

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四季度暨年度投资管理报告

报告日：2020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2,097,187,452.89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12月31日，产品单位净值为1.077435。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12月31日	1.077435	1.077435	2,097,187,452.89
2020年11月30日	1.074549	1.074549	2,306,649,580.77
2020年10月31日	1.071804	1.071804	2,373,536,548.35
2020年09月30日	1.069350	1.069350	2,550,414,420.35

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	11,594.89	5.48%	12,761.26	5.04%
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	18,263.74	8.64%	216,937.65	85.61%
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%	23,696.86	9.35%
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%
委托投资——协议方式	181,633.72	85.88%	0.00	0.00%
合计	211,492.35	5.48%	253,395.77	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	16 复星 03	175,724,696.08	6.93
2	西部利得天添富货币 B	174,620,489.83	6.89
3	16 复星 02	165,759,203.23	6.54
4	14 渝涪陵 MTN001	155,097,049.29	6.12
5	17 能投 01	132,235,963.06	5.22

6	现金及银行存款	127,612,633.92	5.04
7	17 复药 01	102,904,720.05	4.06
8	18 连云港 MTN002	94,043,626.18	3.71
9	16 比亚迪 MTN002	93,783,978.02	3.70
10	安居 01 优	88,853,413.80	3.51

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。

六、托管人报告

托管报告

(2020 年度)

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

2021 年 1 月 13 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

(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

2021年1月14日