

“融远创信 11 号”净值型理财产品 2019 年第 4 季度报告

产品管理人：厦门银行股份有限公司

产品托管人：招商银行股份有限公司天津分行

报告发出时间：2020 年 1 月 21 日

重要提示

产品托管人招商银行股份有限公司天津分行根据《商业银行理财业务监督管理办法》规定，复核了本报告中的产品收益表现、主要财务指标、投资组合情况等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

产品管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用理财资产，但不保证一定盈利。产品的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本产品的发行文件。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

1、产品基本情况

项目	信息
产品名称	“融远创信 11 号” 净值型理财产品
产品登记编码	C1082419000009
产品管理人	厦门银行股份有限公司
产品托管人	招商银行股份有限公司天津分行
产品运作方式	固定收益类非保本浮动收益封闭式净值型
产品成立日	2019-08-21
产品到期日	2020-08-26
报告期末产品份额总额	106,010,000.00
业绩比较基准（如有）	成立日中国人民银行公布的金融机构一年期人民币整存整取存款基准利率+3.00%
估值方法	混合估值法（部分摊余成本法、部分市价法）

2、产品收益表现

阶段	净值增长率（%）
当期（2019-10-01 至 2019-12-31）	1.42
自产品成立日至今	1.93

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2019-10-01 至 2019-12-31
本期已实现收益	1,342,491.07
本期利润	1,508,468.41
期末产品资产净值	108,057,113.52
期末产品份额净值	1.0193

4、投资组合情况及流动性风险分析

4.1 期末资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的
		人民币	比例（%）
1	权益投资		
	其中：普通股		
	存托凭证		
2	基金投资		
3	固定收益投资	69,742,890.00	64.46
	其中：债券	69,742,890.00	64.46
	资产支持证券		
4	金融衍生品投资		
	其中：远期		
	期货		
	期权		
	权证		
5	买入返售金融资产	800,064.00	0.74
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
6	货币市场工具		
7	银行存款和结算备付金合计	13,694.91	0.01
8	其他资产	37,630,667.36	34.78
	合计	108,187,316.27	100.00

4.2 投资组合流动性风险分析

产品管理人会通过评估并及时调整理财产品投资组合的流动性风险水平，使得流动性资产配置比例保持在适当水平，既不损害投资收益，也能应对产品到期需求。目前投资组合中杠杆比例很低，流动性风险较小。

4.3 报告期末占资产净值比例大小排序的前十项资产明细

金额单位：元

序号	资产名称	金额	占产品资产净值比例（%）
1	同业借款	35,000,000.00	32.39
2	18 海能 02	10,116,000.00	9.36
3	16 鲁水 02	10,068,000.00	9.32
4	19 中武 R1	10,040,000.00	9.29
5	19 爱建 01	10,002,000.00	9.26
6	19 天地 01	9,994,000.00	9.25
7	18 宁投 01	9,965,620.00	9.22
8	18 厦特 02	8,456,280.00	7.83
9	19 凯盛 01	1,100,990.00	1.02
10	GC028	800,064.00	0.74

注：前十项资产明细仅包含证券投资、场外投资，不包含银行存款、存出保证金、清算备付金、应收利息等资产。

厦门银行股份有限公司

2020-01-21