

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12月31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3,147,564,873.95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12月31日，产品单位净值为1.041735。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(元)
2019-09-30	1.031769	1.031769	3,187,926,432.18
2019-10-31	1.035072	1.035072	3,264,727,052.93
2019-11-30	1.038230	1.038230	3,261,362,755.95
2019-12-31	1.041735	1.041735	3,147,565,516.78

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	12,024.32	3.81	24,063.71	6.83
同业存单	0	0	0	0
拆放同业及买入返售	0	0	0	0
债券	98,186.84	31.11	306,905.69	87.14
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	21,210.92	6.02
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	205,372.23	65.08	0	0
合计	315,583.39	100.00	352,180.32	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	活期存款	221,497,106.61	7.04
2	19 招商蛇口 SCP003	202,993,076.22	6.45
3	15 大连万达 MTN002	190,375,168.85	6.05
4	16 复星 03	175,591,051.99	5.58
5	16 复星 02	166,014,094.89	5.27
6	15 大连万达 MTN001	163,234,913.20	5.19
7	15 绿地 02	140,582,897.25	4.47

8	16 贵州高速 MTN001	104,166,004.29	3.31
9	17 复药 01	103,812,793.29	3.30
10	17 亚迪 01	101,420,346.28	3.22

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

托管报告

（2019年）

在本报告期间，托管人对管理人的投资运作行为进行了监督，未发现存在损害本产品利益的行为。

在本报告期间，托管人以诚实信用、勤勉尽责的原则认真办理理财资金托管事项，履行托管人职责。

中国建设银行股份有限公司基金托管部深圳分部

2020年1月9日

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 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
2	16 比亚迪	中期票据	101662019	900,000	99.0656	中国建设银行	联席主承销商

	MTN002						
3	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

中国建设银行深圳市分行

2020年3月6日