

龙盈 ESG 固定收益类 G 款 4 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 4 号一年定开理财产品 | | | |
| 产品登记编码 | C1030419006107 | | | |
| 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 23 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 | 398,841,000.00 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） | | |
| 1.0167 | 1.0311 | 5.68% | | |
| 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 | 0.48 | 0.79 |
| | | 间接 | 0.31 | |
| 2 | 债券市场类 | 直接 | 80.63 | 99.21 |
| | | 间接 | 18.58 | |
| 合计 | | | 100.00 | 100.00 |
| 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 4 号单一资产管理计划 | 0.78 | 18.89 | |
| 2 | 19 重庆旅投 CP002 | 0.38 | 9.13 | |
| 3 | 19 云工投 PPN001 | 0.37 | 9.09 | |
| 4 | 19 江苏新投 MTN001 | 0.37 | 9.07 | |
| 5 | 19 中普天 SCP001 | 0.37 | 9.02 | |
| 6 | 19 兴化城投 PPN001 | 0.37 | 8.95 | |
| 7 | 19 开滦 SCP004 | 0.36 | 8.67 | |
| 8 | 19 陕西旅游 SCP001 | 0.31 | 7.56 | |
| 9 | 19 潍坊水务 SCP003 | 0.31 | 7.49 | |

| | | | |
|---|--------------|------|------|
| 10 | 19 海兴 PPN001 | 0.21 | 5.05 |
| 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。</p> <p>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。</p> | | | |
| 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。 | | | |