

## 附件

# “乾元一天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品 投资管理报告

报告日：2019年7月31日

“乾元-天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品于2016年3月2日正式成立。截至报告日，本产品规模为7,581,867,133.19元。

### 一、报告期投资者实际收益率

根据产品说明书的约定，2016年3月2日至2016年5月11日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 32$	$32 \leq T < 63$	$63 \leq T < 93$	$93 \leq T < 120$	$120 \leq T < 270$	$270 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.05%	3.15%	3.35%	3.60%	3.75%	4.05%	4.25%

其中：T为投资期，单位：天

2016年5月12日至2016年7月14日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 32$	$32 \leq T < 63$	$63 \leq T < 93$	$93 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$365 \leq T < 730$	$T \geq 730$
投资者实际收益率	2.05%	3.15%	3.25%	3.60%	3.75%	4.05%	4.25%

其中：T为投资期，单位：天

2016年7月15日至2016年8月15日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	1.95%	2.55%	3.05%	3.40%	3.60%	3.80%

其中：T为投资期，单位：天

2016年8月16日至2017年2月21日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
-----	-----------------	------------------	------------------	-------------------	--------------------	--------------

投资者实际收益率	1.95%	2.35%	2.85%	3.05%	3.35%	3.55%
----------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

其中：T 为投资期，单位：天

2017 年 2 月 22 日至 2017 年 6 月 9 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.10%	2.45%	3.00%	3.20%	3.45%	3.55%

其中：T 为投资期，单位：天

2017 年 6 月 10 日至 2017 年 12 月 21 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 7$	$7 \leq T < 14$	$14 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.30%	2.50%	2.80%	3.30%	3.40%	3.50%	3.70%	4.00%

其中：T 为投资期，单位：天

2017 年 12 月 22 日至 2018 年 1 月 24 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 7$	$7 \leq T < 14$	$14 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.30%	2.60%	3.20%	3.70%	3.75%	3.90%	4.15%	4.35%

其中：T 为投资期，单位：天

2018 年 1 月 25 日至 2018 年 7 月 17 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 7$	$7 \leq T < 14$	$14 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.85%	2.95%	3.20%	3.70%	3.75%	3.90%	4.15%	4.35%

其中：T 为投资期，单位：天

2018 年 7 月 18 日至 2019 年 7 月 26 日投资者实际收益率如下表所示：

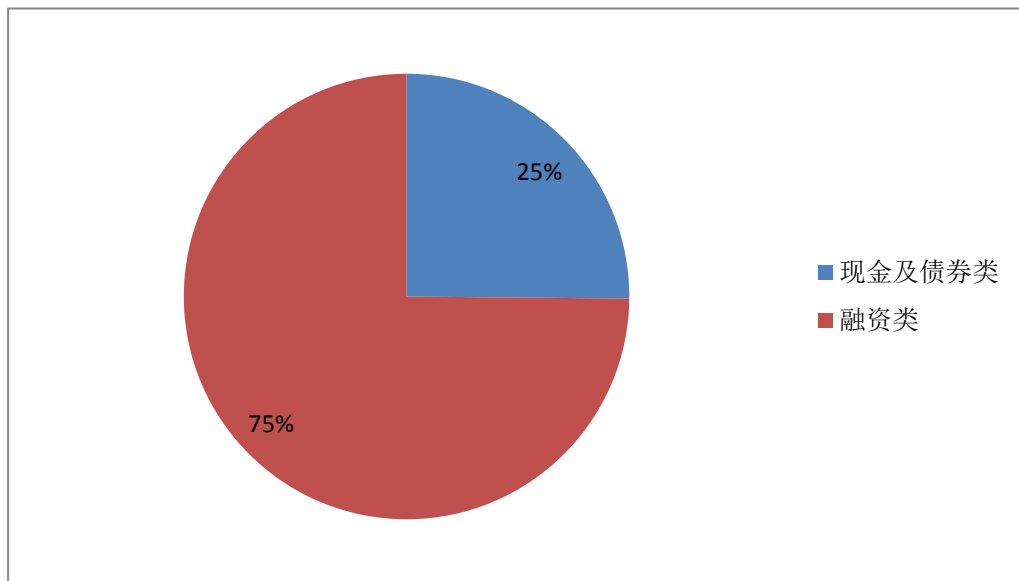
投资期	1≤T<7	7≤T<14	14≤T<30	30≤T<60	60≤T<90	90≤T<180	180≤T<365	T≥365
投资者实际收益率	3.00%	3.10%	3.20%	3.40%	3.50%	3.60%	3.80%	4.00%

其中：T为投资期，单位：天

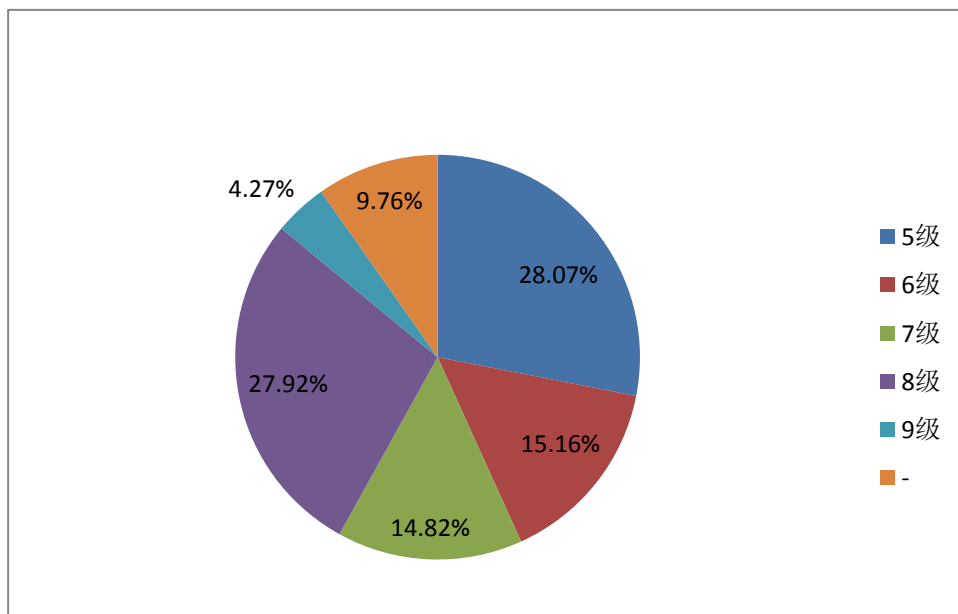
相关收益及计算方法，请具体查阅对应的收益率调整公告及产品说明书。

## 二、产品投资组合详细情况

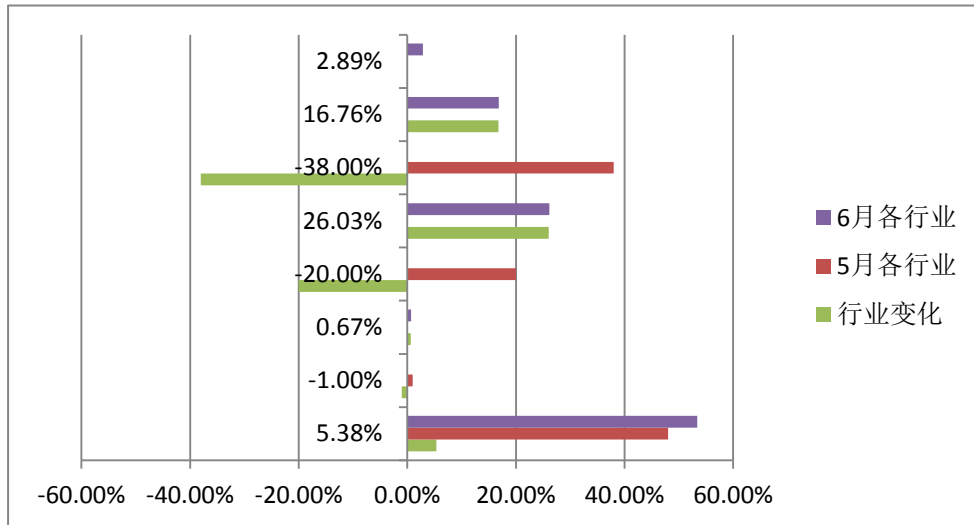
### （一）投资组合的基本情况



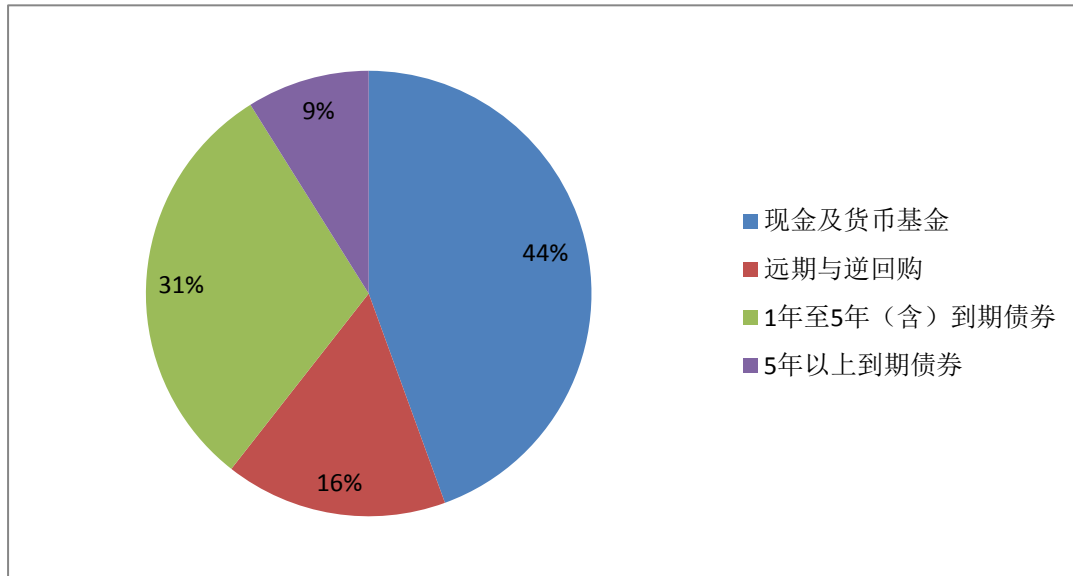
### （二）融资类资产的行内评级构成



### （三）融资类资产的行业占比构成及当月增减变化情况



### （四）现金及债券类资产的期限结构



## 三、产品整体运作情况

（1）自本产品成立起至本报告日，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。

（2）截至本报告日，所有项目均能正常还本付息，按预期收益兑付客户。

（3）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形。

中国建设银行辽宁省分行

2019年7月31日

## 附录

### “乾元一天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品 投资非标准化债权资产清单

我行依照《中国银监会关于规范商业银行理财业务投资运作有关问题的通知》（银监发【2013】8号）要求，现对“乾元一天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品投资非标准化债权资产及权益类资产清单披露如下：

资产类别	融资客户名称	剩余期限	备注
资产受益权	盘锦建设投资有限公司	1609	
资产受益权	盘锦建设投资有限公司	696	
资产受益权	盘锦鑫诚实业集团有限责任公司	266	
委托贷款	铁岭市社会保险事业管理局	1736	
资产受益权	盘锦鑫诚实业集团有限责任公司	1365	
委托贷款	抚顺市社会保险事业管理局	1545	
委托贷款	营口市社会保险事业管理局	1607	
资产受益权	鞍山钢铁集团有限公司	514	
资产受益权	沈阳三聚凯特催化剂有限公司	733	
资产受益权	盘锦建设投资有限公司	331	
委托贷款	葫芦岛市社会保险事业管理局	1616	
委托贷款	朝阳市社会保险局	1614	
委托贷款	阜新市社会保险局	1600	
资产受益权	鞍山钢铁集团有限公司	514	
委托贷款	本溪市社会保险事业管理局	1526	
委托贷款	辽阳市社会保险事业管理局	1580	
委托贷款	铁岭市社会保险事业管理局	1557	
委托贷款	丹东市社会保险事业管理局	1558	
委托贷款	阜新市社会保险局	1600	
资产受益权	盘锦鑫诚实业集团有限责任公司	1609	

到期收益分配详见产品说明书。