

中国建设银行深圳市分行“乾元-龙祺”2018年第1期封闭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-龙祺”2018年第1期封闭式净值型人民币理财产品于2018年12月24日正式成立。截至报告日，本产品规模为60,614,810.00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1.070097。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 |
|------------------------|----------|----------|---------------|
| 报告日 (报告期末最后一个市场交易日) | 1.070097 | 1.070097 | 64,863,743.53 |
| 一个月前 | 1.065344 | 1.065344 | 64,575,648.77 |
| 二个月前 | 1.060906 | 1.060906 | 64,306,617.14 |
| 三个月前 | 1.056161 | 1.056161 | 64,019,023.39 |
| 一年前 | - | - | - |

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-龙祺”2018年第1期封闭式净值型人民币理财产品 | 2018-12-18 | 2018-12-23 | 2018-12-24 | 2020-10-20 |

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 | 441.98 | 6.81% | 441.98 | 6.81% |
| 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 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 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 | 6,046.00 | 93.19% | 6,046.00 | 93.19% |
| 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% | 0.00 | 0.00% |
| 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 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 6,487.98 | 100.00% | 6,487.98 | 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 | 17 深中房 CD001 | 44,960,000.00 | 69.30% |
| 2 | 17 深昆明同荣汇 AB001 | 15,500,000.00 | 23.89% |
| 3 | 现金及银行存款 | 4,419,810.04 | 6.81% |

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

由于产品存续期内，客户无提前终止权，不可赎回本期产品，且所投

组合内所有非标资产到期日均早于产品到期日，故投资组合流动性风险较低。

（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）

无债券持仓

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）

无股票持仓

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）

无衍生品持仓

六、托管人报告

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。

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 03293-0005 | 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

无

（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（见附录一）

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

中国建设银行股份有限公司深圳市分行

2020年04月13日

附录一

中国建设银行深圳市分行“乾元-龙祺”2018年第1期封闭式净值型人民币理财产品投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2020年03月31日

我行依照监管要求，现对中国建设银行深圳市分行“乾元-龙祺”2018年第1期封闭式净值型人民币理财产品投资非标准化债权及股权类资产清单披露如下：

| 交易结构 | 融资客户名称 | 项目名称 | 剩余融资期限（天） | 风险状况 |
|-------|----------------|------------------|-----------|------|
| 委托债权 | 中信房地产集团有限公司 | 17 深中房 CD001 | 175 | 正常 |
| 收/受益权 | 昆明同荣汇房地产开发有限公司 | 17 深昆明同荣汇 AB 001 | 199 | 正常 |

除上述资产外，产品投资其他资产的风险状况：正常

到期收益分配详见产品说明书。