

# 中国建设银行深圳市分行“乾元-龙禧”（按周）开放式净值型人民币理财产品季度投资管理报告

报告日：2019年09月30日

中国建设银行深圳市分行“乾元-龙禧”（按周）开放式净值型人民币理财产品于2018年12月28日正式成立。截至报告日，本产品规模为3,187,924,966.77元，杠杆水平符合监管要求。

## 一、报告期投资者实际收益率

截至2019年09月30日，产品单位净值为1.031769。本报告期内，产品存续规模如下：

日期	份额净值	累计净值	资产净值
2019-09-30	1.031769	1.031769	3,187,924,966.77
2019-08-31	1.028430	1.028430	3,264,564,659.41
2019-07-31	1.024982	1.024982	3,347,335,799.35
2019-06-30	1.021427	1.021427	3,251,993,484.61

相关收益及计算方法，请具体查阅对应的收益率调整公告及产品说明书。

## 二、产品投资组合详细情况

产品名称	募集起始日	募集结束日	产品成立日	产品到期日
中国建设银行深圳市分行“乾元-龙禧”（按周）开放式净值型人民币理财产品	2018年12月20日	2018年12月27日	2018年12月28日	无固定期限

理财产品管理人：中国建设银行股份有限公司深圳市分行

理财产品托管人：中国建设银行股份有限公司深圳市分行

## 三、期末资产持仓

资产类别	穿透前金额	占全部产品总资产	穿透后金额	占全部产品总资产
------	-------	----------	-------	----------

	(万元)	产的比例 (%)	(万元)	产的比例 (%)
现金及银行存款	10491.41	3.28	19682.86	6.02
同业存单	0	0	0	0
拆放同业及买入返售	0	0	0	0
债券	105619.95	33.07	286164.55	87.58
理财直接融资工具	0	0	0	0
新增可投资资产	0	0	0	0
非标准化债权类资产	0	0	0	0
权益类投资	0	0	0	0
金融衍生品	0	0	0	0
代客境外理财投资 QDII	0	0	0	0
商品类资产	0	0	0	0
另类资产	0	0	0	0
公募基金	0	0	18085.08	5.53
私募基金	0	0	0	0
资产管理产品	0	0	0	0
委托投资——协议方式	203278.15	63.64	0	0
合计	319397.85	100.00	326746.24	100.00

#### 四、前十大投资资产明细

序号	资产名称	资产规模 (元)	资产占比 (%)
1	19 招商蛇口 SCP003	201,437,700.80	6.16
2	活期存款	196,828,600.00	6.02
3	15 大连万达 MTN002	196,241,214.20	6.01
4	16 复星 03	173,553,968.04	5.31
5	16 复星 02	164,080,166.29	5.02
6	15 大连万达 MTN001	161,443,682.94	4.94
7	15 绿地 02	148,126,119.76	4.53

8	17 复药 01	102,700,326.87	3.14
9	西部利得天添富货币 B	100,388,557.56	3.07
10	17 亚迪 01	100,294,099.41	3.07

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产

## 五、风险分析

### （一）产品的流动性风险情况

本产品存续期内，客户可在任意产品运作周期内提出申购申请。产品存续期内，客户可在任意产品运作周期内提出赎回份额申请，客户赎回资金将于下一个开放日兑付至客户签约账户。每个运作周期的赎回截止时间为该运作周期开放日前一自然日的 15:00。赎回资金到账之前客户无法提前获得赎回资金，可能导致客户需要资金时不能按需变现，并可能使客户丧失其他投资机会的风险。此外，若赎回申请超过单个客户累计赎回限额或产品发生巨额赎回，亦可能导致客户需要资金时不能按需变现，并可能使客户丧失其他投资机会的风险。

### （二）产品的投资风险情况

#### 1. 产品债券持仓风险及价格波动情况（针对固收类及混合类产品）

目前本产品所投资的债券资产分类状态均为正常。但在本产品存续期限内，其资产项下义务人存在出现违约情形的可能性，同时其资产受未来市场的不确定，利率、汇率的波动等因素的影响，都会导致所投资的债券资产的价值有所波动。从而导致相关金融产品存在市场价值下跌或收益低于业绩比较基准、到期本金无法足额按时偿还等情况的可能性。

#### 2. 产品股票持仓风险及价格波动情况（针对权益类及混合类产品）

本产品未投资于股票资产。

3. 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况（针对商品及金融衍生品类与混合类产品）

本产品未投资于衍生品。

## 六、托管人报告

无

## 七、投资账户信息

序号	账户类型	账户编号	账户名称	开户单位
1	托管户	442501000034000 03294	中国建设银行股份有限公司深圳市分行投资银行理财产品托管专户	中国建设银行股份有限公司深圳市分行营业部

## 八、报告期内关联交易情况

### （一）产品持有关联方发行或承销的证券

序号	证券简称	证券类别	证券代码	交易数量	交易净价	关联方名称	关联方角色
1	19 深航空 SCP001	超短期融资 券	011900114	537,163.84	100.1615	中国建设银行	主承销商
2	19 招商蛇口 SCP003	超短期融资 券	011901553	2,000,000	100.0302	中国建设银行	联席主承销商
3	16 比亚迪 MTN002	中期票据	101662019	900,000	99.0656	中国建设银行	联席主承销商
4	17 华侨城 MTN004	中期票据	101754090	900,000	102.3273	中国建设银行	联席主承销商

### （二）其他重大关联交易

无

## 九、投资非标准化债权及股权类资产清单

无

## 十、产品整体运作情况

（一）本产品自成立至本报告日，产品管理人恪尽职守、勤勉尽责、谨慎管理，忠实履行有关法律、行政法规和相关文件的规定。

（二）截至本报告日，所有投资资产正常运营，未发现异常情况或不利情况。

（三）本产品自成立至本报告日，没有发生涉诉及诉讼等损害投资者利益的情况。

特此公告

中国建设银行  
2019年10月23日