

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：2020年03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2,914,726,443.85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2020年03月31日，产品单位净值为1.051097。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)
2020-03-31	1.051097	1.051097	2,914,726,443.85
2020-02-29	1.047806	1.047806	3,182,016,122.59
2020-01-31	1.044407	1.044407	3,239,986,122.83
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 (万元)	占全部产品总资产 的比例 (%)	穿透后金额 (万元)	占全部产品总资产 的比例 (%)
现金及银行存款	9,628.81	3.33	18,152.70	5.80
同业存单	0.00	0.00	0.00	0.00
拆放同业及买入返售	0.00	0.00	0.00	0.00
债券	72,155.39	24.95	268,389.10	85.79
理财直接融资工具	0.00	0.00	0.00	0.00
新增可投资资产	0.00	0.00	0.00	0.00
非标准化债权类资产	0.00	0.00	0.00	0.00
权益类投资	0.00	0.00	0.00	0.00
金融衍生品	0.00	0.00	0.00	0.00
代客境外理财投资 QDII	0.00	0.00	0.00	0.00
商品类资产	0.00	0.00	0.00	0.00
另类资产	0.00	0.00	0.00	0.00
公募基金	0.00	0.00	26,293.73	8.40
私募基金	0.00	0.00	0.00	0.00
资产管理产品	0.00	0.00	0.00	0.00
委外投资——协议方式	207,381.04	71.72	0.00	0.00
合计	289,165.24	100.00	312,835.53	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	14 渝涪陵 MTN001	211,749,636.10	6.77
2	活期存款	181,527,065.51	5.80
3	16 复星 03	178,994,462.61	5.72
4	西部利得天添富货币 B	171,564,503.82	5.48
5	16 复星 02	167,905,249.76	5.37
6	15 绿地 02	142,376,955.41	4.55

7	17 亚迪 01	102, 521, 257. 70	3. 28
8	17 复药 01	100, 350, 495. 28	3. 21
9	18 亚迪 02	94, 221, 730. 68	3. 01
10	18 津投 07	92, 440, 430. 34	2. 95

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

（2020 年一季度）

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 4 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	4425010000340000 3294	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	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
2	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4月17日