

“乾元-津夜市专享” 2019 年第 76 期理财产品

季度投资管理报告

报告日：2019 年 9 月 30 日

“乾元-津夜市专享”2019 年第 76 期理财产品于 2019 年 5 月 14 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 56,584,000.00 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） | 272 |
| 投资者实际收益率 | 4.05% |

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 |
|-------------------------|----------|-----------|-----------|-----------|
| “乾元-津夜市专享” 2019 年第 76 期 | 2019/5/8 | 2019/5/13 | 2019/5/14 | 2020/2/10 |

理财产品管理人：中国建设银行股份有限公司天津市分行

理财产品托管人：中国建设银行股份有限公司天津市分行

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 | | | | |
| 同业存单 | | | | |

| | | | | |
|---------------|---------|-------|---------|-------|
| 拆放同业及买入返售 | | | | |
| 债券 | 3959.57 | 72.38 | 3959.57 | 72.38 |
| 理财直接融资工具 | | | | |
| 新增可投资资产 | | | | |
| 非标准化债权类资产 | 1510.69 | 27.62 | 1510.69 | 27.62 |
| 权益类投资 | | | | |
| 金融衍生品 | | | | |
| 代客境外理财投资 QDII | | | | |
| 商品类资产 | | | | |
| 另类资产 | | | | |
| 公募基金 | | | | |
| 私募基金 | | | | |
| 资产管理产品 | | | | |
| 委外投资——协议方式 | | | | |
| 合计 | 5470.26 | 100 | 5470.26 | 100 |

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 | 17 滨建投 MTN002 | 27,264,712.91 | 49.84 |
| 2 | 17 泰达投资 MTN001 | 12,331,000.00 | 22.54 |
| 3 | 19 津保障房 AB005 | 15,106,902.04 | 27.62 |
| 4 | | | |
| 5 | | | |
| 6 | | | |
| 7 | | | |
| 8 | | | |
| 9 | | | |
| 10 | | | |

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

由于产品存续期内，客户无提前终止权，不可赎回本期产品，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（公募产品半年报及年度报告需提供）

无

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 | | | | |
| 2 | | | | |
| | | | | |

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 | | | | | | | |
| 2 | | | | | | | |
| | | | | | | | |

（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

中国建设银行天津市分行

2019年10月15日

附录一

“乾元-津夜市专享” 2019 年第 76 期理财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“乾元-津夜市专享”2019 年第 76 期理财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 |
|--------|-----------------|------------------|---------------|------|
| 资产收益权类 | 天津市保障住房建设投资有限公司 | 19 津保障房 AB005 | 458 | 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。