

## 附件

# “乾元一天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品 月度投资管理报告

报告日：2016年12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9,149,189,395.43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2016年12月31日投资者实际收益率如下表所示：

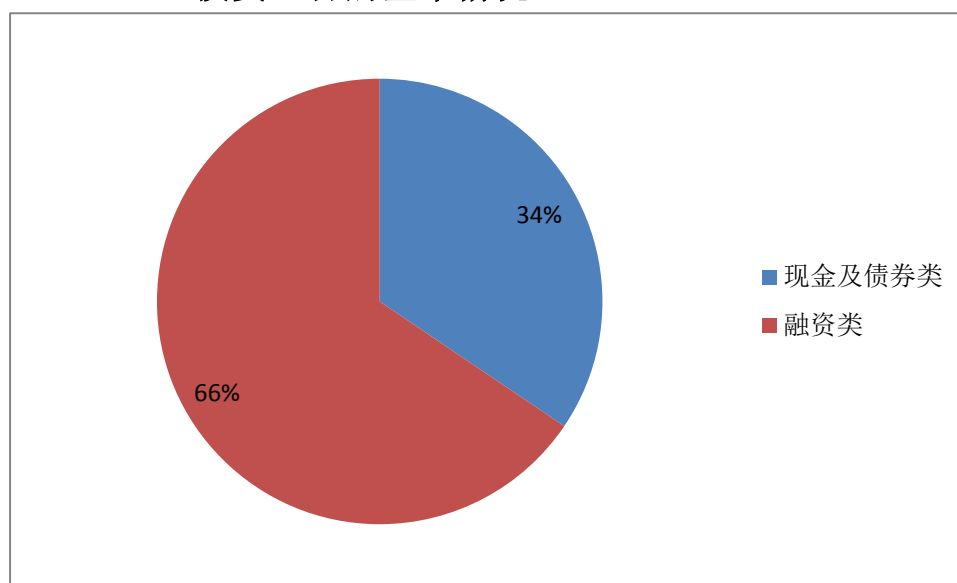
| 投资期      | 1≤T<30 | 30≤T<60 | 60≤T<90 | 90≤T<180 | 180≤T<365 | T≥365 |
|----------|--------|---------|---------|----------|-----------|-------|
| 投资者实际收益率 | 1.95%  | 2.35%   | 2.85%   | 3.05%    | 3.35%     | 3.55% |

其中：T为投资期，单位：天

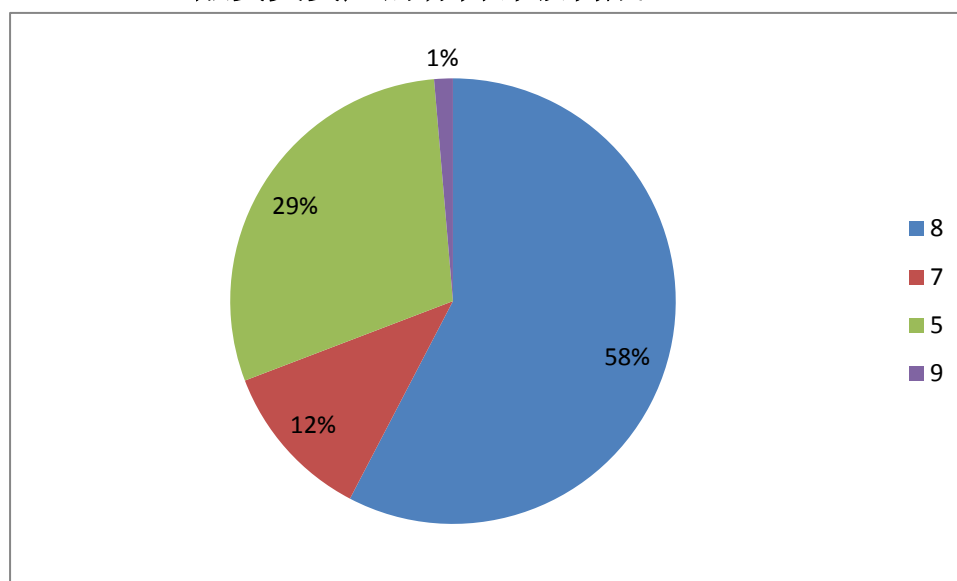
相关收益及计算方法，请具体查阅对应的收益率调整公告及产品说明书。

## 二、产品投资组合详细情况

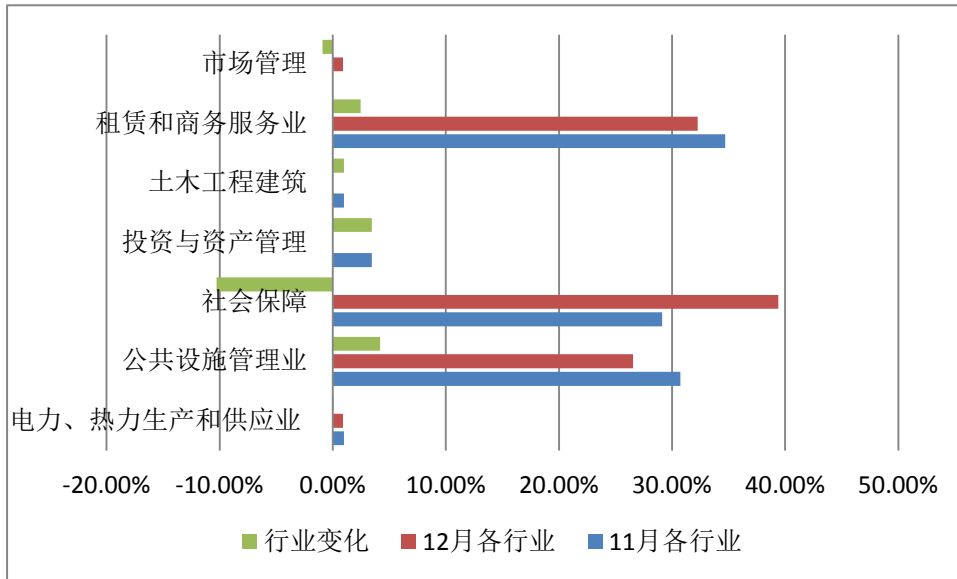
### （一）投资组合的基本情况



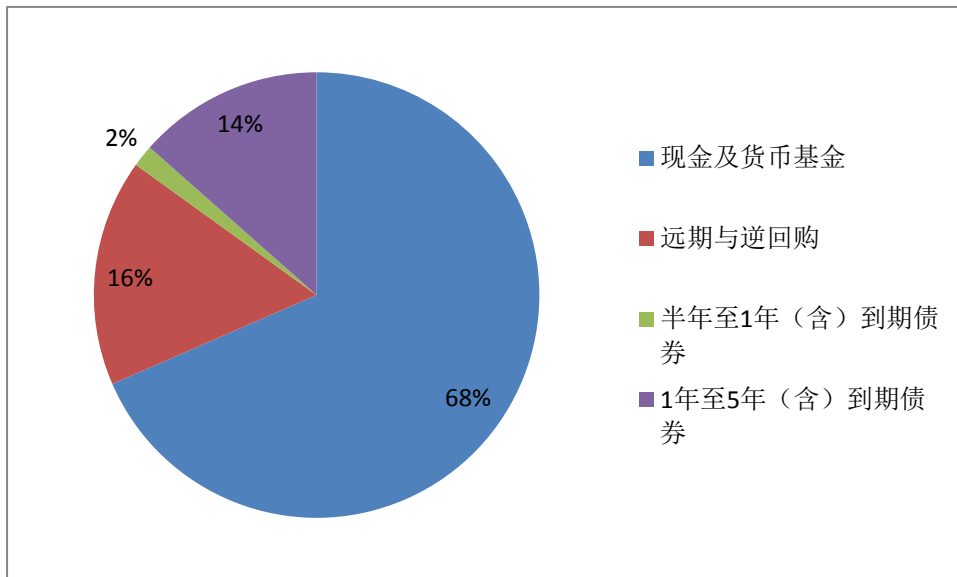
### （二）融资类资产的行内评级构成



### （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

2016年12月31日