品持续运作（实际产品期限受制于银行终止条款）。 | | | |
| 产品托管人 | 华夏银行 | | | |
| 报告期末理财产品份额 | 473,778,000.00 份 | | | |
| 3、报告期理财产品净值表现 | | | | |
| 起始日净值 (2020 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） | | |
| 1.0217 | 1.0358 | 5.54% | | |
| 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 | 0.44 | 1.93 |
| | | 间接 | 1.49 | |
| 2 | 债券市场类 | 直接 | - | 98.07 |
| | | 间接 | 98.07 | |
| 合计 | | | 100 | 100 |
| 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 2 号单一资产管理计划 | 4.98 | 99.56 | |
| 2 | 嘉实快线 A | 0.01 | 0.22 | |
| 3 | 银行存款 | 0.01 | 0.22 | |
| 6、投资组合的流动性风险分析 | | | | |

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。

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。