

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，本产品已确认规模为2,550,414,420.35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09月30日，产品单位净值为1.069350。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年09月30日	1.069350	1.069350	2,550,414,420.35
2020年08月31日	1.066434	1.066434	2,953,369,067.94
2020年07月31日	1.063660	1.063660	3,236,139,865.65
2020年06月30日	1.060389	1.060389	2,755,557,045.00

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	9,279.55	3.62%	16,805.85	6.55%
同业存单	0	0.00%	0.00	0.00%
拆放同业及买入返售	0	0.00%	6,000.00	2.34%
债券	36,294.70	14.14%	210,277.24	81.94%
理财直接融资工具	0	0.00%	0.00	0.00%
新增可投资资产	0	0.00%	0.00	0.00%
非标准化债权类资产	0	0.00%	0.00	0.00%
权益类投资	0	0.00%	0.00	0.00%
金融衍生品	0	0.00%	0.00	0.00%
代客境外理财投资 QDII	0	0.00%	0.00	0.00%
商品类资产	0	0.00%	0.00	0.00%
另类资产	0	0.00%	0.00	0.00%
公募基金	0	0.00%	23,541.41	9.17%
私募基金	0	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	0	0.00%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	211,026.09	82.24%	0.00	0.00%
合计	256,600.34	100.00%	256,624.49	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	205,214,841.37	8.00
2	16 复星 03	174,001,696.03	6.78
3	西部利得天添富货币 B	173,439,099.01	6.76
4	现金及银行存款	168,058,498.71	6.55
5	16 复星 02	163,828,329.93	6.38

6	15 绿地 02	146,004,072.86	5.69
7	17 能投 01	131,281,981.61	5.12
8	17 复药 01	102,050,408.21	3.98
9	18 连云港 MTN002	93,257,602.32	3.63
10	16 比亚迪 MTN002	92,526,541.55	3.61

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 年三季度）

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 10 月 12 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

中国建设银行股份有限公司深圳市分行

2020年10月16日