

龙盈天天理财 1 号 2019 年四季度运行报告

1、重要信息提示				
无。				
2、理财产品概况				
产品名称	龙盈天天理财 1 号			
产品登记编码	C1030419001278			
销售币种	人民币			
产品风险评级	PR1 级（谨慎型）			
收益类型	非保本浮动收益、净值型			
产品成立日	2019 年 1 月 30 日			
产品到期日	本理财产品无特定存续期限（实际产品期限受制于提前终止条款的约定）			
产品托管人	华夏银行			
报告期末理财产品份额	11240533033.56 份			
3、报告期理财产品净值表现				
起始日净值 (2019 年 9 月 30 日)	结束日净值 (2019 年 12 月 31 日)	报告期实现收益率（年化）		
1.0267	1.0361	3.63%		
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	13.78	13.94
		间接	0.16	
2	债券市场类	直接	-	86.06
		间接	86.06	
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	现金及银行存款	16.24	13.94	
2	19 国电 CP001	5.50	4.73	
3	R001	5.00	4.29	
4	19 枫扬 ABN007 优先	3.99	3.42	
5	19 冀中能源 SCP010	3.30	2.84	
6	19 惠泽 ABN004 优先 A	3.00	2.58	
7	19 和信沁雪 ABN004 优先	2.66	2.29	
8	19 鲁钢铁 SCP005	2.55	2.19	
9	19 开滦 MTN002	2.53	2.17	
10	16 漳龙债	2.52	2.16	
6、投资组合的流动性风险分析				

秉承审慎的投资策略，本产品通过对客户需求以及宏观经济和货币市场的判断，投资组合主要选取 AA+ 以上、剩余期限在 3 年以内的债券类资产进行投资，结合市场及产品情况灵活调整组合配置。同时保留一定比例的高流动性资产，在风险可控的基础上提高整体收益。报告期内本产品收益较为稳定，实现年化收益率 3.63%。

流动性风险控制方面，结合产品申赎规律及市场整体流动性情况，提前做好预判，灵活安排头寸，投资资产流动性承压及变现能力强。

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。