

上海行乾元—日日增利开放式产品季度投资管理报告

报告日：2019年9月30日

上海行乾元—日日增利开放式产品于2017年11月24日正式成立。截至报告日，本产品规模为13950231876.02元，杠杆水平符合监管要求。

一、报告期投资者实际收益率

根据产品说明书的约定，本报告期内，投资者实际收益率如下表所示：

投资期（天）	1≤T<45	45≤T<70	T≥70
投资者实际收益率	3.00%	3.40%	3.50%

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
上海行乾元—日日增利开放式产品	2017/11/21	2017/11/23	2017/11/24	-

理财产品管理人：中国建设银行上海市分行

理财产品托管人：中国建设银行上海市分行

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	215,642.45	9.61%	256,708.43	11.44%
同业存单	0.00	0.00%	4,806.72	0.21%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	27,874.80	1.24%
债券	289,353.33	12.90%	739,740.88	32.97%
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	417,052.07	18.59%	417,052.07	18.59%
权益类投资	575,268.26	25.64%	637,898.34	28.43%
金融衍生品	0.00	0.00%	15.52	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	100,000.00	4.46%	101,530.67	4.53%
私募基金	57,938.05	2.58%	57,938.05	2.58%
资产管理产品	0.00	0.00%	0.00	0.00%

委外投资——协议方式	588,312.60	26.22%	0.00	0.00%
合计	2,243,566.76	100.00%	2,243,565.48	100.00%

注：截止报告日本产品募集本金及应付投资者收益合计2243566.76万元

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沪坤安EI001	2719225250	11.96%
2	17沪海通绿地EB001	1702091944	7.49%
3	19宝钢SCP014	1000195902	4.40%
4	上海分行建信现金添利B	1000000000	4.40%
5	19沪绿地金控EB001	951636111	4.19%
6	17沪中民投EB001	596923800.1	2.63%
7	16沪苏州恒翌CD002	541684229.7	2.38%
8	17沪协信EB001	436065954.8	1.92%
9	14沪奉贤轨交七年AB001	404565158.7	1.78%
10	18旭辉02	351185878.2	1.54%

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产

五、产品的流动性风险分析

产品管理人会根据产品到期时间合理调整资产配置，以满足产品的兑付资金需求，故投资组合流动性风险较低。

六、托管人报告

见附件。

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	人民币专用存款账户	31001550400050042595-0338	中国建设银行股份有限公司上海市分行投资银行理财产品托管专户	建设银行上海市分行

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	17宝钢MTN001	中期票据	101754006	246,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
2	16东航集MTN001	中期票据	101654049	560,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商

3	17光大幸福PPN001	定向工具	31782003	153,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
4	16致达控股MTN001	中期票据	101686002	267,082.24	100.00	中国建设银行	主承销商
5	17平安租赁MTN001	中期票据	101754023	3,630.36	100.00	中国建设银行	主承销商
6	17致达MTN001	中期票据	101786002	480,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
7	18光大幸福PPN001	定向工具	31800071	200,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
8	18致达MTN001	中期票据	101800365	800,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
9	19宝钢SCP011	超短期融资券	11901480	400,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
10	19宝钢SCP014	超短期融资券	11902246	10,000,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
11	19扬城建SCP001	超短期融资债券	011900359.IB	600,000.00	100.01	中国建设银行	主承销商
12	19鲁黄金SCP001	超短期融资债券	011900465.IB	400,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
13	19湘投SCP002	超短期融资债券	011900595.IB	800,000.00	100.04	中国建设银行	主承销商
14	19联发集SCP002	超短期融资债券	011900609.IB	1,100,000.00	100.04	中国建设银行	主承销商
15	19杭金投SCP002	超短期融资债券	011900948.IB	100,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
16	19中山城投SCP002	超短期融资债券	011900977.IB	100,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
17	19建安投资SCP001	超短期融资债券	011901353.IB	800,000.00	100.03	中国建设银行	主承销商
18	19泉州城建CP001	一般短期融资券	041900050.IB	100,000.00	100.12	中国建设银行	主承销商
19	19湘高速CP001	一般短期融资券	041900116.IB	200,000.00	99.83	中国建设银行	主承销商
20	17三一MTN001	一般中期票据	101754034.IB	139,549.28	99.91	中国建设银行	主承销商
21	19宿迁城投CP001	一般短期融资券	041900344.IB	48,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
22	18中交房产MTN001	一般中期票据	101801231.IB	189,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
23	19南国置业MTN001	一般中期票据	101900830.IB	240,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
24	16鲁重工MTN001	一般中期票据	101654036.IB	36,000.00	100.40	中国建设银行	主承销商
25	16七匹狼MTN001	一般中期票据	101654091.IB	77,333.33	97.92	中国建设银行	主承销商
26	19上实MTN002	一般中期票据	101900900.IB	126,000.00	100.00	中国建设银行	主承销商
27	19汤山建设MTN001	一般中期票据	101900168.IB	140,000.00	100.11	中国建设银行	主承销商
28	19广新控股MTN002	一般中期票据	101900280.IB	140,000.00	100.11	中国建设银行	主承销商
29	19鲁能集团MTN001	一般中期票据	101900532.IB	140,000.00	100.29	中国建设银行	主承销商
30	19保利久联SCP002	超短期融资债券	011900664.IB	21,600.00	100.00	中国建设银行	主承销商
31	19厦门市政MTN001	一般中期票据	101900636.IB	126,000.00	100.11	中国建设银行	主承销商
32	17横店MTN001	一般中期票据	101754134.IB	100,000.00	102.75	中国建设银行	主承销商
33	18汤山建设MTN001	一般中期票据	101801522.IB	70,000.00	100.60	中国建设银行	主承销商
34	18中粮地产MTN002	一般中期票据	101800771.IB	70,000.00	100.60	中国建设银行	主承销商
35	16保利地产MTN001	一般中期票据	101654100.IB	56,000.00	102.49	中国建设银行	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（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，未发现有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
2019年9月30日

附录一

上海行乾元—日日增利开放式产品投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2019年9月30日

我行依照监管要求，现对上海行乾元—日日增利开放式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
股权投资类(非回购)	上海坤安置业有限公司	16沪坤安EI001	651	正常
股票质押式回购	上海格林兰投资企业（有限合伙）	17沪海通绿地EB001	94	正常
股权投资类（带回购）	绿地金融投资控股集团有限公司	19沪绿地金控EB001	158	正常
股权投资类(非回购)	中民投资管理集团有限公司	17沪中民投EB001	1071	正常
-	苏州恒翌房地产开发有限责任公司	16沪苏州恒翌CD002	694	正常
股权收益权类（非回购）	协信进瀚股权收益权投资类理财产品	17沪协信EB001	1542	正常
资产收益权类	上海市奉贤区轨道交通建设投资有限公司	14沪奉贤轨交七年AB001	803	正常
产业基金类	南京南钢钢铁联合有限公司	17沪南钢基金OB003	1637	正常
股权投资类(非回购)	中科招商投资管理集团（上海）资产管理有限公司	16沪中科EB001	1213	正常
股权投资类(非回购)	正荣集团有限公司	16沪正荣EB001	718	正常
股权投资类(非回购)	中科招商投资管理集团（上海）资产管理有限公司	16沪中科EB002	1213	正常
产业基金类	建银国际资产管理（上海）有限公司	17沪建曦基金OB001	996	正常
股权投资类（带回购）	上海聚博房地产开发有限公司	16沪聚博EI001	2454	正常
股权投资类(非回购)	上海景绰企业发展有限公司	17沪景绰EI002	2154	正常
股权投资类(非回购)	上海三湘文化发展有限公司	17沪三湘EB001	1090	正常
资产收益权类	苏州鑫元茂置业有限公司	16沪鑫元茂AB001	241	正常
股权投资类(非回购)	上海世茂建设有限公司	18沪世茂建设EI001	1277	正常

股权投资类(非回购)	中科招商投资管理集团(上海)资产管理有限公司	16沪中科EB003	1213	正常
股权收益权类(非回购)	华丽家族股份有限公司	18沪华丽家族EB001	386	正常
股权投资类(非回购)	上海华滋奔腾控股集团有限公司	17沪华滋EB001	162	正常
股权投资类(非回购)	上海宝笠投资管理有限公司	15沪建信阳光EI002	274	正常
-	苏州恒翌房地产开发有限责任公司	16沪苏州恒翌CD001	694	正常
股权投资类(非回购)	上海宝瓴投资管理有限公司	17沪宝瓴EB001	2464	正常
股权投资类(非回购)	上海宝笠投资管理有限公司	15沪建信阳光EI001	274	正常
定向增发	远东国际租赁有限公司	17沪远东租赁OI001	479	正常
股权收益权类(非回购)	上海隆源资产经营有限公司	17沪隆源EB001	1127	正常
股权投资类(非回购)	中科招商投资管理集团(上海)资产管理有限公司	16沪中科EB004	1213	正常
股权投资类(非回购)	上海宇培实业(集团)有限公司	17沪宇培EB001	273	正常
资产收益权类	中铁二十三局集团轨道交通工程有限公司	17沪中铁二十三局AB001	172	正常
股权投资类(非回购)	上海新杨工业园区经济发展(集团)有限公司	16沪新杨EB001	365	正常
股权投资类(非回购)	绿地控股集团有限公司	17沪绿地EB001	182	正常
资产收益权类	中国二十冶集团有限公司	17沪中国二十冶AB002	81	正常
定向增发	上海建工股份有限公司66名高管融资人	17沪建工股权激励OI001	603	正常
产业基金	南京南钢钢铁联合有限公司	17沪南钢基金OB002	1637	正常
股权投资类(带回购)	上海建信住房服务有限责任公司	18沪建信住房EB001	396	正常
股权投资类(带回购)	上海建工集团股份有限公司	15沪建工EI001	1151	正常
产业基金类	上海临港经济发展(集团)有限公司	15临港园开基金OB002	1157	正常
股权投资类(非回购)	上海新杨工业园区经济发展(集团)有限公司	15沪新杨EB001	365	正常
资产收益权类	上海国金租赁有限公司	17沪国金租赁AB001	82	正常
资产收益权类	上海东兴投资控股发展有限公司	18沪东兴AB001	96	正常
股权投资类(非回购)	上海新杨工业园区经济发展(集团)有限公司	15沪新杨EB002	365	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。

托 管 报 告

2019年第三季度

2019 年第三季度托管人报告

中国建设银行股份有限公司资产管理业务中心：

我行作为中国建设银行上海分行非净值型理财产品的托管人，根据理财产品说明书履行托管职责。

本报告期内，托管人在执行非净值型理财产品的托管过程中，严格遵守了国家有关法律法规、托管协议、和其他有关规定，勤勉尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在损害理财产品持有人的行为。

本报告期内，托管人对非净值型理财产品估值的计算等方面进行了复核，对非净值型理财产品的投资运作进行了监督，管理人能够按照法规、合同协议等要求进行规范投资，投资比例监督指标正常，未发现违规行为。

托管人复核了本报告中的有关内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国建设银行股份有限公司基金托管部上海分部



2019年10月8日