

龙盈固定收益类 G 款 21 号一年定开科创 打新 FOF 型理财产品 2020 年一季度 运行报告

| | | | |
|-----------------------------|------------------------------------|--------------|--------|
| 1、重要信息提示 | | | |
| 无。 | | | |
| 2、理财产品概况 | | | |
| 产品名称 | 龙盈固定收益类 G 款 21 号一年定开科创打新 FOF 型理财产品 | | |
| 产品登记编码 | C1030419009069 | | |
| 销售币种 | 人民币 | | |
| 产品风险评级 | PR3 级（平衡型） | | |
| 收益类型 | 非保本浮动收益、净值型 | | |
| 产品成立日 | 2019 年 9 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 | 华夏银行股份有限公司 | | |
| 报告期末理财产品份额 | 170,074,000 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） | |
| 1.0221 | 1.0281 | 2.35% | |
| 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 |
| | | 间接 | - |
| 2 | 混合型基金 | 直接 | - |
| | | 间接 | 99.52 |
| 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 (万元) | 占比 (%) |
| 1 | 易方达新鑫 I | 1,685.67 | 9.64 |
| 2 | 东方盛世 | 1,682.75 | 9.62 |
| 3 | 东方价值挖掘 A | 1,651.45 | 9.44 |
| 4 | 广发鑫裕 | 1,644.08 | 9.4 |
| 5 | 光大诚鑫 C | 1,634.07 | 9.34 |
| 6 | 易方达瑞景 | 1,421.43 | 8.13 |
| 7 | 广发聚安 A | 1,235.01 | 7.06 |
| 8 | 华夏睿磐泰利 A | 1,059.30 | 6.06 |
| 9 | 华夏睿磐泰兴 | 1,054.19 | 6.03 |
| 10 | 银河君尚 I | 1,045.71 | 5.98 |

6、投资组合的流动性风险分析

2020年一季度的，受国内外新冠疫情、石油价格战等影响，国内外股市均出现了大幅调整，其中上证综合指数区间跌幅达-9.83%。随着国内各项稳增长政策的落地及疫情的好转，证券市场恐慌性情绪有望好转，A股有望震荡筑底，并缓慢回升至合理估值水平。

科创板作为资本市场改革的重要举措，致力于对符合国家战略定位的新兴企业及中小民企提供更多发展渠道、鼓励企业持续发展。一季度，科创板合计共发行新股24只，根据Wind金融终端统计，上市首日收盘价平均涨幅高达195.73%，新股总体实现较高收益。按当前的新股节奏和市场情绪，预计后续打新收益依旧可观，未来仍有更多优质企业选择在科创板上市。

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。一季度以来组合采用信用债的票息策略并精选科创打新主题基金，成功把握市场机会，获得较好的投资回报。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。

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。